



European Securities and  
Markets Authority

# Suunised

**Teatamine SFTRi artiklite 4 ja 12 alusel**



## Sisukord

1	Viited õigusaktidele, lühendid ja mõisted .....	5
2	Kohaldamisala.....	6
3	Eesmärk.....	7
4	Üldpõhimõtted .....	7
4.1	Teatamise alguskuupäev.....	7
4.2	Teatatavate VFTde arvu kindlaksmääramine .....	8
4.2.1	VFT määratlusega hõlmamata turutehingud.....	8
4.2.2	VFTde kõigile liikidele ühised aspektid .....	8
4.2.3	Repotehingutega seotud aspektid .....	9
4.2.4	Ostu-tagasimüügitehingute ja müügi-tagasiostutehingutega seotud aspektid ....	10
4.2.5	Väärtpaberite laenuks andmise ja võtmisega seotud aspektid.....	10
4.2.6	Kaupa hõlmavate VFTdega seotud aspektid .....	11
4.2.7	Võimenduslaenudega seotud aspektid .....	12
4.3	Keskse vastaspoole kliiritavatest VFTdest teatamine .....	13
4.4	Vastutuse jaotumine SFTRi artikli 4 lõike 3 alusel .....	14
4.4.1	Üldpõhimõtted .....	14
4.4.2	Kolmandate riikide finantssektori vastaspoolled .....	14
4.4.3	Fondid .....	14
4.5	Teatamise vabatahtlik delegeerimine .....	15
4.6	SFTRist tulenevate teatamiskohustuste kohaldamine filiaalide sõlmitud VFTde suhtes 15	
4.6.1	SFTRist tulenevate teatamiskohustuste kohaldamine ELis filiaale omavate ELi- väliste üksuste sõlmitud VFTde suhtes.....	15
4.6.2	Filiaalide sõlmitud ja teatatavate VFTde kindlaksmääramine.....	15
4.7	Teatamine finantssektoriväliste vastaspoolte poolt.....	17
4.8	Toiminguliigid .....	17
4.8.1	Kohaldatavad toiminguliigid.....	17
4.8.2	Täielik hetkeülevaade vs. osaline teatamine VFTde muudatustest.....	17
4.8.3	Toiminguliikide järjekord eri liiki teadete korral.....	18
4.9	Õigeaegne teatamine VFT sõlmimisest, muutmisest ja lõpetamisest .....	22
4.9.1	VFT sõlmimine .....	22
4.9.2	VFT muutmise ja parandamine .....	22

4.9.3	Tagatise ajakohastamine .....	23
4.9.4	Väärtuse, võimendustagatise ja uuesti kasutamise ajakohastamine.....	24
4.9.5	VFT lõpetamine.....	24
4.9.6	Ülevaade teatamise tähtaegadest teate- ja toiminguliikide kaupa.....	25
4.10	Ärisündmuste seosed toiminguliikide ja tasanditega.....	26
4.11	Väärtpaberite keskdepositooriumi liikme identifitseerimine .....	33
4.12	Vastaspole rolli kindlaksmääramine.....	33
4.12.1	Üldpõhimõtted .....	33
4.12.2	Keskse vastaspole kliiritavad VFTd .....	33
4.12.3	Väärtpaberite tagamata laenamine.....	34
4.12.4	Vastaspole rollist teatamine neto riskipositsiooni alusel tagamise korral.....	34
4.13	Hinna ja väärtuse väljad .....	34
4.13.1	Väärtuse hindamise aeg.....	34
4.13.2	Väärtuse hindamisel kasutatav arvutusmeetod .....	34
4.14	Tagatisena kasutatava väärtpaberi CFI (finantsinstrumentide klassifikatsioon) kood	35
4.15	Edasilükatud teatamine enne teatamise alguskuupäeva sõlmitud VFTdest.....	35
4.16	Tehingu kordumatu tunnuskoodi genereerimine ja ülesehitus .....	36
4.17	Õigustatud isikute identifitseerimine ja neist teatamine.....	38
4.18	Väärtpaberite emitendi ja väärtpaberite identifitseerimine.....	39
4.19	Tegevuskord juhul, kui vastaspoolt mõjutavad korporatiivsed sündmused .....	39
4.20	Teatamine järkjärgulise rakendamise perioodil.....	40
5	SFTRi kohased andmeväljade tabelid .....	40
5.1	Vastaspole andmed.....	42
	Non-cleared SFTs concluded by UCITS fund, and the UCITs management company delegates reporting to a third party .....	44
	Non-cleared SFTs concluded by AIF .....	44
	Non-cleared SFTs where fund portfolio management is outsourced.....	44
5.1.1	Peakontorite vahelised kahepoolsed kliirimata VFTd.....	44
5.1.2	Filiaalide vaheline kahepoolne kliirimata VFT .....	46
5.1.3	Kliirimata kahepoolne VFT õigustatud isikutega .....	48
5.1.4	Kliirimata VFT maakleritega, mis arveldatakse deponooriumina tegutseva pangaga <sup>49</sup>	
5.1.5	Kliirimata VFT maakleriga, laenude vahendajaga ja kolmandast isikust vahendajaga.....	51

5.1.6	Kliirimata VFT maakleriga, laenude vahendajaga ja kolmandast isikust vahendajaga, mis arveldatakse väärtpaberite keskdepositooriumi liikmega, kes ei ole ükski nimetatud üksus, ning teatamise vabatahtlik delegeerimine kolmandale isikule .....	53
5.1.7	Kliiritud VFT maakleriga, laenude vahendajaga ja kolmandast isikust vahendajaga	55
5.1.8	Kliiritud VFT maakleriga, laenude vahendajaga ja kolmandast isikust vahendajaga, mis arveldatakse väärtpaberite keskdepositooriumi liikmega, kes ei ole ükski nimetatud üksus, ning teatamise vabatahtlik delegeerimine kolmandale isikule .....	57
5.1.9	Eurofondi sõlmitud kliirimata VFTd .....	59
5.1.10	Eurofondi sõlmitud kliirimata VFTd, kui eurofondi valitseja delegeerib teatamise kolmandale isikule .....	61
5.1.11	Alternatiivse investeerimisfondi sõlmitud kliirimata VFTd.....	62
5.1.12	Kliirimata VFTd fondi portfelli valitsemise teenuse sisseostmise korral.....	64
5.2	Laenu ja tagatise andmed .....	66
5.2.1	Toiminguliikidest teatamine tehingu tasandil ja positsiooni tasandil .....	66
5.3	Laenu andmed .....	77
5.3.1	Sündmuse kuupäevast teatamine .....	77
5.3.2	Kliiritud / kliirimata VFTdest teatamine.....	77
5.3.3	Kauplemiskoht.....	83
5.3.4	Raamlepingu jagu .....	84
5.3.5	Tehingu sõlmimine ja algus .....	86
5.3.6	VFT tähtaeg .....	88
5.3.7	Lõpetamise võimalus.....	90
5.3.8	Üldtagatise ja konkreetse tagatise kokkulepped .....	90
5.3.9	Fikseeritud ja ujuvad intressimäärad .....	93
5.3.10	Repotehingute ja ostu-tagasimüügitehingute / müügi-tagasiostutehingute põhisummad.....	97
5.3.11	Laenupool väärtpaberite laenamisel.....	97
5.3.12	Väärtpaberid .....	98
5.3.13	Kaupa hõlmavad VFTd – kauba laenamine.....	103
5.3.14	Rahalise mahahindlusega väärtpaberite laenamise tehingud .....	105
5.3.15	Tasupõhised väärtpaberite laenamise tehingud: mitterahalise tagatisega, rahaliste tagatiste kogumiga tagatud ja tagamata väärtpaberite laenamise tehingud.....	106
5.3.16	Võimenduslaenu summa ja lühikese positsiooni turuväärtus .....	107
5.4	Tagatise andmed .....	110
5.4.1	Väärtpaberite laenamise tehingu tagatusest teatamine .....	110
5.4.2	Tagatus.....	111

5.4.3	Rahaline tagatis .....	118
5.4.4	Nulltagatisest teatamine .....	119
5.4.5	Väärtpaberitest tagatise väljad .....	119
5.4.6	Tehingu tasandi muutuvtagatis muul viisil kui keskselt kliiritavate VFTde korral 130	
5.4.7	Muul viisil kui keskselt kliiritavate VFTde muutuvtagatis, kui tagamine toimub neto riskipositsiooni alusel.....	139
5.4.8	Ettemakstud tagatis väärtpaberite laenamise tehingu korral.....	179
5.4.9	Kliiritud tehingute portfell .....	181
5.5	Võimendustagatise andmed .....	181
5.5.1	Kliirivatest liikmetest vastaspoolte vahele paigutuv keskne vastaspool .....	182
5.5.2	Keskne vastaspool, kes paigutub kahe vastaspoole vahele, kes ei ole kliirivad liikmed	182
5.5.3	Võimendustagatise kohta teabe edastamine .....	183
5.6	Uuesti kasutamise, raha reinvesteerimise ja rahastamisallikate andmed.....	184
5.6.1	Tagatise uuesti kasutamine.....	184
5.6.2	Rahalise tagatise reinvesteerimine.....	191
5.6.3	Mitterahalise tagatise uuesti kasutamise ja raha reinvesteerimise puudumine	198
5.6.4	Rahastamisallikad .....	199
6	Tagasiside esitatud teabe tagasilükkamise korral.....	200
7	Tagasiside kooskõlastava võrdlemise kohta.....	202
8	Tagasiside puuduva tagatise korral .....	205
9	Pädevatele asutustele teabe esitamine .....	206
9.1	Andmetele juurdepääsu andmise tähtaeg .....	206
9.2	Andmetele juurdepääsu andmise korraldus.....	206



# 1 Viited õigusaktidele, lühendid ja mõisted

## Viited õigusaktidele

<i>Alternatiivsete investeerimisfondide valitsejaid käsitlev direktiiv</i>	Euroopa Parlamendi ja nõukogu 8. juuni 2011. aasta direktiiv 2011/61/EL alternatiivsete investeerimisfondide valitsejate kohta
<i>Andmete kontrollimise regulatiivsed tehnilised standardid</i>	Komisjoni 13. detsembri 2018. aasta delegeeritud määrus (EL) 2019/358, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) 2015/2365 seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, mis käsitlevad väärtpaperite kaudu finantseerimise tehingute puhul kauplemisteabehoidlate poolt andmete kogumist, kontrollimist, summeerimist, võrdlemist ja avaldamist
<i>Andmetele juurdepääsu regulatiivsed tehnilised standardid</i>	Komisjoni 13. detsembri 2018. aasta delegeeritud määrus (EL) 2019/357, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) 2015/2365 seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, milles käsitletakse juurdepääsu väärtpaperite kaudu finantseerimise tehingute kohta kauplemisteabehoidlates hoitavatele andmetele
<i>Energia hulgimüügituru terviklikkuse ja läbipaistvuse määrus</i>	Euroopa Parlamendi ja nõukogu 25. oktoobri 2011. aasta määrus (EL) nr 1227/2011 energia hulgimüügituru terviklikkuse ja läbipaistvuse kohta
<i>Eurofondid</i>	Euroopa Parlamendi ja nõukogu 13. juuli 2009. aasta direktiiv 2009/65/EÜ vabalt võõrandatavatesse väärtpaperitesse ühiseks investeeringuks loodud ettevõtjaid (eurofondid) käsitlevate õigus- ja haldusnormide kooskõlastamise kohta
<i>Euroopa turu infrastruktuuri määrus</i>	Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrus (EL) nr 648/2012 börsiväliste tuletisinstrumentide, kesksete vastaspoolte ja kauplemisteabehoidlate kohta
<i>Finantsinstrumentide turgude määrus</i>	Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrus (EL) nr 600/2014 finantsinstrumentide turgude kohta, millega muudetakse määrust (EL) nr 648/2012
<i>Hüpoteekkrediidi direktiiv</i>	Euroopa Parlamendi ja nõukogu 4. veebruari 2014. aasta direktiiv 2014/17/EL elamukinnisvaraga seotud tarbijakrediidilepingute kohta ning millega muudetakse direktiive 2008/48/EÜ ja 2013/36/EL ja määrust (EL) nr 1093/2010
<i>Rahaturgude statistika määrus</i>	Euroopa Keskpanga määrus (EL) nr 1333/2014 rahaturgude statistika kohta



<i>Tagatiste direktiiv</i>	Euroopa Parlamendi ja nõukogu 6. juuni 2002. aasta direktiiv 2002/47/EÜ finantstagatiskokkulepete kohta
<i>Tarbijakrediidi direktiiv</i>	Euroopa Parlamendi ja nõukogu 23. aprilli 2008. aasta direktiiv 2008/48/EÜ, mis käsitleb tarbijakrediidilepinguid ja millega tunnistatakse kehtetuks nõukogu direktiiv 87/102/EMÜ
<i>Teatamise rakenduslikud tehnilised standardid</i>	Komisjoni 13. detsembri 2018. aasta rakendusmäärus (EL) 2019/363, milles sätestatakse rakenduslikud tehnilised standardid seoses Euroopa Parlamendi ja nõukogu määruse (EL) 2015/2365 kohaselt kauplemisteabehoidlatele väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute üksikasjade kohta esitatavate teadete vormingu ja selliste teadete esitamise sagedusega ning muudetakse komisjoni rakendusmäärust (EL) nr 1247/2012 seoses teavitamiskoodide kasutamisega tuletuslepingutest teavitamisel
<i>Teatamise regulatiivsed tehnilised standardid</i>	Komisjoni 13. detsembri 2018. aasta delegeeritud määrus (EL) 2019/356, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) 2015/2365 seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, millega määratakse kindlaks väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute kohta kauplemisteabehoidlatele esitatavad üksikasjad
<i>Tehnilised standardid</i>	Teatamise regulatiivsed tehnilised standardid (komisjoni delegeeritud määrus (EL) 2019/356) ja teatamise rakenduslikud tehnilised standardid (komisjoni rakendusmäärus (EL) 2019/363)
<i>Turukuritarvituse määrus</i>	Euroopa Parlamendi ja nõukogu 16. aprilli 2014. aasta määrus (EL) nr 596/2014, mis käsitleb turukuritarvitusi (turukuritarvituse määrus)
<i>Väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute ja uuesti kasutamise läbipaistvust käsitlev määrus (SFTR)</i>	Euroopa Parlamendi ja nõukogu 25. novembri 2015. aasta määrus (EL) 2015/2365, mis käsitleb väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute ja uuesti kasutamise läbipaistvust ning millega muudetakse määrust (EL) nr 648/2012 (edaspidi ka „määrus“)

## 2 Kohaldamisala

### Kes?

1. Neid suuniseid kohaldatakse SFTRi artikli 3 punktis 2 määratletud väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute (VFT) vastaspoolte, sama määruse artikli 3 punktis 1 määratletud kauplemisteabehoidlate ning pädevate asutuste suhtes.



## Mis?

2. Neis suunistes käsitletakse SFTRi artiklis 4 sätestatud VFTdest teatamise kohustust, artikli 5 lõikest 7 ja artiklist 12 tulenevaid kauplemisteabehoidlate kohustusi ning artikli 33 lõikes 2 määratletud teatamise alguskuupäeva.

## Millal?

3. Neid suuniseid kohaldatakse alates päevast pärast nende avaldamist Euroopa Väärtpaberiturujärelevalve (ESMA) veebisaidil või päevast, mil SFTRi artikli 33 lõikes 2 määratletud üksuste suhtes muutuvad kohaldatavaks selle määruse asjaomased sätted, olenevalt sellest, kumb päev on hilisem.
4. Tehingute vastaspooltel, teatamise eest vastutavatel üksustel ja teateid edastavatel üksustel soovitatakse kasutada neid suuniseid alates esimesest päevast, mil teatamiskohustus muutub vastavalt SFTRi artikli 33 lõike 2 punktile a kohaldatavaks.

## 3 Eesmärk

5. Suuniste aluseks on ESMA määruse artikli 16 lõige 1. Suuniste eesmärk on selgitada mitmeid SFTRi sätteid ja anda praktilisi juhiseid mõningate sätete rakendamiseks. Suunised aitavad vähendada kulusid kogu teatamisahelas, millesse kuuluvad andmeid esitavad vastaspoolde, asjakohaste menetluste abil andmete täielikkust ja õigsust kontrollivad kauplemisteabehoidlad ning SFTRi artikli 12 lõikes 2 määratletud asutused, kes kasutavad neid andmeid finantsstabiilsust ohustavate riskide jälgimiseks. Suunistes selgitatakse järgmisi aspekte:
  - a. teatamise alguskuupäev, kui see ei lange tööpäevale;
  - b. teatatavate VFTde arv;
  - c. teate andmeväljade täitmine eri liiki VFTdest teatamisel;
  - d. lähenemisviis, mida kasutatakse VFTde tagatiste ja laenude seostamiseks;
  - e. võimendustagatist käsitlevate andmeväljade täitmine;
  - f. uuesti kasutamist, reinvesteerimist ja rahastamisallikaid käsitlevate andmeväljade täitmine;
  - g. kauplemisteabehoidlate poolt tagasiside genereerimine ja selle edaspidine haldamine vastaspoolte poolt, nimelt i) edastatud andmete tagasilükkamise ja ii) kooskõlastava võrdlemise probleemide korral; ning
  - h. kauplemisteabehoidlate poolt pädevatele asutustele antav juurdepääs andmetele.

## 4 Üldpõhimõtted

### 4.1 Teatamise alguskuupäev

6. SFTRi artikli 4 lõike 1 kohast teatamiskohustust kohaldatakse vastavalt SFTRi artikli 33 lõike 2 punkti a alapunktis i sätestatud kohaldamiskuupäevadele. Kohustuse esimene



etapp muutub kohaldatavaks 11. aprillil 2020, mis on laupäev. SFTRi artikli 4 lõike 1 kohaselt peavad vastaspoolled täitma oma teatamiskohustuse hiljemalt tööpäeval, mis järgneb tehingu sõlmimisele, muutmisele või lõpetamisele.

7. SFTRi artikli 33 lõike 2 punkti a alapunktis i nimetatud üksused, mis on asutatud ELi liikmesriikides, kus 13. aprill ei ole riigipüha, st see on tööpäev, peaksid hakkama teatama 11. aprillil 2020 või pärast seda sõlmitud VFTdest alates 13. aprillist 2020.
8. SFTRi artikli 33 lõike 2 punkti a alapunktis i nimetatud üksused, mis on asutatud ELi liikmesriikides, kus 13. aprill on riigipüha, st see ei ole tööpäev, peaksid hakkama teatama 11. aprillil 2020 või pärast seda sõlmitud VFTdest alates 14. aprillist 2020.
9. Sama lähenemisviisi tuleks kohaldada ka teatamiskohustuse ülejäänud kohaldamiskuupäevade puhul.

## 4.2 Teatatavate VFTde arvu kindlaksmääramine

10. Teatamise rakenduslike tehniliste standardite artikli 1 lõike 1 kohaselt peaksid tehingute vastaspoolled edastama teated väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute kohta ühtsel elektroonilisel ja masinloetaval kujul, kasutades ühtset XML-vormingut kooskõlas standardi ISO 20022 metoodikaga. Selle hõlbustamiseks hõlmavad käesolevad suunised eri kasutusjuhtudel kohaldatavat XSD komponenti.

### 4.2.1 VFT määratlusega hõlmamata turutehingud

11. Järgmised tehingud ei kuulu VFT määratluse alla ja neist ei tuleks SFTRi alusel teatada:
  - a. jaeklientidele antavad laenud, mida reguleerivad tarbijakrediiti käsitlevad õigusaktid;
  - b. privaatpanganduse laenud ja lombardlaenud, mis ei ole seotud väärtpaberite kaudu finantseerimisega;
  - c. sündikaatlaenud ja muud äriistel eesmärkidel antavad äri-laenud;
  - d. deponitooriumide arvelduskrediidid ja kesksete vastaspoolte päevasisesed laenud;
  - e. arvelduste toimimise tagamiseks antavad päevasisesed laenud ja arvelduskrediidid;
  - f. automaatne tagatise seadmine keskpankade poolt;
  - g. loovutamine ja loovutuste vastuvõtmine täitmis- ja kliirimisahelas;
  - h. tegevusalastel ja/või tööstuslikel eesmärkidel sõlmitavad kaubatehingud;
  - i. saastekvootidega seotud tehingud.

### 4.2.2 VFTde kõigile liikidele ühised aspektid

12. VFT osalisele, kes kaupleb oma arvel, tuleks viidata kui selle tehingu ühele vastaspoolele.
13. Üksust, kes laenu või tagatise poolel hõlbustab või korraldab VFT sõlmimist või osaleb sellises tehingus muul viisil, kuid mitte oma arvel kauplejana, vaid kliendi nimel tegutsedes, ei tuleks määratleda mitte vastaspoolena, vaid vastavalt vajadusele kas maaklerina, laenude vahendajana, kolmandast isikust vahendajana või väärtpaberite

keskdepositooriumi liikmena. Ühel üksusel võib VFTs olla mitu rolli. Vastaspoole kohta esitatavat andmekogumit käsitletakse üksikasjalikult jaos 5.1.

14. Seega on vastaspooled kohustatud kindlaks määrama, mis liiki VFT nad on sõlminud. Nagu on märgitud teatamise regulatiivsete tehniliste standardite 1. lisa ja käesoleva dokumendi jaos 5.2, ei ole kõik väljad kõigi VFTde puhul kohaldatavad, mistõttu vastaspooled peaksid sõlmitud VFT liigis kindlasti kokku leppima.
15. VFTst tuleb teatada, kui tehingus on kaks vastaspoolt või kui üks tehinguosaline on üksikisik, kes ei ole ettevõtja, ja teine tehinguosaline on SFTRis määratletud vastaspool. Kui vastaspooli on rohkem kui kaks, ei ole tegemist VFTga. Kui laenud jagunevad kahe või enama tagatiseaaja ja kahe või enama tagatiseandja vahel, loetakse VFTks iga kahe vastaspoole vahelist väärtpaberite, raha või kaupade tagatud laenu.
16. Kui punktis 12 esitatud tingimused on täidetud, loetakse investeerimisfonde sõltumata nende õiguslikust vormist VFT vastaspoolteks. Sarnaselt Euroopa turu infrastruktuuri määruse kohasele aruandlusele tuleb silmas pidada, et allfondidel on tavaliselt juriidilise isiku tunnus. Sel juhul tuleks niisugusest allfondist teatada kui iseseisvast vastaspoolest. Asjakohane teave laenude ja tagatiste kohta peaks viitama selle allfondi sõlmitud VFTdele. Kui allfond ei ole VFT osaline, lähtuge jaost 4.17.
17. Kliiritud VFTde korral loetakse iga VFTd keskse vastaspoole, selle kliirivate liikmete, nende klientide jne vahel eraldi VFTks, millest tuleks teatada oma kordumatu tunnuskooriga. Kui VFT sõlmitakse kauplemiskohas ja kliiritakse samal päeval, nagu on sätestatud teatamise regulatiivsete tehniliste standardite artikli 2 lõikes 2, tuleb sellest teatada pärast kliirimist, st vahepealsetest loovutamistest ja loovutuste vastuvõtmisest ei ole vaja teatada. Üksikasjalikum teavet kliiritud VFTdest teatamise kohta leiab jaost 4.3.
18. Arvelduste toimumise tagamiseks sõlmitud VFT korral peaks väärtpaberite keskdepositoorium esitama tehingu vastaspooltena asjaomased keskdepositooriumi liikmed, mitte nende kliendid. See kehtib ka siis, kui VFT tehakse esindajakonto tagatisel.
19. Seetõttu tuleks kõikidest VFTdest peale SFTRi artikli 2 lõikes 3 ja suuniste jaos 4.2.1 nimetatud tehingute teatada vastavalt suuniste järgmises jaos kirjeldatule.
20. Pange tähele, et artikli 2 lõikes 3 osutatud VFTdest tuleb teatada määruse nr 600/2014 alusel.

#### 4.2.3 Repotehingutega seotud aspektid

21. Enam kui ühes valuutas antud tagatud laenude puhul on tegemist eraldi VFTdega ja neist tuleks teatada eraldi kordumatute tunnuskooriga. Igast repotehingust tuleks teatada vastavalt repotehingutest teatamise üldpõhimõtetele:
  - a. esitada iga valuuta puhul kohaldatav põhisumma ja tehingu kordumatu tunnuskooriga ning iga valuuta puhul kohaldatav tagatiskomponent (eraldi komponentide olemasolu korral) ja
  - b. esitada asjakohane tagatis neto riskipositsiooni alusel, st tagatis, mis katab repotehinguid, kuid mida ei ole konkreetselt ühelegi repotehingule eraldatud, ja tagada, et tagatist saaks asjakohaste väljade kaudu seostada.

22. Kui tagasiostuhinda väljendatakse valuutas, mis erineb ostuhinna valuutast, kuid see on siiski seotud sama repotehinguga, siis tuleks hinda ja põhisummasid käsitleva asjakohase teabe esitamiseks konverteerida tehingu lõpu poole valuuta tehingu alguse poole valuutaks. Turuväärtustest teatamisega seoses tutvuge valuutakursside kasutamise juhistega jaos 4.13.1, et tagada vastaval väljal õige arvu esitamine.
23. Kui repotehingu tagatise näol on tegemist teistsuguses vormis ülekandega, mis moodustab siiski osa tagatiste direktiivis määratletud tagatiskokkuleppest, peaksid vastaspoolled vastavast tehingust ikkagi teatama kui repotehingust. Muude jurisdiktsioonide eeskirjade kohaselt sõlmitud repotehingutest (nt Gentani repotehingud) tuleks vastavalt teatada, edastades täielikud ja täpsed andmed vastavalt teatamise tehnilistele standarditele.
24. SFTRi artikli 4 kohane teatamiskohustus hõlmab repotehinguid ja pöördrepotehinguid, mida kesksed vastaspoolled sõlmivad selleks, et investeerida i) oma vara likviidsuse säilitamiseks või ii) võimendustagatiseks antud kliirivate liikmete vara.
25. Repotehingutest ja pöördrepotehingutest teatamiseks tuleks kasutada repotehingute puhul kohaldatavat ISO 20022 kohast XML-vormingut.

#### 4.2.4 Ostu-tagasimüügitehingute ja müügi-tagasiostutehingutega seotud aspektid

26. Teatavaid ostu-tagasimüügitehinguid ja müügi-tagasiostutehinguid reguleerivad kahepoolsed lepingud või raamlepingud. Neid VFTsid hõlmavad lisad erinevad siiski repotehinguid ja pöördrepotehinguid käsitlevatest lisadest. Kahtlemata on sõlmitud VFT liigiks ostu-tagasimüügitehing / müügi-tagasiostutehing.
27. Kui ostu-tagasimüügitehingut / müügi-tagasiostutehingut reguleerib kahepoolne leping või raamleping või raamlepingu lisa, tuleks sellest lepingust teatada vastavatel väljadel, nimelt laenu ja tagatise andmeid käsitleva tabeli 2 väljadel 9-11.
28. Vastaspoolled peaksid püüdma teatada raamlepingutest, mida teatamise rakenduslikud tehnilised standardid ei hõlma, täpselt samal viisil. Raamlepingute puhul tuleks väljal „Raamlepingu versioon“ märkida sõlmitud VFT suhtes kohaldatav versioon.
29. Kui vastaspoolled leiavad, et teatavat liiki ostu-tagasimüügitehingutest või müügi-tagasiostutehingutest teatamiseks on parem kasutada repotehingutest teatamise vormingut, siis peaksid nad vastastikusel kokkuleppel kasutama nendest VFTdest teatamiseks repotehingutest teatamise vormingut.
30. Ostu-tagasimüügitehingutest ja müügi-tagasiostutehingutest teatamiseks tuleks kasutada ostu-tagasimüügitehingute ja müügi-tagasiostutehingute puhul kohaldatavat ISO 20022 kohast XML-vormingut.

#### 4.2.5 Väärtpaberite laenuks andmise ja võtmisega seotud aspektid

31. Määratluse kohaselt on väärtpaberite laenamise tehing seotud väärtpaberite ülekandmisega laenuandjalt laenusaaajale. Ühes väärtpaberite laenamise tehingus kantakse üle ainult üks ISIN-kood. Kui kolmandast isikust üksuste, näiteks laenude vahendajate poolt jaotamise käigus kantakse vastaspoolte paari vahel üle mitu ISIN-koodi, tuleks iga ISIN-koodi kohta teatada eraldi VFTst.

32. Kuna SFTRi artikli 4 lõike 1 kohaselt peab VFTde sõlmimisest, muutmisest ja lõpetamisest teatama hiljemalt järgmisel tööpäeval, tuleks teatada kõikidest sõlmitud VFTdest, sealhulgas kõikidest genereeritud VFTdest, kuigi arveldust ei pruugi olla toimunud.
33. Esitatud stsenaariumides ei võetud arvesse mõningaid varahaldurite liike, näiteks фонде, mis koondavad väärtpaberid varakogumisse ja võivad neid välja laenata. Need fondid kauplevad maakleri kaudu, kes tegutseb volitatud kauplejana ja laenab fondide varakogumist välja kindla hulga väärtpabereid. Otsene tehing kinnitatakse vastaspoole ja varakogumi vahel. Päeva lõpus teostatakse lõplik jaotamine ja igale varakogumis osalevale fondile saadetakse individuaalne kinnitus. Andmed saadetakse ka vastaspoolele ja arveldamine toimub kõigi asjaomaste fondide ühisest depositeoriumist tehtava ühe ülekande kaudu. Sellistel juhtudel ja vastavalt punktis 15 esitatud üldpõhimõttele peaksid vastaspooled kauplemisteabehoidlatele teatama eraldi VFTst iga vastaspoolte paari ja ISIN-koodi kohta.
34. Väärtpaberite laenuks andmise korral keskse vastaspoole struktuuris, mis hõlmab varakogumit, ei saa päevasisese elutsükliga tegevusest teatada juhul, kui laenusaja ja laenuandjale jaotatakse päeva lõpuks ainult uued laenu netopositsioonid. Seetõttu tuleks keskse vastaspoole struktuuri korral teatada päevasisestest laenudest, ehkki neile ei pruugi olla vajalik jaotada tagatist. Tagatistest tuleks teatada kõigi muude väärtpaberite laenamise tehingute puhul, kui väljal (2.72) „Väärtpaberite laenuks andmisel tagatise puudumise märged“ märgitakse „vale“, ja tehinguteates tuleb teatada arveldatud uuest netolaenust (arvelduspäev + 1).
35. Väärtpaberite laenamisest teatamiseks tuleks kasutada väärtpaberite laenamise puhul kohaldatavat ISO 20022 kohast XML-vormingut.
36. Rahapõhistest väärtpaberite laenamise tehingutest, mida nimetatakse ka pöördväärtpaberilaenudeks, tuleks teatada repotehingutena. Kui rahapõhisest väärtpaberite laenamisest teatatakse repotehingu väljade abil, tuleks silmas pidada, et raamlepingu liik peaks kajastama asjakohast aluslepingut, nt GMSLA.

#### 4.2.6 Kaupa hõlmavate VFTdega seotud aspektid

37. VFT täitmine peaks olema struktureeritud nii, et tegelikult kasusaav omanik ei kaotaks majanduslikku omandiõigust oma kaubale ega võtaks kaubaga seoses uut tururiski.
38. Kaupa hõlmavaid repotehinguid / pöördrepotehinguid iseloomustab (tagasiostu-) lepingu olemasolu. Kauba üleandmine toimub omandiõiguse täieliku üleandmise või pantimise alusel.
39. Pidades aga silmas kaupa hõlmava VFT ulatust, tuleks juhul, kui müüki ja tagasiostmist ei kvalifitseerita repotehinguna, esitada see ostu-tagasimüügitehinguna.
40. Kauba laenuks andmise ja võtmise tehingu korral on tagatisesaajaks tehinguosaline, kes kauba välja laenab, ja tagatiseandjaks on tehinguosaline, kes kauba laenuks võtab. Sellised tehingud erinevad repotehingutest / pöördrepotehingutest ning ostu-tagasimüügi tehingutest / müügi-tagasiostu tehingutest, mille puhul kaupa käsitatakse tagatisena.
41. Kaupa hõlmavatest VFTdest teatamisel peaksid vastaspooled lisaks asjaomastele raamlepingutele hindama seda, mil määral seda liiki kaupa hõlmav VFT, millest nad

teatavad, sobib antud VFT jaoks ette nähtud andmeväljadega. See peaks aitama kindlaks teha, kas tehing tuleks esitada kauba laenamise tehinguna või repotehingu / müügi-tagasiosu tehingu või pöördrepotehingu / ostu-tagasimüügi tehinguna, mille tagatiseks on kaup.

42. Lisaks sisaldavad kõik SFTRI artikli 3 punktides 7–10 määratletud VFTd peale võimenduslaenude andmise viidet kauba võimalikule kasutamisele VFT osana. Ostu-tagasimüügi tehing / müügi-tagasiosu tehing piirab kauba kasutamist kahe vastaspoole vaheliste ostude ja edaspidiste müükide korral (ilma turuvahendajata), samal ajal kui kauba laenuks andmise ja võtmise tehingud ja repotehingud võimaldavad nii omandiõiguse ülemineku kui ka pandikokkuleppeid. Seetõttu peaksid vastaspooled väljal 2.20 „Tagatise andmise meetod“ esitama vastavalt asjakohasusele tagatiskokkuleppe liigi.
43. Kaupa hõlmavad VFTd võivad mõnel juhul olla osa keerukamate struktuuridest, mis võivad sisaldada tuletisinstrumente, nagu futuurid ja optsioonid. Teatada tuleks ainult nendest kogustruktuuri osadest, mille näol on tegemist VFTga. Sellistes struktuurides kasutatavatest tuletisinstrumentidest võib olla vaja teatada Euroopa turu infrastruktuuri määruse, finantsinstrumentide turgude direktiivi ja/või energia hulgimüügiture terviklikkuse ja läbipaistvuse määruse alusel.
44. Samaväärse ja asendatud kauba tähenduse osas selgitab ESMA järgmist:
  - a. samaväärne kaup on sama liiki kaup, millel on sarnased omadused ja/või spetsifikatsioonid ning millega võib lepingus kokkulepitud viisil tagastamise etapis asendada algse kauba;
  - b. asendatud kaup on kaup, mis on antud tagatiseks kauba asemel, mis sama tehingu raames algselt tagatiseks anti.

#### 4.2.6.1 Energiat hõlmavad VFTd

45. Tehingust (nt tsoonidevaheline gaasi ost ja tagasimüük (alternatiivsetel) rahastamiseesmärkidel) võib olla vaja teatada energia hulgimüügiture terviklikkuse ja läbipaistvuse määruse alusel (teatamistähtaeg T+30) ja samal ajal ka VFTna (teatamistähtaeg T+1).
46. Seega, kui seda liiki tehingud on piisavalt selged, nii et need saab ühemõtteliselt liigitada kauba rahastamiseks kasutatavate VFTdena, siis tuleb neist teatada, kasutades asjakohast teatamise vormingut.

#### 4.2.7 Võimenduslaenudega seotud aspektid

47. Eeldatakse, et iga vastaspoolte paari vahel eksisteerib igal ajahetkel ainult üks võimenduslaenu tehing, välja arvatud juhul, kui lepinguga on kokku lepitud enam kui ühes alusvaluutas ja iga alusvaluuta kohta on kindlaks määratud võimenduslaen; sel juhul peaks võimenduslaenu tehing olema iga alusvaluuta kohta. Vastav VFT on seotud võimenduslaenuga või lühikese positsiooni turuväärtusega alusvaluutas.
48. Võimenduslaenu tehingu kordumatu tunnuscode tuleks genereerida ainult siis, kui laenulimiiti on vähemalt ühel korral kasutatud. Juhtudel, kui on sõlmitud peamaakleri leping, kuid laenulimiiti ei ole kasutatud, ei ole teadet vaja edastada, kuna VFTd veel pole.

49. Kui nii võimenduslaen kui ka lühikese positsiooni turuväärtus langevad mingil ajahetkel nullini, st rahas või väärtpaberites krediiti ei anta, ei taga peamaakleri hoitav kliendi tagatis enam VFTga seotud riskipositsiooni. Seda hoitakse muude kui VFTga seotud kohustuste katteks. Peamaakler ja klient peaksid i) lõpetama tagatisest teatamise kuni ajani, mil võimenduslaenu või lühikese positsiooni turuväärtusega seotud riskipositsioon taas eksisteerib, või ii) teatama, et rahaline tagatis on null, st see puudub.
50. Tehingust teatamisel ei tuleks toiminguliigiks märkida mitte „ETRM“, vaid „MODI“. Kasutatava tagatise võimaliku väärkajastamise vältimiseks tuleks sel juhul esitada ka teade tagatise ajakohastamise kohta (COLU), mille kohaselt rahalise tagatise väärtus on null. Nulltagatisest teatamise kohta lugege lähemalt jaost 5.4.4.
51. Võimenduslaenude korral ei peaks vastaspoolel teatama tagatiskomponentidest, milleks ei ole väärtpaberid või raha.
52. Kliendi lühikese positsiooni turuväärtusest teatamine ei peaks põhinema peamaakleri raamatupidamislikul kajastamisel (st kas tehingupäeva- või arvelduspäevapõhisel arvestusel) (IAS 39.38 Finantsinstrumendid: kajastamine ja mõõtmine). Lühikese positsiooni turuväärtusest tuleks teatada samal viisil, nagu teatatakse laenu ja tagatise arveldamisest. Seega peaksid vastaspoolel arvutama lühikese positsiooni turuväärtuse kavandatud arvelduspäeva ja eeldatavalt üle antavate väärtpaberite põhjal.
53. Lisaks, kui peamaakleri kliendiportfell ei hõlma väärtpaberitega kauplemist, ei oma nendele klientidele krediidi andmisest teatamine SFTRi vaatenurgast väärtust ja vastavad teated tuleks jätta esitamata, et vältida suures koguses ebaolulise teabe kogumist.

### 4.3 Keskse vastaspoole kliiritavatest VFTdest teatamine

54. Keskse vastaspoole kliiritavate VFTde suhtes kohaldatakse positsiooni tasandil teatamist; see on vabatahtlik ja täiendab tehingu tasandil teatamist. Positsiooni tasandi teateid võib edastada, kui teatavad tingimused on täidetud<sup>1</sup>.
  - a. Õiguslik korraldus on selline, et risk on positsiooni tasandil, tehinguteated on seotud üksteisega asendatavate toodetega ja üksikud tehingud on asendatud positsiooniga. See on nii juhul, kui pärast üksikute tehingute tasaarveldust toimub uuendamine, tasaarveldatud positsioonist tuleneb uus leping ja sellele genereeritakse uus tehingu kordumatu tunnuskood. Nii võib toimuda näiteks kliiriva liikme ja keskse vastaspoole vahel.
  - b. Algsetest tehingutest on tehingu tasandil korrektselt teatatud. Ainult positsioonidest teatamine pole lubatud.
  - c. Muudest sündmustest, mis mõjutavad positsiooniteate ühiseid välju, teatatakse eraldi.
  - d. Algsed tehinguteated (punkt b eespool) ja vajaduse korral muude sündmustega seotud teated (punkt c eespool) on jõudnud sobivasse „olelustersükli lõpu etappi“.

---

<sup>1</sup> Lisateavet leiab SFTRi alusel teatamise suuniste konsultatsioonidokumendi punktist 84.

Selleks tuleks saata ennetähtaegse lõpetamise teated ja seejärel teatada netopositsioonist uue positsioonina või olemasoleva positsiooni ajakohastamisena.

- e. Positsiooniteade edastatakse korrektselt, täites kõik kohaldatavad vastaspoole andmete ja tehinguandmete väljad ning vajaduse korral võimendustagatise ja tagatise uuesti kasutamise tabeli väljad.
55. Kui need tingimused on täidetud, võib teated edasise ajakohastamise, sealhulgas väärtuse ajakohastamise, tagatise ajakohastamise ja muude muudatuste ning lepingu kehtivusajal lepingut mõjutavate sündmuste kohta seostada positsiooniteatega (muudatustena jne, säilitades keskse vastaspoole kliiritud positsiooni kordumatu tunnuskoodi sama väärtuse), mitte teadetega algsete tehingute/sündmuste kohta.
56. Positsiooni tasandi teade tuleks identifitseerida tehingu kordumatu tunnuskoodiga, mis on selle positsiooni alaline identifikaator, st see ei muutu positsiooni muutudes.
57. Tuletame meelde, et positsiooni tasandi teadete edastamiseks tuleks kliiritud VFTdest esmalt teatada tehingu tasandil, märkides toiminguliigiks „POSC“ (ka siis, kui kliirimine toimub samal päeval), ning alles seejärel võib lepingu kehtivusajal lepingut mõjutavatest sündmustest teatada positsiooni tasandil. Jaos 5.2.1 on esitatud stsenaarium, mis illustreerib positsiooni tasandi teadete edastamisel nõutavaid samme.

## **4.4 Vastutuse jaotumine SFTRi artikli 4 lõike 3 alusel**

### **4.4.1 Üldpõhimõtted**

58. Finantssektoriväline vastaspool peaks finantssektori vastaspoolega suheldes kindlaks tegema, kas ta on käsitatav väikese finantssektorivälise vastaspoolena või mitte, ning teavitama finantssektori vastaspoolt oma staatuse võimalikest muutustest.

### **4.4.2 Kolmandate riikide finantssektori vastaspoole**

59. Kui komisjon on kinnitanud antud kolmanda riigi samaväärsust, siis juhul, kui kolmanda riigi finantssektori vastaspool, millel on liidus filiaal, ja VKEst finantssektoriväline vastaspool on sõlminud VFT ning nii kolmanda riigi finantssektori vastaspool kui ka VKEst finantssektoriväline vastaspool on täitnud selle kolmanda riigi teatamiskohustused, ei pea ei kolmanda riigi finantssektori vastaspool ega VKEst finantssektoriväline vastaspool VFTst SFTRi alusel teatama.
60. Kui VFT on sõlminud kolmanda riigi finantssektori vastaspool, kelle suhtes SFTRi ei kohaldata (st kes ei kuulu SFTRi artikli 2 lõike 1 punkti a alapunkti ii kohaldamisalasse), ja VKEst finantssektoriväline vastaspool, siis peaks VKEst finantssektoriväline vastaspool teatama sellest VFTst kauplemisteabehoidlale ise või kasutama 4 lõikega 2 ette nähtud delegerimisvõimalust.

### **4.4.3 Fondid**

61. Kui SFTRi artikli 4 lõike 3 kohast vastutuse jaotust ei kohaldata alternatiivse investeerimisfondi valitseja suhtes, st kui alternatiivse investeerimisfondi valitseja ei kuulu



SFTRi kohaldamisalasse, kannab fond vastutust VFTdest kauplemisteabehoidlale teatamise eest.

## **4.5 Teatamise vabatahtlik delegeerimine**

62. Teatamise delegeerimise korral peaks delegeeriv vastaspool (kellel on teatamiskohustus) esitama teadet esitavale üksusele õigeaegselt kõik VFT andmed ning tal on kohustus veenduda nende andmete õigsuses. Samal ajal peaks teadet esitav üksus tagama, et teatamiskohustusega vastaspooli teavitatakse nende nimel esitatavatest andmetest, kauplemisteabehoidla andmetöötluse asjakohastest tulemustest ning võimalikest teatamise või andmete kvaliteediga seotud probleemidest.

## **4.6 SFTRist tulenevate teatamiskohustuste kohaldamine filiaalide sõlmitud VFTde suhtes**

### **4.6.1 SFTRist tulenevate teatamiskohustuste kohaldamine ELis filiaale omavate ELi-väliste üksuste sõlmitud VFTde suhtes**

63. Lähtudes SFTRi eesmärgist ja pidades silmas kooskõla Euroopa turu infrastruktuuri määrusega, leiab ESMA, et mõistet „sõlmimine“ tuleb mõista nii, et see on seotud tehingu vastaspoolega, st vastaspoolega, kelle juures VFT broneeritakse.

### **4.6.2 Filiaalide sõlmitud ja teatatavate VFTde kindlaksmääramine**

64. Tabel 1 selgitab, millest tuleks teavitavate vastaspoolte filiaalide puhul teatada.
65. Viimane veerg nimetusega „SFTRi alusel teatatav“ osutab sellele, kas tehingu puhul kehtib SFTRist tulenev teatamiskohustus. Kui tehing ei kuulu teatamisele, siis ei tuleks sellest teatada, sõltumata vastaspoolte/filiaalide asukohast. Tabel 1 sisaldab punaseid ridu, mis näitavad stsenaariume, millest ei tule kunagi SFTRi alusel teatada.
66. Oluline on mõista, et teatud stsenaariumide puhul ei tähenda vastaspoole teatamiskohustuse olemasolu seda, et VFTst tuleb teatada, ja vastupidi, nagu selgitab Tabel 1. Näiteks ei pea viimase veeru kohaselt teatama sama juriidilise isiku kahe filiaali vahel sõlmitud tehingutest, isegi kui vastaspoolel (LEI 1) on teatamiskohustus. Põhjus on see, et kahe vastaspoole asemel on tegemist sama vastaspoole laiendustega.
67. Isegi kui filiaalil on juriidilise isiku tunnus (LEI), tuleks väljadel 1.3 „Teavitav vastaspool“ ja 1.11 „Teine vastaspool“ esitada vastava peakontori juriidilise isiku tunnus ning vastava filiaali andmed tuleks esitada väljadel 1.17 „Teavitava vastaspoole filiaal“ ja 1.8 „Teise vastaspoole filiaal“. Väljal 1.12 „Teise vastaspoole riik“ tuleks märkida peakontori, mitte filiaali riigikood.



**Table 1. Teetamine filiaalide pool**

	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 Teatamine finantssektoriväliste vastaspoolte poolt

68. ESMA mõistab, et juriidilise isiku tunnus võib mõne stsenaariumi korral puududa, kuid see stsenaarium ei kehti ELis asutatud finantssektoriväliste vastaspoolte puhul. Kõik üksused, mille suhtes kohaldatakse SFTRi, peaksid kasutama juriidilise isiku tunnust vastavatel andmeväljadel osutatud üksuste identifitseerimiseks.
69. Kui VFT sõlmitakse kahe finantssektorivälise vastaspoole vahel, peaksid nad mõlemad teatama tehingust kauplemisteabehoidlale; samas on neil võimalik kasutada artikli 4 lõikes 2 sätestatud võimalust delegeerida teatamine kas ühele endi hulgast või kolmandale isikule.

## 4.8 Toiminguliigid

### 4.8.1 Kohaldatavad toiminguliigid

70. VFT vastaspooled peaksid teatama VFT sõlmimisest, muutmisest ja lõpetamisest. Kui VFT kohta teate andmeväljadel esitatud teave pole muutunud, ei peaks vastaspooled VFT kohta uuesti andmeid esitama.
71. Väärtuse ajakohastamisest tuleks teatada ainult siis, kui laenatud või tagatisena kasutatavate väärtpaberite väärtus on muutunud.
72. Tagatisest teatamisel ei peaks vastaspooled teatama tagatise päevasisestest muutustest, vaid ainult päeva lõpu seisust.
73. Toiminguliigid on üksteist välistavad. Eri toiminguliikide kohta edastatavad teated sisaldavad pädevate asutuste jaoks eri laadi teavet nii äritegevuse kui ka andmete haldamise vaatenurgast. Seetõttu peaksid vastaspooled püüdma teatada õigest toiminguliigist.

### 4.8.2 Täielik hetkeülevaade vs. osaline teatamine VFTde muudatustest

74. VFTdega seotud muudatuste (nii paranduste kui ka lepingu kehtivusajal lepingut mõjutavate sündmuste) korral peaksid vastaspooled edastama teated, mis sisaldavad kõiki kohaldatavaid andmevälju, sealhulgas neid, mida ei ole muudetud, võimaldades laenude ja tagatiste andmete eraldi esitamist.
75. Lisaks tuleks arvestada, et väärtuse, tagatise, võimendustagatise ja uuesti kasutamise ajakohastamised on igapäevased hetkeülevaated, mille puhul on nõutavad kõik asjakohased andmeväljad. Igapäevast teatamist silmas pidades eeldatakse ka, et kõik need hetkeülevaated kajastavad päeva lõpu seisust, võttes arvesse kõiki antud päeva jooksul tehtud asjakohaseid muudatusi. Arvestades teatamistähtaega T+1, ei eeldata, et vastaspool esitaks tagatise, väärtuse, võimendustagatise või uuesti kasutamise osas paranduse teate jooksva tööpäeva või eelmise tööpäeva kohta. Vastupidi – tagatise, väärtuse, võimendustagatise või uuesti kasutamise parandustest tuleks teatada ainult varasemate andmete osas juhul, kui pärast teatamistähtaega on avastatud viga esitatud teabes.

76. Tehingu laenupoolt käsitleva teabe korral tuleks kõikidest muudatustest teatada muudatustena ja laenuandmete parandustest eraldi. Samal päeval tehtud erinevatest muudatustest võib teatada ühes teates tingimusel, et see teade kajastab täpselt kõiki muudatusi.
77. Väljad, mille täitmine on eri liiki teadete korral nõutav, on esitatud valideerimiseeskirjades.
78. Teatavate väljade puhul, mida ei tohiks muuta (nt täitmise ajatempel), ei eeldata, et kauplemisteabehoidlad kontrolliksid, et nende väljade sisu ei ole toiminguliigiga „MODI“ teate edastamisel muudetud, kui antud välja puhul pole valideerimiseeskirjades märgitud teisiti.

#### 4.8.3 Toiminguliikide järjekord eri liiki teadete korral

79. Tabel 2, Tabel 3 ja Tabel 4 sisaldavad teavet toiminguliikide järjekorra erinevate kombinatsioonide kohta, mida valideerimiseeskirjad ei keela<sup>2</sup>. Tabel 2 on kohaldatav tehingu ja positsiooni<sup>3</sup> tasandil teatamise korral, samas kui Tabel 3 ja Tabel 4 on konkreetselt seotud keskse vastaspoole kliiritavate VFTde korral võimendustagatistest ja uuesti kasutamisest teatamisega.

Tabel 2. Vastaspoole, laenu ja tagatise andmed									
		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	

<sup>2</sup> Valideerimiseeskirjade edaspidised muudatused võivad tabeli sisu muuta.

<sup>3</sup> Positsiooni komponent ei ole kohaldatav positsiooni tasandil teatamise korral.

**Tabel 2. Vastaspoole, laenu ja tagatise andmed**

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

**Tabel 3. Võimendustagatise ajakohastamine**

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

**Tabel 4. Uuesti kasutamise, raha reinvesteerimise ja rahastamisallikate andmed**

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

**Tabel 4. Uuesti kasutamise, raha reinvesteeringu ja rahastamisallikate andmed**

Error				
Reuse update		x	x	x
Correction		x	x	x

80. Eeltoodud tabelite (Tabel 2, Tabel 3 ja Tabel 4) kasutamisel on oluline mõista, et neis on esitatud toiminguliigid, millest võib antud ajahetkel teatada pärast muust toiminguliigist teatamist, mitte ainult vahetult järgnevad lubatavad sammud. Näiteks kui on saadetud teade toiminguliigiga „positsiooni komponent“, võib edaspidi saata ainult teate „parandus“ või „viga“. Pärast „paranduse“ saatmist on aga lubatud kõik muud liiki teated. Juhul, kui üksus on saatnud esmalt teate toiminguliigiga „positsiooni komponent“ ja seejärel sama tehingu kordumatu tunnuskoodi kohta teate „parandus“, võib tekkida küsimus, kas see üksus võib edaspidi saata muud liiki toimingute teateid. Vastus on ei. Toiminguliik „parandus“ ei tühista loogilisi piiranguid, mis tulenevad eelnevast teatest toiminguliigiga „positsiooni komponent“. Seetõttu võib see üksus selle algse toiminguliigi puhul endiselt teatada ainult „veast“ või muust „parandusest“. Samamoodi ei ole vaja uuesti lõpetada VFTd toiminguliigiga „lõpetamine/ennetähtaegne lõpetamine“, kui eelnevalt on esitatud varem lõpetatud VFT parandus (kuna „parandus“ ei mõjuta tehingu lõpetatust).
81. Põhjus, miks pärast toiminguliigiga „positsiooni komponent“ teate edastamist on „viga“ ja „parandus“ ainsad aktsepteeritavad toiminguliigid, on see, et kui VFT on positsiooni kaasatud, tuleks kõik järgnevad teated (sh tagatise ajakohastamine) edastada positsiooni tasandil. Seetõttu tuleks teated edastada teise kordumatu tunnuskoodiga (positsiooni tunnuskoodiga) ja valideerida tuleks ka selle positsiooniga seotud teadete õige järjekord.
82. Teated VFTde kohta tuleks saata vastavalt rakenduslike tehniliste standardite nõuetele sündmuste toimumise kronoloogilises järjekorras. Siiski tunnistatakse, et kui üksus ei edasta teadet õigeaegselt või talle saab teatavaks, et varem edastatud teave oli ebaõige, peaks see üksus edastama teated möödunud sündmuste kuupäevadega, mistõttu kronoloogiline järjekord muutub.
83. Kauplemisteabehoidlad peaksid „sündmuse kuupäeva“ kontrollimisel siiski veenduma vaid selles, et tegemist ei ole tulevase kuupäevaga (see nõue tuleneb otseselt valideerimiseeskirjadest) ning
- möödunud sündmuse kuupäevade korral (st varasem kui teatamiskuupäev –1) ei muuda need sündmused tehinguid pärast nende tähtpäeva või lõpetamist, st teatatud sündmuse kuupäev on varasem kui tähtpäev ja lõpetamise kuupäev, kui see on esitatud (see nõue kajastub ka valideerimiseeskirjades). Samuti peaksid kauplemisteabehoidlad kontrollima, ega möödunud sündmuse kuupäevaga saadetud muudatused ei muuda varem teatatud tähtpäeva. Lisaks ei peaks kauplemisteabehoidlad kohaldama teatatud muudatust olemasoleva kauplemisseisu aruande suhtes (kui tehing on pooleli) ega ka varasema kauplemisseisu aruande suhtes, mis pärineb kuupäevast, mille kohta sündmusest teatati;

- b. kui sündmuse kuupäev langeb kokku teate kuupäevaga või on teate kuupäevale eelnev päev, peaks kauplemisteabehoidla kohaldama muudatusi kauplemisseisu aruande suhtes vastavalt edastatud teadete järjekorrale.
84. Kauplemisteabehoidlad peaksid esitama kõik kinnitatud kauplemistegevuse aruanded pädevatele asutustele olenemata sündmuste kuupäevadest.
85. Kauplemisteabehoidlad peaksid valideerima teadete õige järjestuse, tuginedes nende esitamise järjekorrale, sõltumata välja „Sündmuse kuupäev“ sisust.
86. Kuna mõningatest möödunud sündmustest võidakse teatada seoses tehingutega, mille tähtpäev on saabunud või mis on lõpetatud, võib pärast „lõpetamise/ennetähtaegse lõpetamise“ teadet saata „muudatuse“, „väärtuse ajakohastamise“ või „tagatise ajakohastamise“ teate (tingimusel, et sündmuse kuupäev eelneb tähtpäevale/lõpetamise kuupäevale), nagu kirjeldab Tabel 2.
87. Tuleks tähele panna, et pärast lõpetamise sündmust ei eeldata tagatise asendamisest teatamist (välja arvatud juhul, kui lõpetamine tühistatakse). Seetõttu ei tuleks lõpetamisest teatada enne lõpetamise jõustumiskuupäeva (jagu 4.9.5 sisaldab üksikasjalikumat teavet lõpetamisest teatamise kohta).
88. Kui kauplemisteabehoidla on lükanud tagasi mitu varem edastatud teadet, peaks vastaspool need võimalikult kiiresti parandama ja uuesti saatma, säilitades sündmuste kronoloogilise järjekorra. Kui need varasemad teated puudutavad sündmusi, mis toimusid teatamise kuupäeval või eelmisel päeval, mistõttu kauplemisteabehoidla pidi neid kauplemisseisu aruande esitamisega seoses arvesse võtma (vastavalt punktile 83 eespool), võib vastaspoolel olla vaja edastada viimane teade (teated) uuesti, et tehingu andmed oleksid ajakohased.
89. Toiminguliigi „viga“ puhul on oluline arvesse võtta, et kui sellest on teatatud, et saa seda enam tühistada ega muul viisil „tagasi võtta“. Seega, kui üks kahest vastaspoolest saadab ekslikult seda liiki toimingute teate, peaksid vastaspoolel edasiseks korrektseks teatamiseks tegema järgmist:
  - a. teine vastaspool peaks sama tehingu kordumatu tunnuskooriga seoses samuti saatma teate, milles toiminguliigiks on märgitud „viga“. Seda tunnuskoorigi ei saa nüüd enam kasutada;
  - b. mõlemad vastaspoolel peaksid sellele tehingule ühiselt määrama uue kordumatu tunnuskoorigi, saatma selle kohta teate, märkides toiminguliigiks „uus“ ja märkides ka uue tunnuskoorigi, ning edaspidi teatama võimalikest lepingu kehtivusajal lepingut mõjutavatest sündmustest, kasutades uut tunnuskoorigi.
90. Üks erand, mille korral toiminguliigi „viga“ esitamine ei nõua tehingu tühistamist teise vastaspoole poolt, on võimalik stsenaarium, kus üks vastaspool teatab tehingust ekslikult kaks korda kahele erinevale kauplemisteabehoidlale ja soovib tühistada ainult ühe, ülearuse teate. Sel juhul peaks see vastaspool saatma ühele kauplemisteabehoidlale teate, märkides toiminguliigiks „viga“; teises kauplemisteabehoidlas jääb sama tehing avatuks ja mõlemad vastaspoolel saavad jätkata teadete saatmist sama kordumatu tunnuskooriga.
91. Tuleks tähele panna, et eeltoodu ei ole kohaldatav võimendustagatistest ja uuesti kasutamisest teatamise korral. Näiteks võib vastaspool teatada uuesti kasutamisest

eksklikult (kui uuesti kasutamist pole toimunud); sel juhul peaks ta saatma teate uuesti kasutamise kohta, märkides selles toiminguliigiks „viga“. See ei tohiks siiski takistada vastaspoolt vajaduse korral hilisemas etapis uuesti kasutamisest teatamast.

## **4.9 Õigeaegne teatamine VFT sõlmimisest, muutmisest ja lõpetamisest**

### **4.9.1 VFT sõlmimine**

92. Kui sõlmitud VFT hiljem lõpetatakse (sh arvelduse ebaõnnestumise tõttu), peaksid vastaspoolel pärast seda, kui nad on edastanud teate toiminguliigiga „uus“, saatma teate, milles märgivad toiminguliigiks „lõpetamine/ennetähtaegne lõpetamine“. Kui algsest VFTst teatati toiminguliigiga „positsiooni komponent“ ja see hiljem lõpetatakse, ei peaks vastaspoolel saatma algse VFT kohta teadet toiminguliigiga „lõpetamine/ennetähtaegne lõpetamine“, vaid nad peaksid saatma positsioonist VFT eemaldamiseks teate toiminguliigiga „muudatus“ positsiooni kohta, millesse algne VFT kaasati.
93. Toiminguliiki „viga“ tuleks kasutada ainult selliste tehingute tühistamiseks, mis ei saanud teoks või mis jäävad SFTRist tuleneva teatamiskohustuse kohaldamisalast välja. Stsenariumi korral, kus vastaspoolel lepivad kokku sellise tehingu sõlmimises, mille tingimuseks on registreerimine keskse vastaspoole juures, ja keskne vastaspool lükkab selle tehingu tagasi, peaksid vastaspoolel lõpetama VFT toiminguliigiga „viga“, kuna tehingu toimumise kokkulepitud tingimust ei täidetud, mistõttu tehing ei saanud teoks.
94. Lisaks tuleks arvestada, et ajutisest arvelduse ebaõnnestumisest, mille tulemuseks ei ole VFT lõpetamine, ei tuleks teatada.
95. Võimenduslaenude korral tuleks VFT sõlmimisest teatada esmakordsel lühikese positsiooni turuväärtuse või rahalise netodeebetjäägi (kliendi vaatenurgast) esinemisel ning täitmise ajatempli väli tuleks vastavalt täita.

### **4.9.2 VFT muutmise ja parandamine**

96. VFT muutmise hõlmab järgmistest toiminguliikidest teatamist: „muudatus“ ja „parandus“. Teatamise tähtaeg on sama, mis tehingu sõlmimisel, st muudatusest tuleb teatada selle jõustumisel. Kui see on kohaldatav, näiteks väärtpaperite laenamise tehingu laenupoolel tehtavate muudatuste korral, tuleks selle all mõista kavandatud arvelduspäeva.
97. Vastaspoolel peaksid teatama ainult toimunud muudatustest, st nad ei peaks teatama muudatustest, milles on kokku lepitud, kuid mis jõustuvad tulevikus. Näiteks kui vastaspoolel lepivad kokku repotehingu ümberhindamises mingil tulevikukuupäeval, tuleks ümberhindamisest teatada alles pärast kokkulepitud kuupäeva (ümberhindamise jõustumiskuupäeva) saabumist.
98. Sarnaselt sõlmimisele teatatakse ajutisest arvelduse ebaõnnestumisest ainult juhul, kui selle tulemusel tehakse tehingus muudatus; muudatusest tuleks teatada, märkides toiminguliigiks „muudatus“. Näiteks kui VFT puhul on teatatud osalisest tagastamisest kui muudatusest, kuid hiljem see tühistatakse arvelduse ebaõnnestumise tõttu, peaksid

vastaspooled teatama selle VFT puhul veel ühest muudatusest, et osalisest tagastamisest tulenenud muudatus tagasi pöörata.

99. VFT tagasiulatava muutmise korral (näiteks kui VFT vastaspooled lepivad kahepoolselt kokku tehingu ümberhindamises mineviku jõustumiskuupäevaga), ei pea vastaspooled esitama uuesti teateid kõigi järgnenud tegevuste kohta alates tagasiulatava muudatuse jõustumiskuupäevast. Tuleks tähele panna, et teade tagasiulatava muudatuse kohta tuleks esitada möödunud sündmuse õige kuupäevaga (muudatuse jõustumiskuupäev). Sel juhul ei peaks kauplemisteabehoidlad kohaldama muudetud andmeid kauplemisseisu aruande suhtes<sup>4</sup>.
100. Parandustest tuleks teatada kohe, kui avastatakse valesti esitatud andmed. Paranduse teadet ei ole vaja saata, kui vastaspool on pärast VFT muutmist sisestanud ebaõiget teavet ainult oma sisemistesse süsteemidesse; sellistel juhtudel peaks ta saatma ainult lõplikke, õigeid andmeid sisaldava teate muudatuse kohta.

#### 4.9.3 Tagatise ajakohastamine

101. Tagatise ajakohastamisest teatamisel tuleks silmas pidada ajakohastamise jõustumise kuupäeva, st eeldatavat arvelduspäeva. Mõnikord võib aga juhtuda, et vastaspooled on ajakohastamises kokku leppinud, kuid ajakohastamine ei saa teoks põhjustel, mis on seotud vastaspooltega või kolmandate isikutega, nagu kesksed vastaspooled või väärtpaberite keskdepositooriumid. See tähendab, et tagatise ajakohastamise teade tuleks uuesti esitada, märkides selles lõplikud õiged andmed. Ajutistest arvelduse ebaõnnestumistest, mis ei mõjuta kokkulepitud pakutavat tagatist, ei tuleks teatada.
102. Mõnel juhul võivad üksused olla kokku leppinud tagatise muutmises, kuid ei ole vastavaid muudatusi veel teinud. Vastaspooled peaksid teatama ainult sellisest tagatise ajakohastamisest, mis on aset leidnud, st nad ei peaks teatama tagatisest, kui eeldatav arvelduspäev on tulevikus.
103. Tagatise ajakohastamise teated on igapäevased hetkeülevaated, mis peaksid kajastama tagatise seisut päeva lõpu seisuga. Tagatise päevasisestest muutustest teatama ei pea. Selliste päevasiseste tehingute korral, mille jaoks antakse tagatis ainult üheks päevaks ja see läheb päeva lõpus nulli, peaksid vastaspooled teatama nulltagatisest.
104. Keskse vastaspoole kliiritavate ja kauplemiskohas tehtavate tehingute puhul, mis sisalduvad positsioonis ja millest teatamisel märgitakse toiminguliigiks „positsiooni komponent“, tuleks tagatise ajakohastamisest teatada selle positsiooni osas, millesse need tehingud kaasati, mitte algsete tehingute osas.
105. Samuti tuleks tähele panna, et viimasest tagatise ajakohastamisest tuleks teatada viimase päeva kohta, mil vastav(ad) VFT(d) kehtib (kehtivad), ning teade tuleks saata järgmise päeva lõpuks. Kui VFT kohta on saadetud teade toiminguliigiga „ennetähtaegne lõpetamine“ või kui tähtajalise VFT tähtpäev on saabunud, ei tuleks selle VFT puhul enam tagatise ajakohastamise kohta teateid saata (välja arvatud puuduvad teated, mida õigeaegselt ei saadetud).

---

<sup>4</sup> Sündmuse kuupäeva mõju teadete käsitlemisele kauplemisteabehoidlate poolt kirjeldatakse üksikasjalikumalt jaos 4.8.3.



106. Võimenduslaenude korral tuleks tagatise ajakohastamisest teatada ainult lühikese positsiooni turuväärtuse või netodeebetjäägi (kliendi vaatenurgast) esinemisel. Kui klient ei ole võimenduslaenu veel kasutanud, ei peaks vastaspoolled teatama ei VFTst ega ka vastavast tagatisest. Võib esineda ka stsenaariume, kus klient on võimenduslaenu kasutanud (ning seega on teatatud võimenduslaenu tehingust ja vastavast tagatisest), kuid seejärel läheb võimenduslaen nulli. Kui vastaspoolled ei otsusta VFTd sulgeda, peaksid nad sel juhul edastama nulltagatise teate esimese päeva kohta, mil võimenduslaenu väärtus on null. Kui klient kasutab võimenduslaenu uuesti, tuleks selle VFT puhul teatada tagatise tegelikust väärtusest.

#### 4.9.4 Väärtuse, võimendustagatise ja uuesti kasutamise ajakohastamine

107. Väärtuse ajakohastamise korral peaksid vastaspoolled saatma igapäevased väärtuse hindamised hindamiskuupäevale järgneva tööpäeva lõpuks ja esitama hindamiskuupäeva väljal „sündmuse kuupäev“.
108. Võimendustagatise ajakohastamisest tuleks teatada siis, kui ajakohastamine jõustub, st eeldataval arvelduspäeval, võtmata arvesse ajutisi arvelduse ebaõnnestumisi.
109. Kesksele vastaspoolele enne tehingute portfelli kliirimist makstavatest võimendustagatistest teatamise tähtaeg on seotud portfellis (seotud portfelli koodiga) sisalduva esimese vastava VFT tehingupäev + 1, mitte tagatise andmise kuupäevale järgnev päev.
110. Uuesti kasutamisest teatamisel tuleb lähtuda arveldusest, st vastaspoolled peaksid teatama ainult antud kuupäeva lõpuks arveldatud uuesti kasutatud tagatise väärtuse. Sellest arvelduspäevast tuleks uuesti kasutamise teadetes teatada sündmuse kuupäevana ja teated tuleks saata järgmise päeva lõpuks (st arvelduspäev + 1). Uuesti kasutamise teated on päeva lõpu seisuga ülevaated, st need peaksid kajastama uuesti kasutatud tagatist päeva lõpu seisuga, mitte varem teatatud väärtuste muutust („delta teade“).

#### 4.9.5 VFT lõpetamine

111. Tähtajalise VFT tähtpäeva saabumisel, mis tähendab, et tehing ei ole enam pooleli, ei peaks vastaspoolled saatma „lõpetamise/ennetähtaegse lõpetamise“ liiki toimingute teadet.
112. Kui vastaspoolled lepivad kokku tähtajalise VFT lõpetamises enne tähtpäeva saabumist või tähtajatu VFT lõpetamises, peaksid nad kas:
- edastama teate toiminguliigiga „lõpetamine/ennetähtaegne lõpetamine“, kui lõpetamise arveldamine toimub eeldatavalt lõpetamisteatega samal päeval; või
  - edastama teate toiminguliigiga „muudatus“, kui lõpetamise arveldamine toimub eeldatavalt järgmisel päeval või hiljem. Sel juhul peaksid vastaspoolled tähtpäeva vastavalt muutma.
113. Arvestades, et SFTRis, regulatiivsetes tehnilistes standardites ja rakenduslikes tehnilistes standardites kavandatud aruandlusloogika kohaselt (ja kooskõlas Euroopa turu infrastruktuuri määruse kohase aruandlusloogikaga) ei saa tehingut pärast selle

lõpetamist „uuesti avada“, ei peaks vastaspoolel teatama lõpetamisest, kui selle põhjuseks ei ole arvelduse ebaõnnestumine.

114. Kui vastaspoolel saavad kokkulepitud ennetähtaegse lõpetamise kuupäevale järgneval päeval teada, et lõpetamist ei ole eeldatud arvelduspäeval arveldatud, ei tohiks nad saata „lõpetamise/ennetähtaegse lõpetamise“ liiki toimingute teadet enne, kui lõpetamine arveldatakse. Kui lõpetamine tühistatakse arvelduse ebaõnnestumise tõttu, ei peaks vastaspoolel saatma „lõpetamise/ennetähtaegse lõpetamise“ liiki toimingute teadet, kuna VFT on endiselt pooleli.
115. Kui VFT tähtpäev on saabunud (lepingus kokkulepitud algne tähtpäev (väli 2.14) või muudetud tähtpäev, millest teatati seoses kokkulepitud ennetähtaegse lõpetamisega) ja kui tähtpäevale järgneval päeval saavad tehingu vastaspoolel teada, et VFT lõpu poolt ei ole arveldatud, peaksid nad saatma muudatuse teate, lükates tähtpäeva järgmisele päevale või muule tulevasele päevale, mil arveldamine eeldatavalt aset leiab. Tuleks tähele panna, et tähtpäeva selline muutmine on võimalik ainult kuni tähtpäevale järgneva päevani, kuna alates sellest päevast ei ole VFT enam pooleli ja seda ei saa „uuesti avada“. Kui tagastamine arveldatakse edukalt, ei peaks vastaspoolel edasisi teateid saatma, kuna alates tähtpäevale järgnevast päevast loetakse, et VFT ei ole pooleli.

#### 4.9.6 Ülevaade teatamise tähtaegadest teate- ja toiminguliikide kaupa

116. Tabel 5 kirjeldab, mis tuleks iga teate ja toimingute liigi puhul märkida „sündmuse kuupäevaks“. Sündmuse kuupäevast tuleneb ka see, millest teatatakse, näiteks eeldatav arvelduspäev tagatise ajakohastamise korral ja hindamispäev väärtuse ajakohastamise korral. Tegelikud teated tuleks saata sündmuse kuupäevale järgneva tööpäeva lõpuks.

Tabel 5. Sündmuse kuupäev		
Table	Action type	Sündmuse kuupäev
1&2	NEWT	Lepingu sõlmimise kuupäev („tehingupäev“)
1&2	MODI	Muudatuse jõustumiskuupäev või vajaduse korral eeldatav arvelduspäev
1&2	CORR	Kuupäev, millest alates parandust tuleks kohaldada (tavaliselt kuupäev, mille kohta eelnevalt esitati ebaõiged andmed)
1&2	ETRM	Lõpetamise eeldatav arvelduspäev
1&2	EROR	Ei kohaldata
1&2	COLU	Eeldatav arvelduspäev
1&2	VALU	Hindamispäev
3	NEWT	Eeldatav arvelduspäev
3	MARU	Eeldatav arvelduspäev
3	CORR	Kuupäev, millest alates parandust tuleks kohaldada (tavaliselt kuupäev, mille kohta eelnevalt esitati ebaõiged andmed)
3	EROR	Ei kohaldata
4	NEWT	Tegelik arvelduspäev
4	REUU	Tegelik arvelduspäev
4	CORR	Kuupäev, millest alates parandust tuleks kohaldada (tavaliselt kuupäev, mille kohta eelnevalt esitati ebaõiged andmed)

4	EROR	Ei kohaldata
---	------	--------------

#### 4.10 Ärisündmuste seosed toiminguliikide ja tasanditega

117. Tabel 6 kirjeldab VFT elutsükli jooksul toimuvate ärisündmuste ja teatamise tehnilistes standardites määratletud toiminguliikide vahelisi seoseid.
118. Kui vastaspoolad lepivad kokku VFT ennetähtaegses lõpetamises ja asendamises, peaksid nad sellest vastavalt teatama. Sellistel juhtudel peaksid vastaspoolad kõigepealt algse VFT lõpetama (saates kas „lõpetamise/ennetähtaegse lõpetamise“ teate või „muudatuse“ teate muudetud tähtpäevaga) ja seejärel edastama teate uue tehingu kohta (toiminguliik „uus“).
119. Tabeli lihtsustamiseks on kõik sündmused, mille tulemuseks on VFT lõpetamine, seostatud toiminguliigiga „lõpetamine/ennetähtaegne lõpetamine“, välja arvatud sündmus 44, mille puhul käsitletakse konkreetset lõpetamise teateid. Samas tunnistatakse, et kui vastaspoolad lepivad kokku tehingu lõpetamises tulevikus mõnel muul kuupäeval, tuleks sellest üldjuhul teatada tähtpäeva muudatusena (toiminguliik „muudatus“), samas kui samal päeval lõpetamise korral tuleks toiminguliigiks märkida „lõpetamine/ennetähtaegne lõpetamine“.
120. Kuna teatamise tehnilised standardid ei saa sisaldada täiendavaid toiminguliike, peaksid vastaspoolad VFTdest ja nendega seotud asjakohastest ärisündmustest teatamisel kasutama tehnilistes standardites sätestatud toiminguliike.
121. Eri liiki VFTde puhul lepingu kehtivusajal lepingut mõjutavatest sündmustest teatamisel tuleks esitada järgmised toiminguliigid (väli 2.98) ja asjakohased tasandid (väli 2.99)<sup>5</sup>.

Tabel 6. Ärisündmuste seosed toiminguliikide ja tasanditega						
New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message <sup>6</sup>	Action Type	Level	Märkused/näited
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	See hõlmab volitatud kaupleja blokk-, koond- ja hulgitehingut, mis jaotatakse klientidele. See hõlmab ka kõiki teatatavaid tehinguid, mis sõlmitakse arveldamise eesmärgil (automaatne tagatise seadmine (rahvusvahelise) väärtpaberite keskdepositooriumi poolt, muud krediitliinid, väärtpaberite automaatne päevasisene laenamine (rahvusvaheliselt) väärtpaberite keskdepositooriumilt). Tehingu esimese poole arveldamisest, sealhulgas hilinevad arveldamisest,

<sup>5</sup> Ärisündmuste loetelu ei ole ammendav.

<sup>6</sup> Viidatud on teatamise regulatiivsete ja rakenduslike tehniliste standardite tabelitele.

**Tabel 6. Ärisündmuste seosed toiminguliikide ja tasanditega**

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message <sup>6</sup>	Action Type	Level	Märkused/näited
						mis ei põhjusta VFT lõpetamist ega muid muudatusi, <b>ei</b> tuleks eraldi teatada. Võimenduslaenude korral tuleks tehingu sõlmimisest teatada siis, kui krediiti esmakordselt antakse.
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	See hõlmab näiteks pikendatava repotehingu pikendamist, erikokkulepet tähtajalise repotehingu tagasiostukuupäeva muutmiseks või kokkulepet tagasiostukuupäeva edasilükkamiseks arvelduste ebaõnnestumise haldamise eesmärgil.
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	Näiteks volitajate avalikustamine volitatud kaupleja poolt teisele tehinguosalisele volitusepõhises koondrepotehingus.
8	Full reallocation with a new UTI	All	Table 1 and Table 2	ETRM + NEW T	TCTN	See hõlmab ka stsenaariumi, kus ümberjaotamine toimub enne algse tehingu alguse poole arveldamist.
9	Full reallocation to an existing UTI	All	Table 1 and Table 2	ETRM + MOD I	TCTN	See hõlmab ka stsenaariumi, kus ümberjaotamine toimub enne algse tehingu alguse poole arveldamist.
10	Partial reallocation to a new UTI	All	Table 1 and Table 2	MOD I + NEW T	TCTN	See hõlmab ka stsenaariumi, kus ümberjaotamine toimub enne algse tehingu alguse poole arveldamist.
11	Partial reallocation to an existing UTI	All	Table 1 and Table 2	MOD I + MOD I	TCTN	See hõlmab ka stsenaariumi, kus ümberjaotamine toimub enne algse tehingu alguse poole arveldamist.
12	Increase or reduce size of a repo by modifying the terms	REPO	Table 1 and Table 2	MOD I	TCTN	

**Tabel 6. Ärisündmuste seosed toiminguliikide ja tasanditega**

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message <sup>6</sup>	Action Type	Level	Märkused/näited
	of the contract (same 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	Osalise tagastamise arveldamisest, sealhulgas hilinenud arveldamisest, mis ei põhjusta osalise tagastamise tühistamist, ei tuleks eraldi teatada.
16	Cancellation or failure of the partial return	SBL	Table 1 and Table 2	MOD I	TCTN / PSTN	Hilinenud arveldamisest, mis ei põhjusta osalise tagastamise tühistamist, ei tuleks teatada.
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	Kui ümberhindamises ei lepitud kokku, kuid sellest on ühepoolset ekslikult teatatud, tuleks varasema hinna muutumisest teatada, märkides toiminguliigiks „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	Selle sündmuse tulemuseks on tagasiostuhinna muutmise teade.
21	Events impacting the collateral value	REPO, BSB	Table 1 and Table 2	COL U	-	Näiteks tagatiselt teenitava tulu maksmine (repotehing, ostu-tagasimüügitehing), dividendi- või intressimakse väärtpaberitelt (repotehing, ostu-tagasimüügitehing), ujuva intressimääraga tagatise määra või indeksiga seotud tagatise indeksi kavandatud muutmine mis tahes liiki repotehingus.
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	-	

**Tabel 6. Ärisündmuste seosed toiminguliikide ja tasanditega**

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message <sup>6</sup>	Action Type	Level	Märkused/näited
25	Flat margin loan and/or short market value	ML	Table 1 and Table 2	MOD I	-	
26	Change in outstanding margin loan or short market value	ML	Table 1 and Table 2	MOD I	-	
27	Change of base currency used for margin loan	ML	Table 1 and Table 2	MOD I	-	
28	Additional base currency used for margin loan	ML	Table 1 and Table 2	NEW T	-	Kuna iga võimenduslaenu kohta on ainult üks alusvaluuta, tuleks täiendavast alusvaluutast teatada uue võimenduslaenuna, millel on uus tehingu kordumatu tunnuscode.
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	Toiminguliiki „NEWT“ kasutatakse juhul, kui tagatise andmed esitatakse koos VFT teiste andmetega uue tehingu teates. Tegemist võib olla näiteks stsenaariumiga, kus müüja jaotab tagatise seoses uue üldtagatise põhineva repotehinguga või kolmandast isikust vahendaja jaotab esmakordselt tagatise tehingupäeval.
31	First allocation of collateral after the day of trade	REPO	Table 1 and Table 2	COL U	TCTN	Tegemist võib olla näiteks stsenaariumiga, kus müüja jaotab tagatise seoses uue üldtagatise põhineva repotehinguga või kolmandast isikust vahendaja jaotab esmakordselt tagatise pärast tehingupäeva.
32	Substitution of Collateral	All	Table 1 and Table 2	COL U	-	See hõlmab näiteks müüja kontrol aktsepteeritava tagatise puudumise korral väärtpaberite ajutist asendamist rahaga (tavaliselt kolmandast isikust vahendaja poolt), ajutise rahalise tagatise asendamist väärtpaberitagatise, ajutist rahalise tagatise andmist väärtpaberite tagastamisega viivitamisest muutuvtagatise nõude esitamise korral raamlepingu GMRA punkti 6 alapunkti h alusel. See hõlmab ka kõiki tagatise muudatusi, mis tulenevad korporatiivsetest sündmustest.
33	Change in collateral quality	All	Table 1 and Table 2	COL U	-	

**Tabel 6. Ärisündmuste seosed toiminguliikide ja tasanditega**

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message <sup>6</sup>	Action Type	Level	Märkused/näited
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	-	
36	Cash compensation where required by regulation (e.g. CSDR) or market convention (not under GMRA)	All	Table 1 and Table 2	COL U	-	
37	Default of the collateral issuer	All	ALL	COL U or ETR M	TCTN / PSTN	Toiminguliik „ETRM“ tuleks märkida ainult juhul, kui VFT lõpetatakse tagatise andja kohustuste täitmatajätmise tõttu. Muul juhul tuleks tagatise asendamisest teatamisel märkida toiminguliigiks „COLU“.
38	Variation margining	REPO, SLB, BSB	Table 1 and Table 2	COL U	-	See on eraldi „COLU“ teade neto riskipositsiooni kohta.
39	Change in haircut or margins	REPO, SLB	Table 1 and Table 2	COL U	TCTN / PSTN	
40	Clearing off-venue	All	Table 1 and Table 2	ETRM + NEW T	TCTN / PSTN	See hõlmab börsiväliseid tehinguid, mis kliiritakse samal päeval või pärast seda.
41	Post-trade clearing of a transaction executed on a trading venue	All	Table 1 and Table 2	ETRM + NEW T	TCTN / PSTN	See hõlmab kauplemisskohas täidetavaid tehinguid, mis kliiritakse pärast tehingupäeva.
42	Same-day clearing of a transaction executed on a trading venue	All	Table 1 and Table 2	NEW T	TCTN / PSTN	See hõlmab kauplemisskohas tehtavaid tehinguid, mis kliiritakse avaliku pakkumise mudeli alusel ja samal päeval toimuva uuendamise kaudu.
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	MOD I or ETR M	TCTN	Samal päeval lõpetamise korral tuleks toiminguliigiks märkida „ETRM“, kuid tulevikus saabuva lõpetamiskuupäeva korral tuleks teates toiminguliigiks märkida „MODI“ (muutes tähtpäeva).
45	Termination of an evergreen or puttable SFT	REPO, SLB	Table 1 and Table 2	MOD I	TCTN	See hõlmab lõpetamise võimaluse kaotamist.

**Tabel 6. Ärisündmuste seosed toiminguliikide ja tasanditega**

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message <sup>6</sup>	Action Type	Level	Märkused/näited
46	Maturity/Expiration	All	Table 1 and Table 2	no report	-	Ajutisest aeguva VFT arvelduse ebaõnnestumisest ei tuleks eraldi teatada.
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	-	Täieliku tagastamise arveldamisest, sealhulgas hilinenud arveldamisest, mis ei põhjusta täieliku tagastamise tühistamist, ei tuleks eraldi teatada.
48	Cancellation or failure of the full return	SBL	Table 1 and Table 2	no report or NEWT	TCTN	Täielikust tagastamisest ei tuleks teatada, kui arveldamist ei toimu, et täieliku tagastamise tühistamise korral ei peaks edastama täiendavat teadet. Kui aga täielikust tagastamisest teatamisel märgiti toiminguliigiks „ETRM“ ja seejärel täielik tagastamine tühistati, tuleks tehingust uuesti teatada toiminguliigiga „NEWT“ ja uue tehingu kordumatu tunnuskooriga.
49	Closure of an SFT due to counterparty default	All	Table 1 and Table 2	ETRM	-	See hõlmab näiteks otsustust, et vastaspool ei täida oma lepingulisi kohustusi, kui sellises võimaluses on raamlepingu GMRA artikli 10 punkti a alapunkti ii kohaselt kokku lepitud.
50	Termination of transaction under specific GMRA provisions	REPO, BSB	Table 1 and Table 2	ETRM	-	See hõlmab järgmist: tehingu lõpetamine GMRA 2000 artikli 10 punkti g või GMRA 2011 artikli 10 punkti h kohaselt; „minilõpetamine“ GMRA 2000 artikli 10 punkti h või GMRA 2011 artikli 10 punkti i kohaselt; ümberhindamine või korrigeerimine GMRA 2000 artikli 4 punktide i–k või GMRA 2011 artikli 4 punktide j–l kohaselt.
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	Vastaspoolel lepivad kokku tehingu omaduse muutmises. See hõlmab kõiki muudatusi, mida ei ole eraldi välja toodud.
53	Amend trade - unilateral	All	Table 1 and Table 2	COR R	TCTN / PSTN	Üks vastaspool muudab tehingu omadust.
54	Amend collateral - bilateral	All	Table 1 and Table 2	COL U	TCTN / PSTN	Vastaspoolel lepivad kokku tagatise omaduse muutmises. See hõlmab kõiki muudatusi, mida ei ole eraldi välja toodud.
55	Amend collateral - unilateral	All	Table 1 and Table 2	COR R	TCTN / PSTN	Üks vastaspool muudab tagatise omadust.



**Tabel 6. Ärisündmuste seosed toiminguliikide ja tasanditega**

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message <sup>6</sup>	Action Type	Level	Märkused/näited
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	Kui „ennetähtaegse lõpetamise“ või „vea“ liiki toimingute teade on saadetud ekslikult, ei ole seda võimalik parandada. Kui on edastatud teade nende toiminguliikide kohta, ei saa tehingut viia tagasi kehtivasse olekusse, mistõttu tuleb teatada tehingust uuesti, märkides toiminguliigiks „NEW T“ ja kasutades uut tehingu kordumatut tunnuskoodi.
57	Transaction not executed or out of scope of SFTR but reported to TR by mistake	All	Table 1 and Table 2	ERO R	-	
58	Initial posting of margin to a CCP for cleared SFTs	All	Table 3	NEW T	-	
59	Update of the initial margin posted at the CCP	All	Table 3	MAR U	-	
60	Posting variation margin to a CCP for cleared SFTs	All	Table 3	MAR U	-	
61	Correction of a previously submitted margin report	All	Table 3	COR R	-	
62	Cancellation of a wrongly submitted margin report	All	Table 3	ERO R	-	
63	First report of reuse of collateral or reinvestment of cash collateral	All	Table 4	NEW T	-	
64	Change in the securities reused or update of the estimated reuse or value of reused collateral	All	Table 4	REU U	-	
65	Change in cash collateral reinvestment type, amount or currency	SLB	Table 4	REU U	-	
66	Correction of a previously submitted collateral reuse report with incorrect data	All	Table 4	COR R	-	
67	Cancellation of a wrongly submitted collateral reuse report (e.g. for an entity not subject to	All	Table 4	ERO R	-	

**Tabel 6. Ärisündmuste seosed toiminguliikide ja tasanditega**

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message <sup>6</sup>	Action Type	Level	Märkused/näited
	the reporting obligation)					

#### 4.11 Väärtpaberite keskdepositooriumi liikme identifitseerimine

122. Välja arvatud juhtudel, kui teatatakse võimenduslaenu andmisest või kui tehing hõlmab kaupa, peaksid vastaspoolad alati täitma väärtpaberite keskdepositooriumi liikme või kaudse liikme välja. See väli tuleks täita ka siis, kui VFT arveldatakse väljaspool väärtpaberite keskdepositooriumi. ESMA eeldab, et teavitav vastaspool järgib selle välja täitmisel järgmist loogikat:
- esitab oma juriidilise isiku tunnuse, kui ta arveldab otse väärtpaberite keskdepositooriumis, st on väärtpaberite keskdepositooriumi liige;
  - esitab oma juriidilise isiku tunnuse, kui ta arveldab väärtpaberid ühes kahest rahvusvahelisest väärtpaberite keskdepositooriumist, isegi kui see rahvusvaheline väärtpaberite keskdepositoorium ei ole emiteeriv keskdepositoorium, st vastaspool on rahvusvahelise väärtpaberite keskdepositooriumi liige;
  - esitab oma depositooriumina tegutseva panga juriidilise isiku tunnuse, sõltumata sellest, kas see pank kasutab mõnda alamdepositooriumi või mitte. See hõlmab stsenaariume, kus vastaspool kasutab laenude vahendajat.
123. Vastaspool ei peaks väärtpaberite keskdepositooriumi liikme väljal esitama selle väärtpaberite keskdepositooriumi juriidilise isiku tunnust, milles ta on otsene või kaudne liige.

#### 4.12 Vastaspole rolli kindlaksmääramine

##### 4.12.1 Üldpõhimõtted

124. Repotehingute ja ostu-tagasimüügitehingute korral on tagatisesaajaks ostja ja tagatiseandjaks on müüja.
125. Väärtpaberite laenamise tehingute ja kaupa hõlmavate VFTde korral on tagatisesaajaks laenuandja ja tagatiseandjaks on laenuvõtja.
126. Võimenduslaenude korral on tagatisesaajaks laenuandja ja tagatiseandjaks on laenuvõtja.

##### 4.12.2 Keskse vastaspole kliiritavad VFTd

127. Keskse vastaspole kliiritavate VFTde korral paikneb keskne vastaspool VFT kahe vastaspole vahel. Seetõttu on ta müüja jaoks ostja, laenuandja jaoks laenuvõtja, ostja jaoks müüja ja laenuvõtja jaoks laenuandja.

#### 4.12.3 Väärtpaberite tagamata laenamine

128. Väärtpaberite tagamata laenamise korral peaks väärtpabereid laenuks andev vastaspool teatama endast tagatisesaaajana ja väärtpabereid laenuks võttev vastaspool peaks teatama endast väljal 1.9 tagatiseandjana.

#### 4.12.4 Vastaspoole rollist teatamine neto riskipositsiooni alusel tagamise korral

129. Neto riskipositsiooni alusel tagamise korral ei peaks vastaspoolel täitma välja „Vastaspoole roll“ tagatise puhul, mida kasutatakse muutuvtagatisena. Pärast seda, kui kumbki vastaspool on kindlaks teinud, kas ta on tagatise netoandja või tagatise netosaaja, peaks ta siiski teatama muutuvtagatisena kasutatavast tagatisest, nagu on üksikasjalikumalt kirjeldatud jaos 5.4.7.

### 4.13 Hinna ja väärtuse väljad

#### 4.13.1 Väärtuse hindamise aeg

130. VFT kliirimisel tuleks SFTRi kohase teatamiskohustuse täitmiseks kasutada väärtuse hindamisega seotud teavet, mis on saadud keskselt vastaspoolelt.
131. Väärtpaberite turuväärtus peaks olema iga tööpäeva lõpu seisuga registreeritud väärtus ja sellest tuleks teatada hiljemalt päeval, mis on T+1, lähtudes tagatisvara haldamise eesmärgil (näiteks igapäevase muutuvtagatise arvutamiseks) tehtud hindamisest.
132. Vastaspoolel peaksid oma VFTde turuväärtuse esitama turuhindade ja valuutakursside alusel, mida nad on selle tööpäeva jooksul riskipositsioonide juhtimiseks kasutanud. Väärtpaberite laenuks andmise tehingute puhul tähendaks see üldiselt, et antud tööpäeva lõpu seisuga teatatavateks väärtusteks on väärtpaberite eelmise tööpäeva sulgemishinnad ja nendest teatamise tähtaeg on hiljemalt T+1.
133. Kahe erineva päeva väärtuste esitamisel peaksid vastaspoolel täitma välja 2.3 „Sündmuse kuupäev“ kummagi päeva kohta.

#### 4.13.2 Väärtuse hindamisel kasutatav arvutusmeetod

134. SFTRi kohase teatamiskohustuse täitmisel peaksid vastaspoolel kasutama seda väärtust, mida nad kasutavad tagatisvara haldamiseks ja riskipositsioonide juhtimiseks.
135. Kui turuväärtus pole kättesaadav, ei näe SFTR ette konkreetset meetodit väärtuse arvutamiseks. Sellele vaatamata kuuluvad väljadel 2.57 ja 2.88 esitatavad andmed kooskõlastavale võrdlemisele, mistõttu vastaspoolel peaksid kokku leppima ja esitama väärtused, mis jäävad lubatud hälbe piiridesse, nagu on üksikasjalikult kirjeldatud andmete kogumise regulatiivsete tehniliste standardite lisas.
136. Väärtpaberite turuväärtusest tuleks teatada iga tööpäeva lõpu seisuga ja see peab kajastama tagatisvara haldamise eesmärgil (näiteks igapäevase muutuvtagatise arvutamiseks) tehtud hindamist.

137. Kui hinnatavate väärtpaberite turuhind pole kättesaadav, peaks andmeid esitav vastaspool kasutama varuvariandina kõige hiljutisemat kättesaadavat turuhinda.
138. Asjakohaste väärtuse ja summa väljade korrektseks täitmiseks peaksid vastaspool vastavalt vajadusele kõigil hinnaväljadel kasutama valuutade XML-märgiseid; see on eriti oluline, kui tegemist on erinevate valuutadega. Vt ka jaos 5.2.1.8 toodud näidet.
139. Kui täpse väärtuse esitamiseks peab vastaspool kasutama valuutakurssi, tuleks kasutada asjakohast EKP kurssi. Kui konverteerimiseks vajalik EKP valuutakurss puudub, peaksid vastaspool omavahel kokku leppima, millist valuutakurssi hindamiseks ja teatamiseks kasutada.

#### **4.14 Tagatisena kasutatava väärtpaberi CFI (finantsinstrumentide klassifikatsioon) kood**

140. Kui tagatisena kasutatakse väärtpaberit, tuleks esitada selle väärtpaberi CFI-kood laenu ja tagatise andmete tabeli väljadel 42 ja 79. See väli ei kehti kauba kohta.
141. CFI-koodi esitamiseks peaksid vastaspool alati kasutama ametlikke allikaid. Kasutada tuleks asjakohase riikliku numeratsiooniameti väljastatud andmeid. Lisateavet saab ANNA veebisaidilt aadressil <http://www.anna-web.org/standards/about-identification-standards/> või asjakohaselt riiklikult numeratsiooniametilt.
142. Vastaspool peaksid esitama ainult kehtivad CFI-koodid. Kui CFI-koodi ei ole võimalik ametlikest allikatest leida, peaksid vastaspool selles kokku leppima, kuna CFI-koodi väli kuulub kooskõlastavale võrdlemisele.

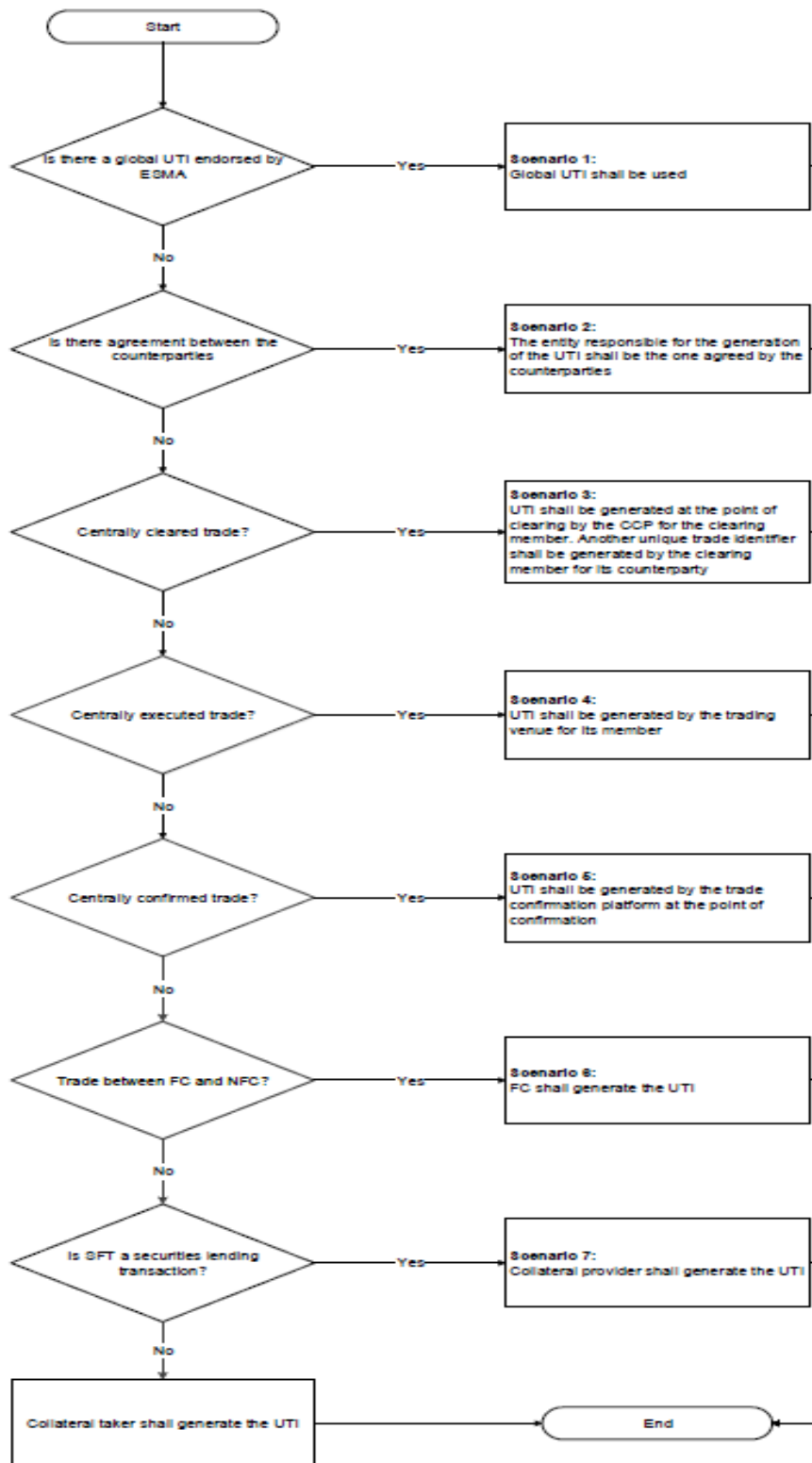
#### **4.15 Edasilükatud teatamine enne teatamise alguskuupäeva sõlmitud VFTdest**

143. Vastaspool, kes otsustavad esitada teated varasemal teatamise alguskuupäeval, peaksid esitama enne teatamise alguskuupäeva sõlmitud tehingute kohta täielikud ja täpsed andmed, sealhulgas igapäevased tagatise ajakohastamised, märkides toiminguliigiks „COLU“. Kui nad teatavad osast oma VFTdest, peaksid nad esitama täielikud ja täpsed võimendustagatise ja uuesti kasutamise andmed teatamise tehniliste standardite lisas olevates tabelites 3 ja 4.
144. Kui asjaomane teatamise alguskuupäev kehtib mõlema vastaspoole puhul, peaksid nad kooskõlastava võrdlemise tõrgete vähendamiseks leppima kokku, millal nad vastavatest tehingutest teatavad. Igal juhul on kõnealustest tehingutest teatamise lõpptähtaeg teatamise alguskuupäev + 190 päeva. Kui vastaspool, kelle puhul teatamise alguskuupäevast tulenev tähtaeg ei ole veel saabunud, otsustab teatada enne teatamise alguskuupäeva sõlmitud tehingutest, peaks ta tagama, et teatamine toimub vastavalt punktile 146.
145. Kui vastaspool nii otsustavad, võivad nad vabatahtlikult täies mahus teatada enne teatamise alguskuupäeva sõlmitud tehingutest, mis on pärast esimest teatamise alguskuupäeva avatud, enne nimetatud lõpptähtaega.

146. Kõnealustest tehingutest teatamisel tuleks väljal 2.98 toiminguliigiks märkida „NEWT“. Väljal „Täitmise ajatempel“ (väli 2.12) tuleks märkida algne täitmise ajatempel. Väljal „Väärtuspäev (alguskuupäev)“ (väli 2.13) tuleks märkida algne väärtuspäev, välja arvatud juhul, kui seda on VFT arveldamise probleemide tõttu muudetud. Ülejäänud andmeväljad peaksid kajastama teatamise hetkel kehtivat seisut. Varasematest lepingu kehtivusajal lepingut mõjutavatest sündmustest eraldi teatada ei tuleks.

#### **4.16 Tehingu kordumatu tunnuskoode genereerimine ja ülesehitus**

147. Tehingu kordumatu tunnuskoode genereerimise protsessi illustreerib alljärgnev vooskeem.



148. Kliiritud VFTde korral tuleks igast keskse vastaspoole ja selle kliirivate liikmete vahelisest VFTst ning kliirivate liikmete ja nende klientide vahelisest VFTst teatada omaette kordumatu tunnuskoodiga.

149. Tuleks tähele panna, et vastaspoolte kokkulepe tehingu kordumatu tunnuskoodi kohta on tehnilistes standardites sätestatud raamistiku kohaselt varuvariant, kuna enamik üksusi tugineb tehingu kordumatu tunnuskoodi genereerimisel kindlale hierarhilisele korrale. Sellegipoolest võivad vastaspoolled sellise kokkuleppe sõlmida ja sel juhul peaksid nad seda järgima kõigil kokkuleppega hõlmatud juhtudel.
150. Tähtajatute VFTde korral peaksid vastaspoolled säilitama selle VFT jaoks algselt genereeritud kordumatu tunnuskoodi ja nad ei tohiks igal pikendamisel genereerida uut tunnuskoodi.
151. Tehingu kordumatu tunnuskoodi genereerinud vastaspoole edastatud tunnuskoodi peaks olema võimalik kasutada selle vastaspoole süsteemides, kes tunnuskoodi ei genereerinud, või teatamise eest vastutava või teadet esitava üksuse süsteemides.
152. Vastaspoolled peaksid looma asjakohase tehnilise süsteemi, mis vastab vahetatavate andmete mahule, et tagada tehingu kordumatu tunnuskoodi õigeaegne edastamine ja kasutamine. Kui tehingu kordumatu tunnuskoodi genereerimisel või edastamisel esineb probleeme, peaksid vastaspoolled tagama nende probleemide õigeaegse lahendamise ning pidama kinni VFTst teatamise tähtajast.
153. Kui tehingu kordumatu tunnuskood on vale, tuleks tehing tühistada ja seejärel teatada uuest tehingust õige tunnuskoodiga.
154. Mis puudutab tehingu kordumatu tunnuskoodi vormingut, siis VFT vastaspoolled võiksid kaaluda võimalust lähtuda makse- ja arveldussüsteemide komitee/Rahvusvahelise Väärtpaberijärelevalve Organisatsiooni suunistest, milles soovitatakse uute tehingute kordumatute tunnuskoodide struktureerimist järgmiste järjestikuste elementide kombinatsioonina:
  - a. tunnuskoodi genereeriva üksuse juriidilise isiku tunnus, mis kehtib genereerimise hetkel, ja
  - b. selle üksuse loodud kordumatu väärtus (kusjuures see väärtus peab olema kordumatu ainult sama üksuse loodud väärtuste kogumi piires, kuna kombinatsioon juriidilise isiku tunnusega tagab üldise kordumatuse).

#### **4.17 Õigustatud isikute identifitseerimine ja neist teatamine**

155. Üks tavaline stsenaarium (kuid võib esineda ka teisi stsenaariume) on selline, mis hõlmab katus- ja allfonde, kus katusfond on tehingu vastaspool ja allfond (allfondid) on õigustatud isikud.
156. Võib esineda ka juhtumeid, kus õigustatud isikuks on eraldatud varakogum; sellise kogumi identifitseerimiseks tuleks kasutada juriidilise isiku tunnust<sup>7</sup>.

---

<sup>7</sup> Nagu viidatakse finantsstabiilsuse nõukogu 2012. aasta aruande „A Global Legal Entity Identifier for Financial Markets“ soovitusel nr 8, võivad varakogumid või juriidilise isiku muud eraldatud osad olla eraldi õiguste ja kohustuste kandjad, kes on sellest juriidilisest isikust piisavalt sõltumatud, mistõttu neil võib olla oma juriidilise isiku tunnus. See on kooskõlas ka juriidilise isiku tunnuseid käsitleva ISO standardiga 17442:2012.

#### 4.18 Väärtpaberite emitendi ja väärtpaberite identifitseerimine

157. Vastaspooled peaksid esitama laenuks antud või võetud väärtpaberite emitendi (emitentide) juriidilise isiku tunnuse, tagatisena kasutatavate väärtpaberite emitendi (emitentide) juriidilise isiku tunnuse ning samuti rahvusvahelise väärtpaberite identifitseerimisnumbri (ISIN-koodi).
158. Selle teabe esitamisel peaksid vastaspooled tagama vastavuse ISIN-koodi ja emitendi juriidilise isiku tunnuse vahel, millest teatatakse vastavalt valideerimiseeskirjadele.

#### 4.19 Tegevuskord juhul, kui vastaspoolt mõjutavad korporatiivsed sündmused

159. Uue juriidilise isiku tunnusega üksus (nt ühinenud või ühendav üksus, edaspidi „uus üksus“) peaks muudatustest teavitama kauplemisteabehoidlat (-hoidlaid), millele ta teatas oma VFTdest, ja taotlema kehtivate VFTde puhul identifikaatori ajakohastamist vastavalt punktile 162 allpool. Kui identifikaatori muutmine tuleneb ühinemisest või omandamisest, peaks ühinenud või ühendav üksus nõuetekohaselt ajakohastama ka omandatud/ühendatud üksuse juriidilise isiku tunnuse. Vajaduse korral peaks vastaspool esitama ka teabe riigi muutumise kohta.
160. Restruktureerimisega seotud korporatiivsete sündmuste korral, mis mõjutavad kõiki pooleliolevaid VFTsid, peaks kauplemisteabehoidla tegema kindlaks kõik pooleliolevad VFTd, mille puhul üksus on identifitseeritud vana juriidilise isiku tunnusega kas teavitava vastaspoole tunnuskoodi väljal või teise vastaspoole tunnuskoodi väljal, ja asendama vana juriidilise isiku tunnuse uuega.
161. Muud restruktureerimisega seotud korporatiivsed sündmused, muu hulgas osalised omandamised ja võrsefirmad, võivad mõjutada ainult osa pooleliolevaid VFTsid; sellisel juhul peaks uus üksus kauplemisteabehoidlale esitama nende VFTde kordumatud tunnuskoodid, mida asjaomane sündmus mõjutab.
162. Seda tehakse järgmise kontrollitud protsessi kaudu.
  - a. Uus üksus peaks esitama kauplemisteabehoidlale, millele ta teatas oma VFTdest, kirjaliku dokumentatsiooni ja taotlema juriidilise isiku tunnuse muutmist tulenevalt korporatiivsest sündmusest. Dokumentatsioonis tuleks selgelt esitada järgmine teave: i) ühinemises, omandamises või muus korporatiivses sündmuses osalevate üksuste juriidilise isiku tunnus; ii) uue üksuse juriidilise isiku tunnus; iii) kuupäev, mil muutus toimub; ja iv) asjaomaste pooleliolevate VFTde kordumatud tunnuskoodid.

Ühinemise või omandamise korral peaks see dokumentatsioon sisaldama tõendusmaterjali selle kohta, et korporatiivne sündmus on toimunud või toimub, ning olema nõuetekohaselt allkirjastatud. Võimaluse korral peaks üksus esitama nõutud teabe eelnevalt, nii et muudatust ei tehtaks tagasiulatuvalt, vaid alates alapunktis iii) osutatud kuupäevast. Tuleks tähele panna, et juriidilise isiku tunnuse õigeaegse ajakohastamata jätmise korral lükatakse üksuse edastatud teated tagasi, kui üksus on varem identifitseeritud vana juriidilise isiku tunnusega ja asjakohase staatusega (st „Välja antud“, „Üleandmise ootel“ või „Arhiveerimise ootel“) ja see status on hiljem asendatud väärtusega „Ühendatud“.



- b. Kauplemisteabehoidla peaks selle teabe edastama kõigile teistele kauplemisteabehoidlatele konkreetses failis, mis sisaldab i) vana juriidilise isiku tunnust, ii) uut juriidilise isiku tunnust ja iii) kuupäeva, alates millest muudatus tuleks teha. Võimaluse korral tuleks see fail edastada eelnevalt, nii et muudatust ei tehtaks tagasiulatuvalt, vaid alates alapunktis iii) osutatud kuupäevast.
  - c. Kõigi nende VFTde vastaspooli, mille puhul on identifitseeritud mõni ühinenud üksus, tuleks teavitada muudatusest, mille teeb kauplemisteabehoidla, millele nad teateid edastavad.
  - d. Kauplemisteabehoidla peaks teavitama ka reguleerivaid asutusi, kellel on juurdepääs ajakohastatud VFTdega seotud andmetele.
  - e. Vajaduse korral peaks kauplemisteabehoidla ajakohastama välja 1.12 „Teise osapoole riik“.
  - f. Muudatused tuleks säilitada iga kauplemisteabehoidla peetavas andmekogus.
163. Edasisi teateid tuleks valideerida Global Legal Entity Identifier Foundationi (GLEIF) andmete alusel nagu tavaliselt ja kui valideerimine ebaõnnestub, tuleks teated tagasi lükata.
164. Seetõttu ei eeldata, et üksus edastaks uue juriidilise isiku tunnuse tõttu teate.
165. Eeltoodud korda ei tuleks järgida juhul, kui vastaspoolel on end valesti identifitseerinud. Sel juhul peaksid nad esitama VFT kohta teate, milles märgivad toiminguliigiks „EROR“, leppima teise vastaspoolega kokku uues tehingu kordumatus tunnuskoodis ning esitama VFT täielikud ja täpsed andmed.

## 4.20 Teatamine järkjärgulise rakendamise perioodil

166. Vastaspoolel, kelle puhul teatamiskohustus veel ei kehti, peaksid esitama vastaspoolele, kelle puhul teatamiskohustus juba kehtib, kogu asjakohase teabe vastavalt teatamise tehnilistele standarditele. Teave, mis tuleks teavitavale vastaspoolele edastada, hõlmab andmevälju „Teine vastaspool“, „Teise vastaspoole filiaal“ ja „Teise vastaspoole riik“. Nende andmeväljade kohta tuleks edastada õigeaegselt teave teavitavale vastaspoolele.
167. Vastaspoolel, kelle puhul teatamiskohustus veel ei kehti, võivad teatamist alustada enne SFTRi artikli 33 lõike 2 punktis a sätestatud teatamise alguskuupäeva, kui see on nende jaoks lihtsam. Kui vastaspool, kelle puhul teatamiskohustus veel ei kehti, otsustab tehingutest teatada, peaks ta järgima suuniste jao 4.15 punkti 144.

## 5 SFTRi kohased andmeväljade tabelid

168. Teatamise regulatiivsete tehniliste standardite artikli 1 lõikes 1 on sätestatud, et „määruse (EL) 2015/2365 artikli 4 lõike 1 kohane teade peab sisaldama asjaomase SFT kohta lisa tabelites 1, 2, 3 ja 4 sätestatud täielikke ja täpseid üksikasju“. Jagudes 5.1–5.6 esitatud kasutusjuhud ei pruugi sisaldada kõiki asjaomase VFTga seotud välju, vaid keskenduvad andmeväljade konkreetsetele osadele, et anda teatamise kohta üksikasjalikumaid juhiseid tarbetu kordamise või muude andmeelementide lisamiseta.

169. Valideerimiseeskirjad sisaldavad täielikke juhiseid VFT liikide, toiminguliikide ja tasandite kaupa, samuti teavet asjakohaste sõltuvuste kohta.
170. Järgmised jaod sisaldavad erinevaid stsenaariume ja vastavaid tabeleid, milles selgitatakse, kuidas neist stsenaariumidest tuleks teatada. Igas tabelis on esitatud SFTRi tehniliste standardite kohased andmeväljad. Veerus „Väli“ on esitatud iga välja nimi ja veerus „Näide“ on toodud näide teabe kohta, mida sellel väljal esitatakse. Viimases veerus nimetusega „XML-teade“ on esitatud XML-teate vorming, mida tuleks tehinguteates kasutada.
171. Kui konkreetse stsenaariumi puhul ei ole märgitud teisiti, kasutatakse kõigis jaos 5 esitatud stsenaariumides järgmisi taustaandmeid.

Vastaspool A on finantssektori vastaspool, kelle juriidilise isiku tunnus on 12345678901234500000.

Vastaspool B on Prantsusmaa finantssektori vastaspool, kelle juriidilise isiku tunnus on ABCDEFGHIJKLMNOPQRST.

Vastaspool C on VKEst finantssektoriväline vastaspool, kelle juriidilise isiku tunnus on 123456789ABCDEFGHIJK.

Vastaspole D juriidilise isiku tunnus on 11223344556677889900.

Maakleri E juriidilise isiku tunnus on 88888888888888888888.

Laenude vahendaja F juriidilise isiku tunnus on BBBBBBBBBBBBBBBBBBBBBB.

Kolmandast isikust vahendaja G juriidilise isiku tunnus on 77777777777777777777.

Depositooriumina tegutseva panga H juriidilise isiku tunnus on AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA.

Kolmas isik I pakub teatamisteenusid ja tema juriidilise isiku tunnus on 12345123451234512345.

Vastaspool J tegutseb ka kliiriva liikmena ja tema juriidilise isiku tunnus on CCCCCCCCCCCCCCCCCC.

Eurofondi K juriidilise isiku tunnus on UUUUUUUUUU111111111 ja eurofondi valitseja L juriidilise isiku tunnus on UUUUUUUUUU222222222.

Alternatiivse investeerimisfondi M juriidilise isiku tunnus on AAAAAAAAAA1111111111 ja alternatiivse investeerimisfondi valitseja N juriidilise isiku tunnus on AAAAAAAAAA222222222.

Keskse vastaspole O juriidilise isiku tunnus on BBBBBBBBBB111111111.

Saksamaa väärtpaberite emitendi juriidilise isiku tunnus on NNNNNNNNNNNNNNNNNNNN.

Hispaania väärtpaberite emitendi juriidilise isiku tunnus on EEEEEEEEEEEEEEEEEEE.

Prantsusmaa väärtpaberite emitendi juriidilise isiku tunnus on FFFFFFFFFFFFFFFFFFFFFF.

Madalmaade väärtpaberite emitendi juriidilise isiku tunnus on DDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDD.

Itaalia väärtpaberite emitendi juriidilise isiku tunnus on ILLLLLLLLLLLLLLLLLLLLL.

Väärtpaberite üldise emitendi juriidilise isiku tunnus on GGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGG.

Prantsusmaa põhiindeksisse kaasatud väärtpaberite emitendi juriidilise isiku tunnus on 529900S21EQ1BO4ESM68.

Kauplemiskoha P tunnuscode on MIC XWAR.

Väärtpaberite ISIN-koodid on järgmised:

- a. Saksamaa võlakirjad (lihtvõlakirjad): DE0010877643
- b. Hispaania tähtajatud võlakirjad: ES0010877643
- c. Prantsusmaa võlakirjad: FR0010877643
- d. Madalmaade võlakirjad: NL0010877643
- e. Prantsusmaa põhiindeksisse kaasatud väärtpaberid: FR0000120271
- f. Muud Prantsusmaa väärtpaberid: FR0010877000
- g. Tagatiskorv: GB00BH4HKS39
- h. Tagatiskomponent 1: IT00BH4HKS39
- i. Tagatiskomponent 2: FR00BH4HKS39

Väärtpaberite CFI-koodid on järgmised:

- a. Valitsuse lihtvõlakiri: DBFTFR
- b. Valitsuse tähtajatu võlakiri: DBFTPR
- c. Aktsiad: ESVUFN

Tabelite halli taustaga tühjad väljad ei ole nende konkreetsete näidete korral kohaldatavad, kuid need on esitatud selguse huvides.

Esitatud on ka kasutusjuhtude kohaldatavus eri liiki VFTde korral. Samuti on esitatud tegelikud teated vastavalt ISO 20022 kohastele XML-skeemidele.

## 5.1 Vastaspole andmed

172. VFT kliirimise korral peaks iga vastaspool teatama kliiriva liikme väljal oma kliirivast liikmest.
173. Teatamise vabatahtliku delegeerimise või vastutuse jaotamise korral peaks teadet esitav üksus või teatamise eest vastutav üksus esitama eraldi vastaspole andmed ning kummagi poole osas laenu ja tagatise andmed.

174. Kasutusjuhtude korral, mis hõlmavad kahte või enam allpool esitatud kasutusjuhtu, peaksid teavitavad vastaspoolad või teatamise eest vastutavad üksused esitama kõik asjakohased üksikasjad vastavalt allpool toodud juhistele.

<b>Tabel 7. Kasutusjuhud</b>				
	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

**Tabel 7. Kasutusjuhud**

	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 Peakontorite vahelised kahepoolsed kliirimata VFTd

175. Tabel 8 näitab, milliseid väärtpaberite kaudu finantseerimise tehinguid saab teha üksnes kahepoolselt kahe peakontori vahel.

**Tabel 8. VFTd, mille kohta kasutusjuhtum kehtib**

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

176. Tabel 9 illustreerib kahepoolses tehingust teatamist juhul, kui teavitav vastaspool (vastaspool A) edastab oma teated (st eraldi teadet esitavat üksust ei ole). Vastaspool A on selle tehingu puhul ka õigustatud isik ja väärtpaberite keskdepositooriumi liige.

**Tabel 9. Peakontorite vahelised kahepoolsed kliirimata VFTd**

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

**Tabel 9. Peakontorite vahelised kahepoolsed kliirimata VFTd**

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

### 5.1.2 Filiaalide vaheline kahepoolne kliirimata VFT

**Tabel 10. VFTd, mille kohta kasutusjuhtum kehtib**

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

177. Tabel 11 sisaldab näidet kahe vastaspoole filiaalide vahel sõlmitud kahepoolsest tehingust teatamise kohta. Juriidilised isikud (peakontorid) identifitseeritakse vastavate juriidilise isiku tunnustega, filiaalide riigid aga ISO riigikoodidega. Vastaspool A on ka väärtpaberite keskdepositooriumi liige.

**Tabel 11. Filiaalide vaheline kahepoolne kliirimata VFT**

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; &lt;Ntr&gt; &lt;FI&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	
8	Branch of the other counterparty	DE	

**Tabel 11. Filiaalide vaheline kahepoolne kliirimata VFT**

No	Field	Example	XML Message
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> </Id>
14	Tri-party agent		<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> </SctiesFincgRptgTxRpt>



### 5.1.3 Kliirimata kahepoolne VFT õigustatud isikutega

Tabel 12. VFTd, mille kohta kasutusjuhtum kehtib			
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	N

178. Tabel 13 sisaldab näidet kahepoolse kliirimata tehingu kohta, kus vastaspool A ei ole õigustatud isik. Õigustatud isikuks on vastaspool D. Vastaspool A on ka väärtpaberite keskdepositooriumi liige.

Tabel 13. Kliirimata kahepoolne VFT õigustatud isikutega			
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;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; &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	

Tabel 13. Kliirimata kahepoolne VFT õigustatud isikutega			
No	Field	Example	XML Message
14	Tri-party agent		<pre>&lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt; &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt; &lt;OthrPtyData&gt; &lt;Bnfcry&gt;</pre>
15	Broker		
16	Clearing member		
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of counterparty A	<pre>&lt;LEI&gt;11223344556677889900&lt;/LEI&gt; &lt;/Bnfcry&gt; &lt;SttlmPties&gt; &lt;CntrlSciesDpstryPtcpt&gt;</pre>
18	Agent lender		<pre>&lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt; &lt;/CntrlSciesDpstryPtcpt&gt; &lt;/SttlmPties&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>

#### 5.1.4 Kliirimata VFT maakleritega, mis arveldatakse deponooriumina tegutseva pangaga

Tabel 14. VFTd, mille kohta kasutusjuhtum kehtib			
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	N

179. Stsenaariumis, mida illustreerib Tabel 15, sõlmib vastaspool A tehingu vastaspoolega B. Vastaspool A kasutab deponooriumina tegutsevat panka H, mis on seetõttu identifitseeritud väljal 1.17. Lisaks kasutab vastaspool A maakleri E teenuseid.

**Tabel 15. Kliirimata VFT maaklritega, mis arveldatakse deponooriumina tegutseva pangaga**

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-0115:15:15Z	<SciesFincgRptgTxRpt> <TradData>
2	Report submitting entity	{LEI} of counterparty A	<Rpt> <New>
3	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm>
4	Nature of the reporting counterparty	F	<RptSubmitgNtty>
5	Sector of the reporting counterparty	CDTI	<LEI>12345678901234500000</LEI> </RptSubmitgNtty>
6	Additional sector classification		<CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
7	Branch of the reporting counterparty		<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id>
8	Branch of the other counterparty		<Ntr> <FI>
9	Counterparty side	GIVE	<Clssfctn>CDTI</Clssfctn> </FI>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	</Ntr> <Sd>GIVE</Sd>
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
12	Country of the other Counterparty	FR	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> <CtryCd>FR</CtryCd>
13	Beneficiary		</OthrCtrPty>
14	Tri-party agent		<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> <CntrlSciesDpstryPtcpt> <LEI> AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData>

**Tabel 15. Kliirimata VFT maakleritega, mis arveldatakse deponooriumina tegutseva pangaga**

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 Kliirimata VFT maakleriga, laenude vahendajaga ja kolmandast isikust vahendajaga

**Tabel 16. VFTd, mille kohta kasutusjuhtum kehtib**

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

180. Stsenaariumis, mida illustreerib Tabel 17, sõlmib vastaspool A tehingu vastaspoolega B. Vastaspool A kasutab laenude vahendajat F ja kolmandast isikust vahendajat G. Lisaks kasutab vastaspool A maakleri E teenuseid. Vastaspool A on väärtpaberite keskdeponooriumi liige.

**Tabel 17. Kliirimata VFT maakleriga, laenude vahendajaga ja kolmandast isikust vahendajaga**

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	

**Tabel 17. Kliirimata VFT maakleriga, laenude vahendajaga ja kolmandast isikust vahendajaga**

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>ABCDEFGHIJKLMNQRST</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>888888888888888888888888</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>

**Tabel 17. Kliirimata VFT maakleriga, laenude vahendajaga ja kolmandast isikust vahendajaga**

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 Kliirimata VFT maakleriga, laenude vahendajaga ja kolmandast isikust vahendajaga, mis arveldatakse väärtpaberite keskdepositooriumi liikmeka, kes ei ole ükski nimetatud üksus, ning teatamise vabatahtlik delegerimine kolmandale isikule

**Tabel 18. VFTd, mille kohta kasutusjuhtum kehtib**

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

181. Stsenaariumis, mida illustreerib Tabel 19, sõlmib vastaspool A tehingu vastaspoolega B. Vastaspool A kasutab laenude vahendajat F ja kolmandast isikust vahendajat G. Lisaks kasutab vastaspool A maakleri E ja depositooriumina tegutseva panga H teenuseid. Vastaspool A delegerib teatamise kolmandale isikule I.

**Tabel 19. Kliirimata VFT maakleriga, laenude vahendajaga ja kolmandast isikust vahendajaga, mis arveldatakse väärtpaberite keskdepositooriumi liikmeka, kes ei ole ükski nimetatud üksus, ning teatamise vabatahtlik delegerimine kolmandale isikule**

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	

**Tabel 19. Kliirimata VFT maakleriga, laenude vahendajaga ja kolmandast isikust vahendajaga, mis arveldatakse väärtpaperite keskodepositooriumi liikmega, kes ei ole ükski nimetatud üksus, ning teatamise vabatahtlik delegerimine kolmandale isikule**

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

**Tabel 19. Kliirimata VFT maakleriga, laenude vahendajaga ja kolmandast isikust vahendajaga, mis arveldatakse väärtpaperite keskdepositooriumi liikmega, kes ei ole ükski nimetatud üksus, ning teatamise vabatahtlik delegerimine kolmandale isikule**

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 Kliiritud VFT maakleriga, laenude vahendajaga ja kolmandast isikust vahendajaga

**Tabel 20. VFTd, mille kohta kasutusjuhtum kehtib**

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

182. Tabel 21 illustreerib teate andmeväljade täitmist kliiritud VFT korral. Andmeväljade täitmine ei sõltu sellest, mis liiki juurdepääs on vastaspoolel kesksele vastaspoolele. Vastav üksus tuleks alati identifitseerida kliiriva liikmena.

183. Vastaspool A pöördub keskse vastaspoole poole kliiriva liikme J kaudu. Ta kasutab ka maakleri E, laenude vahendaja F ja kolmandast isikust vahendaja G teenuseid. Vastaspool A on ka väärtpaperite keskdepositooriumi liige.

184. Tuleks tähele panna, et keskse vastaspoole väli on seotud tabeliga 2 (laenu ja tagatise andmed) ning seetõttu käsitletakse selle täitmist jaos 5.2.

**Tabel 21. Kliiritud VFT maakleriga, laenude vahendajaga ja kolmandast isikust vahendajaga**

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	



**Tabel 21. Kliiritud VFT maakleriga, laenude vahendajaga ja kolmandast isikust vahendajaga**

No	Field	Example	XML Message
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>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id>
13	Beneficiary		<CtryCd>FR</CtryCd> </OthrCtrPty>
14	Tri-party agent	{LEI} of tri-party agent G	<NttyRspnsblForRpt>
15	Broker	{LEI} of broker E	<LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
16	Clearing member	{LEI} of counterparty J	<OthrPtyData>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of counterparty A	<TrptyAgt> <LEI>77777777777777777777777777777777</LEI> </TrptyAgt> <Brkr>
18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<LEI>88888888888888888888888888888888</LEI> </Brkr> <ClrMmb> <LEI>CCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCC</LEI> </ClrMmb> <StlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt> <LEI>12345678901234512345</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </StlmPties> <AgtLndr>

**Tabel 21. Kliiritud VFT maakleriga, laenude vahendajaga ja kolmandast isikust vahendajaga**

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 Kliiritud VFT maakleriga, laenude vahendajaga ja kolmandast isikust vahendajaga, mis arveldatakse väärtpaperite keskedepositooriumi liikmega, kes ei ole ükski nimetatud üksus, ning teatamise vabatahtlik delegerimine kolmandale isikule

**Tabel 22. VFTd, mille kohta kasutusjuhtum kehtib**

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

185. Sarnaselt eelmisele näitele illustreerib Tabel 23 andmeväljade täitmist kliiritud VFT korral, kui vastaspool A pöördub keskse vastaspoole poole kliiriva liikme J kaudu. Ta kasutab ka maakleri E, laenude vahendaja F ja kolmandast isikust vahendaja G teenuseid. Lisaks arveldatakse selle näite puhul tehing üksusega H, mis ei ole tehingu vastaspool, ja teavitav vastaspool delegerib teatamise kolmandale isikule I.

186. Tuleks tähele panna, et andmeväljade täitmine ei sõltu sellest, mis liiki juurdepääs on vastaspoolel kesksele vastaspoolele. Vastav üksus tuleks alati identifitseerida kliiriva liikmena.

**Tabel 23. Kliiritud VFT maakleriga, laenude vahendajaga ja kolmandast isikust vahendajaga, mis arveldatakse väärtpaberite keskodepositooriumi liikmega, kes ei ole ükski nimetatud üksus, ning teatamise vabatahtlik delegerimine kolmandale isikule**

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-0115:15:15Z	<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> <Fl> <Clssfctn>CDTI</Clssfctn>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	</Fl> </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> </OthrCtrPty>
14	Tri-party agent	{LEI} of tri-party agent G	<NttyRspnsblForRpt>
15	Broker	{LEI} of broker E	<LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
16	Clearing member	{LEI} of counterparty J	<OthrPtyData> <TrptyAgt>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of custodian bank H	<LEI>77777777777777777777</LEI> </TrptyAgt> <Brkr>
18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<LEI>88888888888888888888</LEI> </Brkr> <ClrMmb>
			<LEI>CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC</LEI>

**Tabel 23. Kliiritud VFT maakleriga, laenude vahendajaga ja kolmandast isikust vahendajaga, mis arveldatakse väärtpaperite keskodepositooriumi liikmega, kes ei ole ükski nimetatud üksus, ning teatamise vabatahtlik delegerimine kolmandale isikule**

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 Eurofondi sõlmitud kliirimata VFTd

Tabel 24. VFTd, mille kohta kasutusjuhtum kehtib			
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	Y

187. Tabel 25 kirjeldab eurofondi K sõlmitud VFTst teatamist. SFTRi artikli 4 lõike 3 kohaselt vastutab eurofondi nimel teatamise eest eurofondi valitseja L, kelle andmed esitatakse seetõttu nii väljal 2.2 „Teadet esitav üksus“ kui ka väljal 2.10 „Teatamise eest vastutav üksus“. Tehing arveldatakse depositeoriumina tegutseva pangaga H.

**Tabel 25. Eurofondi sõlmitud kliirimata VFTd**

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> ...

**Tabel 25. Eurofondi sõlmitud kliirimata VFTd**

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 Eurofondi sõlmitud kliirimata VFTd, kui eurofondi valitseja delegeerib teatamise kolmandale isikule

**Tabel 26. VFTd, mille kohta kasutusjuhtum kehtib**

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

188. Tabel 27 kirjeldab eurofondi K sõlmitud VFTst teatamist. SFTRi artikli 4 lõike 3 kohaselt vastutab eurofondi nimel teatamise eest eurofondi valitseja L, kelle andmed esitatakse seetõttu väljal 2.10 „Teatamise eest vastutav üksus“. Kuna aga eurofondi valitseja otsustab delegeerida teatamise kolmandale isikule I, esitatakse viimase andmed väljal 2.2 „Teadet esitav üksus“. Tehing arveldatakse deponooriumina tegutseva pangaga H.

**Tabel 27. Eurofondi sõlmitud kliirimata VFTd**

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		

Tabel 27. Eurofondi sõlmitud kliirimata VFTd			
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> <OthrPtyData>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of custodian bank H	<SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt>
18	Agent lender		<LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt>

### 5.1.11 Alternatiivse investeerimisfondi sõlmitud kliirimata VFTd

Tabel 28. VFTd, mille kohta kasutusjuhtum kehtib			
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	Y

189. Tabel 29 kirjeldab alternatiivse investeerimisfondi M sõlmitud VFTst teatamist. SFTRI artikli 4 lõike 3 kohaselt vastutab alternatiivse investeerimisfondi nimel teatamise eest alternatiivse investeerimisfondi valitseja N, kelle andmed esitatakse seetõttu nii väljal 2.2 „Teadet esitav üksus“ kui ka väljal 2.10 „Teatamise eest vastutav üksus“. Tehing arveldatakse depositeeriumina tegutseva pangaga H.

Tabel 29. Alternatiivse investeerimisfondi sõlmitud kliirimata VFTd			
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;ABCDEFGHIJKLMNQRST&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;StlImPties&gt;                     &lt;CntrlSciesDpstryPtcpt&gt;                       &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA&lt;/LEI&gt;                       &lt;/CntrlSciesDpstryPtcpt&gt;                     &lt;/StlImPties&gt;                   &lt;/OthrPtyData&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		



**Tabel 29. Alternatiivse investeerimisfondi sõlmitud kliirimata VFTd**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &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>

### 5.1.12 Kliirimata VFTd fondi portfelli valitsemise teenuse sisseostmise korral

190. Kui portfelli valitsemise teenust ostetakse sisse üksuselt, mis ei ole fondivalitseja, tuleks sellest üksusest teatada ainult kui maaklerist, kui ta tegutseb maaklerina. Vastasel juhul ei tohiks sellest üksusest (nagu ka muudest üksustest, mis võivad VFTs otseselt või kaudselt osaleda), teatada ühelgi väljal.
191. Stsenaariumis, mida illustreerib Tabel 31, delegeeritakse alternatiivse investeerimisfondi M portfelli valitsemine teisele üksusele, kes ei tegutse maaklerina. Tehing arveldatakse deponitoriumina tegutseva pangaga H.

**Tabel 30. VFTd, mille kohta kasutusjuhtum kehtib**

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

**Tabel 31. Kliirimata VFTd fondi portfelli valitsemise teenuse sisseostmise korral**

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; </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	

**Tabel 31. Kliirimata VFTd fondi portfelli valitsemise teenuse sisseostmise korral**

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> </FI> </Ntr>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of AIF management company N	<Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	
12	Country of the other counterparty	FR	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> <CtryCd>FR</CtryCd> </OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt>
13	Beneficiary		
14	Tri-party agent		
15	Broker	{LEI} of AIF management company N	<LEI>AAAAAAAAAA2222222222</LEI> </NttyRspnsblForRpt> <OthrPtyData> <Brkr> <LEI>
16	Clearing member		AAAAAAAAAA2222222222</LEI> </Brkr>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of custodian bank H	<StlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt>
18	Agent lender		<LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </StlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt>

**Tabel 31. Kliirimata VFTd fondi portfelli valitsemise teenuse sisseostmise korral**

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

## 5.2 Laenu ja tagatise andmed

192. Vastaspoole andmeid käsitlevate andmeväljade järel kirjeldatakse laenu ja tagatise väljade täitmist erinevate kasutusjuhtude korral. Esitatakse ka teated, mis vastavad ISO 20002 kohastele XML-skeemidele. See hõlbustab väljade täitmist vastaspoolte poolt.

193. Iga alajagu sisaldab käsitletavate väljade täitmise loogika lühikirjeldust.

### 5.2.1 Toiminguliikidest teatamine tehingu tasandil ja positsiooni tasandil

#### 5.2.1.1 Uus kliirimata kahepoolne VFT tehingu tasandil

194. Tabel 32 illustreerib teate andmeväljade täitmist uue kliirimata VFT korral. Kahepoolsetest VFTdest tuleks tehingu tasandil teatada alljärgneval viisil.

**Tabel 32. Uus kliirimata kahepoolne VFT tehingu tasandil**

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 Uus kahepoolne VFT tehingu tasandil, mis kliiritakse i) samal päeval või ii) hiljem

195. Tabel 33, Tabel 34 ja Tabel 35 illustreerivad teate andmeväljade täitmist vastaspoole (mitte keske vastaspoole) poolt uue VFT korral, kui tehing i) täidetakse kahepoolselt ja kliiritakse hiljem samal päeval või kui ii) tehing kliiritakse mõnel kauplemiskohas tehingu sõlmimisele järgneval päeval. Vastaspoolel peaksid VFT kohta teate edastamisel toiminguliigiks märkima „ETRM“, mis ei võimalda täita välja „Kliiritud“, et teatada kliirimata tehingu ennetähtaegsest lõpetamisest. Seejärel peaks vastaspool edastama VFT kohta teate toiminguliigiga „NEWT“, et teatada VFT kliirimisest. Teadete edastamiste järjekorda illustreerivad vastavalt Tabel 33, Tabel 34 ja Tabel 35.

Tabel 33. Uus kahepoolne VFT tehingu tasandil, mis kliiritakse samal päeval või hiljem			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UT11	<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;/RpTrad&gt;           &lt;ClrSts&gt;             &lt;NonClrd&gt;NORE&lt;/NonClrd&gt;           &lt;/ClrSts&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	

Tabel 34. Kahepoolse VFT lõpetamine tehingu tasandil seoses samal päeval või hiljem kliirimisega			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UT11	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;EarlyTermntn&gt;         ...       &lt;CtrPtyData&gt; </pre>
98	Action type	ETRM	
99	Level		

**Tabel 34. Kahepoolse VFT lõpetamine tehingu tasandil seoses samal päeval või hiljem kliirimisega**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> ... &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>

**Tabel 35. Uus kliiritud VFT tehingu tasandil, mis tuleneb kahepoolse VFT kliirimisest samal päeval või hiljem**

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>a</sup>	
5	Cleared	true	
98	Action type	NEWT	
99	Level	TCTN	

<sup>a</sup> Kliiriva liikme kliendi seisukohast, ei ole kohaldatav keskse vastaspoole teate puhul.

196. Pange tähele, et teadet, mida kirjeldavad Tabel 33 ja Tabel 34, ei pea esitama juhul, kui tehing sõlmitakse kauplemiskohas vastaspoolte vahel, kes on ühtlasi kliirivad liikmed, ning kliiritakse keskse vastaspoole poolt samal päeval; sel juhul tuleb edastada ainult teade, mida kirjeldab Tabel 35. Lisaks illustreerib Tabel 35 teadet, mis tuleb edastada juhul, kui kliiritud VFTd ei kaasata kohe positsiooni (sellisel juhul tuleb teates toiminguliigiks märkida „POSC“, nagu on selgitatud järgmistes näidetes).

### 5.2.1.3 Uus VFT, millest teatatakse kui positsiooni komponendist

197. Tabel 36 ja Tabel 37 illustreerivad teate andmeväljade täitmist juhul, kui uuest VFTst<sup>9</sup> teatatakse kui positsiooni komponendist. Keskse vastaspoole kliiritava positsiooni osaks olevatest VFTdest võib teatada alljärgneval viisil. Pange tähele, et järjestused, mida kirjeldavad Tabel 36 ja Tabel 37, põhinevad eeldusel, et VFT sõlmitakse kauplemiskohas ja keskne vastaspool kliirib selle samal päeval, mistõttu tuleb teatada VFTst ainult selle kliiritud kujul. Keskse vastaspoole kliiritavate VFTde näidete kontekstis identifitseeritakse need tehingud kordumatu tunnuskoodiga (UTI) „PUT11“.

198. Kuna see valik on tehingu tasandil teatamise täiendus, tuleks teated edastada alljärgneval viisil. Keskse vastaspoole kliiritavate VFTde puhul ei peaks vastaspooled esitama teate kontrollnumbrit (väli 2.2).

Tabel 36. Kauplemiskohas sõlmitud ja keskse vastaspoole poolt samal päeval kliiritud uus VFT, millest teatatakse positsiooni komponendi toiminguliigiga tehingu tasandil			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UT11	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;PosCmpnt&gt;         ...         &lt;CtrPtyData&gt;           ...         &lt;/CtrPtyData&gt;         &lt;LnData&gt;         &lt;RpTrad&gt;           ...         &lt;/RpTrad&gt;         &lt;UnqTradldr&gt;UT12&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; </pre>
5	Cleared	true	
98	Action type	POSC <sup>10</sup>	
99	Level	TCTN	

<sup>9</sup> Kliiritud VFTde stsenaariumid on märgitud repotehingute puhul kohaldatavatena, kuid tegelikkuses selliseid stsenaariume ei eeldata. Võimenduslaenu andmise korral ei ole positsiooni tasand võimalik.

<sup>10</sup> Pange tähele, et algsetest tehingutest tehingu tasandil teatamiseks tuleb toiminguliigiks märkida „positsiooni komponent“.

**Tabel 36. Kauplemiskohas sõlmitud ja keskse vastaspoole poolt samal päeval kliiritud uus VFT, millest teatatakse positsiooni komponendi toiminguliigiga tehingu tasandil**

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

**Tabel 37. Keskse vastaspoole kliiritud uus VFT, millest teatatakse positsiooni tasandil**

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; &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
5	Cleared	true <sup>11</sup>	
98	Action type	NEWT <sup>12</sup>	
99	Level	PSTN <sup>13</sup>	

<sup>11</sup> Valikulisusele vaatamata ei saa kahepoolselt kokkulepitud VFTsid asendada ühe tehinguga; seetõttu tuleb kõik positsiooni tasandil edastatud teated kliirida.

<sup>12</sup> Selles näites luuakse uus positsioon. Kui kliiritud tehing kaasatakse olemasolevasse positsiooni, teatatakse sellest selle positsiooni muudatusena (toiminguliik „MODI“).

<sup>13</sup> Pange tähele, et tulemuseks olevast kliiritud VFTst tuleks teatada positsiooni tasandil ja et positsiooni tasandil teatamist võib kasutada ainult tehingu tasandil teatamise täiendamiseks; seetõttu eeldatakse nende teadete edastamist, mida kirjeldavad Tabel 36 ja Tabel 37.

#### 5.2.1.4 VFT muutmine tehingu tasandil

199. Tabel 38 illustreerib teate andmeväljade täitmist varem teatatud VFT muutmise korral tehingu tasandil.

Tabel 38. VFT muutmine tehingu tasandil			
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 Keskse vastaspoole kliiritud VFT muutmine positsiooni tasandil

200. Tabel 39 illustreerib teate andmeväljade täitmist keskse vastaspoole kliiritud ja eelnevalt positsiooni tasandil teatatud VFT muutmise korral. See tuleneb täiendavate tehingu tasandil sõlmitud VFTde kaasamisest, mille keskne vastaspool kliiris samal päeval või hiljem. Kui tehing on positsiooni kaasatud, pole algset tehingu tasandi teadet võimalik muuta, kuid kui mingi osa teabest on valesti esitatud, võib seda VFTd parandada.

Tabel 39. Keskse vastaspoole kliiritud VFT muutmine positsiooni tasandil			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	PUTI1	<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;</pre>
5	Cleared	true	
98	Action type	MODI	
99	Level	PSTN	



Tabel 39. Keske vastaspoole kliiritud VFT muutmine positsiooni tasandil			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> &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;/Mod&gt;     &lt;/Rpt&gt;     &lt;/TradData&gt;     &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.2.1.6 VFT parandus tehingu tasandil

201. Tabel 40 illustreerib teate andmeväljade täitmist juhul, kui varem VFT kohta tehingu tasandil edastatud teates valesti täidetud andmevälju tuleb parandada.

Tabel 40. VFT parandus tehingu tasandil			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<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;UTI1&lt;/UnqTradldr&gt;     &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>
98	Action type	CORR	
99	Level	TCTN	

### 5.2.1.7 Keskse vastaspoole kliiritud VFT parandus positsiooni tasandil

202. Tabel 41 illustreerib teate andmeväljade täitmist juhul, kui varem keskse vastaspoole kliiritud VFT kohta positsiooni tasandil edastatud teates valesti täidetud andmevälju tuleb parandada. Algset tehingu tasandi teadet ei ole vaja parandada, kui selles esitatud teave on õige.

Tabel 41. Keskse vastaspoole kliiritud VFT parandus positsiooni tasandil			
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;     &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
5	Cleared	true	
98	Action type	CORR	
99	Level	PSTN	

### 5.2.1.8 VFT väärtuse hindamine (ainult väärtpaberite laenamise tehingute korral)

203. Tabel 42 illustreerib teate andmeväljade täitmist juhul, kui väärtpaberite laenamise tehingu puhul tuleb ajakohastada väärtpaberite väärtust. Vastaspool hindab laenatud väärtpaberite väärtuseks 1 000 000 eurot, mis antud juhul langeb kokku laenu väärtusega (väli 2.56), mis ei ole toiminguliigi „VALU“ korral kohaldatav. Antud juhul teatab vastaspool laenatud väärtpaberite (väli 2.57) väärtusest valuutas, milles laen on antud. Turuväärtuse valuuta on esitatud XML-märgises.

Tabel 42. VFT väärtuse hindamine (ainult väärtpaperite laenamise tehingute korral)			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;ValtnUpd&gt;       ...       &lt;CtrPtyData&gt;         ...       &lt;/CtrPtyData&gt;       &lt;LnData&gt;         &lt;UnqTradldr&gt;UTI1&lt;/UnqTradldr&gt;         &lt;MktVal           Ccy="EUR"&gt;1000000&lt;/MktVal&gt;         &lt;/LnData&gt;           &lt;CollData&gt;             ...           &lt;/CollData&gt;             ...         &lt;/ValtnUpd&gt;       &lt;/Rpt&gt;     &lt;/TradData&gt;   &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
57	Market value	1000000	
98	Action type	VALU	

#### 5.2.1.9 Tehingu tasandil tagatud VFTde tagatise ajakohastamisest teatamine

204. Tagatist käsitleva teabe esitamisel tuleks alati kasutada toiminguliiki „COLU“; tehingu tasandil tagatud VFTde korral tuleks esitada ka tagatud tehingu kordumatu tunnuscode, nagu kirjeldab Tabel 43. Tagatisest teatamise eripära käsitletakse ka jaos 5.4.
205. Seda näidet saab kohaldada ka positsiooni tasandil teatatud VFTde tagatistest teatamise korral, kui tagatis omistatakse positsioonile.

Tabel 43. Tehingu tasandil tagatud VFTde tagatise ajakohastamisest teatamine			
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; </pre>
98	Action type	COLU	
99	Level		

**Tabel 43. Tehingu tasandil tagatud VFTde tagatise ajakohastamisest teatamine**

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

206. Niipea, kui VFT lisatakse positsiooni koosseisu, tuleks igast tagatise ajakohastamisest teatada selle positsiooni, mitte algse VFT kohta.

#### 5.2.1.10 Neto riskipositsiooni tasandil tagatud VFTde tagatise ajakohastamisest teatamine

207. Tagatist käsitleva teabe esitamisel tuleks alati kasutada toiminguliiki „COLU“; neto riskipositsiooni tasandil tagatud VFTde korral ei ole tehingu kordumatu tunnuscode nõutav, nagu kirjeldab Tabel 44. Tagatisest teatamise eripära käsitletakse ka jaos 5.4.

**Tabel 44. Neto riskipositsiooni tasandil tagatud VFTde tagatise ajakohastamisest teatamine**

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; ... &lt;/CollData&gt; ... &lt;/CollUpd&gt; &lt;/TradData&gt; ... &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
98	Action type	COLU	
99	Level		

#### 5.2.1.11 VFT ennetähtaegne lõpetamine

208. Tabel 45 illustreerib teate andmeväljade täitmist tähtajatu VFT lõpetamise või tähtajalise VFT ennetähtaegse lõpetamise korral. VFTst teatamise tasand, st tehing või positsioon, ei ole selle kasutusjuhtumi puhul oluline, kuna väli 2.99 „Tasand“ ei ole selle toiminguliigi puhul kohaldatav.

**Tabel 45. VFT ennetähtaegne lõpetamine**

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UT11	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; </pre>

Tabel 45. VFT ennetähtaegne lõpetamine			
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		

#### 5.2.1.12 VFT veaks tunnistamine

209. Tabel 46 illustreerib teate andmeväljade täitmist tervikuna valesti edastatud teate tühistamise korral, kui VFTd ei sõlmitud või kui see ei kuulunud teatamisnõuete kohaldamisalasse, kuid sellest teatati eksituse tõttu. VFTst teatamise tasand, st tehing või positsioon, ei ole selle kasutusjuhtumi puhul oluline, kuna väli 2.99 „Tasand“ ei ole selle toiminguliigi puhul kohaldatav.

Tabel 46. VFT veaks tunnistamine tehingu tasandil			
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;UnqTradldr&gt;UTI1&lt;/UnqTradldr&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 Laenu andmed

210. Järgnevat jagudes käsitletakse teatavate andmeväljade täitmist, millel on tehingu laenupoolel mõningad ühised spetsiifilised omadused. Need võimaldavad teavitavatel vastaspooltel otseselt hinnata teavet, mida nad peaksid iga konkreetse andmejao puhul vastavalt kohaldatavusele esitama.
211. Valideerimiseeskirjad sisaldavad täielikke juhiseid VFT liikide, toiminguliikide ja tasandite kaupa, samuti teavet asjakohaste sõltuvuste kohta.
212. Kõik allpool toodud näited ja kasutusjuhtumid sisaldavad juhuslikult loodud koode, mis ei ole seotud konkreetsete väärtpaberite ega üksustega.

### 5.3.1 Sündmuse kuupäevast teatamine

213. Vastaspooled peaksid meeles pidama, et konkreetse sündmuse kuupäeva kohta edastatav teave peaks võimaldama asutustel saada selge ülevaate asjaomastest VFTdest (nende kogumist) tulenevate riskipositsioonide kohta selle päeva lõpu seisuga, millele VFT puhul osutatakse. Vastaspooled peaksid sündmuse kuupäevast teatama vastavalt jaole 4.9.6.

### 5.3.2 Kliiritud / kliirimata VFTdest teatamine

#### 5.3.2.1 Avaliku pakkumise mudeli alusel kliiritud VFT

214. Kui tehing kliiritakse avaliku pakkumise mudeli alusel, toimub kliirimine VFT sõlmimise ajal.
215. Tabel 47 illustreerib teate andmeväljade täitmist ülalnimetatud olukorras keskse vastaspoole O ja kliiriva liikme kliendi vaatenurgast, kuna see on antud juhul ühesugune.
216. Täita tuleks järgmine andmeväljade rühm:
- väljal 2.5 „Kliiritud“ märgitakse „õige“;
  - „Kliiringu ajatempel“ (väli 2.6) on võrdne väljaga 2.12 „Täitmise ajatempel“;
  - väljal 2.7 „Keskne vastaspool“ märgitakse keskse vastaspoole O juriidilise isiku tunnus.

Tabel 47. Keskse vastaspoole ja kliiriva liikme vaatenurk			
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>

Tabel 47. Keskse vastaspoole ja kliiriva liikme vaatenurk			
No	Field	Example	XML Message
10	Other master agreement type	CCPClearing Conditions	<pre> &lt;ExctnDtTm&gt;2020-04-22T16:41:07Z&lt;/ExctnDtTm&gt; &lt;ClrSts&gt; &lt;Clrd&gt; &lt;CCP&gt;  &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBB1111111111&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;OthrMstrAgrmtDtIs&gt;CCPClearingConditions&lt;/OthrMstrAgrmtDtIs&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>
12	Execution timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	

### 5.3.2.2 Uuendamise mudeli alusel kliiritud VFT

217. Kui tehing kliiritakse uuendamise mudeli alusel, toimub kliirimine pärast VFT sõlmimist.
218. Tabel 48 ja Tabel 49 illustreerivad teate andmeväljade täitmist vastavalt keskse vastaspoole O ja kliiriva liikme vaatenurgast, kui keskne vastaspool O kliirib VFT uuendamise mudeli alusel.
219. Sellisel juhul tuleks täita järgmine andmeväljade rühm:
- väljal 2.2 „Teate kontrollnumber“ tuleks märkida eelmine tehingu kordumatu tunnuscode (keskse vastaspoole kliiritud VFTde korral kahepoolse tehingu kordumatu tunnuscode), kuid sellest peaksid teatama ainult kliiriv liige ja tema klient (mitte keskne vastaspool);
  - väljal 2.5 „Kliiritud“ märgitakse „õige“;
  - „Kliiringu ajatempel“ (väli 2.6) on pärast välja 2.12 „Täitmise ajatempel“;

- d. väljal 2.7 „Keskne vastaspool“ märgitakse keskse vastaspoole O juriidilise isiku tunnus.

Tabel 48. Uuendamise mudeli alusel kliiritud VFT keskse vastaspoole vaatenurgast			
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;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;OthrMstrAgrmtDtIs&gt;CCPClearingCondition s&lt;/OthrMstrAgrmtDtIs&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>
2	Report tracking number		
5	Cleared	true	
6	Clearing timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	
7	CCP	{LEI} of CCP O	
9	Master agreement Type	OTHR	
10	Other master agreement type	CCPClearing Conditions	
12	Execution timestamp	2020-04-22T14:41:07Z	

220. Tabel 49 sisaldab näidet kliiriva liikme vaatenurgast. Andmeväljade täitmine peaks kliendi vaatenurgast olema sama.



Tabel 49. Uuendamise mudeli alusel kliiritud VFT kliiriva liikme vaatenurgast			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI2	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData>
2	Report tracking number	UTI1	<Rpt> <New>
5	Cleared	true	<CtrPtyData> ...
6	Clearing timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	</CtrPtyData> ...
7	CCP	{LEI} of CCP O	<LnData> <RpTrad>
9	Master agreement Type	OTHR	<UnqTradIdr>UTI2</UnqTradIdr> <ExctnDtTm>2020-04-22T14:41:07Z</ExctnDtTm>
10	Other master agreement type	CCPClearing Conditions	<ClrSts> <Clrd> <CCP>
12	Execution timestamp	2020-04-22T14:41:07Z	<LEI>BBBBBBBBBB1111111111</LEI> </CCP> <ClrDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</ClrDtTm>  <RptTrckgNb>UTI1</RptTrckgNb> </Clrd> </ClrSts> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>OTHR</Tp> </Tp>  <OthrMstrAgrmtDtIs>CCPClearingConditions</OthrMstrAgrmtDtIs> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData>  <CollData> ... </CollData> ...  </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

### 5.3.2.3 DBV mudeli alusel kliiritud VFT

221. Kui tehing kliiritakse DBV (üleandmine väärtuse järgi) mudeli alusel, toimub kliirimine pärast VFT sõlmimist.

222. Väljal 2.19 osutatakse, kas tehing arveldati DBV mehhanismi kaudu.

223. Tabel 50 illustreerib teate andmeväljade täitmist keskse vastaspoole O vaatenurgast. Sellisel juhul tuleks täita järgmine andmeväljade rühm:

- väljal 2.5 „Kliiritud“ märgitakse „õige“;
- „Kliiringu ajatempel“ (väli 2.6) on pärast välja 2.12 „Täitmise ajatempel“;
- väljal 2.7 „Keskne vastaspool“ märgitakse keskse vastaspoole O juriidilise isiku tunnus.

Tabel 50. Keskse vastaspoole vaatenurk			
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; &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;DivryByVal&gt;true&lt;/DivryByVal&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&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	

**Tabel 50. Keske vastaspoole vaatenurk**

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

**Tabel 51. Kliiriva liikme vaatenurk**

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI2	
2	Report tracking number	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;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; &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;</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	

**Tabel 51. Kliiriva liikme vaatenurk**

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

#### 5.3.2.4 Kliirimata VFT

224. Väljal 2.5 „Kliiritud“ märgitakse „vale“, nagu kirjeldab Tabel 52. Ülejäänud kliirimisega seotud välju ei täideta. Täidetakse täitmise ajatempli väli.

**Tabel 52. Kliirimata VFT**

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;UnqTradldr&gt;UT11&lt;/UnqTradldr&gt; &lt;ExctnDtTm&gt;2020-04- 22T14:41:07Z&lt;/ExctnDtTm&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	Cleared	false	
6	Clearing timestamp		
7	CCP		
12	Execution timestamp	2020-04-22T14:41:07Z	

#### 5.3.3 Kauplemiskoht

225. Väli 2.8 „Kauplemiskoht“ tuleks täita vastavalt VFT sõlmimise liigile. Vastaspooled peaksid alati esitama turu tunnuskoodi.

226. Kui VFT sõlmitakse algoritmkauplemise süsteemide või maaklerite kokkuvõimise platvormil, tuleks esitada selle platvormi kui turu tunnuskoode. Juriidilise isiku tunnust sellel väljal esitada ei saa.

### 5.3.4 Raamlepingu jagu

#### 5.3.4.1 Dokumenteeritud VFT, mis on sõlmitud loendis esitatud raamlepingu alusel

227. Raamlepingu kasutamise korral tuleks täita järgmised andmeväljad:

- a. väli 2.9 „Raamlepingu liik“;
- b. väli 2.11 „Raamlepingu versioon“, kui väljal 2.9 märgitakse muu väärtus kui „BIAG“, „CSDA“ või „OTHR“.

228. Kui raamlepingul (v.a „BIAG“, „CSDA“ või „OTHR“) pole versiooni, peaksid vastaspoolel väljal „Raamlepingu versioon“ esitama aasta, mil nad lepingu sõlmisid.

229. Väärtpaberite keskdepositooriumi arvelduste toimumise tagamise programmide alusel sõlmitud VFTdest teatamisel tuleks raamlepingu liigiks märkida „CSDA“.

230. Tabel 53 illustreerib teate andmeväljade täitmist juhul, kui VFT on sõlmitud raamlepingu GMRA 2011 alusel.

Tabel 53. Dokumenteeritud VFT, mis on sõlmitud loendis esitatud raamlepingu alusel			
No	Field	Example	XML Message
9	Master agreement type	GMRA	<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;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;/SciesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
10	Other master agreement type		
11	Master agreement version	2011	

#### 5.3.4.2 Dokumenteeritud VFT, mis on sõlmitud muu kui loendis esitatud lepingu alusel

231. Kui kasutatakse raamlepingut, mis loendis ei sisaldu (nt keskse vastaspoole kliirimistingimused uuendatud tehingute korral või kahepoolne peamaakleri leping võimenduslaenu andmisel), tuleks täita järgmised andmeväljad:

- a. väli 2.9 „Raamlepingu liik“;
- b. väli 2.10 „Muu raamlepingu liik“, kui väljal 2.9 märgitakse „OTHR“.

232. Tabel 54 illustreerib teate andmeväljade täitmist juhul, kui VFT on sõlmitud raamlepingu alusel, mis loendis ei sisaldu ja selle puhul lähtutakse keskse vastaspoole O repotehingute eeskirjadest.

Tabel 54. Dokumenteeritud VFT, mis on sõlmitud muu kui loendis esitatud lepingu alusel			
No	Field	Example	XML Message
9	Master agreement type	OTHR	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;New&gt;         &lt;LnData&gt;           ...           &lt;CtrPtyData&gt;             ...           &lt;/CtrPtyData&gt;           &lt;RpTrad&gt;             &lt;MstrAgrmt&gt;               &lt;Tp&gt;                 &lt;Tp&gt;OTHR&lt;/Tp&gt;               &lt;/Tp&gt;               &lt;OthrMstrAgrmtDtIs&gt;CCP O               Repo Rulebook&lt;/OthrMstrAgrmtDtIs&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;/SciesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
10	Other master agreement type	CCP O Repo Rulebook	
11	Master agreement version		

#### 5.3.4.3 Dokumenteerimata VFT

233. Dokumenteerimata VFT puhul tuleks täita järgmised andmeväljad (vt Tabel 55):

- a. väli 2.9 „Raamlepingu liik“, millel tuleks märkida „OTHR“;
- b. väli 2.10 „Muu raamlepingu liik“, millel tuleks märkida „Undocumented“ (dokumenteerimata).

Tabel 55. Dokumenteerimata VFT			
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;/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>
10	Other master agreement type	Undocumented	
11	Master agreement version		

### 5.3.5 Tehingu sõlmimine ja algus

234. Järgmised kaks näidet illustreerivad sellisest VFTst teatamist, a) mis algab kohe ja b) mille väärtuspäev on tulevikus.
235. Väärtuspäeva all tuleks mõista kokkulepitud arvelduspäeva vastavalt välja 2.13 määratlusele regulatiivsetes tehnilistes standardites. Eeldatud väärtuspäeval arvelduse ajutise ebaõnnestumise korral ei ole vaja täiendavat teadet edastada (nt muutmise kohta), välja arvatud juhul, kui arvelduse ebaõnnestumise tõttu lepivad vastaspooled kokku tehingu muutmises või lõpetamises (sel juhul tuleb vastavalt teatada kas muutmise või lõpetamise sündmusest).

#### 5.3.5.1 Kohene tehing

236. Tabel 56 illustreerib teate andmeväljade täitmist juhul, kui VFT täidetakse ja algab kahe päeva jooksul, st ELi arveldustsükli jooksul. See on kohene VFT.

Tabel 56. Kohene tehing			
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 Tulevikutehing

237. Tabel 57 illustreerib teate andmeväljade täitmist juhul, kui tehing algab üks kuu pärast täitmise ajatempli kuupäeva; see on tulevikutehing.

Tabel 57. Tulevikutehing			
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;2020-05-22&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>
13	Value date (Start date)	2020-05-22	



Tabel 57. Tulevikutehing			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

### 5.3.6 VFT tähtaeg

238. Minimaalsest etteteatamistähtajast (väli 2.16) teatamisel peaksid vastaspoolled esitama teabe tööpäevade kohta, lähtudes tööpäeva määratlusest, mis on sätestatud VFTd reguleerivas asjakohases raamlepingus või kahepoolses lepingus.
239. Kui seda välja kasutatakse väärtpaperite korral, mille puhul lõpetamise võimalust ei ole teatamise tehnilistes standardites käsitletud (näiteks (tagasi)müüdavad repotehingud), peaksid vastaspoolled esitama teabe varaseima tagasiostu kuupäeva kohta (väli 2.17), kui see on teada.
240. Vastaspoolled peaksid teatama minimaalse etteteatamistähtaja (väli 2.16) tähtajatute repotehingute puhul, st kui väljal 2.21 märgitakse „õige“, samuti uuenevate ja pikendatavate repotehingute puhul, st kui väljal 2.22 märgitakse „ETSB“ või „EGRN“.
241. Lõpetamise võimalusega VFTde puhul peaksid vastaspoolled täitma välja 2.17 „Varaseim tagasiostu kuupäev“. Kui vastaspoolled pole kokku leppinud uues varaseimas tagasiostu kuupäevas, peaksid nad esitama VFT puhul kohaldatava algse varaseima tagasiostu kuupäeva.

#### 5.3.6.1 Tähtajatu

242. Tabel 58 illustreerib teate andmeväljade täitmist juhul, kui vastaspoolled lepivad kokku tähtajatus tehingus, mille lõpetamise minimaalne etteteatamistähtaeg on 1 päev.

Tabel 58. Tähtajatu			
No	Field	Example	XML Message
14	Maturity date (End date)		<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;MinNtcePrd&gt;1&lt;/MinNtcePrd&gt; &lt;Term&gt; &lt;Opn&gt;NOAP&lt;/Opn&gt; &lt;/Term&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; </pre>
16	Minimum notice period	1	
17	Earliest call-back date		
21	Open term	true	

Tabel 58. Tähtajatu			
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>

### 5.3.6.2 Tähtajaline

243. Tabel 59 illustreerib teate andmeväljade täitmist juhul, kui vastaspool oleks leppisid kokku raha, väärtpaberite või kauba vahetamises tagatise vastu tehingu teises (tuleviku) pooles 22. mail 2020.
244. Selles näites peab üks vastaspool teisele vastaspoolele VFT lõpetamisest vähemalt 5 tööpäeva ette teatama.
245. Varaseim kuupäev, mil raha laenuks andjal on õigus nõuda tagasi osa rahast või lõpetada tehing, on 7. mai 2020. Kuigi see stsenaarium pole tavapraktika, võib seda siiski esineda.

Tabel 59. Tähtajaline			
No	Field	Example	XML Message
14	Maturity date (End date)	2020-05-22	<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;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; </pre>
16	Minimum notice period	5	
17	Earliest call-back date	2020-05-07	
21	Open term	false	

Tabel 59. Tähtajaline			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt; ... &lt;/Mod&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

### 5.3.7 Lõpetamise võimalus

246. ESMA juhib tähelepanu sellele, et vastaspoolled peaksid väljal 2.22 esitama ühe järgmistest väärtustest: „EGRN“, „ETSB“ või „NOAP“. Väljal 2.21 tuleb märkida kas „õige“ või „vale“. Kui väljal 2.22 „Lõpetamise võimalus“ märgitakse „ETSB“, tuleb sellel väljal märkida „vale“.
247. Kui VFT on tagasiostetav või tagasimüüdav, peaksid vastaspoolled esitama selle teabe väljal 2.17 „Varaseim tagasiostu kuupäev“.

### 5.3.8 Üldtagatise ja konkreetse tagatise kokkulepped

248. Välja 2.18 „Üldtagatise mäрге“ kasutatakse ainult tagatiseks antud väärtpaberite, mitte laenuks antud väärtpaberite puhul.
249. Kooskõlas regulatiivsete tehniliste standarditega ja selleks, et tagada vastavus rahaturgude statistika määruise aruandlusjuhistele, tuleks märkida „GENE“ kõigil juhtudel, kui tagatiseandja saab valida tagatiseks antava väärtpaberi suure hulga eelnevalt määratletud kriteeriumidele vastavate väärtpaberite hulgast. See hõlmab muu hulgas ka näiteks kesksete vastaspoolte hallatavate algoritmkauplemise süsteemide raames pakutavaid üldtagatiseid ja tehinguid, kus tagatist haldab kolmandast isikust vahendaja. „GENE“ peaks olema vaikimisi valik ka enamiku väärtpaberite laenamise tehingute puhul. „SPEC“ tuleks märkida ainult juhtudel, kui tagatiseandja nõuab konkreetse ISIN-koodiga tagatist.
250. Neto riskipositsiooni alusel tagamisest teatamine (väli 2.73) on eraldi küsimus, mis ei ole otseselt seotud tagatiskokkuleppe liigiga. Üldtagatise tehingute platvormil tehtavad tehingud võivad olla tagatud kas ühe tehingu alusel või neto riskipositsiooni alusel. Vastaspoolled peaksid neist vastavalt teatama. Tagatiskorvidest teatamist selgitatakse tagatust käsitlevas jaos 5.4.2.
251. Kui VFT sõlmiti algselt üldtagatise tehinguna, kuid pärast täitmist jaotatakse sellele tagatiseandja valitud konkreetset väärtpaberid, muutub see kohe konkreetse tagatise tehinguks. VFT kohta tuleks edastada teade toiminguliigiga „MODI“, muutes väljal 2.18 esitatud väärtust, ja asjakohasest tagatisele tuleks teatada toiminguliigiga „COLU“.
252. Kui vastaspoolte kokkuleppes ei tulene teisiti, tuleks kolmepoolsetest repotehingutest teatamisel väljal 2.18 „Üldtagatise mäрге“ märkida „GENE“.

253. Tabel 60, Tabel 61 ja Tabel 62 sisaldavad kolme näidet välja 2.18 „Üldtagatise märg“ täitmise kohta. Pange tähele, et need ei pruugi hõlmata kõiki võimalikke juhtumeid.

#### 5.3.8.1 Konkreetse tagatise omandiõiguse üleminek

254. Tabel 60 illustreerib teate andmeväljade täitmist juhul, kui VFT puhul on lepitud kokku konkreetses tagatises (väljal 2.18 märgitaks „SPEC“) ja selle tagatise suhtes kohaldatakse omandiõiguse ülemineku kokkulepet (väljal 2.20 märgitakse „TTCA“).

Tabel 60. Konkreetse tagatise omandiõiguse üleminek			
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;DlvryByVal&gt;&gt;false&lt;/DlvryByVal&gt;           &lt;/RpTrad&gt;         &lt;/LnData&gt;         &lt;CollDlvryMtd&gt;TTCA&lt;/CollDlvryMtd&gt;         &lt;CollData&gt;           ...         &lt;/CollData&gt;         ...       &lt;/New&gt;     &lt;/Rpt&gt;   &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
19	Delivery By Value ('DBV') indicator	false	
20	Method used to provide collateral	TTCA	

#### 5.3.8.2 Üldtagatise pant

255. Tabel 61 illustreerib teate andmeväljade täitmist juhul, kui VFT puhul on lepitud kokku üldtagatises (väljal 2.18 märgitaks „GENE“) ja selle tagatise suhtes kohaldatakse pandiõigusel põhinevat finantstagatise kokkulepet (väljal 2.20 märgitakse „SICA“).

Tabel 61. Üldtagatise pant			
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;/New&gt;     &lt;/Rpt&gt;   &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
19	Delivery By Value ('DBV') indicator	false	
20	Method used to provide collateral	SICA	

Tabel 61. Üldtagatise pant			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt;   &lt;RpTrad&gt;     &lt;GnlColl&gt;GENE&lt;/GnlColl&gt;     &lt;DlvryByVal&gt;&gt;false&lt;/DlvryByVal&gt;  &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;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

### 5.3.8.3 Väärtuse järgi üleandmise (DBV) tehingus üldtagatise omandiõiguse üleminek

256. Tabel 62 illustreerib teate andmeväljade täitmist juhul, kui VFT puhul on lepitud kokku üldtagatise (väljal 2.18 märgitaks „GENE“) ja selle tagatise suhtes kohaldatakse omandiõiguse ülemineku kokkulepet (väljal 2.20 märgitakse „TTCA“). Tehingu arveldamisel kasutatakse DBV-mehhanismi (väljal 2.19 märgitakse „õige“).

Tabel 62. Väärtuse järgi üleandmise (DBV) tehingus üldtagatise omandiõiguse üleminek			
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;DlvryByVal&gt;&gt;true&lt;/DlvryByVal&gt;           &lt;/RpTrad&gt;         &lt;/LnData&gt;         &lt;CollDlvryMtd&gt;TTCA&lt;/CollDlvryMtd&gt;         &lt;/RpTrad&gt;         &lt;/LnData&gt;         &lt;CollData&gt;         ...         &lt;/CollData&gt;         ... </pre>
19	Delivery By Value ('DBV') indicator	true	
20	Method used to provide collateral	TTCA	

**Tabel 62. Väärtuse järgi üleandmise (DBV) tehingus üldtagatise omandiõiguse üleminek**

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

### 5.3.9 Fikseeritud ja ujuvad intressimäärad

257. VFTde sõlmimisel võivad vastaspoolel kokku leppida VFT laenu poolel fikseeritud või ujuva intressimäära kasutamises. Negatiivsed väärtused on lubatud välja 2.23 „Fikseeritud intressimäär“ ja välja 2.35 „Kohandatud ujuv intressimäär“ puhul.
258. Ujuvast intressimäärast teatamisel peaksid vastaspoolel märkima asjakohase määra ja intressivahe. Vastaspoolel peaksid seda teavet ajakohastama ainult siis, kui nad lepivad kokku intressimäära või -vahe muutmises, mitte igapäevaselt.
259. Pärast teatamise regulatiivsete ja rakenduslike tehniliste standardite avaldamist on kehtestatud teatavad ujuvad intressimäärad, nagu ESTER, SOFR jne. Neil on oma ISO koodid. Teabe ühtsema edastamise huvides peaksid vastaspoolel kasutama juba kokkulepitut koodi. Kui on ka muid ujuvaid intressimäärasid, millel puudub ISO kood, peaksid vastaspoolel esitama ühtse tähtnumbrilise koodi.
260. Vastaspoolel peaksid väljastada 2.35 „Kohandatud intressimäär“ ja 2.36 „Intressimäära kuupäev“ täitma ainult juhul, kui tehingu sõlmimise raames on eelnevalt kokku lepitud edaspidistes intressimäära muutustes. Ülejäänud fikseeritud või ujuva intressimäära muudatused tuleks esitada vastavalt väljadel 2.23 ja 2.25.
261. Vastaspoolel ei tohiks väljadel 2.23 ega 2.25 esitada lühikese positsiooni turuväärtusega seotud intressimäärasid (väljal 2.71).

#### 5.3.9.1 Fikseeritud intressimäär – algne teade

262. Kui vastaspoolel sõlmivad VFTd fikseeritud intressimääradega, peaksid nad täitma väljad 2.23 ja 2.24, nagu kirjeldab Tabel 63. Selles näites on aastapõhine intressimäär -0,23455 ja intressiarvestusmeetod on Actual360 (A004).

**Tabel 63. Fikseeritud intressimäär – algne teade**

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; </pre>
23	Fixed rate	-0.23455	
24	Day count convention	A004	
98	Action type	NEWT	

**Tabel 63. Fikseeritud intressimäär – algne teade**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &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>

#### 5.3.9.2 Fikseeritud intressimäära muutmine

263. Kui vastaspoolel lepivad kokku fikseeritud intressimäära muutmises, st VFT ümberhindamises, peaksid nad muudatusest teatama väljadel 2.23 ja 2.24, nagu kirjeldab Tabel 64. Selles näites on uus aastapõhine intressimäär 0,12345 ja uus intressiarvestusmeetod on Actual365Fixed (A005).

Tabel 64. Fikseeritud intressimäära muutmise			
No	Field	Example	XML Message
1	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;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;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
23	Fixed rate	0.12345	
24	Day count convention	A005	
98	Action type	MODI	

### 5.3.9.3 Ujuv intressimäär – algne teade

264. Tabel 65 illustreerib teate andmeväljade täitmist juhul, kui vastaspoolled valisid VFT sõlmimisel viiteintressimääraks EONIA (väli 25) ning ujuva intressi baasperioodi väljendatakse päevades (väli 2.26) ja ajaperioodi täisarvuline kordaja on 1 päev (väli 2.27).
265. Samuti leppisid vastaspoolled kokku, et ujuva intressi makse sageduse ajaperioodi väljendatakse nädalates (väli 2.28) ja ajaperioodi täisarvuline kordaja, mis näitab vastaspoolte maksete vahetamise sagedust, on 1 nädal (väli 2.29).
266. Selles näites väljendatakse ujuva intressimäära muutmise sageduse ajaperioodi päevades (väli 2.30) ja kordaja on 1 päev (väli 2.31).
267. Baaspunktide arv, mis tuleb laenu intressimäära kindlaksmääramiseks ujuvale intressimäärale lisada või negatiivse väärtuse korral (mis on sellel väljal lubatud) sellest maha arvata, ehk intressivahe on selles näites 5 (väli 2.32).



Tabel 65. Ujuv intressimäär – algne teade			
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	...
28	Floating rate payment frequency - time period	WEEK	<CtrPtyData> ...
29	Floating rate payment frequency - multiplier	1	</CtrPtyData> <LnData>
30	Floating rate reset frequency - time period	DAYS	<RpTrad> <IntrstRate>
31	Floating rate reset frequency - multiplier	1	<Fltg> <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 Ujuva intressimäära kohandamise väljad

268. Ujuva intressimäära kohandamisest tuleks teatada vastavalt vastaspoolte kokkuleppele. Negatiivsed väärtused on lubatud.

### 5.3.10 Repotehingute ja ostu-tagasimüügitehingute / müügi-tagasiostutehingute põhisummad

269. Tabel 73 illustreerib teate andmeväljade täitmist juhul, kui väärtuspäeval on põhisumma 10 162 756,90 eurot ja tähtpäeval on põhisumma 10 161 551,48 eurot.
270. Kui põhisumma tähtpäeval (väli 2.38) pole veel teada, lubavad valideerimiseeskirjad selle välja tühjaks jätta. Seda välja tuleks hiljem ajakohastada, kui väärtus on teada.
271. Võrdlusaluste korral tuleks teate edastamise ajal esitada eeldatav põhisumma tähtpäeval ja seda tuleks ajakohastada, kui erinevus on teada.

Tabel 66. Repotehingute ja ostu-tagasimüügitehingute / müügi-tagasiostutehingute põhisummad			
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 Laenupool väärtpaberite laenamisel

272. Väärtpaberite laenamise tehingute puhul hõlmab tehingu laenupool väärtpaberit, mille väärtus peaks vastaspoolte teadetes kokku langema. Väärtpaberi või kauba hind (väli 2.49) tuleks esitada valuutas, milles väärtpaberi või kauba hind on denomineeritud. See valuuta tuleks esitada väljal 2.50 „Hinna valuuta“. Lisaks ei tohiks väärtpaberi hind sisaldada tagatisega seotud nõudeid, allahindlust, juurdehindlust jms, mis tuleks esitada hoopis tagatise turuväärtuse osana (väli 2.88), isegi kui need arvutatakse tehingu laenupoolle.

273. Väljal 2.46 „Kogus või nimiväärtus“ tuleks nimiväärtus esitada ainult võlakirjade puhul. Nimiväärtus tuleks esitada algses valuutas, mis märgitakse väljal 2.48 „Nimiväärtuse valuuta“. Teistest väärtpaberitest tuleks teatada koguseliselt ning sel juhul tuleb täita väli 2.47 „Möötühik“ ja väli 2.48 „Nimiväärtuse valuuta“ tuleb jätta tühjaks.
274. „Laenuväärtus“ arvutatakse allpool esitatud valemi järgi valuutas, milles väärtpaber on denomineeritud, mitte valuutas, milles kaks vastaspoolt on tehingu sõlminud. „Turuväärtus“ tähistab aga vastaspoolte hinnangut laenatud väärtpaberite väärtusele. See väärtus võib olla muus valuutas kui see, milles laenatud väärtpaber on denomineeritud. Vt ka jaos 5.2.1.8 toodud näidet.
275. Laenuväärtus arvutatakse järgmiselt:

$$\text{Laenuväärtus (väli 2.56)} =$$

$$\text{Kogus või nimiväärtus (väli 2.46)} * \text{Väärtpaberi või kauba hind (väli 2.49)}$$

276. Võib esineda juhtumeid, kus laenatud väärtpaberite (või tagatisena kasutatavate väärtpaberite) väärtuse hindamine ei ole hinnateabe puudumise tõttu võimalik. See kehtib näiteks aktsiate kohta, millega kauplemine on peatatud, või mõningate fikseeritud tulumääraga väärtpaberite kohta mittelikviidsetes turusegmentides. Selliste väärtpaberite kasutamist hõlmavate VFTde sõlmimisel peaksid vastaspoolel teatama väärtusest, milles on lepingus kokku lepitud. Kui kättesaadavaks saab uus hinnateave, peaksid mõlemad vastaspoolel teatama väärtuse ajakohastamisest väljal 2.57 „Turuväärtus“.

### 5.3.12 Väärtpaberid

#### 5.3.12.1 Väärtpaberi / tagatise kvaliteet

277. Väljadel 2.51 „Väärtpaberi kvaliteet“ ja 2.90 „Tagatise kvaliteet“ peaksid teavitavad üksused esitama ühe teatamise rakenduslikes tehnilistes standardites sätestatud väärtustest.
278. Väärtust „NOAP“ tuleks kasutada järgmiste tagatiseliikide korral (väli 2.94): põhiindeksisse kaasatud aktsiad (MEQU), muud aktsiad (OEQU) ja muud varad (OTHR), mille puhul krediidireitingud määruse (EÜ) nr 1060/2009 (reitinguagentuuride määrus) tähenduses ei ole kohaldatavad<sup>14</sup>. Väärtust „NOTR“ tuleks kasutada ainult selliste instrumentide puhul, mida saab hinnata, kuid millel puudub krediidireiting.
279. Selle teabe esitamiseks ja selleks, et vastavalt reitinguagentuuride määruse artiklile 5 vältida mehaanilist tuginemist krediidireitingutele, peaksid vastaspoolel tuginema oma sisemisele hinnangule väärtpaberite krediidikvaliteedi kohta, mis võib hõlmata välisreitinguid ühelt või mitmelt reitinguagentuurilt.
280. Esitatav väärtus peaks võimalikult täpselt kajastama väärtpaberi omadusi. Kui välja 2.51 täitmiseks kasutatakse välisreitinguid, peaksid vastaspoolel oma hinnangu esitamisel

---

<sup>14</sup> Reitinguagentuuride määruse artikli 3 kohaselt tähendab krediidireiting arvamust „ettevõtte krediidivõime, võla- või finantskohustuse, võlakirjade, eelisaktsiate või muude finantsinstrumentide kohta või sellise võla- või finantskohustuse, võlakirjade, eelisaktsiate või muude finantsinstrumentide emitendi kohta, mis on esitatud kindlaksmääratud reitingukategooriate järjestamise süsteemi abil“.

ideaaljuhul tuginema emitendi reitingu asemel instrumendi reitingule, kui see on teada. Valuuta (kohalik vs. välisvaluuta) ja tähtpäev (lühiajaline vs. pikaajaline) peaksid kajastama väärtpaberi konkreetseid omadusi.

281. Vastaspooled peaksid väärtpaberi kvaliteeti puudutava teabe esitama võimalikult ühtselt, kuna seda kasutatakse kooskõlastavaks võrdlemiseks. Samas on ESMA-le teatatud võimalikest piirangutest, mis võivad takistada üksustel seda teavet jagamast; sel juhul peaksid andmeid esitavad vastaspooled teatama väärtusest, mis kõige paremini kajastab nende sisemist hinnangut.

### 5.3.12.2 Võlakirjad

282. Võlakirjade hind tuleks esitada protsentides, kuid mitte 1 kümnendmurruna.
283. Tabel 67 illustreerib teate andmeväljade täitmist VFT korral, mis hõlmab valitsuse investeerimisjärgu väärtpabereid, mis on liigitatud võlainstrumendiks (võlakirjad) nimiväärtusega 100 000 000 eurot.
284. Selles näites emiteeris väärtpaberid Saksamaa emitent (väli 2.53), kelle identifikaatoriks on tema juriidilise isiku tunnus (väli 2.54).
285. Väärtpaberi hind on väljendatud protsentides, st 99,5 % (väli 2.49), selle valuuta on euro (väli 2.50) ja väärtpaberite lunastustähtpäev on 22. aprill 2030 (väli 2.50).
286. VFT laenuväärtus on 99 500 000 eurot (väli 2.56) ja laenuvõtjal ei ole erijuurdepääsu laenuandja väärtpaberiportfelligist laenamiseks (väli 2.68).

Tabel 67. Võlakirjad			
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;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;UnitPric&gt; &lt;Ptrg&gt;99.5&lt;/Ptrg&gt; &lt;/UnitPric&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	
54	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	
55	Security type	GOVS	

Tabel 67. Völakirjad			
No	Field	Example	XML Message
56	Loan value	99500000	<pre> &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;ExclsvArrgmnt&gt;&gt;false&lt;/ExclsvArrgmnt&gt; &lt;/Scty&gt; &lt;/AsstTp&gt; &lt;LnVal Ccy="EUR"&gt;99500000&lt;/LnVal&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;DBFTFR&lt;/ </pre>
68	Exclusive arrangements	FALSE	

### 5.3.12.3 Põhiindeksisse kaasatud aktsiad

287. Tabel 68 illustreerib teate andmeväljade täitmist VFT korral, mis hõlmab põhiindeksisse kaasatud aktsiaid (väli 2.55), mille kogus on 100 000 (väli 2.46). Väli 2.48 ei ole kohaldatav, kuna väljal 2.46 esitatakse kogus, mitte nimiväärtus.
288. Vastaspoolad peaksid aktsiate puhul väärtpaberi liigiks märkima „MEQU“, kui need on komisjoni rakendusmääruse 2016/1646 kohaselt käsitletavad põhiindeksisse kaasatud aktsiatena.
289. Vara liigiks on taas väärtpaber (väli 2.40) ehk aktsia (väli 2.42). Väärtpaberi kvaliteet ei ole seda liiki väärtpaberite puhul kohaldatav (väli 2.51).
290. Selles näites emiteeris väärtpaberid Saksamaa emitent (väli 2.53), kelle identifikaatoriks on tema juriidilise isiku tunnus (väli 2.54).
291. Väärtpaberi hind on väljendatud ühikutes ja moodustab 9,95 eurot (väljad 2.49 ja 2.50). Kuna alusvaraks olev finantsinstrument on aktsia, puudub väärtpaberite tähtpäev, mistõttu väljal 2.52 tuleks märkida ISO 8601 standardi kohaselt „9999-12-31“.

292. VFT laenuväärtus on 995 000 eurot (väli 2.56) ja laenuvõtjal ei ole erijuurdepääsu laenuandja väärtpaperiportfellist laenamiseks (väli 2.68).

Tabel 68. Põhiindeksisse kaasatud aktsiad			
No	Field	Example	XML Message
40	Type of asset	SECU	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;CtrPtyData&gt;     ...   &lt;/CtrPtyData&gt;   &lt;LnData&gt;   &lt;SciesLndg&gt;   &lt;AsstTp&gt;   &lt;Scty&gt;   &lt;Id&gt;DE0010877643&lt;/Id&gt;   &lt;ClssfctnTp&gt;ESVUFN&lt;/ClssfctnTp&gt;   &lt;QtyOrNmnlVal&gt;   &lt;Qty&gt;100000&lt;/Qty&gt;   &lt;/QtyOrNmnlVal&gt;   &lt;UnitPric&gt;   &lt;MntryVal&gt;   &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;9.95&lt;/Amt&gt;   &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/UnitPric&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;   NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN &lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;JursdctnCtry&gt;DE&lt;/JursdctnCtry&gt;   &lt;/Issr&gt;   &lt;Tp&gt;   &lt;Cd&gt;MEQU&lt;/Cd&gt;   &lt;/Tp&gt;   &lt;ExclsvArrgmnt&gt;&gt;false&lt;/ExclsvArrgmnt&gt;   &lt;/Scty&gt;   &lt;/AsstTp&gt;   &lt;LnVal Ccy="EUR"&gt;995000&lt;/LnVal&gt;   &lt;/SciesLndg&gt;   &lt;/LnData&gt;     &lt;CollData&gt;     ...   &lt;/CollData&gt; </pre>
41	Security identifier	{ISIN}	
42	Classification of a security	{CFI}	
46	Quantity or nominal amount	100000	
49	Security or commodity price	9.95	
50	Price currency	EUR	
51	Security quality	NOAP	
52	Maturity of the security	9999-12-31	
53	Jurisdiction of the issuer	DE	
54	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	
55	Security type	MEQU	
56	Loan value	995000	
68	Exclusive arrangements	FALSE	

**Tabel 68. Põhiindeksisse kaasatud aktsiad**

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

#### 5.3.12.4 Muud tähtpäevata väärtpaberid

293. Tabel 69 illustreerib teate andmeväljade täitmist VFT korral, mis hõlmab rakenduslike tehniliste standardite I lisa väljal 2.55 loetlemata väärtpabereid. Sel juhul tuleks väljal 2.55 märkida „Muud varad“. Väärtpaberite kogus on 100 000 (väli 2.46). Väli 2.48 ei ole kohaldatav, kuna väljal 2.46 esitatakse kogus, mitte nimiväärtus.
294. Vara liigiks on taas väärtpaber (väli 2.40), mis on liigitatud kui ESVUFN (väli 2.42). Väärtpaberi kvaliteet ei ole sedalaadi väärtpaberite puhul kohaldatav (väli 2.51).
295. Selles näites emiteeris väärtpaberid Prantsusmaa emitent (väli 2.53), kelle identifikaatoriks on tema juriidilise isiku tunnus (väli 2.54).
296. Väärtpaberi hind on väljendatud ühikutes ja moodustab selles näites 99,5 eurot (väljad 2.49 ja 2.50). Väärtpaberitel puudub tähtpäev, mistõttu väljal 2.52 tuleks märkida ISO 8601 standardi kohaselt „9999-12-31“.
297. VFT laenuväärtus on 9 950 000 eurot (väli 2.56) ja laenuvõtjal ei ole erijuurdepääsu laenuandja väärtpaberiportfelliga laenamiseks (väli 2.68).

**Tabel 69. Muud tähtpäevata väärtpaberid**

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;QtyOrNmnlVal&gt; &lt;Qty&gt;100000&lt;/Qty&gt; &lt;/QtyOrNmnlVal&gt; &lt;UnitPric&gt; &lt;MntryVal&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	
53	Jurisdiction of the issuer	FR	
54	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	

Tabel 69. Muud tähtpäevata väärtpaberid			
No	Field	Example	XML Message
55	Security type	OTHR	<Amt Ccy="EUR">99.5</Amt>
56	Loan value	9950000	</MntryVal> </UnitPric> <Qty>NOAP</Qty> <Mtrty>9999-12-31</Mtrty> <Issr> <Id>
68	Exclusive arrangements	FALSE	<LEI>GGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGG </LEI> </Id> <JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>OTHR</Cd> </Tp> <ExclsvArrgmnt>>false</ExclsvArrgmnt> </Scty> </AsstTp> <LnVal Ccy="EUR">9950000</LnVal> </SctiesLndg> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

### 5.3.13 Kaupa hõlmavad VFTd – kauba laenamine

298. Tabel 70 illustreerib teate andmeväljade täitmist kaupa hõlmava VFT korral (väli 2.40), kusjuures põhitooteks on energia (väli 2.43), alamtooteks on nafta (väli 2.44) ja muuks alamtooteks on Brenti nafta (väli 2.45).
299. Selles näites mõõdetakse kauba kogust 100 000 (väli 2.46) barrelites (väli 47) ja hind barreli kohta on 60 USA dollarit (väljad 49 ja 50).
300. Laenuväärtus on 6 000 000 (väli 56).

Tabel 70. Kaupa hõlmavad VFTd			
No	Field	Example	XML Message
40	Type of asset	COMM	<SctiesFincgRptgTxRpt>



**Tabel 70. Kaupa hõlmavad VFTd**

No	Field	Example	XML Message
43	Base product	NRGY	<TradData> <Rpt>
44	Sub - product	OIL	<New>
45	Further sub - product	BRNT	... <CtrPtyData>
46	Quantity or nominal amount	100000	... </CtrPtyData>
47	Unit of measure	BARL	<LnData> <SctiesLndg>
49	Securities or commodities price	60	<AsstTp>
50	Price currency	USD	<Cmmdty> <Clssfctn> <Nrgy> <Oil>
56	Loan value	6000000	<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> ... </New>

Tabel 70. Kaupa hõlmavad VFTd			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

### 5.3.14 Rahalise mahahindlusega väärtpaberite laenamise tehingud

301. Tabel 71 illustreerib teate andmeväljade täitmist juhul, kui vastaspoolel leppisid kokku EONIA indeksil põhinevas ujuvas mahahindlusmääras (väli 2.59) ning ujuva mahahindlusmäära baasperiodi väljendatakse päevades (väli 2.60) ja ajaperioodi täisarvuline kordaja on 1 päev (väli 2.61).
302. Samuti leppisid vastaspoolel kokku, et ujuva mahahindlusmäära makse sageduse ajaperiood on üks nädal (väljad 2.62 ja 2.63). Pange tähele, et mõlemad väljad on valikulised väljad tehingute puhul, milles ujuva mahahindlusmäära makse sagedust ei ole määratletud.
303. Ujuva määra muutmise sageduse ajaperioodi väljendatakse päevades (väli 2.64) ja kordaja on 1 päev (väli 2.65).
304. Baaspunktide arv, mis tuleb laenu intressimäära kindlaksmääramiseks ujuvale määrale lisada või negatiivse väärtuse korral (mis on sellel väljal lubatud) sellest maha arvata, ehk mahahindlusmäära vahe on 5 (väli 2.66).

Tabel 71. Rahalise mahahindlusega väärtpaberite laenamise tehingud			
No	Field	Example	XML Message
58	Fixed rebate rate		<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;New&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; ... &lt;TxLnData&gt; &lt;SctiesLndg&gt; ... &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>
59	Floating rebate rate	EONA	
60	Floating rebate rate reference period - time period	DAYS	
61	Floating rebate rate reference period - multiplier	1	
62	Floating rebate rate payment frequency - time period	WEEK	
63	Floating rebate rate payment frequency - multiplier	1	
64	Floating rebate rate reset frequency - time period	DAYS	

Tabel 71. Rahalise mahahindlusega väärtpaberite laenamise tehingud			
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 Tasupõhised väärtpaberite laenamise tehingud: mitterahalise tagatisega, rahaliste tagatiste kogumiga tagatud ja tagamata väärtpaberite laenamise tehingud

305. Tasupõhised väärtpaberite laenamise tehingud hõlmavad kolme liiki tehinguid: mitterahalise tagatisega, rahaliste tagatiste kogumiga tagatud ja tagamata väärtpaberite laenamise tehinguid. Kõigi kolme liigi puhul on teatamise loogika sama.

306. Tabel 72 sisaldab väärtust, mille vastaspooled peavad esitama väljal 67 „Laenuks andmise teenustasu“ juhul, kui nad sõlmivad mitterahalise tagatisega, rahaliste tagatiste kogumiga tagatud või tagamata (mahahindlusega) väärtpaberite laenamise tehingu. Laenuks andmise teenustasu on antud juhul 1,23456 % ja see esitatakse ilma protsendimärgita (seda väljendab XML-märgis).

Tabel 72. Mitterahaline tagatis			
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; ... </pre>

**Tabel 72. Mitterahaline tagatis**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt;   &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 Võimenduslaenu summa ja lühikese positsiooni turuväärtus

307. Tagasimaksmata võimenduslaenu kogusummaks (väli 2.69) tuleks teates märkida kas 0 (kui kliendil on kokkuvõttes raha krediitjääk/pikk rahapositsioon) või positiivne väärtus (kui kliendil on kokkuvõttes raha deebetjääk/lühike rahapositsioon alusvaluutas). Alusvaluuta tuleks alati esitada vastavalt peamaakleri ja tema kliendi vahel sõlmitud kahepoolses lepingus määratletule.
308. Võimenduslaenu koguväärtus arvutatakse võimenduslaenu üksikute komponentide alusel valuutade kaupa (väljad 2.33 ja 2.34). Neid välju tuleks korrata nii mitu korda kui vaja, et kajastada kõik kontol kasutatavad valuutad. See võimaldab pädevatel asutustel jälgida kliendi raha deebetjääki (st võimenduslaene) eri valuutades, mitte ainult neto deebetjääki alusvaluutas, samuti raha krediitjääki erinevates tagatisena kasutatavates valuutades. Vastavalt võimenduslaenu kogusummale tuleks kliendi neto deebetjääk antud valuutas esitada positiivse väärtusena koos valuuta tähisega ja kliendi neto krediitjääk tuleks esitada negatiivse väärtusena.
309. Lühikese positsiooni turuväärtus tuleks alati esitada väärtusena, mis on denomineeritud võimenduslaenu alusvaluutas, mis on määratletud kahepoolses lepingus (väli 2.70). Ühe tehingu kordumatu tunnuskoodi kohta tuleks esitada üks rahaline summa; seetõttu tuleks lühikese positsiooni turuväärtus esitada netosummana päeva lõpus. Tagasimaksmata võimenduslaenu osas tuleks lühikese positsiooni turuväärtuse tagamiseks kasutatud raha neto krediitjääk esitada negatiivse väärtusena (väli 2.33) koos oma valuutaga (väli 2.34).
310. Kui võimenduslaenu summa on 0, st kliendil on raha neto krediitjääk alusvaluutas, ja lühikese positsiooni turuväärtus on samuti 0, tuleks väljadel 2.33, 2.69 ja 2.71 märkida 0. Teatada tuleks ka nulltagatise ajakohastamisest, nagu selgitatakse jaos 5.4.4.

### 5.3.16.1 Positiivsed ja negatiivsed jäägid mõningates valuutades ja neto deebetjääk alusvaluutas

311. Tabel 73 illustreerib teate andmeväljade täitmist alusvaluutas neto deebetjäägi korral; selles näites on krediitjääk USA dollarites ning deebetjäägid naelsterlingites ja eurodes. Lihtsuse mõttes on selles näites USA dollarite ja eurode ning naelsterlingite ja eurode vahetuskursid võrdsustatud 1-ga.

Tabel 73. Positiivsed ja negatiivsed jäägid mõningates valuutades ja deebetjääk alusvaluutas			
No	Field	Example	XML Message
33	Margin lending currency amount	-100000	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&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;/SctiesFincgRptgTxRpt&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 krediitjääk alusvaluutas ja lühikese positsiooni positiivne turuväärtus

312. Tabel 74 illustreerib teate andmeväljade täitmist alusvaluutas (GBP) neto krediitjäägi korral; seetõttu märgitakse tagasimaksmata võimenduslaenu väärtuseks 0, kusjuures

Klient kasutab muus kui alusvaluutas (USD) olevat krediitjääki tagatisena, mis katab osa lühikese positsiooni turuväärtusest.

Tabel 74. Neto krediitjääk alusvaluutas ja lühikese positsiooni positiivne turuväärtus			
No	Field	Example	XML Message
33	Margin lending currency amount	-100000	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&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="GBP"&gt;0&lt;/OutsdngMrgnLnAmt&gt; &lt;ShrtMktValAmt Ccy="GBP"&gt;500000&lt;/ShrtMktValAmt&gt; &lt;MrgnLnAttr&gt; &lt;Amt&gt; &lt;Amt Ccy="USD"&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;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
34	Margin lending currency	USD	
69	Outstanding margin loan	0	
70	Base currency of outstanding margin loan	GBP	
71	Short market value	500000	

### 5.3.16.3 Neto krediitjääk alusvaluutas ja lühikese positsiooni turuväärtuse puudumine

313. Tabel 75 illustreerib teate andmeväljade täitmist juhul, kui alusvaluutas (EUR) on krediitjääk ja lühikese positsiooni turuväärtus puudub. Kuna tagasimaksmata võimenduslaen ja lühikese positsiooni turuväärtus puuduvad, ei pea krediitjäägist teatama (kuna seda ei kasutata võimenduslaenu või lühikese positsiooni turuväärtuse tagatisena). Küll aga on vajalik pädevaid asutusi teavitada nulljäägist. Esitada tuleks alusvaluuta, milles algses lepingus kokku lepitati.

Tabel 75. Krediitjääk alusvaluutas ja lühikese positsiooni turuväärtuse puudumine			
No	Field	Example	XML Message
33	Margin lending currency amount	0	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; </pre>
34	Margin lending currency	USD	

Tabel 75. Krediitjääk alusvaluutas ja lühikese positsiooni turuväärtuse puudumine			
No	Field	Example	XML Message
69	Outstanding margin loan	0	...
70	Base currency of outstanding margin loan	EUR	<pre> &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;MrgnLndg&gt; &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>
71	Short market value	0	

## 5.4 Tagatise andmed

314. Järgnevat jagudes käsitletakse teatavate andmeväljade täitmist, millel on VFT tagatisepoolel mõningad ühised spetsiifilised omadused. See võimaldab teateid edastavatel vastaspooltel otseselt hinnata teavet, mida nad peaksid iga konkreetse andmejao puhul vastavalt kohaldatavusele esitada.

315. Valideerimiseeskirjad sisaldavad täielikke juhiseid VFT liikide, toiminguliikide ja tasandite kaupa, samuti teavet asjakohaste sõltuvuste kohta.

### 5.4.1 Väärtpaberite laenamise tehingu tagatusest teatamine

316. Vastaspool peab väljal 2.72 „Väärtpaberite laenuks andmisel tagatise puudumise märges“ teatama, kas väärtpaberite laenamise tehing on tagatud või tagamata.

#### 5.4.1.1 Tagamata väärtpaberite laenamise tehing

317. Vastaspool peab väljal 2.72 „Väärtpaberite laenuks andmisel tagatise puudumise märges“ märkima „õige“, kui väärtpaberite laenuks andmine on tagamata, kuid see korraldatakse siiski väärtpaberite laenamise tehinguna.

#### 5.4.1.2 Tagatud väärtpaberite laenamise tehing

318. Vastaspoolad peaksid väljal 2.72 „Väärtpaberite laenuks andmisel tagatise puudumise märgi“ märkima „vale“, kui väärtpaberite laenuks andmine on tagatud või kui vastaspoolad lepivad kokku tehingu tagamises, kuid tagatise konkreetne jaotamine ei ole veel teada.

#### 5.4.2 Tagatus

319. Kui tagatiskorv ei ole teate edastamise ajal teada, tuleks väljal 2.96 märkida „NTAV“. Sama kehtib ka üldtagatisega tehingute platvormidel tehtavate repotehingute kohta. Sel juhul peaksid vastaspoolad edastama ajakohastatud teabe tagatiskorvi kindlaksmääramise kohta niipea, kui see neile teatavaks saab, ja seejärel ajakohastama teabe tagatiskomponentide kohta hiljemalt väärtuspäevale järgneval tööpäeval.

320. Kui tehingut ei tagata tagatiskorviga, eeldab ESMA, et vastaspoolad teatavad asjaomastest tagatise elementidest.

##### 5.4.2.1 Tagatiskorviga tagatud tehing

321. Tabel 76 illustreerib teate andmeväljade täitmist juhul, kui kaks eraldi VFTd tehakse tagatiskorvi tagatisel (väli 2.96), mille ISIN-kood on GB00BH4HKS39. Tagatiskorvi tagatisel võidakse teha mitu VFTd ilma, et tagatist antaks neto riskipositsiooni alusel. Need VFTd tagatakse tehingu tasandil (väljal 2.73 märgitakse „vale“).

Tabel 76. Tagatiskorviga tagatud tehing			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&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;/OthrPtyData&gt;         &lt;/New&gt;       &lt;/Rpt&gt;     &lt;/TradData&gt;   &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&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}	



**Tabel 76. Tagatiskorviga tagatud tehing**

No	Field	Example	XML Message
98	Action type	NEWT	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	</AgtLndr> </OthrPtyData>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	</CtrPtyData> <LnData> <RpTrad>
1.9	Counterparty side	GIVE	<UnqTradldr>UT1</UnqTradldr>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI2	</Tp> </MstrAgrmt>
3	Event date	24/04/2020	</RpTrad> </LnData>
9	Master agreement	GMRA	<CollData> <RpTrad>
73	Collateralisation of net exposure	FALSE	<NetXpsrCollstnInd>>false</NetXpsrCollstnInd>
96	Collateral basket identifier	{ISIN}	<BsktlDr> <Id>GB00BH4HKS39</Id> </BsktlDr> </RpTrad> </CollData>
98	Action type	NEWT	... </New> </Rpt> <Rpt> <New> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>1234567890123450000</LEI> </Id> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr>

Tabel 76. Tagatiskorviga tagatud tehing			
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;RpTrad&gt;  &lt;UnqTradldr&gt;UTI2&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;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.4.2.2 Tehing, mille tagatiskorv ei ole teate edastamise ajal teada

322. Tabel 77 illustreerib teate andmeväljade täitmist tehingu korral, mis on tagatud tagatiskorviga, kuid tagatiskorv ei ole teate edastamise ajal teada (väljal 2.96 märgitakse „NTAV“).

323. VFT tagatakse tehingupõhiselt (väli 2.73). VFT tagatakse tehingu alusel (väljal 2.73 märgitakse „vale“).

Tabel 77. Tehing, mille tagatiskorv ei ole teate edastamise ajal teada			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt; </pre>

**Tabel 77. Tehing, mille tagatiskorv ei ole teate edastamise ajal teada**

No	Field	Example	XML Message
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	<pre> &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;UnqTradldr&gt;UTI1&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;NTAV&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>
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	NTAV	
98	Action type	NEWT	

### 5.4.2.3 Neto riskipositsiooni alusel tagatiskorviga tagamine

324. Tabel 78 illustreerib teate andmeväljade täitmist juhul, kui kaks tehingut tagatakse neto riskipositsiooni alusel (väljal 2.73 märgitakse „õige“) tagatiskorviga (väli 2.96), mille ISIN-kood on GB00BH4HKS39. See näide ei tähenda, et kõik üldtagatisega tehingud tagatakse neto riskipositsiooni alusel. Vastaspooled peaksid teatama VFTdest siis, kui need sõlmitakse.
325. Väärrib märkimist, et kui VFTd tagatakse neto riskipositsiooni alusel tagatiskorviga, peaksid teated toiminguliigiga „COLU“ sisaldama teavet üksikute tagatiskomponentide kohta. Tagatiskorvi ISIN-kood esitatakse ainult kuni väärtpaperite jaotuse kindlaksmääramiseni. Tagatiskomponendid tuleks esitada päeva lõpu seisuga.

Tabel 78. Neto riskipositsiooni alusel tagatiskorviga tagamine			
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;UnqTradldr&gt;UTI1&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;/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	

**Tabel 78. Neto riskipositsiooni alusel tagatiskorviga tagamine**

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	<pre> &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;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;           &lt;UnqTradldr&gt;UTI2&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;/New&gt;   &lt;/Rpt&gt; &lt;/Rpt&gt; </pre>

**Tabel 78. Neto riskipositsiooni alusel tagatiskorviga tagamine**

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 Neto riskipositsiooni alusel tagamine, kui tagatiskorv ei ole teate edastamise ajal teada

326. Tabel 79 illustreerib teate andmeväljade täitmist juhul, kui tehing tagatakse neto riskipositsiooni alusel (väljal 2.73 märgitakse „õige“), kuid tagatiskorv ei ole teada (väljal 2.96 märgitakse „NTAV“).

327. Tehing tagatakse neto riskipositsiooni alusel (väli 2.73).

**Tabel 79. Neto riskipositsiooni alusel tagamine, kui tagatiskorv ei ole teate edastamise ajal teada**

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; </pre>
96	Collateral basket identifier	NTAV	
98	Action type	NEWT	

**Tabel 79. Neto riskipositsiooni alusel tagamine, kui tagatiskorv ei ole teate edastamise ajal teada**

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

### 5.4.3 Rahaline tagatis

328. Tabel 80 illustreerib teate andmeväljade täitmist mahahindlusega ja rahaliste tagatiste kogumiga tagatud väärtpaperite laenamise tehingu korral. Selles näites tagatakse tehing rahalise tagatisega summas 1 000 000 eurot (väljad 2.76 ja 2.77). Teatamise stsenaarium on toiminguliikide „NEWT“ ja „COLU“ puhul sama.

**Tabel 80. Rahaline tagatis**

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 Nulltagatisest teatamine

329. Teatamise lihtsustamiseks tuleks juhul, kui tagatise väärtus on 0, tagatis alati esitada rahalise tagatisena, märkides rahalise tagatise summaks 0 ja tagatiskomponendi liigiks „raha“, sõltumata sellest, kas selle VFT puhul varem kasutatud tagatiseks olid väärtpaberid, kaup või raha.
330. Tabel 81 illustreerib teate andmeväljade täitmist juhul, kui tagatise väärtus on 0 ja tagatiskomponendi liigiks on väärtpaberid, kaup (ainult repotehingute ja ostu-tagasimüügitehingute / müügi-tagasiostutehingute korral) või raha.

Tabel 81. Nulltagatisest teatamine, kui tagatiseks on väärtpaberid, kaup või raha			
No	Field	Example	XML Message
75	Type of collateral component	CASH	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&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;/SciesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
76	Cash collateral amount	0	
77	Cash collateral currency	EUR	

#### 5.4.5 Väärtpaberitest tagatise väljad

331. Väärtpaberite puhul, mille kohta üksikasjad pole kättesaadavad, on teate edastamise tähtaeg väärtuspäev + 1 päev. Arveldamisega seotud küsimuste kohta lugege suuniste jaost 5.4.8. Tagatiskorvide kohta, mille üksikasjad esitatakse alles pärast tagatise jaotamist, lugege suuniste jaost 5.4.2.

##### 5.4.5.1 Väärtuskärbe

332. Vastaspoolad peaksid esitama tagatise andmed vastavalt teatamise regulatiivsete tehniliste standardite lisa tabelile 2.



333. Tagatise turuväärtus (väli 2.88) tuleks esitada õiglasest väärtuses, välja arvatud väärtuskärbe. Teisisõnu, tagatise turuväärtus peaks sisaldama tagatiseandja antavat kogu tagatist, sealhulgas veel arveldamata tagatist, enne võimaliku väärtuskärpe mahaarvamist.
334. Väärtuskärpest või võimendusest (väli 2.89) tuleks iga liiki VFTde puhul teatada ISIN-koodi tasandil protsendina. Repotehingute puhul lepatakse väärtuskärpes kokku lepingus ja see peaks olema VFT kestuse ajal fikseeritud, kui vastaspool ei lepi kokku uues väärtuskärpes. Väärtuskärpe arvutamiseks lahutatakse 1st raha ja tagatise väärtuse suhe ning tulemus korrutatakse 100ga. Näiteks kui repotehingus on raha ja tagatise väärtused vastavalt 100 ja 105, on väärtuskärbe  $100 * [1 - (100/105)] = 4,7619$  ja see tuleks esitada kujul „4.7619“. Repotehingute portfelli tasandi väärtuskärpe korral (st kui vastaspoolte kokkuleppel rakendatakse ühte väärtuskärbet repotehingute kogu tagatisportfelli suhtes) kehtivad samad põhimõtted. Nagu on sätestatud teatamise regulatiivsetes tehnilistes standardites, tuleks ka portfelli tasandi väärtuskärpest teatada ISIN-koodi tasandil, st seda tuleks korrata iga portfellis oleva ISIN-koodi puhul (ja raha puhul, kui see on osa portfelist).
335. Väärtpaberite laenamise tehingu korral tuleks väljal 2.89 „Väärtuskärbe või võimendus“ esitada ainult väärtuskärped, mis on kohaldatavad tehingu tagatisepoole suhtes. Võimendustagatise nõudeid kajastatakse tagatise turuväärtuse (väli 2.88) ja rahalise tagatise summa (väli 2.76) kaudu. Seega tuleks tagatise turuväärtust ja rahalise tagatise summat ajakohastada võimalike lisanditega (näiteks täiendav laenuintressi määr), mida hakatakse kohaldama tehingu käigus.
336. Tabel 82 kirjeldab väärtpaberite laenamise tehingu tagatise andmeid juhul, kui 100 000 euro väärtuses väärtpabereid laenatakse 100 000 euro suuruse rahalise tagatise vastu (väljad 2.76 ja 2.77), st väärtuskärbe puudub, mis tähendab, et väärtuskärpeks tuleks märkida 0 (väli 2.89).

Tabel 82. Rahaline tagatis ilma väärtuskärpeta			
No	Field	Example	XML Message
76	Cash collateral amount	100000	<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;100000&lt;/Amt&gt; </pre>
77	Cash collateral currency	EUR	
89	Haircut or margin	0	

**Tabel 82. Rahaline tagatis ilma väärtuskärpeta**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &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. Tabel 83 kirjeldab 100 000 euro väärtuses väärtuspaberite laenamise tagatist, milleks on 105 000 USA dollari suurune rahaline tagatis (väljad 2.76 ja 2.77), mis kajastab 105 % võimendust tehingu laenupoolel.

**Tabel 83. Rahaline tagatis välisvaluutas ja võimendusega**

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. „Segatagatise“ näites (Tabel 84) on 100 000 euro väärtuses väärtpaberite laenamine tagatud 55 000 euro suuruse rahalise tagatisega (väli 2.76) ja 60 000 euro suuruse mitterahalise tagatisega (väli 2.88). See hõlmab (täpsustamata) võimendustagatise nõuet laenupoleel, mis kehtib nii rahalise kui ka mitterahalise tagatise kohta, millele lisandub tagatisena kasutatavate väärtpaberite 5 % väärtuskärbe. Andmeväljal 2.89 on märgitud rahalise tagatise kohta 0 ja tagatisena kasutatavate väärtpaberite kohta 5.

Tabel 84. „Segatagatis“ väärtuskärpe ja võimendusega			
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;/Scty&gt;               &lt;HrcutOrMrgn&gt;5&lt;/HrcutOrMrgn&gt;             &lt;/AsstTp&gt;           &lt;/RpTrad&gt;           &lt;Csh&gt;             &lt;Amt               Ccy="EUR"&gt;55000&lt;/Amt&gt;             &lt;/Csh&gt;           &lt;HrcutOrMrgn&gt;0&lt;/HrcutOrMrgn&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. Negatiivsetest väärtuskärbetest võib teatada juhul, kui tagatise väärtus on väiksem kui laenu väärtus. Väärtuskärpe märk peaks vastaspoolte teadetes olema sama.

340. Tabel 85 kirjeldab repotehingut, mis on tagatud väärtpaberikorviga (seekord rahaline tagatis puudub) ja kõigi tagatisena kasutatavate väärtpaberite suhtes kohaldatakse portfelli tasandi väärtuskärbet. Portfellis oleva iga tagatiskomponendi (sealhulgas raha, kui see on portfelli osa) kohta tuleks esitada sama väärtuskärbe. 150 000 euro suurune

laen on tagatud kahe väärtpaberiga: 110 000 euro väärtuses väärtpaberiga A ja 50 000 euro väärtuses väärtpaberiga B. Tagatise turuväärtus kokku on 160 000 eurot, mis vastab portfelli tasandi väärtuskärpele  $100 * [1 - (150/160)] = 6,25 \%$ . See on väärtus, milles tuleks väljal 2.89 teatada iga ISIN-koodi kohta. Ka neto riskipositsiooni alusel tagamise korral (väli 2.73) tuleks esitada iga väärtpaberi puhul sama väärtuskärbe.

Tabel 85 . Tagatisportfell portfelli tasandi väärtuskärpega			
No	Field	Example	XML Message
88	Collateral market value	110000	<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;110000&lt;/MktVal&gt;                 &lt;/Scty&gt;               &lt;/Scty&gt;             &lt;MktVal               Ccy="EUR"&gt;50000&lt;/MktVal&gt;             &lt;/Scty&gt;           &lt;/AsstTp&gt;         &lt;/RpTrad&gt;         &lt;/CollData&gt;         ...       &lt;/New&gt;     &lt;/Rpt&gt;   &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
89	Haircut or margin	6.25	
88	Collateral market value	50000	
89	Haircut or margin	6.25	<pre> &lt;HrcutOrMrgn&gt;6.25&lt;/HrcutOrMrgn&gt; </pre>

341. Võimenduslaenu korral, kui väärtuskärbet või võimendustagatise nõuet kohaldatakse kogu tagatisportfelli suhtes, tuleks väljal 2.89 esitatavat väärtust korrata kõigi ISIN-koodide ja rahaliste elementide puhul. Kui see pole nii ja väärtuskärpeid kohaldatakse väärtpaberite kaupa, tuleks esitada väärtuskärbe või võimendus iga ISIN-koodi kohta (samas vormis nagu muude VFTde puhul, st protsendina).

#### 5.4.5.2 Tagatise liik

342. Väljal 2.94 „Tagatise liik“ peaksid vastaspooled esitama ühe järgmistest väärtustest:

- a. „GOVS“ – riigivõlakirjad;
- b. „SUNS“ – riigiülesed ja asutuste emiteeritud väärtpaberid;
- c. „FIDE“ – pankade ja muude finantseerimisasutuste emiteeritud võlaväärtpaberid (sealhulgas pandikirjad);
- d. „NFID“ – finantssektoriväliste ettevõtjate emiteeritud võlaväärtpaberid (sealhulgas pandikirjad);
- e. „SEPR“ – väärtpaberistatud tooted (sealhulgas varaga tagatud väärtpaberid, tagatud võlakohustused, ärikinnisvara hüpoteekväärtpaberid, eluasemehüpoteekväärtpaberid, varaga tagatud kommertsväärtpaberid);
- f. „MEQU“ – põhiindeksisse kaasatud aktsiad (sealhulgas vahetusvõlakirjad);
- g. „OEUQ“ – muud aktsiad (sealhulgas vahetusvõlakirjad);
- h. „OTHR“ – muud varad (sealhulgas usaldusfondide osakud).

343. Muude väärtpaberite puhul võivad vastaspooled tugineda teistele ametlikele allikatele, et viia ebakõlade ja kooskõlastaval võrdlemisel tekkida võivate probleemide risk miinimumini. Riigivõlakirjade määratlemisel peaksid teadet esitavad üksused tuginema VFTde andmete kogumist käsitlevate finantsstabiilsuse nõukogu standardite 19. joonealusele märkusele ja kasutama Basel III standardmeetodit. Kui Basel III nõuded ei ole ühe vastaspoole suhtes kohaldatavad, peaksid vastaspooled sellel väljal esitatavas väärtuses kokku leppima.

344. „Põhiindeksisse kaasatud aktsiate“ ja „muude aktsiate“ eristamine on finantsstabiilsuse nõukogu standarditega kooskõlas. Finantsstabiilsuse nõukogu liikmed võivad siiski otsustada, millised indeksid tuleks liigitada „põhiindeksiteks“, tingimusel et need määratletakse kooskõlas finantsstabiilsuse nõukogu/Baseli pangajärelevalve komitee raamistikuga, mis käsitleb väärtuskärpeid muul viisil kui keskselt kliiritavate VFTde puhul.

345. ESMA rakenduslikes tehnilistes standardites kapitalinõuete määrase kohaste põhiindeksite ja tunnustatud börside kohta<sup>15</sup> on esitatud põhiindeksite loetelud (I lisa, tabelid 1 ja 2). Need loetelud sisaldavad aktsiaindekseid ja vahetusvõlakirjade indekseid, mis hõlmavad varasid nii ELis kui ka väljaspool seda. Aktsiate ja vahetusvõlakirjade liigitamisel põhiindeksisse kaasatud või muudeks aktsiateks ja võlakirjadeks tuleks lähtuda neist loeteludest.

#### 5.4.5.3 Tagatise uuesti kasutamise võimalus

346. Vastaspooled peaksid selle välja täitmisel võtma arvesse ainult lepingulist võimalust tagatist uuesti kasutada. Kui väljal 2.20 „Tagatise andmise meetod“ märgitakse „TTCA“ või „SIUR“, tuleks väljal 2.95 „Tagatise uuesti kasutamise võimalus“ alati märkida „õige“. Siin ei tohiks arvestada tegevuspiiranguid ega regulatiivseid nõudeid, mis võivad takistada

---

<sup>15</sup> Komisjoni 13. septembri 2016. aasta rakendusmäärus (EL) 2016/1646.

uesti kasutamist. Lepinguline uuesti kasutamise võimalus tuleks kindlaks määrata raamlepinguga, milles määratletakse VFTs kasutatava tagatiskokkuleppe liik.

347. Näiteks keskne vastaspool, kes annab VFT tagatise omandiõiguse üleminekul põhineva tagatiskokkuleppe (TTCA) alusel ühelt kliirivalt liikmelt edasi teisele, peaks teatama, et tagatis on uuesti kasutamiseks kättesaadav, isegi kui keskse vastaspoole kliirimistingimused võivad seda takistada. Sama kehtib ka eurofondide kohta: uuesti kasutamiseks kättesaadavast mitterahalisest tagatisest tuleks vastavalt teatada, isegi kui börsil kaubeldavaid фонде ja muid eurofondide emissioone käsitlevate ESMA suuniste kohaselt ei saa seda uuesti kasutada.
348. Pange ka tähele, et välja „Tagatise uuesti kasutamise võimalus“ puhul ei võeta arvesse, kas tagatist on uuesti kasutatud või kas seda tegelikult uuesti kasutatakse. Ainult juhul, kui tagatist kasutatakse uuesti (mis hõlmab ka laenatud väärtpaberite kasutamist väärtpaberite laenamise kokkuleppe alusel), tuleks saata lisaks teade uuesti kasutamise kohta (vt jagu 5.6.1).

#### 5.4.5.4 Lihtvõlakirjad

349. Tabel 86 illustreerib 24. aprillil 2020 tagatisena kasutatud lihtvõlakirjadest teatamist.
350. Selles näites kasutati repotehingus tagatisena 102 000 000 euro väärtuses Saksamaa riigivõlakirju, mille ISIN-kood on DE0010877643 ja mis on liigitatud kui DBFTFR ning mille puhul rakendatakse 2 % väärtuskärbet ja mille tähtpäev on 22. aprill 2030. Väärtpaberid on teada ja neist teatatakse vastavalt teatamise tähtajale koos kogu ülejäänud teabega tehingu laenupoole kohta. Väärtpaberite kvaliteet on „INVG“ (investeeringusjärgu väärtpaber) ja tagatis on kättesaadav edaspidiseks uuesti kasutamiseks. Tabelis keskendutakse ainult tagatisest teatamisel asjakohastele väljadele.
351. Tagatise nimiväärtuse või koguse valuutast teatamine on valikuline, kuid nimiväärtuse esitamisel tuleks esitada ka valuuta. Kogusest teatamise korral (nt aktsiate puhul) ei tohiks seda välja täita.
352. Tagatise väärtuspäeva väli on kohaldatav ainult väärtpaberite laenamise tehingute korral ettemakstud tagatise kontekstis.
353. Ühikuhinna määratlus (väli 2.87) näitlikustab, et esitatud väärtus peaks sisaldama intressi kandvatelt väärtpaberitelt kogunevat intressi, st esitada tuleks rahavoogudega hind.

Tabel 86. Lihtvõlakirjad			
No	Field	Example	XML Message
3	Event date	2020-04-24	<SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad>
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}	

Tabel 86. Lihtvõlakirjad			
No	Field	Example	XML Message
83	Collateral quantity or nominal amount	100000000	<EvtDt>2020-04-24</EvtDt> </RpTrad>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	</LnData> <CollData> <RpTrad>
86	Price currency		<AsstTp> <Scty>
87	Price per unit	102	<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> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty>
95	Availability for collateral reuse	true	<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> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

#### 5.4.5.5 Tähtajatud võlakirjad

354. Tabel 87 illustreerib 102 000 000 euro väärtuses tagatisena kasutatavatest Hispaania riigivõlakirjadest teatamist. Rakendatakse 2 % väärtuskärbet. Väärtpaberid on teada ja neist teatatakse vastavalt teatamise tähtajale koos kogu ülejäänud teabega tehingu laenupoole kohta. Väärtpaberite kvaliteet on „INVG“ (investeeringisjargu väärtpaber) ja tagatis on kättesaadav uuesti kasutamiseks. Tabelis keskendutakse ainult tagatisest teatamisel asjakohastele väljadele.
355. Tagatise nimiväärtuse või koguse valuutast teatamine on valikuline, kuid nimiväärtuse esitamisel tuleks esitada ka valuuta. Kogusest teatamise korral (nt aktsiate puhul) ei tohiks seda välja täita.
356. Tagatise väärtuspäeva väli on kohaldatav ainult väärtpaberite laenamise tehingute korral ettemakstud tagatise kontekstis.
357. Ühikuhinna määratlus (väli 2.87) näitlikustab, et esitatud väärtus peaks sisaldama intressi kandvatelt väärtpaberitelt kogunevat intressi, st esitada tuleks rahavoogudega hind.

Tabel 87. Tähtajatud võlakirjad			
No	Field	Example	XML Message
3	Event date	2020-04-24	<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;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; </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	
90	Collateral quality	INVG	
91	Maturity date of the security	9999-12-31	
92	Jurisdiction of the issuer	ES	
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	



Tabel 87. Tähtajatud võlakirjad			
No	Field	Example	XML Message
94	Collateral type	GOVS	<pre> &lt;HrcutOrMrgn&gt;2&lt;/HrcutOrMrgn&gt;   &lt;Qlty&gt;INVG&lt;/Qlty&gt;   &lt;Mtrty&gt;9999-12-31&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;/RpTrad&gt;   &lt;/CollData&gt;    ...    &lt;/New&gt;   &lt;/Rpt&gt;   &lt;/TradData&gt;   &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
95	Availability for collateral reuse	true	
98	Action type	NEWT	

#### 5.4.5.6 Põhiindeksisse kaasatud aktsiad

358. Tabel 88 illustreerib tagatisena põhiindeksisse kaasatud aktsiatest („MEQU“) teatamist. Selles näites on tegemist Prantsusmaa indeksi CAC40 aktsiatega, mille väärtus on 105 000 000 eurot ja CFI-kood on ESVUFN ning millele rakendatakse 5 % väärtuskärbet. Väärtpaberid on teada ja neist teatatakse vastavalt teatamise tähtajale koos kogu ülejäänud teabega tehingu laenupoole kohta. Väljal „Tagatise kvaliteet“ on märgitud „NOAP“, kuna reiting ei ole nende väärtpaberite puhul kohaldatav. Väärtpaberid on edaspidiseks uuesti kasutamiseks kättesaadavad.
359. Tagatise nimiväärtuse või koguse valuutast teatamine on valikuline, kuid nimiväärtuse esitamisel tuleks esitada ka valuuta. Kogusest teatamise korral (nt aktsiate puhul) ei tohiks seda välja täita.
360. Tagatise väärtuspäeva väli on kohaldatav ainult väärtpaberite laenamise tehingute korral ettemakstud tagatise kontekstis.
361. Ühikuhinna määratlus (väli 2.87) näitlikustab, et esitatud väärtus peaks sisaldama intressi kandvatelt väärtpaberitelt kogunevat intressi, st esitada tuleks rahavoogudega hind.

Tabel 88. Põhiindeksisse kaasatud aktsiad			
No	Field	Example	XML Message
3	Event date	2020-04-24	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData>
75	Type of the collateral component	SECU	<Rpt> <New>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<CtrPtyData> ... ...
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	</CtrPtyData> <LnData>
83	Collateral quantity or nominal amount	10000000	<RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> </RpTrad>
86	Price currency	EUR	</LnData> <CollData>
87	Price per unit	10.5	<RpTrad> <AsstTp>
88	Collateral market value	105000000	<Scty> <Id> FR0000120271</Id> <ClssfctnTp> ESVUFN
89	Haircut or margin	5	</ClssfctnTp>
90	Collateral quality	NOAP	<QtyOrNmnlVal> <Qty>100000000</Qty> </QtyOrNmnlVal>
91	Maturity date of the security	9999-12-31	<UnitPric> <MntryVal>
92	Jurisdiction of the issuer	FR	<Amt> Ccy="EUR">10.5</Amt> </MntryVal>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	</UnitPric> <MktVal>
94	Collateral type	MEQU	Ccy="EUR">105000000</MktVal>
95	Availability for collateral reuse	true	<HrcutOrMrgn>5</HrcutOrMrgn> <Qty>NOAP</Qty> <Mtrty>9999-12-31</Mtrty> <Issr> <Id>
98	Action type	NEWT	<LEI>529900S21EQ1BO4ESM68</LEI> </Id> <JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>MEQU</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp>

Tabel 88. Põhiindeksisse kaasatud aktsiad			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/RpTrad&gt; &lt;/CollData&gt; ... &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.4.6 Tehingu tasandi muutuvtagatis muul viisil kui keskselt kliiritavate VFTde korral

362. Selles alajaos sisalduvad viited väärtpaberite laenamise tehingule või repotehingule on esitatud üksnes selleks, et tuua näiteid erinevate raamlepingute kohta. Muud liiki VFTdest, nagu ostu-tagasimüügitehingud / müügi-tagasiostutehingud või kaupa hõlmavad VFTd, tuleks teatada samade põhimõtete kohaselt.
363. Lisaks viidatakse selles alajaos muutuvtagatise esitamisele üksikute VFTde tasandil. Järgmises jaos toodud näited illustreerivad aga muutuvtagatisest teatamist juhul, kui tehinguid tagatakse neto riskipositsiooni alusel.
364. Negatiivsed märgid tagatiskomponentide ees, kui need moodustavad osa neto riskipositsiooni tasandi muutuvtagatisest, osutavad päeva lõpu seisule, mitte antud päeva voole. Ehkki numbriliselt võivad need kokku langeda, on erinevus põhimõtteline. Seega peaksid vastaspoolel teatama iga tagatiskomponendi seisust päeva lõpu seisuga. Lisajuhised on esitatud punktis 373.
365. Lihtsustamiseks on allpool toodud näidetes väärtuskärpeks märgitud 0. Vastaspoolel peaksid teatama väärtuskärpest, mis on arutatud vastavalt jaole 5.4.5.1.

##### 5.4.6.1 Väärtpaberite laenamise tehingu muutuvtagatis tagatiseandja poolt samade väärtpaberite täiendava pakkumisega

366. Tabel 89 illustreerib väärtpaberite laenamise tehingu ajakohastamist teabega muutuvtagatise kohta lihtvõlakirjade näites (Tabel 86): tagatise nimiväärtuse suurendamist 1 000 099 võrra, et kompenseerida võlakirja hinna langust 102-lt 100,99-le, nagu sellest teatab tagatiseandja. Nii tagatiseandja kui ka tagatisesaaja peaksid esitama teabe tagatise kohta täpselt samal viisil, nagu Tabel 89 üksikasjalikult kirjeldab.

Tabel 89. Väärtpaberite laenamise tehingu ajakohastamine teabega muutuvtagatise kohta			
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; </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of the agent lender F	

**Tabel 89. Väärtpaberite laenamise tehingu ajakohastamine teabega muutuvtagatise kohta**

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

**Tabel 89. Väärtpaberite laenamise tehingu ajakohastamine teabega muutuvtagatise kohta**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &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;/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>

5.4.6.2 Repotehingu muutuvtagatis tagatiseandja poolt samade väärtpaberite täiendava pakkumisega

367. Tabel 90 illustreerib repotehingu ajakohastamist teabega muutuvtagatise kohta lihtvõlakirjade näites (Tabel 86): tagatise nimiväärtuse suurendamist 1 000 099 võrra, et kompenseerida võlakirja hinna langust 102-lt 100,99-le, nagu sellest teatab tagatiseandja. Nii tagatiseandja kui ka tagatisesaaaja peaksid esitama teabe tagatise kohta täpselt samal viisil, nagu Tabel 90 üksikasjalikult kirjeldab.

**Tabel 90. Repotehingu ajakohastamine teabega muutuvtagatise kohta**

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

**Tabel 90. Repotehingu ajakohastamine teabega muutuvtagatise kohta**

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> </Id>
3	Event date	24/04/2020	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
9	Master agreement	GMRA	
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>BBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	</OthrPtyData> </CtrPtyData>
83	Collateral quantity or nominal amount	101000099	</CtrPtyData> <LnData> <RpTrad>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<EvtDt>2020-04-24</EvtDt>
86	Price currency		<UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr> <MstrAgrmt>
87	Price per unit	100.99	<Tp> <Tp>GMRA</Tp>
88	Collateral market value	102000000	</Tp> </MstrAgrmt>
89	Haircut or margin	0	</RpTrad> </LnData>
90	Collateral quality	INVG	<CollData> <RpTrad>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	<AsstTp> <Scty> <Id>DE0010877643</Id>
92	Jurisdiction of the issuer	DE	
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal>
94	Collateral type	GOVS	<Amt Ccy="EUR">101000099</Amt>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	</NmnlVal> </QtyOrNmnlVal>
98	Action type	COLU	<UnitPric> <Ptrg>100.99</Ptrg>

Tabel 90. Repotehingu ajakohastamine teabega muutuvtagatise kohta			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> &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>

#### 5.4.6.3 Väärtpaberite laenamise tehingu muutuvtagatis samade väärtpaberite tagastamisega tagatiseandjale

368. Tabel 91 illustreerib teistsugust tagatise teabe ajakohastamist eeltoodud näites (Tabel 86): tagatise nimiväärtuse vähendamist 999 709 euro võrra, et kompenseerida võlakirja hinna tõusu 102-lt 103,03-le, nagu sellest teatab tagatiseandja. Nii tagatiseandja kui ka tagatisesaaja peaksid esitama teabe tagatise kohta täpselt samal viisil, nagu Tabel 91 üksikasjalikult kirjeldab.

**Tabel 91. Väärtpaberite laenamise tehingu muutuvtagatis samade väärtpaberite tagastamisega tagatiseandjale**

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;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; &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	



Tabel 91. Väärtpaberite laenamise tehingu muutuvtagatis samade väärtpaberite tagastamisega tagatiseandjale			
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 Repotehingu muutuvtagatis samade väärtpaberite tagastamisega tagatiseandjale

369. Tabel 92 illustreerib teistsugust tagatise teabe ajakohastamist eeltoodud näites (Tabel 86): tagatise nimiväärtuse vähendamist 999 709 euro võrra, et kompenseerida võlakirja

hinna tõusu 102-lt 103,03-le, nagu sellest teatab tagatiseandja. Nii tagatiseandja kui ka tagatisesaaja peaksid esitama teabe tagatise kohta täpselt samal viisil, nagu Tabel 92 üksikasjalikult kirjeldab.

Tabel 92. Repotehingu muutuvtagatis samade väärtpaperite tagastamisega tagatiseandjale			
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; &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; </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	
90	Collateral quality	INVG	
91	Maturity date of the security	22/04/2030	
92	Jurisdiction of the issuer	DE	

**Tabel 92. Repotehingu muutuvtagatis samade väärtpaberite tagastamisega tagatiseandjale**

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

#### 5.4.7 Muul viisil kui keskselt kliiritavate VFTde muutuvtagatis, kui tagamine toimub neto riskipositsiooni alusel

370. Kui tagamine toimub neto riskipositsiooni alusel, võivad vastaspoolled lisaks tehingu raames vahetatavale tagatisele leppida kokku sama liiki raamlepingu alusel sõlmitud laenutehingute netopõhises tagamises.
371. Seetõttu võib juhtuda, et tagatisesaaja võib tagastada mõned tagatiskomponendid, mille tagatiseandja on netopõhiseselt andnud. Selle eesmärk on tagada, et tagatud tehingute kogumil ei oleks ülemäärast tagatist või et tagatis ei ületaks väärtuskärpe- või võimenduslätse, milles vastaspoolled võivad olla kokku leppinud.
372. On ka juhtumeid, kus tagatisesaaja tagastatavad väärtpaberid ei ole täpselt samad, mille tagatiseandja algselt andis. Sel juhul on riskipositsioonide ja tagatuse taseme õigeks arvutamiseks vaja kindlaks teha ülekandmise suund.
373. Kui tagamine toimub neto riskipositsiooni alusel, tuleks tagatisest korrektseks teatamiseks seega teha järgmist.
- Kui tagatis vahetatakse muul viisil kui keskselt kliiritavates VFTdes osana neto riskipositsiooni alusel antavast tagatisest kahe vastaspoole vahel, peaksid vastaspoolled XML-skeemis esitama väärtpaberite hulga ja turuväärtuse märgiga, mis tähistab iga väärtpaberi seisu nende vaatenurgast.
  - Kui tagatiseandja annab muutuvtagatisena lisatagatise, peaks ta esitama uue tagatise turuväärtuse neto riskipositsiooni alusel negatiivse märgiga.
  - Kui tagatisesaaja tagastab osa samast lisatagatisest, mille ta juba andis muutuvtagatisena, peaks ta esitama uue netotagatise turuväärtuse neto riskipositsiooni alusel positiivse märgiga, samal ajal kui tagatiseandja peaks esitama uue netotagatise turuväärtuse negatiivse märgiga.
  - Kui tagatiseandja saab tagatiskomponente, mis erinevad algselt antud tagatiskomponentidest, peaks ta nende uute tagatiskomponentide turuväärtuse esitama positiivse märgiga.
  - Tagatisesaaja seevastu peaks positiivse märgiga teatama muutuvtagatise osana saadud tagatiskomponentidest ja negatiivse märgiga tagatisesaajale antud tagatiskomponentidest, mis erinevad algselt saadud tagatiskomponentidest.
374. Sedalaadi teatamist kohaldatakse ainult „COLU“ teadete puhul, kui i) tagamine toimub neto riskipositsiooni alusel ja ii) tagatiskomponendi (-komponentide) kohta tehingu kordumatut tunnuskoodi ei esitata. Seda teatamist ei kohaldata tagatise tehingupõhisel jaotamisel.
375. Kui tagamine toimub neto riskipositsiooni alusel, peaksid vastaspoolled saatma „COLU“ toiminguliigiga teated iga tehingu tasandil tagatud VFT kohta ja ühe „COLU“ toiminguliigiga teate muutuvtagatisena kasutatava tagatise kohta.

5.4.7.1 Neto riskipositsioon – muutuvtagatis tehingupõhiselt rahaliste tagatiste kogumiga tagatud väärtpaberite laenamise tehingutes

376. Tabel 93 sisaldab näidet väärtpaberite laenamise tehingute kohta, mis on algselt tagatud rahalise tagatisega (mahahindlusega väärtpaberite laenamise tehingud), ja seejärel kasutatavad vastaspoolel rahaliste tagatiste kogumi suhtes muutuvtagatist.

377. Raha puhul tavaliselt väärtuskärbet ei arvestata ja selles näites on võimendus laenupoolel samuti null. Väärtuskärbete ja võimenduste kohta peaksid vastaspoolel lugema jao 5.4.4 alajaost 5.4.5.1.

Tabel 93. Neto riskipositsioon – muutuvtagatis tehingupõhiselt rahaliste tagatiste kogumiga tagatud väärtpaberite laenamise tehingutes			
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;UTI1&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')	UTI1	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMSLA	
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	
75	Type of the collateral component	CASH	
76	Cash collateral amount	100000000	
77	Cash collateral currency	EUR	
98	Action type	COLU	
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI2	

**Tabel 93. Neto riskipositsioon – muutuvtagatis tehingupõhiselt rahaliste tagatiste kogumiga tagatud väärtpaberite laenamise tehingutes**

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> <RptgCtrPty> <Id>
3	Event date	24/04/2020	
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>  <UnqTradldr>UT12</UnqTradldr>

**Tabel 93. Neto riskipositsioon – muutuvtagatis tehingupõhiselt rahaliste tagatiste kogumiga tagatud väärtpaberite laenamise tehingutes**

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;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;SctiesLndg&gt; </pre>

**Tabel 93. Neto riskipositsioon – muutuvtagatis tehingupõhiselt rahaliste tagatiste kogumiga tagatud väärtpaperite laenamise tehingutes**

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 riskipositsioon – muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algselt tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse

378. Tabel 94 kirjeldab tagatist kolme tehingu kordumatu tunnuskoodi puhul, mis algselt tagati tehingupõhiselt. Need kolm repotehingut kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse ning hilisem teade tagatise kohta sisaldab tagatise elemente, mis on seotud üksikute kordumatu tunnuskooriga VFTdega, ja tagatist, mida kasutatakse tehingute tagamiseks neto riskipositsiooni alusel.

**Tabel 94. Neto riskipositsioon – muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algselt tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse**

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



**Tabel 94. Neto riskipositsioon – muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algselt tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse**

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>ABCDEFGHIJKLMNORST</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> </OthrPtyData> </CtrPtyData>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	</CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt>
86	Price currency		<UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr>
87	Price per unit	100	<MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp>
88	Collateral market value	100000000	</Tp> </MstrAgrmt>
89	Haircut or margin	0	</RpTrad> </LnData>
90	Collateral quality	INVG	<CollData> <RpTrad>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	<AsstTp> <Scty> <Id>DE0010877643</Id>
92	Jurisdiction of the issuer	DE	<ClsfctnTp>DBFTFR</ClsfctnTp>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<QtyOrNmnlVal> <NmnlVal>
94	Collateral type	GOVS	<Amt Ccy="EUR">100000000</Amt>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	</NmnlVal>

**Tabel 94. Neto riskipositsioon – muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algselt tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse**

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>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN</LEI> >
87	Price per unit	100	</Id>
88	Collateral market value	50000000	<JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> </Issr>
89	Haircut or margin	0	<Tp> <Cd>GOVS</Cd>
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>

**Tabel 94. Neto riskipositsioon – muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algselt tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse**

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> </OthrPtyData>
98	Action type	COLU	</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>UT12/UnqTradIdr> <MstrAgrmt>

**Tabel 94. Neto riskipositsioon – muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algselt tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse**

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>
86	Price currency		<Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty>
87	Price per unit	100	<Issr> <Id>
88	Collateral market value	5000000	<LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI> </Id>
89	Haircut or margin	0	<JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry>
90	Collateral quality	INVG	</Issr> <Tp>
91	Maturity date of the security	22/04/2040	<Cd>GOVS</Cd> </Tp>
92	Jurisdiction of the issuer	NL	<AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	</Scty> </AsstTp>
94	Collateral type	GOVS	<NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	</RpTrad> </CollData>
98	Action type	COLU	...

**Tabel 94. Neto riskipositsioon – muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algselt tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse**

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> <CtrPtyData>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<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>

**Tabel 94. Neto riskipositsioon – muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algselt tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse**

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> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty>
83	Collateral quantity or nominal amount	2000000	<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> ...
94	Collateral type	GOVS	</CollUpd>  </Rpt>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<Rpt> <CollUpd> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
98	Action type	COLU	<LEI>1234567890123450000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
			<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI>

**Tabel 94. Neto riskipositsioon – muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algselt tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse**

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;/Tp&gt; </pre>

**Tabel 94. Neto riskipositsioon – muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algelt tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse**

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 riskipositsioon – mitterahaliste tagatiste kogumiga tagatud väärtpaberite laenamise tehingute muutuvtagatis samaväärsete, kuid mitte samade väärtpaberite tagastamisega tagatiseandjale

379. Tabel 95 illustreerib tagatise kohta esitatud teabe keerukat ajakohastamist. Tehingupõhist tagamist ei ole; algselt lepiti kokku tagatiste kogumiga tagamises. Selles näites tõusis riskipositsiooni tagamiseks kasutatud ühe väärtpaberi – Saksamaa riigivõlakirja – hind 102-lt 103,3-le, kuid tagatisesaaja vajab Saksamaa riigivõlakirju, samal ajal kui tagatiseandja on nõus võtma vastu Prantsusmaa riigivõlakirju. Kaks vastaspoolt lepivad kokku järgmises asenduses: tagatisesaaja tagastab 2 000 000 suuruse nimiväärtusega Prantsusmaa riigivõlakirjadest tagatise. Seega kompenseeritakse ülemäärane 2 060 000 euro suuruse turuväärtusega Saksamaa riigivõlakirjadest tagatis 2 060 000 euro suuruse turuväärtusega Prantsusmaa riigivõlakirjadest tagatisega, mis on tagatiseandja valduses (st tagatisesaaja vaatenurgast negatiivse märgiga), millega taastatakse algne netotagatise tasakaal.
380. Pange tähele, et tagatise andmete korratavas jaos väärtpaberite suhtes kohaldatavaid välju korratakse kõigi asjakohaste üksikasjade esitamiseks kaks korda. Mõlemad väärtpaberid on edaspidiseks uuesti kasutamiseks kättesaadavad.
381. Nii tagatiseandja kui ka tagatisesaaja peaksid esitama teabe tagatise kohta täpselt samal viisil, nagu Tabel 95 üksikasjalikult kirjeldab, lisades neto riskipositsiooni alusel tagamiseks kasutatava muutuvtagatise osaks olevate tagatiskomponentide ette asjakohased märgid, nagu on osutatud punktis 373.

Tabel 95. Neto riskipositsioon – tagatiste kogumiga tagatud väärtpaberite laenamise tehingute muutuvtagatis samaväärsete, kuid mitte samade väärtpaberite tagastamisega tagatiseandjale			
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;/CtrPtyData&gt;     &lt;/Rpt&gt;   &lt;/CollUpd&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	

**Tabel 95. Neto riskipositsioon – tagatiste kogumiga tagatud väärtpaberite laenamise tehingute muutuvtagatis samaväärsete, kuid mitte samade väärtpaberite tagastamisega tagatiseandjale**

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> <AsstTp>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<Scty> <Id>DE0010877643</Id>
94	Collateral type	GOVS	<ClssfctnTp>DBFTPR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<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>

**Tabel 95. Neto riskipositsioon – tagatiste kogumiga tagatud väärtpaberite laenamise tehingute muutuvtagatis samaväärsete, kuid mitte samade väärtpaberite tagastamisega tagatiseandjale**

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>

**Tabel 95. Neto riskipositsioon – tagatiste kogumiga tagatud väärtpaberite laenamise tehingute muutuvtagatis samaväärsete, kuid mitte samade väärtpaberite tagastamisega tagatiseandjale**

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 riskipositsioon – algelt tehingupõhiselt tagatud ja seejärel tasaarvestatavate tehingute kogumisse kaasatud repotehingute muutuvtagatis samaväärsete, kuid mitte samade väärtpaberite tagastamisega tagatiseandjale

382. Alljärgnev näide (Tabel 96) on järg näitele, mida sisaldab Tabel 94. Antud juhul tagastatakse üks muutuvtagatisena antud väärtpaberitest, kuid algelt antuga võrreldes suuremas koguses.

**Tabel 96. Neto riskipositsioon – algelt tehingupõhiselt tagatud ja seejärel tasaarvestatavate tehingute kogumisse kaasatud repotehingute muutuvtagatis samaväärsete, kuid mitte samade väärtpaberite tagastamisega tagatiseandjale**

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; </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	

**Tabel 96. Neto riskipositsioon – algselt tehingupõhiselt tagatud ja seejärel tasaarvestatavate tehingute kogumisse kaasatud repotehingute muutuvtagatis samaväärsete, kuid mitte samade väärtpaperite tagastamisega tagatiseandjale**

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

**Tabel 96. Neto riskipositsioon – algselt tehingupõhiselt tagatud ja seejärel tasaarvestatavate tehingute kogumisse kaasatud repotehingute muutuvtagatis samaväärsete, kuid mitte samade väärtpaperite tagastamisega tagatiseandjale**

No	Field	Example	XML Message
88	Collateral market value	50000000	<pre> &lt;LEI&gt;NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN&lt;/LEI&gt; &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;Scty&gt; &lt;Id&gt;DE0010877643&lt;/Id&gt; &lt;ClssfctnTp&gt;DBFTFR&lt;/ClssfctnTp&gt; &lt;QtyOrNmnlVal&gt; &lt;NmnlVal&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;50000000&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;50000000&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; &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; </pre>
89	Haircut or margin	0	
90	Collateral quality	INVG	
91	Maturity date of the security	22/04/2030	
92	Jurisdiction of the issuer	DE	
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	
94	Collateral type	GOVS	
95	Availability for collateral reuse	TRUE	
98	Action type	COLU	
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI2	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	
84	Collateral unit of measure		

**Tabel 96. Neto riskipositsioon – algselt tehingupõhiselt tagatud ja seejärel tasaarvestatavate tehingute kogumisse kaasatud repotehingute muutuvtagatis samaväärsete, kuid mitte samade väärtpaperite tagastamisega tagatiseandjale**

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

**Tabel 96. Neto riskipositsioon – algselt tehingupõhiselt tagatud ja seejärel tasaarvestatavate tehingute kogumisse kaasatud repotehingute muutuvtagatis samaväärsete, kuid mitte samade väärtpaperite tagastamisega tagatiseandjale**

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



**Tabel 96. Neto riskipositsioon – algselt tehingupõhiselt tagatud ja seejärel tasaarvestatavate tehingute kogumisse kaasatud repotehingute muutuvtagatis samaväärsete, kuid mitte samade väärtpaperite tagastamisega tagatiseandjale**

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



**Tabel 96. Neto riskipositsioon – algselt tehingupõhiselt tagatud ja seejärel tasaarvestatavate tehingute kogumisse kaasatud repotehingute muutuvtagatis samaväärsete, kuid mitte samade väärtpaberite tagastamisega tagatiseandjale**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &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;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;/AsstTp&gt;     &lt;/RpTrad&gt;   &lt;/CollData&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;IIIIIIIIIIIIIIIIIIII&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/Issr&gt; &lt;/JursdctnCtry&gt;IT&lt;/JursdctnCtry&gt; &lt;/Issr&gt; </pre>

**Tabel 96. Neto riskipositsioon – algselt tehingupõhiselt tagatud ja seejärel tasaarvestatavate tehingute kogumisse kaasatud repotehingute muutuvtagatis samaväärsete, kuid mitte samade väärtpaberite tagastamisega tagatiseandjale**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &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;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;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;/OthrPtyData&gt;       &lt;/RptgCtrPty&gt;     &lt;/CollUpd&gt;   &lt;/Rpt&gt; &lt;/Rpt&gt; </pre>

**Tabel 96. Neto riskipositsioon – algselt tehingupõhiselt tagatud ja seejärel tasaarvestatavate tehingute kogumisse kaasatud repotehingute muutuvtagatis samaväärsete, kuid mitte samade väärtpaperite tagastamisega tagatiseandjale**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &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;  &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>

5.4.7.5 Neto riskipositsioon – rahaline muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algselt tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse (Tabel 97)

383. See näide on variatsioon eelmistest näidetest, kus neto riskipositsiooni alusel anti muutuvtagatis väärtpaperite näol. Kolm VFTd tehingu kordumatute tunnuscodeidega UTI1, UTI2 ja UTI3 on tehingupõhiselt tagatud väärtpaperitega ja seejärel on vastaspooled kokku leppinud rahalises muutuvtagatises. Tagatiseandja annab riskipositsiooni katteks lisaraha.

Tabel 97. Neto riskipositsioon – rahaline muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algselt tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse			
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;/RpTrad&gt;     &lt;UnqTradldr&gt;UTI1&lt;/UnqTradldr&gt;     &lt;MstrAgrmt&gt;       &lt;Tp&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	
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
86	Price currency		
87	Price per unit	100	

**Tabel 97. Neto riskipositsioon – rahaline muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algelt tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse**

No	Field	Example	XML Message
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>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN</LEI> > </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>

**Tabel 97. Neto riskipositsioon – rahaline muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algelt tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse**

No	Field	Example	XML Message
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> </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> <Id>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI2	<Id>
3	Event date	24/04/2020	<LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI>
9	Master agreement	GMRA	</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}	<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>
88	Collateral market value	50000000	<CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
89	Haircut or margin	0	<Id>
90	Collateral quality	INVG	<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id>



**Tabel 97. Neto riskipositsioon – rahaline muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algelt tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse**

No	Field	Example	XML Message
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>
94	Collateral type	GOVS	</OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI>
98	Action type	COLU	</AgtLndr> </OthrPtyData>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	</CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	<RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender B	<UnqTradldr>UT12</UnqTradldr> <MstrAgrmt> <Tp>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI3	<Tp>GMRA</Tp> </Tp>
3	Event date	24/04/2020	</MstrAgrmt> </RpTrad>
9	Master agreement	GMRA	</LnData> <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>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	<Amt Ccy="EUR">50000000</Amt> </NmnlVal>
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	</QtyOrNmnlVal> <UnitPric>
84	Collateral unit of measure		<Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<MktVal Ccy="EUR">50000000</MktVal>
86	Price currency		<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn>

**Tabel 97. Neto riskipositsioon – rahaline muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algelt tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse**

No	Field	Example	XML Message
87	Price per unit	100	<Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty>
88	Collateral market value	50000000	<Issr> <Id>
89	Haircut or margin	0	<LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI> </Id>
90	Collateral quality	INVG	<JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry>
91	Maturity date of the security	22/04/2040	</Issr> <Tp>
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	MEQU	</Scty> </AsstTp>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd>
98	Action type	GOVS	<Id> </RpTrad> </CollData>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	... </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	
76	Cash collateral amount	2000000	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty>
77	Cash collateral currency	EUR	<OthrPtyData> <AgtLndr>
98	Action type	COLU	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData>

**Tabel 97. Neto riskipositsioon – rahaline muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algsetl tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt;   &lt;RpTrad&gt;     &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt;  &lt;UnqTradIdr&gt;UTI3&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;         &lt;Id&gt;NL0010877643&lt;/Id&gt;         &lt;ClssfctnTp&gt;DBFTFR       &lt;/ClssfctnTp&gt;       &lt;QtyOrNmnlVal&gt;         &lt;Qty&gt;50000000&lt;/Qty&gt;       &lt;/QtyOrNmnlVal&gt;       &lt;UnitPric&gt;         &lt;MntryVal&gt;           &lt;Amt             Ccy="EUR"&gt;10&lt;/Amt&gt;           &lt;/MntryVal&gt;         &lt;/UnitPric&gt;         &lt;MktVal           Ccy="EUR"&gt;50000000&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;DDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDD         &lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;       &lt;JurstdctnCtry&gt;NL&lt;/JurstdctnCtry&gt;       &lt;/Issr&gt;       &lt;Tp&gt;         &lt;Cd&gt;MEQU&lt;/Cd&gt;       &lt;/Tp&gt; </pre>

**Tabel 97. Neto riskipositsioon – rahaline muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algelt tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &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;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;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>

**Tabel 97. Neto riskipositsioon – rahaline muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algelt tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;AsstTp&gt;   &lt;Csh&gt;     &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;2000000&lt;/Amt&gt;     &lt;/Csh&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>

5.4.7.6 Muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algelt tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse. Antud päeval on positsioon neutraalne ja muutuvtagatist ei ole vaja

384. Tabel 98 arendab eeltoodud näidet (Tabel 97) edasi, kuid antud juhul seisneb oluline näidatav asjaolu selles, et päeva lõpus ei vahetata muutuvtagatist neto riskipositsiooni alusel tagamiseks. Teatamise loogika sarnaneb nulltagatisest teatamisega, mida käsitletakse jaos 5.4.4.

**Tabel 98. Neto riskipositsioon – muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algelt tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse. Antud päeval on positsioon neutraalne ja muutuvtagatist ei ole vaja**

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; </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	

**Tabel 98. Neto riskipositsioon – muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algselt tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse. Antud päeval on positsioon neutraalne ja muutuvtagatist ei ole vaja**

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

**Tabel 98. Neto riskipositsioon – muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algelt tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse. Antud päeval on positsioon neutraalne ja muutuvtagatist ei ole vaja**

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

**Tabel 98. Neto riskipositsioon – muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algelt tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse. Antud päeval on positsioon neutraalne ja muutuvtagatist ei ole vaja**

No	Field	Example	XML Message
83	Collateral quantity or V nominal amount	50000000	</Scty> </AsstTp>
84	Collateral unit of measure		<NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	</RpTrad> </CollData>
86	Price currency		... </CollUpd>
87	Price per unit	100	</Rpt> <Rpt>
88	Collateral market value	50000000	<CollUpd> <CtrPtyData>
89	Haircut or margin	0	<CtrPtyData> <RptgCtrPty>
90	Collateral quality	INVG	<Id>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id>
92	Jurisdiction of the issuer	FR	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI>
94	Collateral type	GOVS	</Id> </OthrCtrPty>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<OthrPtyData> <AgtLndr>
98	Action type	COLU	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	</OthrPtyData> </CtrPtyData>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	</CtrPtyData> <LnData>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI3	<UnqTradldr>UT12</UnqTradldr> <MstrAgrmt>
3	Event date	24/04/2020	<Tp> <Tp>GMRA</Tp>
9	Master agreement	GMRA	</Tp> </MstrAgrmt>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	</RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad>



**Tabel 98. Neto riskipositsioon – muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algselt tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse. Antud päeval on positsioon neutraalne ja muutuvtagatist ei ole vaja**

No	Field	Example	XML Message
75	Type of the collateral component	SECU	<AsstTp>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<Scty> <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>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric>
86	Price currency		<MktVal
87	Price per unit	100	Ccy="EUR">50000000</MktVal>
88	Collateral market value	50000000	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty>
89	Haircut or margin	0	<Issr> <Id>
90	Collateral quality	INVG	<LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI> </Id>
91	Maturity date of the security	22/04/2040	<JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry>
92	Jurisdiction of the issuer	NL	</Issr> <Tp>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<Cd>GOVS</Cd> </Tp>
94	Collateral type	GOVS	<AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	</Scty> </AsstTp>
98	Action type	COLU	<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>

**Tabel 98. Neto riskipositsioon – muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algselt tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse. Antud päeval on positsioon neutraalne ja muutuvtagatist ei ole vaja**

No	Field	Example	XML Message
3	Event date	24/04/2020	<pre> &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;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;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt;   &lt;/RpTrad&gt;   &lt;UnqTradldr&gt;UTI3&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;NL0010877643&lt;/Id&gt;       &lt;/Scty&gt;     &lt;/AsstTp&gt;   &lt;/RpTrad&gt;   &lt;ClssfctnTp&gt;DBFTFR&lt;/ClssfctnTp&gt;   &lt;QtyOrNmnlVal&gt;     &lt;NmnlVal&gt;       &lt;Amt         Ccy="EUR"&gt;50000000&lt;/Amt&gt;       &lt;/NmnlVal&gt;     &lt;/QtyOrNmnlVal&gt;     &lt;UnitPric&gt;       &lt;Ptrg&gt;100&lt;/Ptrg&gt;     &lt;/UnitPric&gt; </pre>
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	
75	Type of the collateral component	CASH	
76	Cash collateral amount	0	
77	Cash collateral currency	EUR	
98	Action type	COLU	

**Tabel 98. Neto riskipositsioon – muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algselt tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse. Antud päeval on positsioon neutraalne ja muutuvtagatist ei ole vaja**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;MktVal Ccy="EUR"&gt;50000000&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;DDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDD &lt;/LEI&gt;  &lt;/Id&gt;  &lt;Jurisdiction&gt;NL&lt;/Jurisdiction&gt; &lt;/Issr&gt; &lt;Tp&gt; &lt;Cd&gt;MEQU&lt;/Cd&gt; &lt;/Tp&gt;  &lt;AvblForCollReuse&gt;true&lt;/AvblForCollReuse&gt;  &lt;/Scty&gt; &lt;/AsstTp&gt;  &lt;NetXprCollstnInd&gt;true&lt;/NetXprCollstnInd&gt;  &lt;HrcutOrMrgn&gt;0&lt;/HrcutOrMrgn&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;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; </pre>

**Tabel 98. Neto riskipositsioon – muutuvtagatis repotehingute puhul, mis algselt tagati tehingupõhiselt ja seejärel kaasati tasaarvestatavate tehingute kogumisse. Antud päeval on positsioon neutraalne ja muutuvtagatist ei ole vaja**

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

#### 5.4.8 Ettemakstud tagatis väärtpaperite laenamise tehingu korral

385. Neto riskipositsiooni alusel tagamise korral tagatise jaotusest teatamisel tuleks tagatise kohta esitatud teabe ajakohastamisel märkida vastaspoolte juriidilise isiku tunnused, raamleping, tagatise väärtuspäev ja tagatise konkreetne jaotus, et tagatise teabe ajakohastamist oleks võimalik siduda olemasolevate VFTdega. Väli 2.74 „Tagatise väärtuskuupäev“ on kohaldatav ainult väärtpaperite laenamise tehingute kontekstis.

386. Sündmuse kuupäeva väljal märgitakse eeldatav tagatise arvelduspäev. Algses tehinguteates ja tagatise ajakohastamise teates esitatud vastaspoolte juriidilise isiku tunnuste, raamlepingu ja kuupäevaväljade võrdlemisel on võimalik kindlaks teha, milliste

tehingute kohta netojäägi tagatise ajakohastamine kehtib. Allpool esitatud näites (Tabel 99) tuleks tagatisest teatada eeldatud arvelduse alusel, mis leidis aset 23.4.2020 ja mis on esitatud väljal 2.3 „Sündmuse kuupäev“. Väljal 2.74 „Tagatise väärtuspäev“ märgitakse kuupäev, alates millest ajakohastatud teave tagatise kohta kehtib tagasimaksmata laenude suhtes (st alates 24.4.2020 ei ole tagatis enam „ettemakstud“). Seega selleks, et teha kindlaks, milliste VFTde kohta tagatise kohta esitatud ajakohastatud teave kehtib, seostatakse tagatise väärtuspäev nende VFTde väärtuspäeva ja tähtpäevaga, mille vastaspooltel on samad juriidilise isiku tunnused ja millel on sama raamleping.

Tabel 99. Ettemakstud tagatis			
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;             &lt;CollValDt&gt;2020-04- 24&lt;/CollValDt&gt;           &lt;AsstTp&gt;             &lt;Scty&gt;               &lt;Id&gt;DE0010877643&lt;/Id&gt;             &lt;/Scty&gt;           &lt;/AsstTp&gt;         &lt;/CollData&gt;       &lt;/CollUpd&gt;     &lt;/Rpt&gt;   &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&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	
86	Price currency		
87	Price per unit	102	
88	Collateral market value	102000000	
89	Haircut or margin	2	
90	Collateral quality	INVG	
91	Maturity date of the security	2030-04-22	
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	

**Tabel 99. Ettemakstud tagatis**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;LEI&gt;NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN &lt;/LEI&gt;          &lt;/Id&gt;  &lt;JurisdictionCtry&gt;DE&lt;/JurisdictionCtry&gt;         &lt;/Issr&gt;         &lt;Tp&gt;         &lt;Cd&gt;GOVS&lt;/Cd&gt;         &lt;/Tp&gt;  &lt;AvblForCollReuse&gt;true&lt;/AvblForCollReuse&gt;          &lt;/Scty&gt;         &lt;/AsstTp&gt;         &lt;/Collsd&gt;         &lt;/SctiesLndg&gt;         &lt;/CollData&gt;          ...          &lt;/CollUpd&gt;         &lt;/Rpt&gt;         &lt;/TradData&gt;         &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.4.9 Kliiritud tehingute portfell

387. Välja 2.97 „Portfelli tunnuskood“ täitmisel peaksid vastaspoolel tagama oma teadetes järjepidevalt sama tunnuskoodi kasutamise. Kui tunnuskoodiga tähistatakse tehinguid tagavat portfelli, mis sisaldab ka tuletisinstrumente, peaksid vastaspoolel kasutama sama koodi, mida nad kasutavad Euroopa turu infrastruktuuri määruse alusel edastatavates teadetes.
388. Portfelli tunnuskood ei pea olema universaalselt kordumatu, kuid seda tuleb kasutada järjepidevalt. Kuna välja 2.97 sisaldab väärtust, mille suhtes ei kohaldata kooskõlastavat võrdlemist, ei pea tehingu vastaspoolel selles kokku leppima.

### 5.5 Võimendustagatise andmed

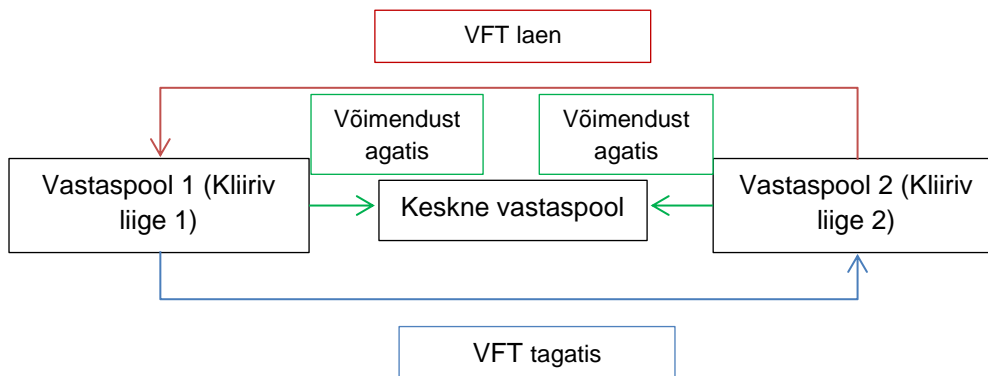
389. Selles jaos sisalduvad andmed peaksid esitama kõik vastaspoolel, kelle VFTd on keskselt kliiritud, välja arvatud juhul, kui nende vastaspoolte suhtes kohaldatakse artikli 4 lõike 2 kohast kohustuslikku delegerimist; sel juhul peaks teated edastama nimetatud artiklis määratletud üksus.
390. Keske vastaspoole teenuste kasutamiseks esitavad nii kliiriv liige 1 kui ka kliiriv liige 2 keskele vastaspoolele võimendustagatise. Võimendustagatis hõlmab alustamise tagatist ja muutuvtagatist<sup>16</sup>. Võimendustagatis, mille kliirivad liikmed keskele vastaspoolele

<sup>16</sup> Võib esineda ka ülemäärane võimendustagatis, mis on nõutud summat ületav tagatise osa.

annavad, ei ole otseselt seotud VFT tagatisega. Keskne vastaspool kasutab võimendustagatist vastavate kliirivate liikmete jaoks kliiritavast tehingust tulenevate riskide katmiseks. Võimendustagatis, mille kliirivad liikmed kesksele vastaspoolele annavad, võib katta ka riske, mis tulenevad muudest tehingutest, näiteks tuletisinstrumentidega tehtavatest tehingutest.

### 5.5.1 Kliirivatest liikmetest vastaspoolte vahele paigutatud keskne vastaspool

Juhtum 1. Kliirivatest liikmetest vastaspoolte vahele paigutatud keskne vastaspool

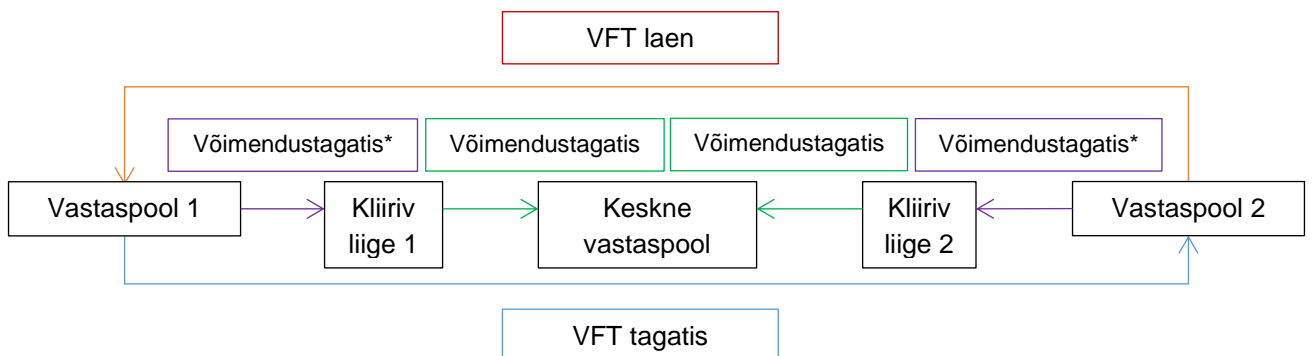


391. Kui vastaspool ise ei ole kliiriv liige, võib võimendustagatis, mille ta annab kliirivale liikmele (vt „võimendustagatis“ juhtumis 2 allpool), erineda kliiriva liikme poolt kesksele vastaspoolele antud võimendustagatisest.

### 5.5.2 Keskne vastaspool, kes paigutub kahe vastaspoolte vahele, kes ei ole kliirivad liikmed

- 

Juhtum 2. Keskne vastaspool, kes paigutub kahe vastaspoolte vahele, kes ei ole kliirivad liikmed



### 5.5.3 Võimendustagatise kohta teabe edastamine

392. Kui on olemas kolmas võimendustagatise vahetamise liik, peaksid vastaspoole leppima kokku selle järjepidevas esitamises kas alustamise tagatisena või muutuvtagatisena.
393. Alustamise tagatis, muutuvtagatis ja ülemäärane tagatis esitatakse ühe numbrina, mis hõlmab kõigi saadud/antud/panditud varaklasside (väärtuskärpe-eelset) brutoväärtust. Kui kliiritavas portfellis pole tuletisinstrumente, on soovitatav lähtuda keskse vastaspoole alusvaluutat; kui aga portfell sisaldab tuletisinstrumente, millest tuleb teatada Euroopa turu infrastruktuuri määruse alusel, tuleks kasutada sama valuutat.
394. Võimendustagatise kohta esitatav teave on kohaldatav ainult keskse vastaspoole kliiritud VFTde puhul. Näites, mida kirjeldab Tabel 100, kasutab üksus tagamiseks sama portfelli nagu Euroopa turu infrastruktuuri määruse alusel. Teavitav vastaspool (vastaspool J), kes on ühtlasi ka kliiriv liige, kasutab vastaspoole D osutatavaid delegeeritud teatamisteenuseid. Teatatakse 1 000 000 euro suurusest alustamise tagatisest ja 300 000 euro suurusest muutuvtagatisest kesksele vastaspoolele O. Samuti teatab vastaspool ülemäärasest tagatisest summas 100 000 eurot.

Tabel 100. Võimendustagatise andmed			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<SciesFincgRptgTxMrgnDataRpt> <TradData> <Rpt> <TradUpd> <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> <EvtDt>2020-04-23</EvtDt> <CtrPty> <RptgCtrPty> <LEI>CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC</LEI> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <LEI>BBBBBBBBBBB1111111111</LEI> </OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI>CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC</LEI> </NttyRspnsblForRpt> <RptSubmitgNtty> <LEI>11223344556677889900</LEI>
2	Event date	2020-04-23	
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty D	
4	Reporting Counterparty	{LEI} of counterparty J	
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty J	
6	Other counterparty	{LEI} of CCP O	
7	Portfolio code	EMIRSFTRC ODE1	
8	Initial margin posted	1000000	
9	Currency of the initial margin posted	EUR	
10	Variation margin posted	300000	
11	Currency of the variation margins posted	EUR	
12	Initial margin received		



Tabel 100. Võimendustagatise andmed			
No	Field	Example	XML Message
13	Currency of the initial margin received		</RptSubmitgNtty> </CtrPty>
14	Variation margin received		<CollPrftfIld>EMIRSFTRCODE1</CollPrftfIld>
15	Currency of the variation margins received		<PstdMrgnOrColl> <InitlMrgnPstd
16	Excess collateral posted	100000	Ccy="EUR">1000000</InitlMrgnPstd> <VartnMrgnPstd
17	Currency of the excess collateral posted	EUR	Ccy="EUR">300000</VartnMrgnPstd> <XcssCollPstd
18	Excess collateral received		Ccy="EUR">100000</XcssCollPstd> </PstdMrgnOrColl> <RcvdMrgnOrColl>
19	Currency of the excess collateral received		... </RcvdMrgnOrColl> </TradUpd>
20	Action type	MARU	</Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxMrgnDataRpt>

## 5.6 Uuesti kasutamise, raha reinvesteerimise ja rahastamisallikate andmed

395. Nagu rõhutatakse regulatiivsetes tehnilistes standardites, erineb teatamise tehniliste standardite lisa tabeli 4 aluseks olev loogika teiste tabelite loogikast ja seda tabelit ei kasutata kooskõlastavaks võrdlemiseks, kuna sealset teavet ei saa siduda üksikute tehingutega. Selle asemel teatatakse mitterahalise tagatise uuesti kasutamisest, rahalise tagatise reinvesteerimisest ja rahastamisallikatest teavitava üksuse tasandil koondsummadena.
396. Kui andmeid tagatise uuesti kasutamise, raha reinvesteerimise ja rahastamisallikate kohta esitatakse erinevatel ajahetkedel, tuleks teavitava vastaspoole ja teatamise eest vastutava üksuse antud kombinatsiooni puhul ainult esimeses teates märkida toiminguliigiks „NEWT“, olenemata sellest, milliseid välju see teade hõlmab. Selle kombinatsiooni järgmistes teadetes tuleks kasutada asjakohast toiminguliiki.

### 5.6.1 Tagatise uuesti kasutamine

397. Tagatise uuesti kasutamisest tuleb teatada finantsstabiilsuse nõukogu raamistikus<sup>17</sup> kokku lepitud ja regulatiivsetes tehnilistes standardites esitatud valemi abil. Tavaliselt ei erista turuosalised oma vara vastaspooltelt saadud tagatistest (tingimusel, et tagatiseväärtpabereid võib uuesti kasutada). Seetõttu on finantsstabiilsuse nõukogu valemi

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

aluseks eeldus, et üksused peaksid esitama uuesti kasutatava tagatise hinnangulise suuruse, lähtudes saadud tagatise osakaalust võrreldes nende endi varaga.

398. Teatamiskohustus kehtib ainult VFTde puhul, mis tähendab, et see ei hõlma muude tehingutega seoses antud või saadud tagatisväärtpabereid. Teisisõnu tuleks valemist välja jätta tagatised, mis on antud seoses võimendustagatise arvestamisega tuletisinstrumentidega tehtavates tehingutes või muudes SFTRi kohaldamisalast välja jäävates tehingutes, mis on loetletud jaos 4.2.1.
399. See tähendab ka, et uuesti kasutamise valemi komponentidest ei tuleks ESMA-le eraldi esitada. Selle asemel peaksid teavitavad üksused esitama ainult hinnangu, mis tuleneb valemi rakendamisest ISIN-koodi tasandil.
400. Kui uuesti kasutamist pole tegelikult toimunud, tuleks teate vastav väli jätta tühjaks. Kui tagatist enam uuesti ei kasutata, esitatakse teade toiminguliigiga „uuesti kasutamise ajakohastamine“ (REUU) ja väärtuseks märgitakse 0.
401. Teatamise delegeerimise korral ei vastuta vastaspool, kellele teatamine on delegeeritud, tagatise hinnangulisest uuesti kasutamisest teatamise eest. Finantssektorivälised vastaspoolel peavad hinnangulise uuesti kasutamise ise arvutama ja õigeaegselt esitama oma hinnangu teatamise eest vastutavale vastaspoolele.
402. Kui vastaspoolel eelistavad teatada hinnangulise uuesti kasutamise asemel tegelikust uuesti kasutamisest, võivad nad seda teha.
403. Finantsstabiilsuse nõukogu raamistikus on mõiste „tagatis“ laias laastus määratletud selle majandusliku funktsiooni järgi, st selle all mõeldakse väärtpabereid olenemata tehingu õiguslikust struktuurist. Ulatuse mõttes tähendab see, et *saadud ja uuesti kasutatav tagatis* hõlmab järgmist:
  - a. pöördrepotehingutes ja ostu-tagasimüügitehingutes tagatisena saadud väärtpaberid;
  - b. väärtpaberite laenuks võtmise tehingutes laenuks võetud väärtpaberid;
  - c. väärtpaberite laenuks andmise tehingutes tagatisena saadud väärtpaberid;
  - d. väärtpaberid, mis on saadud lisatagatisena VFTdega seotud muutuvtagatise nõuete täitmiseks.
404. Panditud alustamise tagatise, mis on eraldatud ja immobiliseeritud (nt tuletisinstrumentide kontekstis) ning mida seetõttu ei saa uuesti kasutada, ei tohiks hindamisel arvesse võtta.
405. Võimenduslaenu andmisel ei sõltu tagatise uuestikasutatavus ainult tehingus kasutatava tagatiskokkuleppe liigist, vaid ka peamaakleri ja tema kliendi vahel kokku lepitud lepingulistest limiitidest (uuesti tagatiseks seadmise limiidist). See limiit arvutatakse kindla protsendina päevasest võimenduslaenu jäägist. Tagatise uuesti kasutamiseks tuleb uuesti tagatiseks seatavad väärtpaberid kanda limiidi piires kõigepealt kliendi kontolt peamaakleri kontole. ESMA teeb ettepaneku, et uuesti kasutamise valemi alusel arvutamisel tuleks *saadud ja uuesti kasutatavast tagatise*st välja arvata tagatisväärtpaberid, mida ei saa uuesti tagatiseks seadmise lepingulise limiidi tõttu kanda peamaakleri kontole. Hoiustatud, kuid määramata väärtpabereid ei tohiks arvesse võtta. Selliste väärtpaberite arvessevõtmine tooks kaasa tegelikult uuesti kasutatava tagatise ülehindamise.

406. Eeltoodust tulenevalt hõlmab antud tagatis järgmist:
- repotehingutes ja müügi-tagasiostutehingutes tagatiseks antud väärtpaberid;
  - laenatud väärtpaberid;
  - väärtpaberite laenuks võtmise tehingutes tagatiseks antud väärtpaberid;
  - väärtpaberid, mis on antud tagatiseks VFTdega seotud muutuvtagatise nõuete täitmiseks.
407. Väärtpaberid, mis on saadud või antud SFTRi kohaldamisalast välja jäävates tehingutes, sealhulgas Euroopa Keskpankade Süsteemi vastaspooltega tehtavates VFTdes, tuleks uuesti kasutamise valemist välja jätta.
408. Keskset vastaspooleid peaksid oma uuesti kasutamise hinnangutest jätma välja tagatisväärtpaberid, mida kantakse kliirivate liikmete vahel üle nende keskse kliirimise tegevuse raames. See puudutab nii „saadud tagatise“ kui ka „uuesti kasutatud tagatise“ komponente. Nende tagatisväärtpaberite puhul ei toimu keskse vastaspoole poolt uuesti kasutamist kui niisugust, kuna väärtpaberite ülekandmine kajastab pigem uuendamisprotsessi, mis leiab aset siis, kui keskne vastaspool paigutub kahe algse vastaspoole vahele. Võimendustagatiseks saadud tagatisväärtpabereid tuleks vastavalt kohaldatavusele hinnangutes arvesse võtta ja keskset vastaspooleid peaksid teatama nende muu tegevuse raames toimuvast uuesti kasutamisest. See hõlmab sularahahaldust ja kõiki muid teenuseid või mehhanisme (nt väärtpaberite pöördlaenu), mis kesketel vastaspooltel võivad olla.
409. Finantsstabiilsuse nõukogu raamistikku kuuluvad tagatise uuesti kasutamise moodsid<sup>18</sup> arvutavad välja riiklikud või ülemaailmsed asutused tagatiste uuesti kasutamise andmete alusel, millest üksused on teatanud. Uuesti kasutamise määra jaoks peavad asutused arvutama välja nimetaja, tuginedes üksuste poolt tabelis 2 esitatud andmetele.

#### 5.6.1.1 Väärtpaberite uuesti kasutamine finantssektori vastaspoole või muu kui VKEst finantssektorivälise vastaspoole poolt, ilma teatamise delegeerimiseta

410. Tabel 101 illustreerib olukorda, kus vastaspool B teatab väärtpaberite uuesti kasutamisest summas 10 000 000 eurot; väärtpaberite ISIN-kood on IT00BH4HKS39.

Tabel 101. Väärtpaberite uuesti kasutamine finantssektori vastaspoole või muu kui VKEst finantssektorivälise vastaspoole poolt, ilma teatamise delegeerimiseta			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd> ... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm>
2	Event date	2020-04-23	
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty B	

<sup>18</sup>9 Vt mitterahaliste tagatiste uuesti kasutamist käsitleva finantsstabiilsuse nõukogu raamistiku 4. jagu.

Tabel 101. Väärtpaberite uuesti kasutamine finantssektori vastaspoole või muu kui VKEst finantssektorivälise vastaspoole poolt, ilma teatamise delegerimiseta			
No	Field	Example	XML Message
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty B	<CtrPtyData> <RptSubmitgNtty>
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty B	<LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty>
6	Type of collateral component	SECU	<LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </RptgCtrPty>
7	Collateral component	{ISIN}	<NttyRspnsblForRpt>
8	Value of reused collateral		<LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
9	Estimated reuse of collateral	10000000	</CtrPtyData> <CollCmpnt>
10	Reused collateral currency	EUR	<Scty> <ISIN>IT00BH4HKS39</ISIN> <ReuseVal> <Estmtd
18	Action type	REUU	Ccy="EUR">10000000</Estmtd> </ReuseVal> </Scty> </CollCmpnt> <EvtDt>2020-04-23</EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData>  </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt>

#### 5.6.1.2 Väärtpaberite uuesti kasutamine finantssektori vastaspoole või muu kui VKEst finantssektorivälise vastaspoole poolt, teatamise delegerimisega

411. Tabel 102 illustreerib olukorda, kus vastaspool A delegerib teatamise vastaspoolele B, kes teatab väärtpaberite uuesti kasutamisest summas 10 000 000 eurot; väärtpaberite ISIN-kood on IT00BH4HKS39.

Tabel 102. Väärtpaberite uuesti kasutamine finantssektori vastaspoole või muu kui VKEst finantssektorivälise vastaspoole poolt, teatamise delegerimisega			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData>
2	Event date	2020-04-23	<Rpt> <CollReuseUpd>

Tabel 102. Väärtpaberite uuesti kasutamine finantssektori vastaspoole või muu kui VKEst finantssektorivälise vastaspoole poolt, teatamise delegerimisega			
No	Field	Example	XML Message
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty B	... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm>
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	<CtrPtyData> <RptSubmitgNtty>
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty>
6	Type of collateral component	SECU	<LEI>12345678901234500000</LEI> </RptgCtrPty>
7	Collateral component	{ISIN}	<NttyRspnsblForRpt>
8	Value of reused collateral		<LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
9	Estimated reuse of collateral	10000000	</CtrPtyData> <CollCmpnt>
10	Reused collateral currency	EUR	<Scty> <ISIN> IT00BH4HKS39</ISIN> <ReuseVal> <Estmtd
18	Action type	REUU	Ccy="EUR">10000000</Estmtd> </ReuseVal> </Scty> </CollCmpnt> <EvtDt>2020-04-23</EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData>  </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt>

### 5.6.1.3 Väärtpaberite uuesti kasutamine VKEst finantssektorivälise vastaspoole poolt, kui vastaspooli on üks

412. Tabel 103 illustreerib olukorda, kus vastaspool C on VKEst finantssektorivälise vastaspool, kes on sõlminud VFTd ainult ühe üksusega – vastaspoolega B (finantssektori vastaspool). Vastaspool B teatab väärtpaberite uuesti kasutamisest summas 10 000 000 eurot; väärtpaberite ISIN-kood on IT00BH4HKS39.

**Tabel 103. Väärtpaberite uuesti kasutamine VKEst finantssektorivälise vastaspoole poolt, kui vastaspooli on üks**

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;ABCDEFGHIJKLMNQRST&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;             ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;           &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;/SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt&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}	
8	Value of reused collateral		
9	Estimated reuse of collateral	10000000	
10	Reused collateral currency	EUR	
18	Action type	REUU	

#### 5.6.1.4 Väärtpaberite uuesti kasutamine VKEst finantssektorivälise vastaspoole poolt, kui vastaspooli on mitu

413. Tabel 104 ja Tabel 105 sisaldavad teavet, mis tuleks esitada väärtpaberite uuesti kasutamisel VKEst finantssektorivälise vastaspoole poolt, kui vastaspooli on mitu. Selles näites on kaks tabelit. Kuid tabelleid võib olla sama palju kui vastaspooli, kellega VKEst finantssektorivälise vastaspool on VFTd sõlminud ja hiljem tagatist uuesti kasutanud.
414. Selles näites on vastaspool C VKEst finantssektorivälise vastaspool, kes on sõlminud VFTd kahe üksusega – vastaspoolega B ja vastaspoolega D. Vastaspool B teatab

väärtpaberite uuesti kasutamisest summas 10 000 000 eurot; väärtpaberite ISIN-kood on IT00BH4HKS39 (Tabel 104). Vastaspool D teatab väärtpaberite uuesti kasutamisest summas 2 000 000 eurot; väärtpaberite ISIN-kood on FR00BH4HKS3 (Tabel 105).

Tabel 104. Väärtpaberite uuesti kasutamine VKEst finantssektorivälise vastaspoole poolt, kui vastaspooli on mitu (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>
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty C	<CtrPtyData> <RptSubmitgNtty>
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty B	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty>
6	Type of collateral component	SECU	<LEI>123456789ABCDEFGHIJK</LEI> </RptgCtrPty>
7	Collateral component	{ISIN}	<NttyRspnsblForRpt>
8	Value of reused collateral		<LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</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>

Tabel 105. Väärtpaberite uuesti kasutamine VKEst finantssektorivälise vastaspoole poolt, kui vastaspooli on mitu (2)			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T18:41:07Z	<SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd> ... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> <LEI>11223344556677889900</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty> <LEI>123456789ABCDEFGHIJK</LEI> </RptgCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI>11223344556677889900</LEI> </NttyRspnsblForRpt> </CtrPtyData> <CollCmpnt> <Scty> <ISIN> FR00BH4HKS3</ISIN> <ReuseVal> <Estmtd Ccy="EUR">2000000</Estmtd> </ReuseVal> </Scty> </CollCmpnt> <EvtDt>2020-04-23</EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt>
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	{LEI} of counterparty D	
6	Type of collateral component	SECU	
7	Collateral component	{ISIN}	
8	Value of reused collateral		
9	Estimated reuse of collateral	2000000	
10	Reused collateral currency	EUR	
18	Action type	REUU	

## 5.6.2 Rahalise tagatise reinvesteerimine

415. Vastaspooled peaksid teatama rahalise tagatise reinvesteerimisest, kui raha kasutatakse väärtpaberite laenamise tehingutes tagatisena ja reinvesteeritakse kas otse laenuandja (tagatisesaaja) poolt või laenuandja nimel volitatud kaupleja poolt. Reinvesteerimisest teatamine ei sõltu finantssektori vastaspoole liigist, nt maakler, edasimüüja, investeerimisühing jne. Teatamine on seotud tema positsiooniga asjaomastes VFTdes.



416. Reinvesteerimise liik (väli 4.12) ja reinvesteeritud rahasumma (väli 4.13) tuleks esitada reinvesteeritud rahalise tagatise valuutade kaupa (väli 4.14). Kuna eeldatakse, et vastaspoolad esitavad ühe reinvesteerimise intressimäära, seda valuutade kaupa jaotamata, tuleks reinvesteerimise intressimäär (väli 4.11) arvutada kaalutud keskmise määrana reinvesteeritud rahasumma (väli 4.13) alusel pärast ümberarvestamist reinvesteeritud raha valuutasse (väli 4.14).
417. Arvesse tuleb võtta ka raha, mis on saadud tagatiseks muul viisil kui keskselt kliiritavates VFTdes ja seejärel reinvesteeritud.
418. Võimenduslaenude andmisega seoses saadud ja hiljem reinvesteeritud rahast ei peaks teatama rahalise tagatise reinvesteerimisena. Võimenduslaenude andmise kontekstis rahalisest tagatisest teatamise kohta lugege jaost 5.3.16.
419. Kui teavitav vastaspool ei suuda eristada oma raha ja rahalise tagatisena saadud raha, tuleks reinvesteeritud rahasumma arvutada sama meetoodika abil nagu mitterahalise tagatise korral.
420. Andmed kesksete vastaspoolte saadud rahaliste tagatiste (kesksete vastaspoolte tagatisnõuete alusel) ja rahaliste tagatiste reinvesteerimise kohta on juba avalikult kättesaadavad makse- ja arveldussüsteemide komitee/Rahvusvahelise Väärtpaberijärelevalve Organisatsiooni kvantitatiivsest avalikustatavast teabest<sup>19</sup>. Ehkki SFTRi alusel edastatakse teateid iga päev (mitte kvartaalselt, nagu kvantitatiivse avalikustatava teabe puhul), tähendab kogutava teabe võrreldav detailsus ja liik, et täiendav teatamine ei ole vajalik. Kesksete vastaspoolte poolt rahaliste tagatiste reinvesteerimine jäetakse seega välja.
421. Rahaliste tagatiste reinvesteerimisega seoses märgitakse veel seda, et vastaspoolad peaksid võtma arvesse ka võimalikke edaspidiseid juhiseid või selgitusi, mida finantsstabiilsuse nõukogu selles kontekstis annab.

#### 5.6.2.1 Raha reinvesteerimine finantssektori vastaspoole või muu kui VKEst finantssektorivälise vastaspoole poolt, ilma teatamise delegeerimiseta

422. Tabel 106 illustreerib olukorda, kus vastaspool B teatab ise raha reinvesteerimisest repoturul summas 100 000 eurot 1,5 % intressimääraga.

Tabel 106. Raha reinvesteerimine finantssektori vastaspoole või muu kui VKEst finantssektorivälise vastaspoole poolt, ilma teatamise delegeerimiseta			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd>
2	Event date	2020-04-23	

<sup>19</sup> CPMI-IOSCO, veebruar 2015, „Public quantitative disclosure standards for central counterparties“: <https://www.bis.org/cpmi/publ/d125.pdf>.

Tabel 106. Raha reinvesteerimine finantssektori vastaspoole või muu kui VKEst finantssektorivälise vastaspoole poolt, ilma teatamise delegerimiseta			
No	Field	Example	XML Message
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty B	... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm>
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty B	<CtrPtyData> <RptSubmitgNtty>
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty B	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty>
11	Reinvestment Rate	1.5	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptgCtrPty>
12	Type of re-invested cash investment	REPM	<NttyRspnsblForRpt>
13	Re-invested cash amount	100000	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
14	Re-invested cash currency	EUR	</CtrPtyData> <CollCmpnt> <Csh> <RinvstdCsh> <Tp>REPM</Tp> <RinvstdCshAmt Ccy="EUR">100000</RinvstdCshAmt> </RinvstdCsh>
18	Action type	REUU	<CshRinvstmtRate>1.5</CshRinvstmtRate> </Csh> </CollCmpnt> <EvtDt>  2020-04-23 </EvtDt>  ... </CollReuseUpd>  </Rpt> </TradData>  </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt>

#### 5.6.2.2 Raha reinvesteerimine finantssektori vastaspoole või muu kui VKEst finantssektorivälise vastaspoole poolt, teatamise delegerimisega

423. Tabel 107 illustreerib olukorda, kus vastaspool A delegeerib raha reinvesteerimisest teatamise vastaspoolele B. Vastaspool B teatab raha reinvesteerimisest repoturul summas 100 000 eurot 1 % intressimääraga.

**Tabel 107. Raha reinvesteerimine finantssektori vastaspoole või muu kui VKEst finantssektorivälise vastaspoole poolt, teatamise delegerimisega**

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 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> </SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt>

5.6.2.3 Raha reinvesteerimine VKEst finantssektorivälise vastaspoole poolt, kui vastaspooli on üks

424. Tabel 108 illustreerib olukorda, kus vastaspool C on VKEst finantssektorivälise vastaspool, kes on sõlminud VFTd ainult ühe üksusega – vastaspoolega B. Vastaspool B

teatab rahalise tagatise reinvesteerimisest repoturul summas 100 000 eurot 1 % intressimääraga.

Tabel 108. Raha reinvesteerimine VKEst finantssektorivälise vastaspoole poolt, kui vastaspooli on üks			
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;/RinvstdCsh&gt;             &lt;/Csh&gt;             &lt;CshRinvstmtRate&gt;1&lt;/CshRinvstmtRate&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;/SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt&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	

5.6.2.4 Raha reinvesteerimine VKEst finantssektorivälise vastaspoole poolt, kui vastaspooli on mitu

425. Tabel 109 ja Tabel 110 sisaldavad teavet, mis tuleks esitada tagatise reinvesteerimisel VKEst finantssektorivälise vastaspoole poolt, kui vastaspooli on mitu. Selles näites on kaks tabelit. Kuid tabeleid võib olla sama palju kui vastaspooli, kellega VKEst finantssektorivälise vastaspool on VFTd sõlminud ja hiljem rahalise tagatise reinvesteerinud.
426. Selles näites on vastaspool C VKEst finantssektorivälise vastaspool, kes on sõlminud VFTd kahe üksusega – vastaspoolega B ja vastaspoolega D. Vastaspool B teatab rahalise tagatise reinvesteerimisest summas 100 000 eurot (Tabel 109). Vastaspool D teatab rahalise tagatise reinvesteerimisest summas 100 000 eurot (Tabel 110).

Tabel 109. Raha reinvesteerimine VKEst finantssektorivälise vastaspoole poolt, kui vastaspooli on mitu (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;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	

**Tabel 109. Raha reinvesteerimine VKEst finantssektorivälise vastaspoole poolt, kui vastaspooli on mitu (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>

**Tabel 110. Raha reinvesteerimine VKEst finantssektorivälise vastaspoole poolt, kui vastaspooli on mitu (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	

**Tabel 110. Raha reinvesteerimine VKEst finantssektorivälise vastaspoole poolt, kui vastaspooli on mitu (2)**

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>

### 5.6.3 Mitterahalise tagatise uuesti kasutamise ja raha reinvesteerimise puudumine

427. Tabel 111 illustreerib teate andmeväljade täitmist juhul, kui mitterahalist tagatist ei kasutata uuesti ja rahalist tagatist ei reinvesteerita. Vastaspooled peaksid seega esitama teabe nii, nagu Tabel 111 kirjeldab.

428. Sellisel juhul tuleks regulatiivsete tehniliste standardite tabeli 4 väljal 12 „Reinvesteeritud rahalise investeeringu liik“ märkida „muu“.

**Tabel 111. Rahalise tagatise uuesti kasutamise puudumine**

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 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> <RinvstdCshAmt Ccy="EUR">0</RinvstdCshAmt>

**Tabel 111. Rahalise tagatise uuesti kasutamise puudumine**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &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 Rahastamisallikad

429. Väljad, mis käsitlevad rahastamisallikaid, tuleks täita ainult tagasimaksmata võimenduslaenu või lühikese positsiooni turuväärtuse korral. Teavitavad vastaspoole või teatamise eest vastutavad üksused peaksid selle teabe esitama teavitava vastaspoole, mitte üksikute tehingute tasandil.
430. Tabel 112 illustreerib olukorda, kus vastaspool B teatab repoturult saadavast 5 000 000 eurost, mida kasutatakse rahastamisallikana võimenduslaenude finantseerimiseks.

**Tabel 112. Rahastamisallikad**

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;ABCDEFGHJKLMNOPQRST&lt;/LEI&gt; &lt;/RptSubmitgNtty&gt; &lt;RptgCtrPty&gt; &lt;LEI&gt;ABCDEFGHJKLMNOPQRST&lt;/LEI&gt; &lt;/RptgCtrPty&gt; &lt;NttyRspnsblForRpt&gt; &lt;LEI&gt;ABCDEFGHJKLMNOPQRST&lt;/LEI&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 B	
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty B	
15	Funding sources	REPO	
16	Market value of the funding sources	5000000	
17	Funding sources currency	EUR	



Tabel 112. Rahastamisallikad			
No	Field	Example	XML Message
18	Action type	REUU	<pre> &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;CollCmpnt&gt; ... &lt;/CollCmpnt&gt; &lt;EvtDt&gt; 2020-04-23 &lt;/EvtDt&gt; &lt;FndgSrc&gt; &lt;Tp&gt;REPO&lt;/Tp&gt; &lt;MktVal Ccy="EUR"&gt;5000000&lt;/MktVal&gt; &lt;/FndgSrc&gt; &lt;/Crrctn&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt&gt; </pre>

## 6 Tagasiside esitatud teabe tagasilükkamise korral

431. Andmete kogumise regulatiivsete tehniliste standardite artikli 1 lõikes 1 nähakse ette mitmesugused kontrollid, mille kauplemistehabehoidla peab läbi viima, et veenduda SFTRI artikli 4 alusel teatatud VFTde andmete õigsuses ja täielikkuses.
432. Kauplemistehabehoidla peaks tagasilükkamise kohta tagasisidet andma järgmiste tagasilükkamiskategooriate kohaselt:
- esitatud teabe skeemi valideerimine vastavalt andmete kogumise regulatiivsete tehniliste standardite artikli 1 lõike 1 punktile b;
  - teadet esitava üksuse volitus/luba vastavalt andmete kogumise regulatiivsete tehniliste standardite artikli 1 lõike 1 punktile c;
  - esitatud teabe loogiline valideerimine vastavalt andmete kogumise regulatiivsete tehniliste standardite artikli 1 lõike 1 punktidele d–j;
  - tegevuse või esitatud teabe sisu valideerimine vastavalt andmete kogumise regulatiivsete tehniliste standardite artikli 1 lõike 1 punktile k, mis on kajastatud valideerimiseeskirjades, ja käesolevatele suunistele.
433. Tuleks tähele panna, et kauplemistehabehoidla autendib üksuse kauplemistehabehoidlaga ühendumise ajal; seetõttu ei anta konkreetset tagasilükkamise tagasisidet.
434. Kauplemistehabehoidla peaks kontrollima failide vastavust XML-skeemile (kogu faili ja konkreetsete VFTde kohta edastatud teadete süntaks). Kui fail on mittevastav, lükatakse tagasi kogu fail (kõik failis sisalduvad tehingud) ja põhjuseks on asjaolu, et fail on vigane.
435. Kuna andmete kogumise regulatiivsete tehniliste standardite artikli 1 punkti c kohaselt peaks see kontroll toimuma kauplemistehabehoidlale edastatud teadete kontrollimise osana ja kuigi volitamise saab kindlaks teha registreerimise ajal, tuleks teadete

edastamise volitust kontrollida ka teadete tasandil ja kauplemisteabehoidla peaks lükkama tagasi kõik teated, mis seda kontrolli ei läbi, edastades asjakohase tagasiside.

436. Kauplemisteabehoidlad peaksid kasutama asjakohast ISO 20022 kohast XML-sõnumit, et edastada valideerimise tagasisidet üksustele, mis nende juures on registreeritud. Vastaspooltele tagasilükkamisest teatamisel peaksid kauplemisteabehoidlad kasutama teate väljadel sisalduvaid koode.
437. Tagasilükkamise kohta teate saamisel peaks teabe edastanud vastaspool või teatamise eest vastutav üksus SFTRi artikli 4 lõikes 1 sätestatud tähtaja jooksul esitama korrekse ja täieliku teabe kas ise või teadet esitava üksuse kaudu.
438. Kui fail sisaldab kolme tehingut, kuid tehingute valideerimine ebaõnnestub, näitab statistika, et fail on vastu võetud kolme tagasilükatud tehinguga.
439. Kui teavitava vastaspoole, teatamise eest vastutava üksuse või teadet esitava üksuse edastatud andmefail sisaldab tõsist skeemiviga ja tehinguid ei saa valideerida, teatatakse sellest ühe faili tagasilükkamisena.
440. Lisaks ülaltoodud teabele edastavad kauplemisteabehoidlad igale teavitavale vastaspoolele, teatamise eest vastutavale üksusele või teadet esitavale üksusele (vastavalt kohaldatavusele) päeva lõpu seisuga teate (auth.084.001.01), mis sisaldab järgmist teavet:

Tabel 113. Tagasiside esitatud teabe tagasilükkamise korral			
No.	Field	Details to be reported	XML Message
1	Number of files received	Numeric values	<code>&lt;SctiesFincgRptgTxStsAdv&lt;br&gt;&lt;TxRptStsAndRsn&lt;br&gt;&lt;Rpt&lt;br&gt;&lt;RptSttstcs&lt;br&gt;&lt;TtINbOfRpts&gt;2&lt;/TtINbOfRpts&gt;&lt;br&gt;&lt;TtINbOfRptsAccptd&gt;1&lt;/TtINbOfRptsAccptd&gt;&lt;br&gt;&lt;TtINbOfRptsRjctd&gt;1&lt;/TtINbOfRptsRjctd&gt;&lt;br&gt;&lt;NbOfRptsRjctdPerErr&lt;br&gt;&lt;DtldNb&gt;1&lt;/DtldNb&gt;&lt;br&gt;&lt;RptSts&lt;br&gt;&lt;MsgRptld&gt;ReportID&lt;/MsgRptld&gt;&lt;br&gt;&lt;Sts&gt;RJCT&lt;/Sts&gt;&lt;br&gt;&lt;DtldVldtnRule&lt;br&gt;&lt;Id&gt;RuleID&lt;/Id&gt;&lt;br&gt;&lt;Desc&gt;Rule description&lt;/Desc&gt;&lt;br&gt;&lt;SchmeNm&lt;br&gt;&lt;Cd&gt;1&lt;/Cd&gt;&lt;br&gt;&lt;/SchmeNm&lt;br&gt;&lt;/DtldVldtnRule&gt;&lt;br&gt;&lt;/RptSts&gt;&lt;br&gt;&lt;/NbOfRptsRjctdPerErr&gt;&lt;br&gt;&lt;/RptSttstcs&gt;&lt;br&gt;&lt;TxSttstcs&gt;&lt;br&gt;&lt;TtINbOfTxS&gt;2&lt;/TtINbOfTxS&gt;</code>
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;TtlNbOfTxAccptd&gt;1&lt;/TtlNbOfTxAccptd&gt;  &lt;TtlNbOfTxRjctd&gt;1&lt;/TtlNbOfTxRjctd&gt;   &lt;NbOfTxRjctd&gt;     &lt;TxId&gt;       &lt;Tx&gt;         &lt;RptgCtrPty&gt;  &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;   &lt;/RptgCtrPty&gt;   &lt;OthrCtrPty&gt;  &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;   &lt;/OthrCtrPty&gt;  &lt;UnqTradldr&gt;UT11&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;/NbOfTxRjctd&gt; &lt;/TxSttstcs&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TxRptStsAndRsn&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxStsAdv&lt; </pre>
--	--	--	---

441. Nii tagatakse, et juhul, kui teavitav vastaspool või teatamise eest vastutav üksus ei edasta ise teateid kauplemisteabehoidlale, vaid neil on ainult vaatamist võimaldav konto, saavad nad üksikasjaliku ülevaate SFTRi kohase teatamiskohustuse täitmisest.

## 7 Tagasiside kooskõlastava võrdlemise kohta

442. Kauplemisteabehoidlate vahelise kooskõlastava võrdlemise protsessis sobitavad kauplemisteabehoidlad esmalt laenud ning seejärel i) viivad läbi laenude kooskõlastava võrdlemise laene puudutavatel kooskõlastatavatel väljadel ja paralleelselt ii) viivad läbi tagatisete kooskõlastava võrdlemise tagatisi puudutavatel kooskõlastatavatel väljadel. Tagatisi seega ei sobitata, olenemata sellest, kas tegemist on tehingupõhise tagatisega või neto riskipositsiooni tasandi tagatisega. Sobitada tuleks ainult laenud ja nendega tuleks kokku viia vastavate laenudega seotud tagatised nii tehingupõhise tagatise kui ka neto riskipositsioonil põhineva tagatise korral. Kauplemisteabehoidlad ei peaks tagatisi

sobitama; kui üks pool ei esita teavet neto riskipositsiooni tagatise kohta, kajastatakse iga tagatisvara kooskõlastava võrdlemise tulemuste teate jaotises „Vaste puudub“ ja tagatiste kooskõlastava võrdlemise staatuseks märgitakse „Kooskõlastavalt võrdlemata“.

**Tabel 114. Kooskõlastava võrdlemise kategooriad**

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. Olles saanud ja vastu võtnud teate toiminguliigiga „EROR“ ning seda kontrollinud, peaks kauplemisteabehoidla eemaldama asjaomase VFT kooskõlastava võrdlemise protsessist kohe, st alates vahetult järgnevast kooskõlastava võrdlemise tsüklist.
444. Kuna ühtegi VFTd ei saa „taaselustada“, tuleks VFT jätta välja kooskõlastava võrdlemise protsessist 30 päeva möödudes tehingu tähtpäevast või ennetähtaegsest lõpetamisest, st teatest, milles toiminguliigiks on märgitud „Lõpetamine/ennetähtaegne lõpetamine“ või „Positsiooni komponent“, nagu on sätestatud kontrollimise regulatiivsete tehniliste standardite artikli 2 lõike 2 punktis h. Tagatise üksikasjade kooskõlastaval võrdlemisel erinevad vastavad teated laenuteadetest selle poolest, et neis puuduvad tähtpäevad. Neto riskipositsioonil põhineva tagatise puhul tähendab see, et selle kuupäev on seotud VFT laenupoole kuupäevaga. Seetõttu peaks kauplemisteabehoidla püüdma seda teavet kooskõlastavalt võrrelda 30 päeva jooksul arvates neto riskipositsioonil põhineva tagatisega hõlmatud viimase laenu tähtpäevast. Neto riskipositsioonil põhineva tagatise kooskõlastava võrdlemise staatust korratakse kõigi VFTde puhul, mida neto riskipositsioonil põhinev tagamine hõlmab.
445. Kui teatamiskohustus on mõlemal vastaspoolel, peaksid nad veenduma, et teatatud VFTde sobitamise staatus on „Sobitatud“, laenude kooskõlastava võrdlemise staatus on „Kooskõlastatavalt võrreldud“ ja tagatiste kooskõlastava võrdlemise staatus on „Kooskõlastatavalt võrreldud“.
446. Selleks edastavad kauplemisteabehoidlad neile alljärgneva teate, mis sisaldab üksikasjalikku teavet kõigi nende teatatud ja kooskõlastavale võrdlemisele kuuluvate VFTde kooskõlastava võrdlemise staatuse kohta:

**Tabel 115. Tagasiside kooskõlastava võrdlemise kohta**

No.	Field		Details to be reported	XML Message
1	Reporting counterparty	Unique key	Table A Field 3	<SctiesFincgRptgRcncltnStsAdv< <RcncltnData>
2	UTI		Table B Field 1	

Tabel 115. Tagasiside kooskõlastava võrdlemise kohta				
No.	Field		Details to be reported	XML Message
3	Other counterparty		Table A Field 11	<pre> &lt;Rpt&gt;   &lt;PairgRcncltnSts&gt;     &lt;DtldNbOfRpts&gt;2&lt;/DtldNbOfRpts&gt;     &lt;DtldSts&gt;PARD&lt;/DtldSts&gt;   &lt;/PairgRcncltnSts&gt;   &lt;RcncltnRpt&gt;     ...     &lt;Txld&gt;       &lt;RptgCtrPty&gt;         &lt;LEI&gt;1234567890123450000&lt;/LEI&gt;         &lt;/RptgCtrPty&gt;         &lt;OthrCtrPty&gt;           &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMN&lt;           &lt;/LEI&gt;           &lt;/OthrCtrPty&gt;           &lt;UnqTradldr&gt;UT110&lt;/UnqTradldr&gt;           &lt;/Txld&gt;           &lt;Modfd&gt;&gt;true&lt;/Modfd&gt;           &lt;RcncltnSts&gt;           &lt;RptgData&gt;           &lt;NotMtchd&gt;           &lt;CtrPty1&gt;             &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA&lt;/             &lt;/LEI&gt;             &lt;/CtrPty1&gt;             &lt;CtrPty2&gt;               &lt;LEI&gt;EEEEEEEEEEEEEEEE&lt;/               &lt;/LEI&gt;               &lt;/CtrPty2&gt;               &lt;MtchgCrit&gt;               &lt;LnMtchgCrit&gt;               &lt;TermntnDt&gt;               &lt;Val1&gt;2019-04-20               &lt;Val2&gt;2019-04-21               &lt;/TermntnDt&gt;               &lt;/LnMtchgCrit&gt;               &lt;CollMtchgCrit&gt;               &lt;CmpntTp&gt;               &lt;Scty&gt; </pre>
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	

Tabel 115. Tagasiside kooskõlastava võrdlemise kohta				
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;/SciesFincgRptgRcncltnStsAdv&gt; </pre>

447. Pärast VFTde eemaldamist kooskõlastava võrdlemise protsessist tuleks need VFTd eemaldada ka vastaspooltele ja pädevatele asutustele edastatavatest kooskõlastava võrdlemise teadetest. Kauplemisteabehoidlad peaksid säilitama nende VFTde viimase kooskõlastava võrdlemise staatuse oma süsteemides.

## 8 Tagasiside puuduva tagatise korral

448. Teates tuleks märkida, kas VFT on tagatud või mitte. Kui VFT on tagatud, tuleb teave tagatise kohta esitada kohe, kui see on teada.
449. Kui tagatis ei ole teate edastamise ajal teada, jäetakse tagatise kohta käivad väljad (2.75–2.94) tühjaks. Küll aga tuleks väljal 2.96 märkida kas tagatiskorvi kehtiv ISIN-kood või „NTAV“. Teade VFT kohta võetakse vastu.
450. Päeva lõpus genereerib kauplemisteabehoidla vastavalt andmete kogumise regulatiivsete tehniliste standardite artikli 3 punktile c teate, milles on esitatud „selliste väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute kordumatud tunnuskoovid, mille puhul rakendusmääruse (EL) 2019/363 I lisa tabeli 2 andmevälja 72 all on kirje „väär“ ning sama tabeli andmeväljadel 73–96 esitatava tagatise kohta ei ole teavet veel esitatud“. Kuna teave tagatise üksikute komponentide kohta esitatakse väljadel 2.75–2.94, peaks kauplemisteabehoidla tuletama üksustele meelde tagatise kohta teabe esitamise vajadust, koostades „Puuduva tagatise teate“, mis sisaldab nende VFTde kordumatuid tunnuskoode, millest vastaspool on teatanud kui tagatud tehingust ja mille puhul ainult väli 2.96 on täidetud.
451. Pidades silmas eeldust, et päevasisestele VFTdele tagatist ei jaotata, peaksid kauplemisteabehoidlad selleks, et need andmed oleksid tõhusad ja vastaspoolte jaoks praktilise väärtusega, esitama nimetatud teates VFTd, mis vastavad kõigile järgmistele tingimustele:

- a. väljal 2.72 on märgitud „vale“ ja ainult väli 2.96 on täidetud;
- b. täitmise ajatempli kuupäeva osa ja tähtpäev või lõpetamise kuupäev on erinevad;
- c. VFTde puhul tuleb läbi viia kooskõlastav võrdlemine.

## 9 Pädevatele asutustele teabe esitamine

### 9.1 Andmetele juurdepääsu andmise tähtaeg

452. Mis puudutab andmetele juurdepääsu andmise ajakohasust, siis kauplemisteabehoidlad peaksid panema oma sisemised protsessid paika nii, et vastavalt artikli 4 lõike 1 punktile f saab pädev asutus VFTde üksikasjadele vahetu ja kohese juurdepääsu 30 päeva jooksul pärast juurdepääsutaotluse esitamist.
453. Kauplemisteabehoidlad peaksid kasutama teavet, mille pädevad asutused esitavad andmetele juurdepääsu regulatiivsetes tehnilistes standardites ette nähtud vormil. Filiaalide ja tütarettevõtjate VFTde andmete esitamisel pädevatele asutustele tuleks arvesse võtta ka olemasolevaid andmeid juriidilise isiku tunnuste seoste kohta.
454. Vastaspoolte poolt SFTRi artikli 4 alusel edastatud andmetele juurdepääsu andmisel tuleks kauplemistegevuse ja kauplemisseisu aruannetes kajastada VFTd, millest on teatatud tehingu ja positsiooni tasandil.
455. Mis puudutab andmetele juurdepääsu regulatiivsete tehniliste standardite artikli 4 lõike 2 punkti k nõudeid, siis kaupa puudutavatele andmetele tuleks anda juurdepääs, kui vastavad liikmesriigid on kindlaks teinud.
456. Mis puudutab andmetele juurdepääsu regulatiivsete tehniliste standardite artikli 4 lõike 2 punkti n nõudeid seoses juurdepääsuga keskpanga emiteeritavas valuutas VFTde andmetele, siis juurdepääs andmetele peaks hõlmama kõiki väärtuse hindamisega mitteseotud välju, kus seda valuutat kasutatakse. Kui mitu asutust emiteerivad sama valuutat, nagu see on euro puhul, peaks neil kõigil olema juurdepääs nende VFTde andmetele.
457. Mis puudutab andmetele juurdepääsu regulatiivsete tehniliste standardite artikli 4 lõike 2 punkti o nõudeid seoses juurdepääsuga andmetele VFTde kohta, mis on seotud võrdlusalustega, mille haldamise eest SFTRi artikli 12 lõikes 2 nimetatud üksus vastutab, siis kauplemisteabehoidla peaks saama võrdlusaluste haldajate suutlikkust tõendava teabe.

### 9.2 Andmetele juurdepääsu andmise korraldus

458. Seoses teatamise regulatiivsete tehniliste standardite lisa tabelite 1–4 kohaselt esitatud andmetega VFTde kohta, sealhulgas selliste VFTde viimane kauplemisseis, mille tähtaeg ei ole möödunud või mille kohta ei ole edastatud teatamise rakenduslike tehniliste standardite I lisa tabeli 2 andmeväljal 98 osutatud „vea“, „lõpetamise/ennetähtaegse lõpetamise“ või „positsiooni komponendi“ liiki toimingute teadet, peaksid kauplemisteabehoidlad kasutama järgmisi XML-vorminguid.

459. Vastavad kauplemistegevuse teated on auth.052.001.01 (vastaspool, laen ja tagatis), auth.070.001.01 (võimendustagatis) ja auth.071.001.01 (tagatise uuesti kasutamine). Vastavad kauplemisseisu teated on 079.001.01 (vastaspool, laen ja tagatis), auth.085.001.01 (võimendustagatis) ja auth.086.001.01 (tagatise uuesti kasutamine). Neid vorminguid on ajakohastatud ja täpsustatud vormingute osas, mis on seotud i) repotehingute tagatistest ja ostu-tagasimüügitehingute tagatistest teatamisega, ii) võimenduslaenude tagatistest teatamisega, iii) neto riskipositsioonide tagatistest teatamisega ja iv) mitme tagatisvaraga tagamisest teatamisega.
460. Lisaks tuleb samu vorminguid kasutada ka siis, kui kauplemisteabehoidlad koostavad vastuseid nii korduvatele kui ka sihtotstarbelistele päringutele laenude ja tagatiste kohta. Kauplemisteabehoidlad ei pea andma juurdepääsu võimendustagatise ja uuesti kasutamise andmetele sihtotstarbeliste päringute kaudu, kuna nende teadete puhul ei ole välja, mille kohta saab päringu esitada.

Tabel 116. Aruanne VFTde kohta – vastaspoolte, laenude ja tagatiste andmed			
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;SciesFincgRptgTxStatRpt&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;/SciesFincgRptgTxStatRpt&gt; </pre>

461. Vastaspooleid, teatamise eest vastutavad üksused või teadet esitavad üksused edastavad andmeid võimendustagatise ja uuesti kasutamise kohta päeva lõpu seisuga. See ei välista võimalust, et teavitav vastaspool, teatamise eest vastutav üksus või teadet esitav üksus edastab selle teabe mitmes osas.
462. Kauplemisteabehoidla peaks pädevatele asutustele esitatavas kauplemistegevuse aruandes auth.070.001.01 (võimendustagatis) kajastama kõik VFTde võimendustagatiste



teated, mis antud päeval edastati, ja kauplemisseisu aruandes auth.085.001.01 viimase seisuga kõigi VFTde võimendustagatiste puhul, millest teatati vastava sündmuse kuupäeva kohta või kui antud kuupäeva kohta teavet ei edastatud, siis viimase edastatud teabe.

Tabel 117. Aruanne VFTde kohta – võimendustagatiste andmed			
No.	Field	Details to be reported	XML schema
1	Reportable field	Table 3 Field 1 to Field 20	<pre> &lt;SciesFincgRptgMrgnDataTxStatRpt&gt; &lt;Stat&gt; ... &lt;CtrPty&gt; ... &lt;/CtrPty&gt; &lt;CollPrftfId&gt;...&lt;/CollPrftfId&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;/SciesFincgRptgMrgnDataTxStatRpt&gt; </pre>

463. Juurdepääsu võimaldamisel uuesti kasutamise andmetele VKEst finantssektoriväliste vastaspoolte puhul peaksid kauplemisteabehoidlad esitama pädevatele asutustele kogu teabe, mis on teavitava vastaspoole puhul antud sündmuse kuupäeva kohta edastatud toiminguliigiga „NEWT“ ja „REUU“. Kauplemisteabehoidlad peaksid kohaldatavate juhtude kindlaksmääramiseks kasutama välju „Teatamise eest vastutav üksus“ „Teadet esitav üksus“. Kui asjaomase teavitava vastaspoole puhul on teatamise eest vastutavaid üksusi mitu ja nad kasutavad sama teadet esitavat üksust, peaksid kauplemisteabehoidlad esitama kõik teavitava vastaspoole puhul antud sündmuse kuupäeva osas edastatud teated tagatise uuesti kasutamise kohta.
464. Kauplemisteabehoidla peaks pädevatele asutustele esitatavas kauplemistegevuse aruandes auth.071.001.01 kajastama kõik VFTde tagatiste uuesti kasutamise teated, mis antud päeval edastati, ja kauplemisseisu aruandes auth.086.001.01 viimase seisuga kõigi VFTde tagatiste uuesti kasutamise teadete puhul, mis edastati vastava sündmuse kuupäeva kohta või kui antud kuupäeva kohta teavet ei edastatud, siis viimase edastatud teabe.

Tabel 118. Aruanne VFTde kohta – uuesti kasutamise andmed			
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. Seoses nende VFTde teadete asjaomaste üksikasjadega, mille kauplemisteabehoidla on tagasi lükanud, sealhulgas eelmisel tööpäeval tagasi lükatud VFTde teadetega, ja tagasilükkamise põhjustega, mis on sätestatud andmete kontrollimise regulatiivsete tehniliste standardite I lisa tabelis 2, peaksid kauplemisteabehoidlad kasutama sama XML-vormingut, mida sisaldab Tabel 113. Tagasiside esitatud teabe tagasilükkamise korral.

Tabel 119. Aruanne tagasi lükatud teadete kohta				
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	

Tabel 119. Aruanne tagasi lükatud teadete kohta				
No.	Field	Additional information	Details to be reported	XML schema
10	Identification of the SFT			
11	Reporting counterparty	Unique key of the SFT	Table 1 Field 3	
12	UTI		Table 2 Field 1	
13	Other counterparty		Table 1 Field 11	
14	Master agreement type		Table 2 Field 9	
15	Rejection reason		Error codes	
16	Rejection description		Error description	

466. Seoses selliste VFTde teadete kooskõlastava võrdlemise staatusega, mille suhtes kauplemisteabehoidla on kohaldanud kooskõlastavat võrdlemist vastavalt andmete kontrollimise regulatiivsetele tehnilistele standarditele, välja arvatud need VFTd, mille tähtpäev on möödas või mille kohta on rohkem kui kuu enne teadete kooskõlastavat võrdlemist edastatud „vea“, „lõpetamise/ennetähtaegse lõpetamise“ või „positsiooni komponendi“ liiki toimingute teade, peaksid kauplemisteabehoidlad kasutama sama XML-vormingut, mida sisaldab Tabel 115. Tagasiside kooskõlastava võrdlemise kohta.
467. XML skeemi definitsiooni on ajakohastatud, et võimaldada mitme tagatiskomponendi korral kooskõlastava võrdlemise väärtuste esitamist mõlemale vastaspoolele, teatamise eest vastutavale üksusele, teadet esitavale üksusele ja pädevatele asutustele.
468. Kõigi sama raamlepingu liigiga hõlmatud tehingute puhul, kui neto riskipositsiooni tagatuse välja väärtus on „õige“, tuleks tagatiste kooskõlastava võrdlemise tulemustest teatada ainult üks kord.

Tabel 120. Aruanne VFTde kooskõlastava võrdlemise staatuse kohta				
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	

Tabel 120. Aruanne VFTde kooskõlastava võrdlemise staatuse kohta				
No.	Field	Additional information	Details to be reported	XML schema
10	Loan reconciliation status		reconciled/not reconciled	
11	Reportable loan fields subject of reconciliation	Only not reconciled fields are to be reported, both values subject of reconciliation shall be reported		
12	Collateral reconciliation status		reconciled/not reconciled	
13	Reportable collateral fields subject of reconciliation	Only not reconciled fields are to be reported, both values subject of reconciliation shall be reported		

469. Pääringu saamisel peaksid kauplemisteabehoidlad kontrollima, kas pääring on korrektne ja kas seda saab kauplemisteabehoidla süsteemidega töödelda. Vigase andmepääringu korral (nt kui pääring ei vasta nõuetele) saadab kauplemisteabehoidla pädevale asutusele tagasisidesõnumi, milles teatab, et pääring on vigane, ja lisab vea liigi kirjelduse.

```

<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. Kauplemisteabehoidlad teostavad sihtotstarbelised andmepääringud võimalikult kiiresti pärast nende esitamist ja kontrollimist, ka puhkepäevadel. Sihtotstarbelistele pääringutele vastamise aeg on sätestatud andmetele juurdepääsu regulatiivsete tehniliste standardite artikli 5 lõikes 4:

- a. kui juurdepääsu taotletakse pooleli VFTde üksikasjadele või selliste VFTde üksikasjadele, mille tähtpäev on möödunud või mille kohta on mitte rohkem kui aasta enne taotluse esitamise kuupäeva esitatud teatamise rakenduslike tehniliste standardite I lisa tabeli 2 andmeväljal 98 osutatud „vea“, „lõpetamise/ennetähtaegse lõpetamise“ või „positsiooni komponendi“ liiki toimingute teade, siis hiljemalt kell 12.00 koordineeritud maailmaaja (UTC) järgi esimesel kalendripäeval pärast juurdepääsutaotluse esitamist;
  - b. kui juurdepääsu taotletakse selliste VFTde üksikasjadele, mille tähtpäev on möödunud või mille kohta on rohkem kui aasta enne taotluse esitamise kuupäeva esitatud teatamise rakenduslike tehniliste standardite I lisa tabeli 2 andmeväljal 98 osutatud „vea“, „lõpetamise/ennetähtaegse lõpetamise“ või „positsiooni komponendi“ liiki toimingute teade, siis mitte hiljem kui kolm tööpäeva pärast juurdepääsutaotluse esitamist;
  - c. kui juurdepääsu taotletakse selliste VFTde üksikasjadele, mis kuuluvad nii punkti a kui ka punkti b alla, siis mitte hiljem kui kolm tööpäeva pärast juurdepääsutaotluse esitamist.
471. Kui andmepäring esitatakse hiljem kui üks päev enne esimest teostamispäeva, võib esimese teostamise vastavalt päringus täpsustatud parameetritele edasi lükata järgmise teostamispäevani.
472. Kui päringu teostamine ebaõnnestub tehnilistel põhjustel, saadab kauplemisteabehoidla ESMA süsteemi veateate. Veateates tuleks kirjeldada, mis liiki viga tekkis.
473. Vastuseks igale andmepäringule koostab kauplemisteabehoidla vastusefaili, mis sisaldab andmeid kõigi pädeva asutuse määratletud otsingukriteeriumidele vastavate VFTde kohta:
- a) sihtotstarbelise päringu korral koostatakse ühekordne vastusefail (üks vastusefail ühe päringu kohta);
  - b) korduva päringu korral koostatakse vastusefailid regulaarselt vastavalt pädeva asutuse määratud sagedusele.
474. Kauplemisteabehoidlad peaksid võimaldama SFTRi artikli 12 lõikes 2 nimetatud üksustel kehtestada andmetele juurdepääsu sageduse, mis erineb igapäevasest juurdepääsust. Korduva päringu teostamise maksimaalse kestuse kehtestamisel peaksid kauplemisteabehoidlad võtma arvesse SFTRi artikli 12 lõikes 2 loetletud üksuste vajadusi ja piirama nende üksuste süsteemide toimimisega seotud riske.
475. Andmetele juurdepääsu regulatiivsete tehniliste standardite artiklis 5 ei viidata tähtaegadele, mida kauplemisteabehoidlad peaksid järgima selliste plaaniliste hooldustööde tegemisel, mis mõjutavad andmetele juurdepääsuga seotud kauplemisteabehoidla teenuseid, sõltumata kasutatavast kanalist või vormingust.
476. Kauplemisteabehoidlad peaksid hoolikalt kavandama plaanilisi hooldustöid, mis mõjutavad andmetele juurdepääsuga seotud kauplemisteabehoidla teenuseid, et need tööd ei langeks tööpäevadele, mis määratakse kindlaks vastavalt liidus järjekindlalt kokkulepitud kalendriale, näiteks TARGET2 kalendriale. Kui need hooldustööd langevad erandlike asjaolude korral niisugusele tööpäevale, tuleks plaanilisi hooldustöid teha väljaspool tavapärasest tööaegast, st kas väga vara hommikul või väga hilja õhtul.

Kauplemisteabehoidlad peaksid veenduma, et ülalnimetatud plaanilisi hooldustöid ei tehta viisil, mis takistab tuletisinstrumente puudutava teabe õigeaegset kättesaadavust pädevatele asutustele.

477. Kauplemisteabehoidlad peaksid kasutama elektroonilisi vahendeid, et teavitada kõiki pädevaid asutusi plaaniliste hooldustööde alustamise ja lõpetamise kuupäevadest ning kellaegadest.
478. Kui plaanilisi hooldustöid, mis mõjutavad andmetele juurdepääsuga seotud kauplemisteabehoidla teenuseid, kavandatakse kauplemisteabehoidlas igal aastal, võiks kauplemisteabehoidla teavitada kõiki pädevaid asutusi sellisest kavandamisest igal aastal ja vähemalt kolm tööpäeva ette. Lisaks tuleks võimalikke täiendavaid teateid andmetele juurdepääsuga seotud kauplemisteabehoidla teenuseid mõjutavate plaaniliste hooldustööde kohta, millest ei teatata igal aastal, edastada võimalikult kiiresti ja vähemalt kolm tööpäeva enne selliste plaaniliste hooldustööde alguskuupäeva.
479. Kauplemisteabehoidlad peaksid säilitama nimetatud teadete andmed, mille saab ESMA-le viimase taotluse alusel kättesaadavaks teha. Plaaniliste hooldustööde teadete andmed peaksid sisaldama vähemalt järgmist teavet: teate ajatempel, andmetele juurdepääsuga seotud kauplemisteabehoidla teenuseid mõjutavate plaaniliste hooldustööde algus ja lõpp ning teavitatud kasutajate loetelu.
480. Andmetele juurdepääsu regulatiivsete tehniliste standardite artikli 5 lõike 5 kohaselt päringute kontrollimisel peaksid kauplemisteabehoidlad kinnitama andmetele juurdepääsu taotluse saamist ning kontrollima selle nõuetekohasust ja täielikkust esimesel võimalusel, kuid hiljemalt 60 minuti jooksul pärast andmetele juurdepääsuga seotud kauplemisteabehoidla teenuseid mõjutavate plaaniliste hooldustööde lõppu.
481. Selleks, et tagada andmetele juurdepääs andmetele juurdepääsu regulatiivsete tehniliste standardite artikli 5 lõike 4 punkti a kohaselt, peaksid kauplemisteabehoidlad püüdma vastata taotlusele esimesel võimalusel, kuid hiljemalt kell 12.00 koordineeritud maailmaaja (UTC) järgi esimesel kalendripäeval pärast andmetele juurdepääsuga seotud kauplemisteabehoidla teenuseid mõjutavate plaaniliste hooldustööde lõppu. Artikli 5 lõike 4 punktide b ja c kohased tähtajad jäävad samaks.
482. Plaaniväliste hooldustööde korral peaksid kauplemisteabehoidlad järgima andmetele juurdepääsu regulatiivsete tehniliste standardite artikli 5 lõigetes 4 ja 5 sätestatud tähtaegu ning nende tähtaegade järgimisest lähtutakse kauplemisteabehoidla nõuetelevastavuse hindamisel. Kauplemisteabehoidlad peaksid ESMA-t teavitama plaanivälisest hooldustöödest vastavalt oma sisemisele korrale.
483. Kauplemisteabehoidlad koostavad väljundfailid ISO 20022 kohases XML-vormingus. Väljundfailid peaksid sisaldama VFTde andmete alamhulka, mis piirdub pädevale asutusele seadusega antud volitustega, nagu on sätestatud andmetele juurdepääsu regulatiivsete tehniliste standardite artiklites 1 ja 2.
484. Väljundfailides esitatakse tehinguandmete alamhulk vastavalt andmepäringus määratletud kriteeriumidele. Kui päringu vastus sisaldab palju kirjeid, jaotatakse vastus mitmeks failiks.
485. Väljundfail sisaldab iga tehingu kohta kõiki välju, mis on sätestatud regulatiivsetes ja rakenduslikes tehnilistes standardites ning millest vastaspoolel on



kauplemisteabehoidlatele teatanud. Andmepäringu kriteeriumid peaksid piirama ainult päringu parameetrite arvu (välju, mille kohta saab päringuid teha) ja sellest tulenevalt väljundfailis sisalduvate kirjete arvu, mitte aga iga tehingu kohta edastatava teabe ulatust (st väljade arvu tehingu kohta).

486. Kui päringu teostamisel ei saada vastuseks ühtki tehingut, peaks kauplemisteabehoidla saatma vastava tagasisideteate.