



European Securities and
Markets Authority

Gairės

Duomenų teikimas pagal VPĮFS reglamento 4 ir 12 straipsnius



Turinys

1	Nuorodos į teisės aktus, santrumpos ir sąvokų apibrėžtys	5
2	Taikymo sritis	6
3	Tikslas.....	7
4	Bendrieji principai.....	7
4.1	Duomenų teikimo pradžios data	7
4.2	VPĮFS, apie kuriuos reikia pranešti, skaičiaus nustatymas	8
4.2.1	Rinkos sandoriai, nepatenkantys į VPĮFS apibrėžtį.....	8
4.2.2	Su visų rūšių VPĮFS susiję aspektai.....	9
4.2.3	Su atpirkimo sandoriais susiję aspektai	10
4.2.4	Su BSB / SBB (pirkimo siekiant parduoti atgal / pardavimo siekiant atpirkti) sandoriais susiję aspektai.....	10
4.2.5	Su vertybinių popierių skolinimu ir skolinimusi susiję aspektai	11
4.2.6	Su biržos prekių VPĮFS susiję aspektai.....	12
4.2.7	Su garantinės įmokos skolinimu susiję aspektai	13
4.3	VPĮFS, kuriems atlikta pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita, duomenų teikimas	14
4.4	Atsakomybės paskirstymas pagal VPĮFSR 4 straipsnio 3 dalį	15
4.4.1	Bendrasis atvejis	15
4.4.2	Trečiosios šalys – finansų sandorio šalys	15
4.4.3	Fondai	15
4.5	Savanoriškas pareigos teikti duomenis pavedimas	15
4.6	VPĮFSR įtvirtintų pareigų teikti duomenis taikymas VPĮFS, kuriuos sudaro filialai. 16	
4.6.1	VPĮFSR įtvirtintų pareigų teikti duomenis taikymas VPĮFS, kuriuos sudaro filialus ES turintys ES nepriklausantys subjektai	16
4.6.2	Filialų sudarytų VPĮFS, apie kuriuos reikia pranešti, nustatymas	16
4.7	Ne finansų sandorio šalies teikiami duomenys	17
4.8	Veiksmų rūšys.....	18
4.8.1	Taikytinos veiksmų rūšys.....	18
4.8.2	Išsamus vaizdas arba VPĮFS pakeitimų duomenų teikimas iš dalies	18
4.8.3	Įvairių rūšių pranešimų veiksmų rūšių seka.....	19
4.9	Laiku teikiamas pranešimas apie VPĮFS sudarymą, pakeitimą ir nutraukimą	22
4.9.1	VPĮFS sudarymas.....	22

4.9.2	VPĮFS pakeitimas ir pataisymas	23
4.9.3	Užtikrinimo priemonės atnaujinimas	24
4.9.4	Vertinimo, garantinės įmokos ir pakartotinio naudojimo atnaujinimai	24
4.9.5	VPĮFS nutraukimas.....	25
4.9.6	Kiekvienos pranešimo rūšies ir veiksmo rūšies duomenų teikimo terminų apžvalga	26
4.10	Veiklos įvykių susiejimas su veiksmy rūšimis ir lygiais.....	26
4.11	CVPD dalyvio tapatybės nustatymas.....	33
4.12	Sandorio šalies pobūdžio nustatymas	34
4.12.1	Bendrasis atvejis	34
4.12.2	VPĮFS, kuriems atlikta pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita	34
4.12.3	Neužtikrinto vertybinių popierių skolinimo ir skolinimosi duomenų teikimas	34
4.12.4	Sandorio šalies pobūdžio duomenų teikimas grynosios pozicijos užtikrinimo atveju.....	34
4.13	Kainos ir vertės laukai	34
4.13.1	Vertinimų laikas	34
4.13.2	Vertinimams taikomas skaičiavimo metodas.....	35
4.14	Vertybinio popieriaus, naudojamo kaip užtikrinimo priemonė, CFI kodo duomenų teikimas.....	35
4.15	Telkimas laikotarpio pabaigoje	36
4.16	UTI formavimas ir struktūra	36
4.17	Naudos gavėjų nustatymas ir jų duomenų teikimas	38
4.18	Vertybinių popierių emitento ir vertybinių popierių nustatymas	38
4.19	Procedūra, taikoma, kai sandorio šaliai įvyksta emitento įvykis	39
4.20	Duomenų teikimas per laipsniško taikymo laikotarpį.....	40
5	VPĮFSR laukų lentelės	40
5.1	Sandorio šalies duomenys	42
5.1.1	Dvišaliais VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaita, tarp būstinių	44
5.1.2	Dvišaliai VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaita, tarp filialų	46
5.1.3	Dvišaliai VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaita, su naudos gavėjais	48
5.1.4	VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaita, su makleriais, atsiskaitant su vertybinius popierius saugančiu banku	49
5.1.5	VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaita, su makleriu, agentu skolintoju ir trišaliu agentu	51
5.1.6	VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaita, su makleriu, agentu skolintoju ir trišaliu agentu, atsiskaitant su CVPD dalyviu, kuris nėra nė vienas iš tų subjektų ir savanoriškai pavedant duomenų teikimą trečiajai šaliai.	53

5.1.7	VPĮFS, kuriems atlikta tarpuskaita, su makleriu, agentu skolintoju ir trišaliu agentu	55
5.1.8	VPĮFS, kuriems atlikta tarpuskaita, su makleriu, agentu skolintoju ir trišaliu agentu, atsiskaitant su CVPD dalyviu, kuris nėra nė vienas iš tų subjektų ir savanoriškai pavedant duomenų teikimą trečiajai šaliai.	57
5.1.9	KIPVPS fondo sudaryti VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaita	59
5.1.10	KIPVPS fondo sudaryti VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaita; KIPVPS valdymo įmonė paveda duomenų teikimą trečiajai šaliai	61
5.1.11	AIF sudaryti VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaita	62
5.1.12	VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaita, kai naudojamosi užsakomosiomis fondo portfelio valdymo paslaugomis.....	64
5.2	Paskolų ir užtikrinimo priemonių duomenys.....	66
5.2.1	Pranešimas apie veiksmų rūšis sandorio lygmeniu ir pozicijos lygmeniu.	66
5.3	Paskolų duomenys.....	77
5.3.1	Įvykio datos duomenų teikimas	77
5.3.2	Pranešimas apie VPĮFS, kuriems atlikta / neatlikta tarpuskaita.....	78
5.3.3	Prekybos vieta.....	84
5.3.4	Pagrindinio susitarimo skirsnis.....	84
5.3.5	Sandorio sudarymas ir pradžia	87
5.3.6	VPĮFS terminas	88
5.3.7	Nutraukimo pasirinkimo galimybė	91
5.3.8	Susitarimai dėl bendrųjų ir specialiųjų užtikrinimo priemonių.....	91
5.3.9	Fiksuotosios ar kintamosios normos	93
5.3.10	Atpirkimo sandorių ir BSB / SBB sandorių pagrindinės sumos.....	97
5.3.11	Vertybinių popierių skolinimo paskolos pusė.....	98
5.3.12	Vertybiniai popieriai	98
5.3.13	VPĮFS su biržos prekėmis. Biržos prekių skolinimas.....	104
5.3.14	VPSS su grynujų pinigų grąžinimu.....	105
5.3.15	VPSS su mokesčiu: VPSS su nepiniginiu įkaitu, VPSS su lėšų sujungimu ir neužtikrintas VPSS.....	107
5.3.16	Garantinės įmokos paskolos suma ir trumposios pozicijos rinkos vertė	107
5.4	Užtikrinimo priemonės duomenys.....	111
5.4.1	VPSS užtikrinimo duomenų teikimas	111
5.4.2	Užtikrinimas.....	111
5.4.3	Piniginis įkaitas.....	118
5.4.4	Nulinio įkaito duomenų teikimas.....	119

5.4.5	Vertybinių popierių įkaito laukai	120
5.4.6	Kintamosios garantinės įmokos nustatymas sandorio lygmeniu sudarant VPĮFS, kuriems netaikoma pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita.....	131
5.4.7	VPĮFS, kuriems netaikoma pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita, kintamosios garantinės įmokos nustatymas pateikiant užtikrinimą grynosios pozicijos pagrindu	140
5.4.8	Iš anksto apmokėtas VPSS įkaitas	181
5.4.9	Sandorių, kuriems atlikta tarpuskaita, portfelis	182
5.5	Garantinės įmokos duomenys	183
5.5.1	Pagrindinė sandorio šalis, užimanti tarpininkės padėtį tarp dviejų sandorio šalių, kurios yra tarpuskaitos narės	183
5.5.2	Pagrindinė sandorio šalis, užimanti tarpininkės padėtį tarp dviejų sandorio šalių, kurios nėra tarpuskaitos narės	184
5.5.3	Informacijos apie garantinę įmoką pateikimas.....	184
5.6	Pakartotinio naudojimo duomenys, grynujų pinigų reinvestavimas ir finansavimo šaltiniai	185
5.6.1	Pakartotinis įkaito naudojimas	186
5.6.2	Piniginio įkaito reinvestavimas	193
5.6.3	Pakartotinis nulinio nepiniginio įkaito naudojimas ir grynujų pinigų reinvestavimas.....	200
5.6.4	Finansavimo šaltiniai	201
6	Grįžtamoji informacija apie atmetimą	202
7	Grįžtamoji informacija apie derinimą	204
8	Grįžtamoji informacija apie trūkstamą įkaitą	207
9	Kaip teikti informaciją valdžios institucijoms	207
9.1	Prieigos prie duomenų suteikimo terminai	207
9.2	Praktiniai prieigos prie duomenų aspektai	208



1 Nuorodos į teisės aktus, santrumpos ir sąvokų apibrėžtys

Nuorodos į teisės aktus

<i>AIFVD</i>	2011 m. birželio 8 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2011/61/EB dėl alternatyvaus investavimo fondų valdytojų (AIFV)
<i>Įkaito direktyva</i>	2002 m. birželio 6 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2002/47/EB dėl susitarimų dėl finansinio įkaito
<i>Vartojimo kredito direktyva</i>	2008 m. balandžio 23 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2008/48/EB dėl vartojimo kredito sutarčių ir panaikinanti Tarybos direktyvą 87/102/EEB
<i>Duomenų teikimo TĮS</i>	2018 m. gruodžio 13 d. Komisijos įgyvendinimo reglamentas (ES) 2019/363, kuriuo nustatomi pranešimų apie vertybinių popierių įsigijimo finansavimo sandorių duomenis, teikiamų sandorių duomenų saugykloms pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (ES) 2015/2365, formato ir dažnumo techniniai įgyvendinimo standartai ir iš dalies keičiamos Komisijos įgyvendinimo reglamento (ES) Nr. 1247/2012 nuostatos, susijusios su pranešimų kodų naudojimu teikiant pranešimus apie išvestinių finansinių priemonių sutartis
<i>ERIR</i>	Europos rinkos infrastruktūros reglamentas – 2012 m. liepos 4 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) 648/2012 dėl ne biržos išvestinių finansinių priemonių, pagrindinių sandorio šalių ir sandorių duomenų saugyklų
<i>PRR</i>	2014 m. balandžio 16 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 596/2014 dėl piktnaudžiavimo rinka (Piktnaudžiavimo rinka reglamentas)
<i>FPRR</i>	Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 600/2014 dėl finansinių priemonių rinkų, kuriuo iš dalies keičiamas Reglamentas (ES) Nr. 648/2012
<i>PRSR</i>	Reglamentas (ES) Nr. 1333/2014 dėl pinigų rinkos statistikos
<i>Hipotekos kredito direktyva</i>	2014 m. vasario 4 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2014/17/ES dėl vartojimo kredito sutarčių dėl gyvenamosios paskirties nekilnojamojo turto, kuria iš dalies keičiamos direktyvos 2008/48/EB ir 2013/36/ES bei Reglamentas (ES) Nr. 1093/2010



REMIT

2011 m. spalio 25 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 1227/2011 dėl didmeninės energijos rinkos vientisumo ir skaidrumo

Duomenų teikimo TRS

2018 m. gruodžio 13 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2019/356, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) 2015/2365 papildomas techniniais reguliavimo standartais, kuriais patikslinami sandorių duomenų saugykloms pateiktini vertybinių popierių įsigijimo finansavimo sandorių (VPĮFS) duomenys

Prieigos prie duomenų TRS

2018 m. gruodžio 13 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2019/357, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) 2015/2365 papildomas techniniais reguliavimo standartais, susijusiais su prieiga prie sandorių duomenų saugyklose laikomų vertybinių popierių įsigijimo finansavimo sandorių (VPĮFS) duomenų

Duomenų tikrinimo TRS

2018 m. gruodžio 13 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2019/358, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) 2015/2365 papildomas sandorių duomenų saugyklų atliekamo vertybinių popierių įsigijimo finansavimo sandorių (VPĮFS) duomenų rinkimo, tikrinimo, bendrinimo, lyginimo ir skelbimo techniniais reguliavimo standartais

VPĮFSR

2015 m. lapkričio 25 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) 2015/2365 dėl vertybinių popierių įsigijimo finansavimo sandorių ir pakartotinio naudojimo skaidrumo ir kuriuo iš dalies keičiamas Reglamentas (ES) Nr. 648/2012 (toliau taip pat – reglamentas)

TS

Duomenų teikimo TRS (Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2019/356) ir duomenų teikimo TĮS (Komisijos įgyvendinimo reglamentas (ES) 2019/363)

KIPVPS

2009 m. liepos 13 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2009/65/EB dėl įstatymų ir kitų teisės aktų, susijusių su kolektyvinio investavimo į perleidžiamus vertybinius popierius subjektais (KIPVPS), derinimo

2 Taikymo sritis

Kam skirtos šios gairės?

1. Šios gairės taikomos VPĮFS sandorio šalims, kaip apibrėžta VPĮFSR 3 straipsnio 2 punkte, sandorių duomenų saugykloms, kaip apibrėžta VPĮFSR 3 straipsnio 1 punkte, ir kompetentingoms institucijoms.

Apie ką šios gairės?

2. Šios gairės taikomos dėl pareigos teikti VPĮFS duomenis, kaip numatyta VPĮFSR 4 straipsnyje, SDS prievolių pagal VPĮFSR 5 straipsnio 7 dalį ir 12 straipsnį, ir VPĮFSR 33 straipsnio 2 dalyje nustatytos duomenų teikimo pradžios datos.

Kada taikomos šios gairės?

3. Šios gairės taikomos nuo jų paskelbimo ESMA interneto svetainėje dienos arba nuo dienos, nuo kurios subjektams taikomos atitinkamos nuostatos, kaip nustatyta VPĮFSR 33 straipsnio 2 dalyje, priklausomai nuo to, kuri data yra vėlesnė.
4. Sandorio šalys, už duomenų teikimą atsakingi subjektai ir duomenis teikiantys subjektai raginami jomis naudotis nuo pat pirmosios dienos, nuo kurios pradedama taikyti pareiga teikti duomenis, kaip numatyta VPĮFSR 33 straipsnio 2 dalies a punkte.

3 Tikslas

5. Šių gairių pagrindas – ESMA reglamento 16 straipsnio 1 dalis. Šių gairių tikslas – patikslinti kai kurias VPĮFSR nuostatas ir pateikti praktinius nurodymus dėl kai kurių iš tų nuostatų įgyvendinimo. Gairės padės sumažinti išlaidas visoje duomenų teikimo grandinėje – duomenis teikiančioms sandorio šalims, SDS, įgyvendinančioms duomenų išsamumo ir teisingumo tikrinimo procedūras, ir VPĮFSR 12 straipsnio 2 dalyje nurodytoms valdžios institucijoms, naudojančioms duomenis finansiniam stabilumui kylančiai rizikai prižiūrėti. Gairėse išaiškinami šie aspektai:
 - a. duomenų teikimo pradžios data, jeigu tai nedarbo diena;
 - b. VPĮFS, apie kuriuos reikia pranešti, skaičius;
 - c. įvairių rūšių duomenų teikimo laukų pildymas;
 - d. metodas, kurį taikant VPĮFS įkaitas susiejamas su VPĮFS paskolomis;
 - e. garantinės įmokos duomenų teikimo laukų pildymas;
 - f. pakartotinio naudojimo, reinvestavimo ir finansavimo šaltinių duomenų teikimo laukų pildymas;
 - g. SDS grįžtamosios informacijos rengimas ir paskesnis jos valdymas, kurį atlieka sandorio šalys, visų pirma, i) atmetant pateiktus duomenis ir ii) esant suderinimo trūkumų ir
 - h. SDS suteikiama prieiga prie duomenų valdžios institucijoms.

4 Bendrieji principai

4.1 Duomenų teikimo pradžios data

6. Pareiga teikti duomenis pagal VPĮFSR 4 straipsnio 1 dalį taikoma atsižvelgiant į atitinkamą taikymo datą, nurodytą VPĮFSR 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktyje. Pirmasis pareigos laikymosi etapas prasideda 2020 m. balandžio 11 d., kuri yra šeštadienis. Pagal

VPĮFSR 4 straipsnio 1 dalį sandorio šalys turėtų įvykdyti savo pareigą teikti duomenis ne vėliau kaip kitą darbo dieną po sandorio sudarymo, pakeitimo ar nutraukimo.

7. VPĮFSR 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktyje nurodyti subjektai, įsteigti ES valstybėse narėse, kur balandžio 13 d. nėra valstybinė šventė, t. y. jeigu tai darbo diena, turėtų pradėti teikti duomenis apie 2020 m. balandžio 11 d. ar po jos sudarytus VPĮFS iki 2020 m. balandžio 13 d.
8. VPĮFSR 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktyje nurodyti subjektai, įsteigti ES valstybėse narėse, kur balandžio 13 d. yra valstybinė šventė, t. y. jeigu tai nedarbo diena, turėtų pradėti teikti duomenis apie 2020 m. balandžio 11 d. ar po jos sudarytus VPĮFS iki 2020 m. balandžio 14 d.
9. Tokio pat požiūrio reikėtų laikytis dėl kitų pareigos teikti duomenis taikymo datų.

4.2 VPĮFS, apie kuriuos reikia pranešti, skaičiaus nustatymas

10. Pagal duomenų teikimo TĮS 1 straipsnio 1 dalį sandorio šalys turėtų teikti VPĮFS duomenis bendroju XML šablonu bendraja elektronine, kompiuteriu skaitoma forma pagal ISO 20022 metodiką. Tam į šias gaires yra įtrauktas atitinkamas XSD komponentas, taikytinas įvairiais naudojimo atvejais.

4.2.1 Rinkos sandoriai, nepatenkantys į VPĮFS apibrėžtį

11. Toliau išvardyti sandoriai neturėtų patekti į VPĮFS apibrėžtį ir apie juos neturėtų būti pranešama pagal VPĮFSR:
 - a. skolinimas mažmeniniams klientams, reglamentuojamas vartojimo kredito teisės aktais;
 - b. privačiosios bankininkystės paskolos ir lombardinės paskolos, nesusijusios su vertybinių popierių finansavimu;
 - c. sindikuotas skolinimas ir kitas skolinimas įmonėms komerciniais tikslais;
 - d. depozitoriumų kreditai su galimybe pereikvoti sąskaitos lėšas ir pagrindinių sandorio šalių paros skolinimo priemonės;
 - e. dienos paskola / banko sąskaitos pereikvojimas vieną banko darbo dieną įvykdant neįvykdytus įsipareigojimus;
 - f. savarankiškas centrinio banko užtikrinimas;
 - g. sandorio perdavimas ir perėmimas atsiskaitymams atlikti vykdymo ir tarpuskaitos grandinėje;
 - h. biržos prekių sandoriai, sudaryti veiklos ir (arba) pramonės tikslais;
 - i. sandoriai, susiję su apyvartiniais taršos leidimais.

4.2.2 Su visų rūšių VPĮFS susiję aspektai

12. VPĮFS šalis, veikianti kaip įgaliotoji šalis ir sudaranti sandorį savo sąskaita, turėtų būti vadinama VPĮFS šalimi.
13. Subjektas, kuris padeda sudaryti VPĮFS, organizuoja jo sudarymą arba kitaip dalyvauja jį sudarant, bet ne kaip įgaliotoji šalis ir ne savo sąskaita, paskolos arba įkaito pusėje ir veikia kliento vardu, turėtų būti apibrėžiama ne kaip sandorio šalis, o kaip makleris, agentas skolintojas, trišalis agentas arba CVPD dalyvis, kaip taikytina. Vienam subjektui sudarant VPĮFS gali tekti keli vaidmenys. Konkreti informacija apie sandorio šalių duomenų rinkinį pateikiama 5.1 skirsnyje.
14. Taigi nustatyti, kokios rūšies VPĮFS jos sudarė, privalo nustatyti pačios sandorio šalys. Be to, kaip paaiškinta Duomenų teikimo TRS 1 priede ir šio dokumento 5.2 skirsnyje, ne visi laukai taikomi visiems VPĮFS, tad sandorio šalys būtinai turi sutarti dėl sudaromo VPĮFS rūšies.
15. Apie VPĮFS reikia pranešti, kai jį sudarė dvi sandorio šalys arba kai viena iš VPĮFS šalių yra asmuo, kuris nėra įmonė, o kita yra sandorio šalis, kaip apibrėžta VPĮFSR. VPĮFS su daugiau nei pora sandorio šalių nebūna. Jeigu paskola paskirstoma tarp dviejų ar daugiau įkaito gavėjų ir dviejų ar daugiau įkaito davėjų, VPĮFS apibrėžiamas kaip kiekviena dviejų sandorio šalių įkaitu užtikrinta vertybinių popierių, grynųjų pinigų ar biržos prekių paskola.
16. Jeigu tenkinamos 12 punkte nustatytos sąlygos, neatsižvelgiant į jų teisinį pobūdį, investiciniai fondai laikomi VPĮFS sandorio šalimis. Konkrečiai kalbant, subfondų atveju, panašiai, kaip daroma pagal ERIR, subfondai paprastai turi LEI. Tokiu atveju apie juos reikėtų atskirai pranešti kaip apie sandorio šalį. Pateikiant atitinkamą informaciją apie paskolą ir įkaitą reikėtų nurodyti to subfondo sudarytus VPĮFS. Jeigu subfondas nėra VPĮFS šalis, žr. 4.17 skirsnį.
17. VPĮFS, kurių tarpuskaita atlikta, atveju kiekvienas iš pagrindinės sandorio šalies, jos tarpuskaitos narių ir jų klientų ir pan. sudarytų VPĮFS yra atskiras VPĮFS ir apie jį reikėtų pranešti nurodant atskirą UTI. Jeigu VPĮFS sudaromas prekybos vietoje ir jo tarpuskaita atliekama tą pačią dieną, kaip numatyta Duomenų teikimo TRS 2 straipsnio 2 dalyje, apie jį pranešama atlikus jo tarpuskaitą, t. y. apie tarpinį sandorio perdavimą ir perėmimą atsiskaitymams atlikti pranešti nereikėtų. Dėl išsamios informacijos apie VPĮFS, kurių tarpuskaita atlikta, duomenų teikimą žr. 4.3 skirsnį.
18. Be to, VPĮFS, sudaromų siekiant įvykdyti neįvykdytus įsipareigojimus, atveju kaip sandorio šalis CVPD turėtų nurodyti atitinkamus CVPD dalyvius, o ne jų klientus. Tai taikytina ir tais atvejais, kai VPĮFS vykdomas pasitelkiant bendrą sąskaitą.
19. Taigi, išskyrus VPĮFSR 2 straipsnio 3 dalyje išvardytus sandorius ir sandorius, nurodytus 4.2.1 skirsnyje, apie visus kitus VPĮFS reikėtų pranešti, kaip paaiškinta tolesniame šių gairių skirsnyje.
20. Reikėtų pažymėti, kad apie pagal 2 straipsnio 3 dalį išvardytus VPĮFS reikėtų pranešti remiantis Reglamentu 600/2014.

4.2.3 Su atpirkimo sandoriais susiję aspektai

21. Tuo atveju, kai paskolos užtikrinamos įkaitu daugiau nei viena valiuta, jos laikomos atskirais VPĮFS ir apie jas turėtų būti pranešama nurodant atskirus UTI. Apie kiekvieną atpirkimo sandorį reikėtų pranešti laikantis bendrųjų atpirkimo sandorio duomenų teikimo principų:
 - a. pranešti apie taikytinas pagrindines sumas ir UTI ir pavienius įkaito komponentus, jei tokių yra, kiekviena atskira valiuta ir
 - b. pranešti apie atitinkamą įkaitą nurodant grynąją poziciją, t. y. tą, kuri padengia atpirkimo sandorius, bet kuri nėra paskirstoma konkrečiai jiems, ir užtikrinti, kad ją būtų galima susieti per atitinkamus laukus.
22. Kai atpirkimo kaina yra nurodyta kita valiuta nei pirkimo kaina, bet ji vis tiek yra susijusi su tuo pačiu atpirkimo sandoriu, tolimesnio atsiskaitymo valiutą reikėtų pakeisti artimesnio atsiskaitymo valiuta, kad būtų galima pateikti atitinkamą informaciją apie kainą ir pagrindines sumas. Žr. gaires dėl valiutos kurso naudojimo pateikiant rinkos vertės duomenis 4.13.1 skirsnyje, siekiant užtikrinti, kad šiam laukui būtų pateikiami nuoseklūs duomenys.
23. Kai atpirkimo sandorio įkaitas nėra pervedimas, kuris vis dėlto yra susitarimo dėl įkaito dalis, kaip apibrėžta Įkaito direktyvoje, sandorio šalys vis tiek turėtų apie jį pranešti kaip apie atpirkimo sandorį. Pagal kitų jurisdikcijų taisykles sudarytų atpirkimo sandorių, kaip antai „gentan“ atpirkimo sandorių, duomenis reikėtų pateikti atitinkamai, pateikiant išsamius ir tikslus duomenis, kaip numatyta Duomenų teikimo TRS.
24. Atpirkimo sandoriams ir atvirkštinio atpirkimo sandoriams, kuriuos pagrindinės sandorio šalys sudaro investuodamos i) nuosavą turtą, kad išlaikytų likvidumą, arba ii) tarpuskaitos narių turtą, pateikiamą kaip taikoma pareiga teikti duomenis pagal VPĮFSR 4 straipsnį.
25. Atpirkimo sandorių ir atvirkštinio atpirkimo sandorių duomenis reikėtų teikti naudojant atpirkimo sandoriams skirtą ISO 20022 XML šabloną.

4.2.4 Su BSB / SBB (pirkimo siekiant parduoti atgal / pardavimo siekiant atpirkti) sandoriais susiję aspektai

26. Tam tikriems BSB / SBB sandoriams taikomi dvišaliai arba pagrindiniai susitarimai. Tačiau konkretūs tokiems VPĮFS skirti priedai skiriasi nuo priedų, susijusių su atpirkimo sandoriais ir atvirkštinio atpirkimo sandoriais. Sudaromo VPĮFS rūšis yra neabejotinai BSB / SBB sandoris.
27. Kai BSB / SBB sandoriui taikomas dvišalis ar pagrindinis susitarimas arba pagrindinio susitarimo priedas, apie tokį susitarimą reikėtų pranešti atitinkamuose laukuose, t. y. paskolų ir įkaito duomenims skirtos 2 lentelės 9–11 laukuose.
28. Sandorio šalys turėtų siekti pranešti apie pagrindinius susitarimus, kurie nėra įtraukti į Duomenų teikimo TĮS, lygiai tokiu pat būdu. Be to, kalbant apie pagrindinį susitarimą, lauke „Pagrindinio susitarimo versija“ reikėtų nurodyti sudaromam VPĮFS taikomą versiją.

29. Kai sandorio šalys nustato, kad apie tam tikrų rūšių BSB / SBB sandorius geriau pranešti naudojant atpirkimo sandorių šabloną, jeigu abi sandorio šalys sutinka, jos turėtų naudoti atpirkimo sandorių šabloną pranešdamos apie tokius VPĮFS.
30. BSB / SBB sandorių duomenis reikėtų teikti naudojant BSB / SBB sandoriams skirtą ISO 20022 XML šabloną.

4.2.5 Su vertybinių popierių skolinimu ir skolinimusi susiję aspektai

31. Kalbant apie apibrėžtį, VPSS sandorio sudarymas yra susijęs su skolinčiojo vertybinių popierių perleidimu skolininkui. Sudarant VPSS sandorį negali būti perleidžiami daugiau nei vieno ISIN kodo vertybiniai popieriai. Jeigu paskirstymą vykdo trečiosios šalys, kaip antai agentai skolintojai, ir tarp tam tikrų dviejų sandorio šalių reikia perleisti daugiau nei vieno ISIN kodo vertybinius popierius, reikėtų pateikti atskirų VPĮFS duomenis dėl kiekvieno ISIN kodo.
32. Atsižvelgiant į tai, kad pagal VPĮFSR 4 straipsnio 1 dalį VPĮFS sudarymo, pakeitimo ir nutraukimo duomenis reikia pateikti ne vėliau nei kitą darbo dieną, reikėtų pranešti apie visus sudarytus VPĮFS. Tai apima visus VPĮFS, kurie buvo sukurti, net jeigu už juos dar neatsiskaityta.
33. Į kai kurių rūšių turto valdytojus pateiktuose įvairiuose scenarijuose neatsižvelgiama. Tarp jų – fondai, kaupiantys vertybinius popierius kaip bendrą grupės turtą ir galintys juos skolinti. Tokie fondai vykdo prekybą per maklerį, kuris veikia kaip agentas ir skolina vertybinį popierių už tam tikrą kiekį iš fondų turto grupės. Tarp sandorio šalies ir grupės patvirtinamas tiesioginis sandoris. Dienos pabaigoje vykdomas galutinis paskirstymas ir kiekvienam grupėje dalyvaujančiam fondui išsiunčiami individualūs patvirtinimai. Išsami informacija taip pat siunčiama sandorio šaliai, o atsiskaitymas vyksta atliekant vieną pavedimą iš bendro visų dalyvaujančių fondų depozitoriumo. Šiuo konkrečiu atveju, laikantis 15 punkte išdėstyto bendrojo principo, sandorio šalys turėtų pateikti SDS atskirų VPĮFS duomenis dėl kiekvienos sandorio šalių poros ir kiekvieno ISIN kodo.
34. Jeigu vertybiniai popieriai skolinami tarp pagrindinių sandorio šalių esant turto grupei, neįmanoma pateikti vienos dienos gyvavimo ciklo veiklos duomenų, jeigu dienos pabaigoje skolininkui ir skolintojui paskirstomos tik gryniosios naujų paskolų pozicijos. Taigi pagrindinių sandorio šalių atveju reikėtų pateikti vienos dienos paskolų duomenis, nors jos nebūtinai suteikiamos su įkaitu. Įkaito duomenis reikėtų pateikti dėl visų kitų VPSS, kurių laukas (2.72) „Vertybinių popierių skolinimo be įkaito žyma“ užpildytas verte „Ne“, įskaitant grynąjį naujų paskolų, už kurias atsiskaityta, poreikį, apie kurį pranešama prekybos ataskaitoje (S+1).
35. VPSS duomenis reikėtų teikti naudojant VPSS skirtą ISO 20022 XML šabloną.
36. Grynųjų pinigų VPSS, taip pat vadinamų atvirkštinėmis vertybinių popierių paskolomis, duomenis reikėtų pateikti kaip atpirkimo sandorių duomenis. Kai grynųjų pinigų VPSS duomenys pateikiami užpildant atpirkimo sandorių laukus, reikėtų pažymėti, kad pagrindinio susitarimo rūšis turėtų atitikti atitinkamą pamatinį susitarimą, pvz., GMSLA.

4.2.6 Su biržos prekių VPĮFS susiję aspektai

37. VPĮFS vykdymas turėtų būti tokios struktūros, kad tikrasis savininkas neprarastų ekonominės biržos prekių nuosavybės ir taip pat neprisiimtų naujos biržos prekių rinkos rizikos.
38. Sudarant biržos prekių atpirkimo / atvirkštinio atpirkimo sandorius paprastai sudaromas (atpirkimo) susitarimas. Biržos prekes galima perleisti tiesiogiai perleidžiant ar įkeičiant nuosavybės teises.
39. Tačiau, atsižvelgiant į biržos prekių VPĮFS taikymo sritį, kai pardavimas ir atpirkimas nėra laikomi atpirkimo sandoriu, jis turėtų būti BSB sandoris.
40. Sudarant biržos prekių skolinimo ir skolinimosi (VPSS) sandorį įkaito gavėjas – tai šalis, kuri skolina biržos prekes, o įkaito davėjas biržos prekes besiskolinanti šalis. Priešingai nei atpirkimo / atvirkštinio atpirkimo sandorių ir BSB / SBB sandorių atveju, kai biržos prekė sudarant sandorį laikoma įkaitu.
41. Pranešant apie biržos prekių VPĮFS, be atitinkamų pagrindinių susitarimų, sandorio šalys turėtų įvertinti, kiek šios rūšies VPĮFS, susijęs su biržos prekėmis, apie kurias pranešama, galėtų būti įtrauktas į tam VPĮFS skirtus laukus. Tai turėtų padėti nustatyti, ar apie sandorį reikia pranešti kaip apie biržos prekių skolinimo ar skolinimosi sandorį arba kaip apie biržos prekes užtikrintą atpirkimo / SBB sandorį ar atvirkštinio atpirkimo / BSB sandorį.
42. Be to, visuose VPĮFS, kaip apibrėžta VPĮFSR 3 straipsnio 7–10 punktuose, išskyrus garantinės įmokos skolinimą, nurodoma, kad biržos prekės gali būti naudojamos kaip VPĮFS dalis. BSB / SBB sandoriuose biržos prekės naudojamos tik kai dvi sandorio šalys perka ir vėliau parduoda (nedalyvaujant rinkos tarpininkui), o biržos prekių skolinimo ir skolinimosi sandoriuose ir atpirkimo sandoriuose gali būti susitariama ir dėl nuosavybės teisių perleidimo, ir dėl jų įkeitimo. Taigi sandorio šalys, kai tinkama, lauke 2.20 „Užtikrinimo priemonės pateikimo būdas“ turėtų nurodyti susitarimo dėl užtikrinimo priemonių rūšį.
43. Su biržos prekėmis susiję VPĮFS kartais gali priklausyti sudėtingesnėms struktūroms, į kurias gali įeiti išvestinės finansinės priemonės, kaip antai ateities sandoriai ir pasirinkimo sandoriai. Duomenis reikėtų pateikti tik apie tas visos struktūros dalis, kurios yra VPĮFS. Apie tokiose struktūrose naudojamas išvestines finansines priemones gali būti pranešama pagal ERIR ir (arba) FPRD ir (arba) REMIT.
44. Kalbant apie lygiavertčių biržos prekių ir biržos prekių pakaitalų reikšmę, ESMA patikslina šiuos aspektus:
 - a. lygiavertės biržos prekės – tos pačios rūšies panašių charakteristikų ir (arba) specifikacijų biržos prekės, kuriomis grąžinimo etape galima pakeisti pirmines biržos prekes, kaip numatyta sutartyje;
 - b. biržos prekių pakaitalai – tai biržos prekės, įkeičiamos kaip biržos prekių, kurios buvo iš pradžių įkeistos tame pačiame sandoryje, pakaitalas.

4.2.6.1 Energijos VPĮFS

45. Sandoris (pvz., dujų pardavimo siekiant atpirkti sandoris tarp zonų, kuriose nustatyti (alternatyvūs) finansavimo tikslai) gali būti REMIT sandoris, apie kurį reikia pranešti per T+30 laikotarpį, ir kartu VPĮFS, apie kurį reikia pranešti per T+1 laikotarpį.
46. Taigi, kai tokių rūšių sandorius galima pakankamai aiškiai ir vienareikšmiškai priskirti prie VPĮFS, skirtų biržos prekėms finansuoti, apie juos reikia pranešti naudojant atitinkamą duomenų teikimo šabloną.

4.2.7 Su garantinės įmokos skolinimu susiję aspektai

47. Tikimasi, kad tarp kiekvienos sandorio šalių poros tam tikru metu sudaromas tik vienas garantinės įmokos skolinimo sandoris, išskyrus atvejus, kai subjektai sutartyje susitaria dėl daugiau nei vienos bazinės valiutos ir garantinės įmokos paskolos suteikiamos kiekviena iš jų; tokiu atveju turėtų būti po vieną garantinės įmokos skolinimo sandorį kiekviena bazine valiuta. Toks VPĮFS bus susijęs su bet kokia garantinės įmokos paskola arba trumposios pozicijos rinkos vertė bazine valiuta.
48. Garantinės įmokos skolinimo sandorių UTI turėtų būti priskiriamas tik jeigu ta priemone buvo bent vieną kartą pasinaudota. Tais atvejais, kai pasirašyta pagrindinio maklerio paslaugų sutartis, bet priemone dar nebuvo pasinaudota, duomenų teikti nereikia, nes dar nėra sudarytas VPĮFS.
49. Jeigu kuriuo nors metu ir garantinės įmokos paskola, ir trumposios pozicijos rinkos vertė nukrenta iki nulio, t. y. nesuteikiamas joks kreditas grynaisiais pinigais ar vertybiniais popieriais, pagrindinio maklerio turimu kliento įkaitu VPĮFS pozicija nebeužtikrinama. Jis laikomas kitiems su VPĮFS nesusijusiems įsipareigojimams. Pagrindinis makleris ir klientas turėtų i) neteikti įkaito duomenų, kol vėl nebus garantinės įmokos paskolos arba trumposios pozicijos rinkos vertės, arba ii) nurodyti, kad įkaitas grynaisiais pinigais yra nulis, kad parodytų, jog įkaito nėra.
50. Teikiant sandorio duomenis veiksmo rūšį reikėtų nurodyti ne kaip „ETRM“, o kaip „MODI“. Šiuo atveju taip pat tikimasi gauti pranešimą apie įkaito atnaujinimą (COLU), kuriame nurodoma nulinė piniginių įkaito vertė, kad būtų galima užtikrinti, kad naudojamas įkaitas nebūtų perteikiamas netinkamai. Dėl nulinio įkaito duomenų teikimo žr. 5.4.4 skirsnį.
51. Garantinės įmokos paskolų atveju sandorio šalys neturėtų pranešti apie užtikrinimo priemonės komponentus, kurie nėra vertybiniai popieriai ir gryniesi pinigai.
52. Kliento trumposios pozicijos rinkos vertės duomenų teikimas neturėtų būti grindžiamas pripažinimu pagrindinio maklerio apskaitoje (kuri yra apskaita prekybos data arba atsiskaitymo data) (TAS 39.38 „Finansinės priemonės. Pripažinimas ir matavimas“). Trumposios pozicijos rinkos vertės duomenis reikėtų teikti taip pat, kaip teikiami atsiskaitymo už paskolą ir įkaitą duomenys. Taigi sandorio šalys trumposios pozicijos rinkos vertę turėtų apskaičiuoti remdamosi numatyta atsiskaitymo data ir vertybiniais popieriais, kurie, kaip tikimasi, bus pateikti.
53. Be to, kai pagrindinio maklerio paslaugų kliento portfelyje vertybiniais popieriais neprekiuojama, pagal VPĮFSR nėra prasmės pranešti apie kredito suteikimą tokiems

klientams ir norint užkirsti kelią didelių nesvarbios informacijos kiekių surinkimui reikėtų to vengti.

4.3 VPJFS, kuriems atlikta pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita, duomenų teikimas

54. Duomenys pozicijos lygmeniu teikiami apie VPJFS, kuriems atlikta pagrindinių sandorio šalių tarpuskaita, o sandorio lygmeniu duomenų galima neteikti, jie yra papildomi. Duomenis pozicijos lygmeniu galima teikti, kai tenkinamos tam tikros sąlygos¹.
- a. Teisiškai susitariama taip, kad rizika yra pozicijos lygmenyje, visos prekybos ataskaitos yra susijusios su produktais, galinčiais pakeisti vienas kitą, o pavienius prekybos sandorius pakeitė pozicija. Tai pasakytina apie atvejus, kai po pavienių prekybos sandorių užskaitos vyksta novacija, dėl užskaitytos pozicijos sudaroma nauja sutartis ir jai priskiriamas naujas UTI. Taip galėtų būti, pavyzdžiui, sandoris tarp tarpuskaitos nario ir pagrindinės sandorio šalies.
 - b. Teisingai pranešta apie pirminius prekybos sandorius, t. y. sandorio lygmeniu. Negalima pranešti vien apie pozicijas.
 - c. Apie kitus įvykius, darančius poveikį bendriems laukams pozicijos ataskaitoje, pranešama atskirai.
 - d. Pirminių prekybos sandorių ataskaitos (b punktas pirmiau) ir su kitais įvykiais susijusios ataskaitos (c punktas pirmiau), kai taikytina, yra pasiekusios tinkamą „gyvavimo ciklo pabaigos būklę“. Tai turėtų būti pasiekama siunčiant pranešimus apie nutraukimą anksčiau laiko ir po to pranešant apie grynąją poziciją kaip apie naują poziciją arba esamos pozicijos atnaujinimą.
 - e. Pozicijos ataskaita pateikiama teisingai, kai visi taikytini laukai užpildomi konkrečios sandorio šalies ir sandorio duomenimis ir prireikus pakartotinai naudojama garantinės įmokos ir įkaito laukų lentelė.
55. Jeigu šios sąlygos įvykdytos, vėliau atnaujintus pateikiamus duomenis, įskaitant atnaujintą nustatytą vertę, atnaujintus įkaito duomenis ir kitus pakeitimus ir gyvavimo ciklo įvykius, galima panaudoti pozicijos ataskaitoje (kaip pakeitimus ir pan., išlaikant tą pačią pozicijos, kuriai atlikta pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita, UTI vertę), o ne pirminių prekybos sandorių ir (arba) įvykių ataskaitose.
56. Pozicijos lygio ataskaitai turėtų būti priskirtas atskiras UTI, kuris yra nuolatinis tos pozicijos identifikatorius, t. y. jis nesikeičia dėl pozicijos pakeitimų.
57. Vėl nustatoma, kad norint teikti pozicijos lygmens duomenis, apie VPJFS, kuriems atlikta tarpuskaita, pirma reikėtų pranešti sandorio lygmeniu nurodant veiksmo rūšį „POSC“ (net jeigu tarpuskaita atliekama tą pačią dieną) ir tik vėliau gyvavimo ciklo įvykių duomenis galima teikti pozicijos lygmeniu. Scenarijų, kuriame pavaizduoti visi duomenų teikimo pozicijos lygmeniu veiksmai, žr. 5.2.1 skirsnyje.

¹ Žr. CP dėl Gairių dėl duomenų teikimo pagal VPJFSR 84 punktą.

4.4 Atsakomybės paskirstymas pagal VPĮFSR 4 straipsnio 3 dalį

4.4.1 Bendrasis atvejis

58. Ne finansų sandorio šalis turėtų pranešti finansų sandorio šaliai, ar ji laikoma mažąja ne finansų sandorio šalimi ar ne, ir nuolat teikti finansų sandorio šaliai informaciją apie galimus statuso pakeitimus.

4.4.2 Trečiosios šalys – finansų sandorio šalys

59. Kai Komisija paskelbia, kad tam tikra trečioji šalis yra lygiavertė, kai VPĮFS sudaromas tarp trečiosios šalies finansų sandorio šalies, turinčios filialą Sąjungoje, ir MVĮ ne finansų sandorio šalies, kai trečiosios šalies finansų sandorio šalis ir MVĮ ne finansų sandorio šalis yra įvykdžiusios toje trečiojoje šalyje nustatytas pareigas teikti duomenis, pagal VPĮFSR apie VPĮFS neturėtų pranešti nei trečioji šalis finansų sandorio šalis, nei MVĮ ne finansų sandorio šalis.

60. Kalbant apie VPĮFS, sudarytus tarp trečiosios šalies finansų sandorio šalies, kuriai netaikomas VPĮFSR (t. y. kuriai netaikomas VPĮFSR 2 straipsnio 1 dalies a punkto ii papunktis), ir MVĮ ne finansų sandorio šalies, apie tokius VPĮFS MVĮ ne finansų sandorio šalis turėtų tiesiogiai pranešti SDS arba pasinaudoti pavedimo galimybe, numatyta 4 straipsnio 2 dalyje.

4.4.3 Fondai

61. Kai atsakomybės paskirstymas pagal VPĮFSR 4 straipsnio 3 dalį nėra taikomas AIFV, t. y. AIFV netaikomas VPĮFSR, atsakomybė pranešti SDS apie VPĮFS ir toliau tenka fondui.

4.5 Savanoriškas pareigos teikti duomenis pavedimas

62. Pavedant pareigą teikti duomenis pavedančioji sandorio šalis (kuriai taikoma pareiga teikti duomenis) turėtų laiku pateikti duomenis teikiančiam subjektui visą informaciją apie VPĮFS; sandorio šalis turi užtikrinti, kad ši informacija būtų teisinga. Be to, duomenis teikiantis subjektas turėtų užtikrinti, kad duomenis teikiančios sandorio šalys būtų informuojamos apie jų vardu teikiamus duomenis, atitinkamus SDS duomenų tvarkymo rezultatus ir atitinkamas su duomenų teikimu ar duomenų kokybe susijusias problemas, jei jų kiltų.

4.6 VPĮFSR įtvirtintų pareigų teikti duomenis taikymas VPĮFS, kuriuos sudaro filialai

4.6.1 VPĮFSR įtvirtintų pareigų teikti duomenis taikymas VPĮFS, kuriuos sudaro filialus ES turintys ES nepriklausantys subjektai

63. Atsižvelgdama į VPĮFSR tikslą ir remdamasi ERIR ESMA mano, kad terminas „sudarymas“ turi būti suprantamas, kaip susijęs su sandorio šalimi, t. y. sandorio šalimi, į kurios apskaitą įtrauktas VPĮFS.

4.6.2 Filialų sudarytų VPĮFS, apie kuriuos reikia pranešti, nustatymas

64. 1 lent. paaiškinama, kokius duomenis reikėtų teikti dėl duomenis teikiančių sandorio šalių filialų.

65. Paskutinėje skiltyje „Reikia pranešti pagal VPĮFSR“ nurodoma, ar sandoriui taikoma VPĮFSR nustatyta pareiga teikti duomenis. Jeigu duomenų teikti nereikia, apie sandorį pranešti nereikėtų nepriklausomai nuo sandorių šalių ir (arba) filialų buvimo vietos. Raudonose 1 lent. eilutėse parodyti scenarijai, apie kuriuos niekada nereikia pranešti pagal VPĮFSR.

66. Svarbu suprasti, kad tam tikrų scenarijų atveju tai, kad sandorio šaliai tenka pareiga teikti duomenis, nereiškia, jog apie VPĮFS reikia pranešti, ir atvirkščiai, kaip paaiškinta 1 lent. Pavyzdžiui, kai sandorius sudaro du to paties juridinio asmens filialai, net jeigu sandorio šaliai (kuriai priskirtas LEI 1) tenka pareiga teikti duomenis, apie tokius sandorius pranešti nereikia, kaip nurodyta paskutinėje skiltyje. Mat tai ne dvi sandorio šalys, o vienos sandorio šalies dalys.

67. Net kai filialas turi LEI, laukuose 1.3 „Pranešimą teikianti sandorio šalis“ ir 1.11 „Kita sandorio šalis“ reikėtų nurodyti atitinkamos būstinės LEI, o atitinkamo filialo informaciją reikėtų pateikti laukuose 1.17 „Pranešimą teikiančios sandorio šalies filialas“ ir 1.8 „Kitos sandorio šalies filialas“. 1.12 lauke „Kitos sandorio šalies valstybė“ reikėtų nurodyti būstinės, o ne filialo valstybės kodą.

1 lent. Duomenų teikimas pagal filialus									
	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

1 lent. Duomenų teikimas pagal filialus

	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
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 Ne finansų sandorio šalies teikiami duomenys

68. ESMA supranta, kad pagal kai kuriuos scenarijus LEI gali būti nežinomas; tačiau šis scenarijus nėra taikomas ES įsteigtoms ne finansų sandorio šalims. Visi subjektai, kuriems taikomas VPĮFSR, turėtų naudoti LEI, kad identifikuotų atitinkamuose duomenų laukuose nurodytus subjektus.
69. Kai VPĮFS sudaro dvi ne finansų sandorio šalys, jos abi turėtų apie jį pranešti SDS, nors jos gali pasinaudoti galimybe pavesti duomenų teikimą pagal 4 straipsnio 2 dalį vienai iš jų arba trečiajai šaliai.

4.8 Veiksmų rūšys

4.8.1 Taikytinos veiksmų rūšys

70. VPĮFS šalys turėtų pranešti apie VPĮFS sudarymą, pakeitimą ir nutraukimą. Jeigu jokie VPĮFS duomenys, nurodyti duomenų laukuose, nėra pasikeitę, sandorio šalys neturėtų vėl teikti VPĮFS duomenų.
71. Apie atnaujintus vertinimus reikėtų pranešti tik jeigu pasikeitė paskolintų arba kaip įkaitas naudojamų vertybinių popierių vertė.
72. Pranešdamos apie įkaitą sandorio šalys neturėtų teikti duomenų apie vienos dienos įkaito pakeitimus ir turėtų pranešti tik apie jo būklę dienos pabaigoje.
73. Veiksmo rūšis gali būti tik viena. Teikiant kiekvienos rūšies veiksmo duomenis valdžios institucijoms teikiama skirtinga informacija verslo ir duomenų tvarkymo požiūriu. Taigi sandorio šalys turėtų stengtis nurodyti teisingą veiksmo rūšį.

4.8.2 Išsamus vaizdas arba VPĮFS pakeitimų duomenų teikimas iš dalies

74. Kai yra su VPĮFS susijusių pakeitimų ir dėl gyvavimo ciklo įvykių, ir dėl taisymų, sandorio šalys turėtų teikti pranešimus su visais taikytiniais laukais, įskaitant nepasikeitusius, kad paskolų ir įkaitų duomenis vis tiek būtų galima pateikti atskirai.
75. Be to, reikėtų pažymėti, kad atnaujinami vertinimo, įkaito, garantinės įmokos ir pakartotinio naudojimo duomenys yra kasdienės išsamios ataskaitos, kuriose privalo būti užpildyti visi svarbūs laukai. Be to, turint omenyje, kad ataskaitos teikiamos kasdien, tikimasi, kad kiekvienu iš tokių išsamių pranešimų bus perteikiama būklė dienos pabaigoje, atsižvelgiant į visus svarbius tą dieną padarytus pakeitimus. Todėl, turint omenyje, kad duomenis reikia pateikti per T+1 laikotarpį, iš sandorio šalies nereikalaujama, kad ji teiktų šios dienos arba ankstesnės darbo dienos įkaito, vertinimo, garantinės įmokos ar pakartotinio naudojimo pataisymų ataskaitą. Priešingai, įkaito, vertinimo, garantinės įmokos ar pakartotinio naudojimo pataisymus reikėtų teikti tik dėl ankstesnių duomenų, jeigu po duomenų teikimo termino pateiktoje informacijoje buvo pastebėta klaida.
76. Informacijos apie sandorio paskolos pusę atveju reikėtų pranešti apie kiekvieną pakeitimą pateikiant jį atskirai nuo paskolos duomenų pataisymų. Jeigu tą pačią dieną buvo įvairių pakeitimų, apie juos galima pranešti pateikiant vieną ataskaitą, jeigu joje tiksliai perteikiami visi pakeitimai.
77. Konkretūs laukai, kuriuos reikia užpildyti kiekvienos rūšies ataskaitoje, nurodomi patvirtinimo taisyklėse.
78. Kalbant apie tam tikrus laukus, kurių nereikėtų keisti (pvz., „įvykdymo laiko žyma“), SDS neprivalo tikrinti, ar šių laukų turinys nebuvo pakeistas, kai duomenys pateikiami nurodant veiksmo rūšį „MODI“, nebent konkretaus lauko patvirtinimo taisyklėse būtų nurodyta kitaip.

4.8.3 Įvairių rūšių pranešimų veiksmų rūšių seka

79. 2 lent., 3 lent. ir 4 lent. pateikiama informacija apie įvairius veiksmų rūšių sekos derinius, kurie nėra draudžiami pagal patvirtinimo taisykles². 2 lent. pateikta informacija taikoma prekybos ir pozicijos³ lygmens pranešimams, o 3 lent. ir 4 lent. yra konkrečiai susijusios su VPJFS, kuriems atlikta pagrindinių sandorio šalių tarpuskaite, garantinių įmokų duomenų teikimu ir pakartotinio naudojimo duomenų teikimu.

		2 lent. Sandorio šalių, paskolų ir įkaitų duomenys							
		Following Steps							
		New	Error	Termination	Modification	Valuation	Collateral	Correction	Position Component
Previous steps	New		x	x	x	x	x	x	
	Error								
	Termination		x		x	x	x	x	
	Modification		x	x	x	x	x	x	
	Valuation		x	x	x	x	x	x	
	Collateral		x	x	x	x	x	x	
	Correction		x	x	x	x	x	x	
	Position Component		x					x	

² Dėl būsimų patvirtinimo taisyklių apibrėžties pakeitimų lentelės turinys gali keistis.

³ Teikiant pozicijos lygmens duomenis pozicijos komponentas netaikomas.

3 lent. Garantinės įmokos atnaujinimas					
		Following step			
		New	Error	Margin update	Correction
Previous step	New		x	x	x
	Error				
	Margin update		x	x	x
	Correction		x	x	x

4 lent. Pakartotinio naudojimo, pinigų reinvestavimo ir finansavimo šaltinių duomenys					
		Following step			
		New	Error	Reuse update	Correction
Previous step	New		x	x	x
	Error				
	Reuse update		x	x	x
	Correction		x	x	x

80. Naudojant 2 lent., 3 lent. ir 4 lent. svarbu suprasti, kad jos skirtos veiksmų rūšims, apie kurias galima pranešti bet kada, kai pateikiama kita veiksmo rūšis, o ne tik galimas tiesiai po jo esantis kitas etapas. Pavyzdžiui, išsiuntus pranešimą, kuriame nurodyta veiksmo rūšis „Pozicijos komponentas“, galima siųsti tik veiksmo rūšį „Pataisymas“ arba „Klaida“. Tačiau išsiuntus veiksmo rūšį „Pataisymas“, ataskaita gali būti bet kokios kitos rūšies. Jeigu subjektas, išsiuntęs pranešimą ir nurodęs veiksmo rūšį „Pozicijos komponentas“, vėliau išsiuntė to paties UTI veiksmo rūšį „Pataisymas“, gali kilti klausimas, ar tas

subjektas gali ir toliau siųsti pranešimus nurodydamas kitas veiksmų rūšis. Atsakymas yra „ne“. Nurodžius veiksmo rūšį „Pataisymas“ nėra panaikinami (nebetaikomi) loginiai apribojimai, pradėti taikyti anksčiau pateikus pranešimą nurodant veiksmo rūšį „Pozicijos komponentas“. Taigi tas subjektas dėl tos pačios veiksmo rūšies vis tiek gali pateikti tik „klaidą“ arba dar vieną „pataisymą“. Be to, pateikus anksčiau nutraukto VPĮFS pataisymą nėra būtina vėl nutraukti VPĮFS, kurio veiksmo rūšis yra „Nutraukimas / pirmalaikis nutraukimas“ (nes „Pataisymas“ nedaro poveikio apmokėto prekybos sandorio būklei).

81. Veiksmų rūšys „Klaida“ ir „Pataisymas“ yra vienintelės priimtinos veiksmų rūšys pateikus pranešimą su veiksmo rūšimi „Pozicijos komponentas“ todėl, kad įtraukus VPĮFS į poziciją, visi paskesni pranešimai (įskaitant įkaito atnaujinimus) turėtų būti teikiami pozicijos lygmeniu. Taigi pranešimai turėtų būti teikiami su skirtingais UTI (t. y. su pozicijos UTI), taip pat reikėtų patvirtinti teisingą tokių tos pozicijos pranešimų sekos nustatymą.
82. VPĮFS duomenis reikėtų siųsti tokia chronologine tvarka, kokia įvyksta įvykiai, laikantis TĮS nustatytų reikalavimų. Tačiau pripažįstama, kad tais atvejais, kai subjektas nepateikia pranešimo laiku arba sužino, kad anksčiau buvo pateikta neteisinga informacija, jis turėtų siųsti pranešimus nurodydamas ankstesnių įvykių datas, tad nesilaikydamas chronologinės tvarkos.
83. Tačiau SDS turėtų peržiūrėti „Įvykio datą“ tik tam, kad patikrintų, ar tai nėra ateities data (tai aiškiai nustatyta patvirtinimo taisyklėse) ir:
 - a. ankstesnių įvykių datų (t. y. duomenų teikimo data –1) atveju tokie įvykiai nedaro poveikio sandoriams suėjus jų terminui arba juos nutraukus, t. y. pranešime nurodoma įvykio data yra ankstesnė nei termino suėjimo data ir, jei nurodoma, nutraukimo data (tai taip pat nustatyta patvirtinimo taisyklėse). SDS taip pat turėtų tikrinti, ar dėl ankstesnės įvykio data pateiktų pakeitimų nesikeičia anksčiau pranešta termino suėjimo data. Be to, SDS neturėtų taikyti pakeitimo, apie kurį pranešta, dabartiniam pranešimui apie prekybos sandorio būklę (jeigu sandoris dar nėra apmokėtas) ir ankstesniam pranešimui apie prekybos sandorio būklę, kurio data sutampa su pranešimo apie įvykį data;
 - b. jeigu įvykių datos sutampa su pranešimo data arba diena prieš pranešimo datą, SDS turėtų taikyti pranešimo apie prekybos būklę pakeitimus remdamasi pateiktų pranešimų seka.
84. SDS turėtų pateikti valdžios institucijoms visus priimtinius prekybos veiklos pranešimus, nepriklausomai nuo įvykio datos.
85. SDS turėtų patvirtinti teisingą pranešimų seką remdamasi jų pateikimo tvarka, nepriklausomai nuo lauko „Įvykio data“ turinio.
86. Atsižvelgiant į tai, kad apie kai kuriuos ankstesnius įvykius gali būti pranešama dėl prekybos sandorių, kurių terminas yra suėjęs arba kurie buvo nutraukti, veiksmo rūšis „Pakeitimas“, „Vertinimo atnaujinimas“ arba „Užtikrinimo priemonės atnaujinimas“ leidžiama siųsti po „Nutraukimo / pirmalaikio nutraukimo“ (jeigu įvykio data yra ankstesnė nei termino suėjimo / nutraukimo data), kaip nurodyta 2 lent.
87. Reikėtų pažymėti, kad apie įkaito pakaitalus po nutraukimo įvykio galima nepranešti (nebent nutraukimas būtų atšauktas). Taigi apie nutraukimą nereikėtų pranešti iki faktinės

nutraukimo datos (išsamesnę informaciją apie pranešimą apie nutraukimą žr. 4.9.5 skirsnyje).

88. Jeigu SDS atmetė daugelį ankstesnių pranešimų, sandorio šalis turėtų kuo greičiau ištaisyti ir iš naujo juos išsiųsti laikydamosi chronologinės įvykių tvarkos. Jeigu tie ankstesni pranešimai yra susiję su įvykiais, kurie įvyko pranešimo pateikimo dieną arba dieną anksčiau ir į kuriuos SDS dėl to atsižvelgtų rengdama pranešimą apie prekybos sandorio būklę (kaip numatyta pirmiau 83 punkte), sandorio šalis taip pat galbūt turės iš naujo pateikti paskutinį (-ius) pranešimą (-us), kad įrašas apie sandorį atitiktų naujausią būklę.
89. Kalbant apie veiksmo rūšį „Klaida“, svarbu pažymėti, kad ją nurodžius jos negalima atšaukti arba kitaip panaikinti. Taigi, jeigu viena iš dviejų sandorio šalių siunčia pranešimą per klaidą nurodydama tokią veiksmo rūšį, sandorio šalys turėtų imtis toliau aprašytų veiksmų, kad toliau duomenų teikimas vyktų teisingai:
 - a. kita sandorio šalis taip pat turėtų išsiųsti pranešimą dėl to paties UTI nurodydama veiksmo rūšį „Klaida“. Šio UTI bus nebegalima naudoti;
 - b. abi sandorio šalys turėtų susitarti dėl naujo UTI, priskirtino šiam sandoriui, apie jį pranešti nurodydamos veiksmo rūšį „Naujas“ ir sutartą naująjį UTI ir toliau teikti duomenis apie paskesnius gyvavimo ciklo įvykius su šiuo UTI.
90. Viena išimtis, kai pateikus veiksmo rūšį „Klaida“ kita sandorio šalis nebūtinai turėtų atšaukti sandorį, būtų galimas scenarijus, pagal kurį viena iš sandorio šalių per klaidą praneštų apie sandorį du kartus dviem skirtingoms SDS ir norėtų atšaukti tik vieną perteklinį pranešimą. Šiuo atveju ta sandorio šalis turėtų siųsti pranešimą nurodydama veiksmo rūšį „Klaida“ vienai SDS, o pats sandoris lieka atidarytas kitoje SDS ir abi sandorio šalys gali ir toliau teikti jo duomenis su tuo pačiu UTI.
91. Taip pat reikėtų pažymėti, kad toks apribojimas nėra taikytinas teikiant duomenis apie garantines įmokas ir pakartotinį naudojimą. Pavyzdžiui, sandorio šalis gali pranešti apie pakartotinį naudojimą per klaidą (kai nebuvo jokio pakartotinio naudojimo) ir tokiu atveju ji turėtų pateikti pakartotinio naudojimo pranešimą nurodydama veiksmo rūšį „Klaida“. Tačiau tai neturėtų kliudyti tai sandorio šaliai pranešti apie pakartotinį naudojimą vėliau, jei reikės.

4.9 Laiku teikiamas pranešimas apie VPĮFS sudarymą, pakeitimą ir nutraukimą

4.9.1 VPĮFS sudarymas

92. Jeigu sudarytas VPĮFS vėliau nutraukiamas (įskaitant atvejus, kai jis nutraukiamas dėl nepavykusio atsiskaitymo), sandorio šalys, pranešusios apie jį su veiksmo rūšimi „Naujas“, turėtų pranešti apie jį nurodydamos veiksmo rūšį „Nutraukimas / pirmalaikis nutraukimas“. Jeigu apie pirminį VPĮFS buvo pranešta nurodant veiksmo rūšį „Pozicijos komponentas“, o vėliau jis buvo nutrauktas, sandorio šalys neturėtų siųsti pranešimo su veiksmo rūšimi „Nutraukimas / pirmalaikis nutraukimas“ dėl pirminio VPĮFS; sandorio šalys turėtų siųsti pranešimą nurodydamos veiksmo rūšį „Pakeitimas“ dėl pozicijos, į kurią buvo įtrauktas pirminis VPĮFS, kad tas VPĮFS būtų pašalintas iš tos pozicijos.

93. Veiksmo rūšį „Klaida“ reikėtų naudoti tik siekiant panaikinti sandorius, kurie taip ir nebuvo sudaryti arba kuriems netaikoma pareiga teikti duomenis pagal VPĮFSR. Pagal konkretų scenarijų, pagal kurį sandorio šalys susitaria sudaryti sandorį, kurį pagrindinė sandorio šalis turi užregistruoti, o pagrindinė sandorio šalis jį atmeta, sandorio šalys turėtų nutraukti VPĮFS nurodydama veiksmo rūšį „Klaida“, nes nebuvo įvykdyta sutarta sandorio sudarymo sąlyga ir sandoris taip ir nebuvo sudarytas.
94. Be to, reikėtų pažymėti, kad apie laikinai nepavykusį atsiskaitymą, dėl kurio VPĮFS nėra nutraukiamas, pranešti nereikėtų.
95. Konkrečiu garantinės įmokos skolinimo atveju apie VPĮFS sudarymą reikėtų pranešti, kai pirmą kartą susidaro trumposios pozicijos rinkos vertė arba grynasis debetinis pinigų likutis (kliento požiūriu), ir reikėtų atitinkamai nurodyti įvykdymo laiko žymą.

4.9.2 VPĮFS pakeitimas ir pataisymas

96. Pakeičiant VPĮFS pranešama apie šias veiksmų rūšis: „Pakeitimas“ ir „Pataisymas“. Duomenų teikimo laikotarpis yra toks pat, kaip prekybos sandorio sudarymo atveju, t. y. reikia pranešti nuo to momento, kada įsigalioja pakeitimas. Kai taikytina, pvz., atliekant pakeitimus VPSS paskolos pusėje, tai reikėtų suprasti kaip numatytą atsiskaitymo datą.
97. Sandorio šalys turėtų pranešti tik apie įvykusius pakeitimus, t. y. jos neturėtų pranešti apie pakeitimus, dėl kurių buvo susitarta, bet kurie įsigalios ateityje. Pavyzdžiui, jeigu sandorio šalys susitaria įvertinti atpirkimo sandorį pakartotinai ateities data, apie pakartotinį vertinimą reikėtų pranešti tik kai ateis sutarta data (pakartotinio vertinimo įsigaliojimo data).
98. Kaip ir pranešimų apie sudarymą atveju, laikinai nepavykus atsiskaityti apie tai nepranešama, nebent dėl to tektų atlikti sandorio pakeitimus, apie kuriuos tuomet reikėtų atitinkamai pranešti nurodant veiksmo rūšį „Pakeitimas“. Pavyzdžiui, jeigu apie dalinį VPĮFS gražinimą pranešama kaip apie pakeitimą ir vėliau dėl nepavykusio atsiskaitymo jis panaikinamas, sandorio šalys turėtų pranešti apie kitą šio VPĮFS pakeitimą, kad atšauktų su daliniu gražinimu susijusius pakeitimus.
99. Keičiant VPĮFS atgaline data (pvz., kai VPĮFS šalys dvišaliu pagrindu susitaria pakartotinai įvertinti sandorį nustatydamos praeities įsigaliojimo datą), sandorio šalys neprivalo pakartotinai teiktų pranešimų apie visus paskesnius veiksmus nuo atgaline data atlikto pakeitimo įsigaliojimo datos. Reikėtų pažymėti, kad pranešimą apie atgaline data atliekamą pakeitimą reikėtų pateikti nurodant teisingą ankstesnę įvykio datą (sutampančią su pakeitimo įsigaliojimo data). Tokiu atveju SDS neturėtų taikyti pakeistų duomenų pranešimui apie prekybos sandorio būklę⁴.
100. Apie pataisymus reikėtų pranešti iš karto, kai nustatoma, kad buvo pateikti neteisingi duomenys. Pranešimo apie pataisymą siųsti nereikia, jeigu pakeitus VPĮFS sandorio šalis įvedė neteisingą informaciją tik į savo vidaus sistemas; tokiais atvejais įmonė turėtų siųsti pranešimą apie pakeitimą, į kurį įtraukiami tik galutiniai, teisingi duomenys.

⁴ Dėl išsamesnės informacijos apie įvykio datos poveikį tam, kaip SDS tvarko pranešimus, žr. 4.8.3 skirsnį.

4.9.3 Užtikrinimo priemonės atnaujinimas

101. Apie užtikrinimo priemonės atnaujinimą reikėtų pranešti nurodant jo įsigaliojimo datą, t. y. numatytą atsiskaitymo datą. Tačiau gali būti taip, kad sandorio šalys susitaria dėl kai kurių atnaujinimų, bet dėl su sandorio šalimis ar trečiosiomis šalimis, kaip antai pagrindinėmis sandorio šalimis arba CVPD, susijusių priežasčių jie gali būti neatlikti. Tai reikėtų, kad atitinkamą pranešimą apie įkaito atnaujinimą reikėtų pateikti pakartotinai pateikiant galutinius, teisingus duomenis. Apie laikinai nepavykusius atsiskaitymus, kurie nedaro poveikio sutartam įkaitui, pranešti nereikėtų.
102. Kai kuriais kitais atvejais subjektai jau sutarė dėl kai kurių įkaito pakeitimų, bet dar jų nepadarė. Sandorio šalys turėtų pranešti tik apie padarytus įkaito atnaujinimus, t. y. jos neturėtų pranešti apie įkaitą, kurio numatyta atsiskaitymo data yra ateityje.
103. Įkaito atnaujinimai yra išsamios dienos ataskaitos, kuriose turi būti apibūdinama įkaito būklė tam tikros dienos pabaigoje. Apie vienos dienos įkaito pakeitimus pranešti nereikėtų. Konkrečiu atveju, kai sudaromi vienos dienos sandoriai, kuriems įkaitas pateikiamas tik tą dieną ir dienos pabaigoje tampa nulinis, sandorio šalys turėtų pranešti apie nulinį įkaitą.
104. Kai vietoje sudaromi sandoriai, kuriems atliekama pagrindinės sandorio šalies tarpuskaity, įtraukiami į poziciją ir apie juos pranešama nurodant veiksmo rūšį „Pozicijos komponentas“, įkaito atnaujinimų duomenis reikėtų siųsti dėl pozicijos, į kurią tokie sandoriai buvo įtraukti, o ne dėl pirminių sandorių.
105. Galiausiai reikėtų pažymėti, kad paskutinis įkaito atnaujinimas turėtų būti pateikiamas dėl paskutinės dienos, kurią atitinkamas (-i) VPĮFS nėra apmokėtas (-i); jis turėtų būti pateikiamas iki kitos dienos pabaigos. Pateikus pranešimą apie VPĮFS su veiksmo rūšimi „Pirmalaikis nutraukimas“ arba terminuotam (-iems) VPĮFS pasiekus termino suėjimo dieną, to (tų) VPĮFS įkaito atnaujinimų pateikti nereikėtų (išskyrus trūkstamus vėluojamus pateikti pranešimus).
106. Konkrečiai kalbant apie garantinės įmokos skolinimą, įkaito atnaujinimus reikėtų siųsti tik jeigu susidaro trumposios pozicijos rinkos vertė arba grynasis debetinis likutis (kliento požiūriu). Tais atvejais, kai klientas dar nėra pasinaudojęs garantinės įmokos paskola, sandorio šalys neturėtų pranešti nei apie VPĮFS, nei apie atitinkamą įkaitą. Taip pat gali būti scenarijų, kai klientas yra pasinaudojęs garantinės įmokos paskola (taigi apie garantinės įmokos skolinimo sandorį ir atitinkamą įkaitą buvo pranešta) ir vėliau garantinės įmokos paskola tapo nulinė. Tokiais atvejais, jeigu sandorio šalys nenuspręstų uždaryti VPĮFS, pirmą dieną, kurią garantinės įmokos paskolos vertė tampa nulinė, jos turėtų pranešti apie nulinį įkaitą. Kai klientas vėl pasinaudoja garantinės įmokos paskola, dėl to VPĮFS reikėtų pranešti faktines įkaito vertes.

4.9.4 Vertinimo, garantinės įmokos ir pakartotinio naudojimo atnaujinimai

107. Vertinimo atnaujinimų atveju sandorio šalys turėtų siųsti dienos vertinimus iki kitos po vertinimo dienos darbo dienos pabaigos ir nurodyti šią datą lauke „Įvykio data“.
108. Apie garantinės įmokos atnaujinimus reikėtų pranešti, kai jie įsigalioja, t. y. numatytą atsiskaitymo dieną, neatsižvelgiant į laikinai nepavykusius atsiskaitymus.

109. Tuo konkrečiu atveju, kai prekybos sandorių, kuriems atlikta tarpuskaita, portfelyje garantinės įmokos apmokamos pagrindinei sandorio šaliai iš anksto, apie jas reikėtų pranešti pirmojo taikytino VPĮFS atitinkamame portfelyje (susiejant juos pagal portfelio kodą) T+1 dieną, o ne kitą dieną po to, kai jis buvo pateiktas.
110. Kalbant apie pranešimą apie pakartotinį naudojimą, jis priklauso nuo atsiskaitymo, t. y. sandorio šalys turėtų pranešti tik apie pakartotinai naudojamos užtikrinimo priemonės vertę tam tikros dienos pabaigoje. Tokia atsiskaitymo data turėtų būti nurodoma pranešimuose apie pakartotinį naudojimą kaip „Įvykio data“ ir tokie pranešimai turėtų būti pateikiami iki kitos dienos pabaigos (t. y. atsiskaitymo data + 1). Pranešimai apie pakartotinį naudojimą yra išsamūs dienos pabaigos pranešimai, t. y. jais turėtų būti pranešama apie pakartotinai naudojamą užtikrinimo priemonę dienos pabaigoje, o ne apie pakeitimą palyginti su anksčiau pateiktomis vertėmis (pranešimas apie skirtumą).

4.9.5 VPĮFS nutraukimas

111. Sandorio šalys neturėtų siųsti pranešimo nurodydamos veiksmo rūšį „Nutraukimas / pirmalaikis nutraukimas“, kai sueina terminuoto VPĮFS terminas ir jis nebėra neapmokėtas.
112. Jeigu sandorio šalys susitaria nutraukti terminuotą VPĮFS anksčiau termino suėjimo datos arba nutraukti neterminuotą VPĮFS, jos turėtų:
 - a. pateikti pranešimą nurodydamos veiksmo rūšį „Nutraukimas / pirmalaikis nutraukimas“, kai numatyta atsiskaitymo už nutraukiamą sandorį data sutampa su pranešimo apie nutraukimą data, arba
 - b. pateikti pranešimą nurodydamos veiksmo rūšį „Pakeitimas“, kai numatyta atsiskaitymo už nutraukiamą sandorį data yra kita diena ar vėlesnė data. Šiuo atveju sandorio šalys turėtų atitinkamai pakeisti termino suėjimo datą.
113. Atsižvelgiant į tai, kad laikantis duomenų teikimo logikos, įtvirtintos VPĮFS TRS ir (arba) TĮS (ir atitinkančios šiuo metu taikomą duomenų teikimo logiką pagal ERIR), nutraukus sandorį jo negalima vėl „atidaryti“, sandorio šalys neturėtų pranešti apie nutraukimą, jeigu jis nėra susijęs su nepavykusiu atsiskaitymu.
114. Praktiškai, jeigu kitą dieną po sutartos pirmalaikio nutraukimo datos sandorio šalys sužino, kad su nutraukiamu sandoriu susijęs atsiskaitymas numatytą atsiskaitymo dieną neįvyko, jos neturėtų siųsti pranešimo nurodydamos veiksmo rūšį „Nutraukimas / pirmalaikis nutraukimas“, kol už nutraukiamą sandorį nebus atsiskaityta. Jeigu nutraukimas atšauktas dėl nepavykusio atsiskaitymo, sandorio šalys neturėtų siųsti pranešimo nurodydamos veiksmo rūšį „Nutraukimas / pirmalaikis nutraukimas“, nes VPĮFS ir toliau lieka neapmokėtas.
115. Be to, artėjant VPĮFS termino suėjimo dienai (kuri yra iš pradžių sutartyje nustatyta termino suėjimo diena (2.14 laukas) arba pakeista termino suėjimo diena pranešant apie iš anksto sutartą pirmalaikį nutraukimą), jeigu kitą dieną po termino suėjimo dienos sandorio šalys sužino, kad paskutiniame etape už VPĮFS nebuvo atsiskaityta, jos turėtų siųsti pranešimą apie pakeitimą, kad nukeltų termino suėjimo datą iki kitos dienos arba kitos ateities datos, kurią tikimasi atsiskaityti. Reikėtų pažymėti, kad toks termino suėjimo datos pakeitimas būtų įmanomas tik iki kitos dienos po termino suėjimo dienos, nes nuo jos VPĮFS nebebus

neapmokėtas ir jo nebebus galima vėl „atidaryti“. Kai už grąžinimą atsiskaitoma sėkmingai, sandorio šalys neturėtų siųsti papildomų pranešimų, nes VPĮFS bus laikomas apmokėtu nuo kitos dienos po termino suėjimo datos.

4.9.6 Kiekvienos pranešimo rūšies ir veiksmo rūšies duomenų teikimo terminų apžvalga

116. 5 lent. paaiškinama, ką reikėtų nurodyti kaip „Įvykio datą“ kiekvienos rūšies pranešimuose ir kiekvienos veikimo rūšies atveju. Įvykio data iš esmės taip pat nurodo, dėl ko reikia teikti pranešimą, pvz., įkaito atnaujinimo atveju tai numatyta atsiskaitymo data arba vertinimo atnaujinimo atveju – vertinimo data. Pranešimai faktiškai turėtų būti pateikiami iki kitos darbo dienos po įvykio datos pabaigos.

5 lent. Įvykio data		
Table	Action type	Įvykio data
1&2	NEWT	Sutarties sudarymo data („prekybos sandorio data“)
1&2	MODI	Faktinė pakeitimo data arba, jei taikytina, numatyta atsiskaitymo data
1&2	CORR	Data, nuo kurios turėtų būti taikomas pataisymas (paprastai data, dėl kurios buvo anksčiau pateikti neteisingi duomenys)
1&2	ETRM	Numatyta atsiskaitymo už nutraukiamą sandorį data
1&2	EROR	Netaikytina
1&2	COLU	Numatyta atsiskaitymo data
1&2	VALU	Vertinimo data
3	NEWT	Numatyta atsiskaitymo data
3	MARU	Numatyta atsiskaitymo data
3	CORR	Data, nuo kurios turėtų būti taikomas pataisymas (paprastai data, dėl kurios buvo anksčiau pateikti neteisingi duomenys)
3	EROR	Netaikytina
4	NEWT	Faktinė atsiskaitymo data
4	REUU	Faktinė atsiskaitymo data
4	CORR	Data, nuo kurios turėtų būti taikomas pataisymas (paprastai data, dėl kurios buvo anksčiau pateikti neteisingi duomenys)
4	EROR	Netaikytina

4.10 Veiklos įvykių susiejimas su veiksmy rūšimis ir lygiais

117. 6 lent. parodyta, kaip veiklos įvykiai, įvykstantys per VPĮFS gyvavimo ciklą, susiejami su Duomenų teikimo TRS nustatytais veiksmy rūšimis.
118. Jeigu sandorio šalys susitaria anksčiau laiko nutraukti ir pakeisti VPĮFS, apie tai reikėtų atitinkamai pranešti. Tokiais atvejais sandorio šalys turėtų pirma nutraukti pirminį VPĮFS (išsiųsdamos veiksmo rūšį „Nutraukimas / pirmalaikis nutraukimas“ arba „Pakeitimas“ su pakeista termino suėjimo data) ir po to pateikti pranešimą apie naują sandorį (kurio veiksmo rūšis yra „Naujas“).

119. Be to, norint supaprastinti lentelę, visi įvykiai, dėl kurių VPĮFS nutraukiamas, susiejami su veiksmo rūšimi „Nutraukimas / pirmalaikis nutraukimas“, išskyrus 44 įvykį, konkrečiai susijusį su nutraukiamų sandorių duomenų teikimu. Tačiau pripažįstama, kad sutarus nutraukti sandorį kitą dieną ateityje, apie tai paprastai reikėtų pranešti kaip apie termino suėjimo datos pakeitimą (nurodant veiksmo rūšį „Pakeitimas“), o apie nutraukimą tą pačią dieną reikėtų pranešti nurodant veiksmo rūšį „Nutraukimas / pirmalaikis nutraukimas“.
120. Į Duomenų teikimo TS negalima įtraukti papildomų veiksmų rūšių, tad pranešdamos apie VPĮFS ir atitinkamus su jais susijusius veiklos įvykius sandorio šalys turėtų naudoti tas, kurios yra įtrauktos į TS.
121. Apie veiklos gyvavimo ciklo įvykius, susijusius su įvairių rūšių VPĮFS, reikėtų pranešti nurodant toliau išvardytas veiksmų rūšis (2.98 laukas) ir atitinkamus lygius (2.99 laukas)⁵.

6 lent. Veiklos įvykių susiejimas su veiksmų rūšimis ir lygiais

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message ⁶	Action Type	Level	Pastabos ir pavyzdžiai
1	Backloading	All	Table 1 and Table 2	NEWT	TCTN / PSTN	
2	Conclusion	All	Table 1 and Table 2	NEWT or POSC	TCTN / PSTN	Įtraukiami bendri agento vykdomi sandoriai atliekant paskirstymą klientams. Taip pat įtraukiami sandoriai, apie kuriuos reikia pranešti ir kurie sudaromi atsiskaitymo tikslais (savarankiškas (T)CVPD ir kitų kredito įstaigų užtikrinimas, vienos dienos vertybinių popierių iš (T)CVPD autoskolinimasis). Apie pirminio etapo atsiskaitymą, įskaitant atidėtąjį atsiskaitymą, dėl kurio VPĮFS nėra nutraukiamas arba neatliekama kitų jo pakeitimų, neturėtų būti pranešama atskirai. Garantinės įmokos skolinimo atveju apie sudarymą reikėtų pranešti, kai kreditas pratęsiamas pirmą kartą.
3	Roll-over into new identical transaction	REPO	Table 1 and Table 2	NEWT	TCTN	
4	Extension	REPO, SLB	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN	Tai apima, pvz., atpirkimo sandorio, kurį galima pratęsti, pratęsimą, <i>ad hoc</i> susitarimą pakeisti terminuoto atpirkimo sandorio atpirkimo datą arba susitarimas atidėti atpirkimo datą vykstant neįvykdytų įsipareigojimų tvarkymo procesui.
5	Automatic change of purchase and repurchase dates of an evergreen SFT at	REPO, SLB	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN	

⁵ Veiklos įvykių sąrašas nėra baigtinis.

⁶ Daromos nuorodos į TRS ir Duomenų teikimo TĮS lenteles.

6 lent. Veiklos įvykių susiejimas su veiksmų rūšimis ir lygiais

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message ⁶	Action Type	Level	Pastabos ir pavyzdžiai
	the end of each business day until termination or maturity					
6	Cancellation of disputed transaction (after external reporting)	All	Table 1 and Table 2	EROR	-	
7	New allocation of the SFTs	All	Table 1 and Table 2	NEWT	TCTN	Pvz., kai agentas atskleidžia pagrindines šalis kitai bendro agento vykdomo atpirkimo sandorio šaliai.
8	Full reallocation with a new UTI	All	Table 1 and Table 2	ETRM + NEWT	TCTN	Tai taip pat apima scenarijų, kai perskirstymas vyksta prieš atsiskaitant pradiniame pirminio sandorio etape.
9	Full reallocation to an existing UTI	All	Table 1 and Table 2	ETRM + MODI	TCTN	Tai taip pat apima scenarijų, kai perskirstymas vyksta prieš atsiskaitant pradiniame pirminio sandorio etape.
10	Partial reallocation to a new UTI	All	Table 1 and Table 2	MODI + NEWT	TCTN	Tai taip pat apima scenarijų, kai perskirstymas vyksta prieš atsiskaitant pradiniame pirminio sandorio etape.
11	Partial reallocation to an existing UTI	All	Table 1 and Table 2	MODI + MODI	TCTN	Tai taip pat apima scenarijų, kai perskirstymas vyksta prieš atsiskaitant pradiniame pirminio sandorio etape.
12	Increase or reduce size of a repo by modifying the terms of the contract (same UTI, no settlement instructions issued)	REPO	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN	
13	Agreement to accept the partial delivery of the collateral as final implemented by a change in contractual terms	REPO	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN	
14	Partial termination	REPO, BSB, ML	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN / PSTN	
15	Partial return	All	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN / PSTN	Apie dalinio grąžinimo atsiskaitymą, įskaitant atidėtąjį atsiskaitymą, dėl kurio dalinis grąžinimas nėra panaikinamas, neturėtų būti pranešama atskirai.
16	Cancellation or failure of the partial return	SBL	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN / PSTN	Apie atidėtąjį atsiskaitymą, dėl kurio dalinis grąžinimas nėra panaikinamas, neturėtų būti pranešama.
17	Re-rating (fixed rate, spread or rebate rate)	REPO, BSB, SLB	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN	

6 lent. Veiklos įvykių susiejimas su veiksmų rūšimis ir lygiais

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message ⁶	Action Type	Level	Pastabos ir pavyzdžiai
18	Agreed cancellation of the re-rate, hence reverting to the previous rate	REPO, BSB, SLB	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN	Jeigu dėl pakartotinio vertinimo nesusitarta, bet per klaidą apie jį vienašališkai pranešta, apie ankstesnio vertinimo pakeitimą reikėtų pranešti nurodant „CORR“.
19	Change in floating repo rate	REPO	Table 1 and Table 2	MODI	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	MODI	TCTN	Dėl tokio įvykio būtų siunčiamas pranešimas apie atpirkimo kainos pakeitimą.
21	Events impacting the collateral value	REPO, BSB	Table 1 and Table 2	COLU	-	Pvz., įkaito pajamų mokėjimas (atpirkimo sandoris, BSB sandoris), kompensacinis mokėjimas (atpirkimo sandoris, BSB sandoris), planinis kintamosios normos įkaito arba indeksuojamo įkaito indekso normos pakeitimas bet kokios rūšies atpirkimo sandorių atveju).
22	Cash mark	SBL	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN / PSTN	
23	Fee mark	SBL	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN / PSTN	
24	Valuation of securities on loan	SLB	Table 1 and Table 2	VALU	-	
25	Flat margin loan and/or short market value	ML	Table 1 and Table 2	MODI	-	
26	Change in outstanding margin loan or short market value	ML	Table 1 and Table 2	MODI	-	
27	Change of base currency used for margin loan	ML	Table 1 and Table 2	MODI	-	
28	Additional base currency used for margin loan	ML	Table 1 and Table 2	NEWT	-	Garantinės įmokos paskola suteikiama tik viena bazine valiuta, tad apie papildomą bazinę valiutą reikėtų pranešti kaip apie naują garantinės įmokos paskolą su nauju UTI.
29	Valuation of securities used as collateral	All	Table 1 and Table 2	COLU	-	
30	First allocation of collateral on the day of trade	REPO	Table 1 and Table 2	NEWT or COLU	TCTN	Kai pateikiami įkaito duomenys nurodant kito VPĮFS informaciją pranešant apie naują sandorį, naudojama veiksmo rūšis NEWT. Tai, pavyzdžiui, galėtų būti scenarijus, kai pardavėjas skiria įkaitą naujam bendrosios užtikrinimo

6 lent. Veiklos įvykių susiejimas su veiksmų rūšimis ir lygiais

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message ⁶	Action Type	Level	Pastabos ir pavyzdžiai
						priemonės (BUP) atpirkimo sandoriui arba kai trišalis agentas pirmą kartą skiria įkaitą prekybos sandorio dieną.
31	First allocation of collateral after the day of trade	REPO	Table 1 and Table 2	COLU	TCTN	Tai, pavyzdžiui, galėtų būti scenarijus, kai pardavėjas skiria įkaitą naujam BUP atpirkimo sandoriui arba kai trišalis agentas pirmą kartą skiria įkaitą prekybos sandorio dieną.
32	Substitution of Collateral	All	Table 1 and Table 2	COLU	-	Pavyzdžiui, įtraukiama laikinas vertybinių popierių pakeitimas grynaisiais pinigais (paprastai tai daro trišalis agentas), jeigu pardavėjo sąskaitoje tinkama užtikrinimo priemonė yra nepakankama, laikinas piniginių įkaito pakeitimas vertybinių popierių įkaitu, laikinas užtikrinimas grynaisiais pinigais, jeigu vėluojama grąžinti vertybinius popierius vykdant kintamojo įkaito vertės išlaikymo prievolę pagal GMRA 6 straipsnio h punktą. Taip pat įtraukiami visi įkaito pakeitimai, susiję su įmonės įvykiais.
33	Change in collateral quality	All	Table 1 and Table 2	COLU	-	
34	Change in cash collateral amount or currency	REPO, SLB	Table 1 and Table 2	COLU	-	
35	Buy-in where required by regulation (e.g. CSDR) or market convention (not under GMRA)	All	Table 1 and Table 2	COLU	-	
36	Cash compensation where required by regulation (e.g. CSDR) or market convention (not under GMRA)	All	Table 1 and Table 2	COLU	-	
37	Default of the collateral issuer	All	ALL	COLU or ETRM	TCTN / PSTN	ETRM reikėtų nurodyti tik jeigu įkaito davėjui neįvykdžius įsipareigojimų VPIFS nutraukiamas. Antraip apie įkaito pakeitimą reikėtų pranešti nurodant COLU.
38	Variation margining	REPO, SLB, BSB	Table 1 and Table 2	COLU	-	Dėl grynosios pozicijos teikiamas atskiras COLU pranešimas.

6 lent. Veiklos įvykių susiejimas su veiksmų rūšimis ir lygiais

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message ⁶	Action Type	Level	Pastabos ir pavyzdžiai
39	Change in haircut or margins	REPO, SLB	Table 1 and Table 2	COLU	TCTN / PSTN	
40	Clearing off-venue	All	Table 1 and Table 2	ETRM + NEWT	TCTN / PSTN	Įtraukiami ne biržos sandoriai, kurių tarpuskaita atlikta tą pačią dieną ar vėliau.
41	Post-trade clearing of a transaction executed on a trading venue	All	Table 1 and Table 2	ETRM + NEWT	TCTN / PSTN	Įtraukiami prekybos vietoje sudaryti sandoriai, kurių tarpuskaita atlikta po prekybos sandorio dienos.
42	Same-day clearing of a transaction executed on a trading venue	All	Table 1 and Table 2	NEWT	TCTN / PSTN	Įtraukiami prekybos vietoje sudaryti sandoriai, kurių tarpuskaita atlikta pagal viešo pasiūlymo modelį ir taikant tos pačios dienos novaciją.
43	CCP rejects transaction which is conditional upon registration with the CCP	All	Table 1 and Table 2	EROR	-	
44	Termination of an open SFT or termination of a term repo (by agreement or unilaterally)	REPO, SLB	Table 1 and Table 2	MODI or ETRM	TCTN	ERTM reikėtų nurodyti nutraukiant sandorį tą pačią dieną, o MODI reikėtų naudoti pranešant apie nutraukimą ateities data (pakeičiant termino suėjimo datą).
45	Termination of an evergreen or puttable SFT	REPO, SLB	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN	Įtraukiama nutraukimo pasirinkimo galimybė.
46	Maturity/Expiration	All	Table 1 and Table 2	no report	-	Apie laikinai nepavykusį atsiskaitymą už VPĮFS, kurio terminas netrukus sueis, nereikėtų pranešti atskirai.
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	-	Apie visiško grąžinimo atsiskaitymą, įskaitant atidėtąjį atsiskaitymą, dėl kurio visiškas grąžinimas nėra panaikinamas, neturėtų būti pranešama atskirai.
48	Cancellation or failure of the full return	SBL	Table 1 and Table 2	no report or NEWT	TCTN	Apie visišką grąžinimą neturėtų būti pranešama, jeigu jį atlikus nėra atsiskaitoma, tad jeigu visiškas grąžinimas panaikinamas, papildomai pranešti nereikia. Tačiau, jeigu apie visišką grąžinimą pranešta nurodant ETRM, o vėliau visiškas grąžinimas panaikinamas, apie sandorį reikėtų pranešti pakartotinai nurodant veiksmo rūšį NEWT ir naują UTI.
49	Closure of an SFT due to counterparty default	All	Table 1 and Table 2	ETRM	-	Tai, pavyzdžiui, reiškia, kad sandorio šalis gali būti pripažinta nevykdančia įsipareigojimų, jeigu dėl tokios įsipareigojimų neįvykdymo galimybės buvo susitarta pagal GMRA 10 straipsnio a punkto ii papunktį.

6 lent. Veiklos įvykių susiejimas su veiksmų rūšimis ir lygiais

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message ⁶	Action Type	Level	Pastabos ir pavyzdžiai
50	Termination of transaction under specific GMRA provisions	REPO, BSB	Table 1 and Table 2	ETRM	-	Tai apima: sandorio nutraukimą pagal 2000 m. GMRA 10 straipsnio g punktą arba 2011 m. GMRA 10 straipsnio h punktą; „mini užbaigimą“ pagal 2000 m. GRMA 10 straipsnio h punktą arba 2011 m. GMRA 10 straipsnio i punktą; perkainojimą arba koregavimą pagal 2000 m. GMRA 4 straipsnio i–k punktus arba 2011 m. GMRA 4 straipsnio j–l punktus.
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	MODI	TCTN / PSTN	Sandorio šalys sutinka pakeisti sandorio požymį. Taip surenkami visi pakeitimai, kurie nėra išvardyti atskirai.
53	Amend trade - unilateral	All	Table 1 and Table 2	CORR	TCTN / PSTN	Viena šalis pataiso sandorio požymį.
54	Amend collateral - bilateral	All	Table 1 and Table 2	COLU	TCTN / PSTN	Sandorio šalys sutinka pakeisti įkaito požymį. Taip surenkami visi pakeitimai, kurie nėra išvardyti atskirai.
55	Amend collateral - unilateral	All	Table 1 and Table 2	CORR	TCTN / PSTN	Viena šalis pataiso įkaito požymį.
56	Lifecycle event (e.g. change in size or re-rating of open repo) incorrectly reported	All	Table 1 and Table 2	CORR	TCTN / PSTN	Pirmalaikio nutraukimo, apie kurį pranešta neteisingai, arba klaidos ištaisyti neįmanoma. Išsiuntus pranešimą su šiomis veiksmų rūšimis sandoriui nebegalima nustatyti neapmokėto sandorio statuso, todėl apie sandorį būtina vėl pranešti nurodant veiksmo rūšį NEWT ir naują UTI.
57	Transaction not executed or out of scope of SFTR but reported to TR by mistake	All	Table 1 and Table 2	EROR	-	
58	Initial posting of margin to a CCP for cleared SFTs	All	Table 3	NEWT	-	
59	Update of the initial margin posted at the CCP	All	Table 3	MARU	-	
60	Posting variation margin to a CCP for cleared SFTs	All	Table 3	MARU	-	

6 lent. Veiklos įvykių susiejimas su veiksmų rūšimis ir lygiais

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message ⁶	Action Type	Level	Pastabos ir pavyzdžiai
61	Correction of a previous submitted margin report	All	Table 3	CORR	-	
62	Cancellation of a wrongly submitted margin report	All	Table 3	EROR	-	
63	First report of reuse of collateral or reinvestment of cash collateral	All	Table 4	NEWT	-	
64	Change in the securities reused or update of the estimated reuse or value of reused collateral	All	Table 4	REUU	-	
65	Change in cash collateral reinvestment type, amount or currency	SLB	Table 4	REUU	-	
66	Correction of a previously submitted collateral reuse report with incorrect data	All	Table 4	CORR	-	
67	Cancellation of a wrongly submitted collateral reuse report (e.g. for an entity not subject to the reporting obligation)	All	Table 4	EROR	-	

4.11 CVPD dalyvio tapatybės nustatymas

122. Išskyrus atvejus, kai pranešama apie garantinės įmokos skolinimą arba kai sandoris sudaromas su biržos prekėmis, sandorio šalys visuomet turėtų užpildyti centrinio vertybinių popierių depozitoriumo (CVPD) dalyvio ar netiesioginio dalyvio lauką. Lauką reikėtų užpildyti net jeigu už VPĮFS atsiskaitoma ne CVPD. ESMA tikisi, kad duomenis teikianti sandorio šalis turėtų užpildyti šį lauką laikydamosi tokios tvarkos:

- a. nurodo savo LEI, jeigu atsiskaitoma tiesiogiai bet kuriame CVPD, t. y. ji yra CVPD dalyvė;
- b. nurodo savo LEI, jeigu už vertybinius popierius atsiskaitoma bet kuriame iš dviejų TCVPD, net jeigu TCVPD nėra juos išleidęs CVPD, t. y. sandorio šalis yra TCVPD dalyvė;
- c. nurodo savo vertybinius popierius saugančio banko LEI, neatsižvelgiant į tai, ar vertybinius popierius saugantis bankas pasitelkia subdepozitoriumą ar ne. Tai apima scenarijus, kai sandorio šalis pasitelkia agentą skolintoją.

123. Lauke „CVPD dalyvis“ sandorio šalis neturėtų nurodyti CVPD, kuriame ji tiesiogiai ar netiesiogiai dalyvauja, LEI.

4.12 Sandorio šalies pobūdžio nustatymas

4.12.1 Bendrasis atvejis

124. Atpirkimo sandorių ar BSB sandorių atveju pirkėjas yra įkaito gavėjas, o pardavėjas – įkaito davėjas.

125. VPSS ar VPĮFS, susijusių su biržos prekėmis, atveju skolintojas yra įkaito gavėjas, o skolininkas – įkaito davėjas.

126. Garantinės įmokos paskolų atveju skolintojas yra įkaito gavėjas, o skolininkas – įkaito davėjas.

4.12.2 VPĮFS, kuriems atlikta pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita

127. VPĮFS, kuriems atlikta pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita, atveju pagrindinė sandorio šalis užima tarpininkės padėtį tarp dviejų VPĮFS sandorio šalių. Taigi bus taip: pirkėjas – pardavėjui, skolininkas – skolintojui, pardavėjas – pirkėjui ir skolintojas – skolininkui.

4.12.3 Neužtikrinto vertybinių popierių skolinimo ir skolinimosi duomenų teikimas

128. Neužtikrinto vertybinių popierių skolinimo ir skolinimosi atveju vertybinius popierius skolinanti sandorio šalis turėtų pranešti, kad ji yra įkaito gavėja, o sandorio šalis, kuri skolinasi vertybinius popierius, turėtų nurodyti save 1.9 lauke kaip įkaito davėją.

4.12.4 Sandorio šalies pobūdžio duomenų teikimas grynosios pozicijos užtikrinimo atveju

129. Grynosios pozicijos užtikrinimo atveju sandorio šalys neturėtų pildyti lauko „Sandorio šalies pobūdis“ dėl įkaito, naudojamo kaip kintamoji garantinė įmoka. Tačiau sandorio šalys, nustačiusios, ar jos yra grynoji įkaito davėja ar grynoji įkaito gavėja, turėtų pranešti apie įkaitą, susijusį su kintamąja garantine įmoka, kaip paaiškinama 5.4.7 skirsnyje.

4.13 Kainos ir vertės laukai

4.13.1 Vertinimų laikas

130. Atlikus VPĮFS tarpuskaitą, teikiant duomenis pagal VPĮFSR reikėtų naudoti informaciją, susijusią su pagrindinės sandorio šalies atliktais vertinimais.

131. Vertybinių popierių rinkos vertė turėtų būti vertė, galiojanti kiekvienos darbo dienos pabaigoje; apie ją turėtų būti pranešama ne vėliau nei per T+1 laikotarpį ir ji turėtų atitikti vertinimą, kuriuo remiantis tvarkomas įkaitas, pvz., kai apskaičiuojama dienos kintamoji garantinė įmoka.

132. Sandorio šalys turėtų pranešti apie savo VPĮFS rinkos vertę remdamosi rinkos kainomis ir valiutos kursu, kuriuos tos sandorio šalys naudojo tą darbo dieną pozicijų valdymo tikslais. Vertybinių popierių skolinimo sandorių atveju tai paprastai reikštų, kad rinkos vertės, apie kurias pranešama bet kurios darbo dienos pabaigoje, būtų vertybinių popierių kainos ankstesnės darbo dienos pabaigoje, apie kurias pranešama ne vėliau nei per T+1 laikotarpį.
133. Jeigu pateikiami dviejų skirtingų dienų vertinimai, sandorio šalys turėtų užpildyti 2.3 lauką „Įvykio data“ atskirai dėl kiekvienos dienos.

4.13.2 Vertinimams taikomas skaičiavimo metodas

134. Teikdamos duomenis pagal VPĮFSR sandorio šalys turėtų naudoti vertę, kurią naudojo įkaito valdymo ir pozicijos valdymo tikslais.
135. Kai rinkos vertė nežinoma, VPĮFSR nenurodomas joks konkretus šių vertinimų skaičiavimo metodas. Vis dėlto 2.57 ir 2.88 laukuose pateikiami duomenys yra derinami duomenys, tad sandorio šalys turėtų susitarti ir teikti vertes, kurios patenka į priimtina leidžiamosios nuokrypos intervalą, kaip nurodyta Duomenų rinkimo TRS priede.
136. Vertybinių popierių rinkos vertė turėtų būti pateikiama tokia, kokia ji yra kiekvienos darbo dienos pabaigoje, ir ji turėtų atitikti vertinimą, kuriuo remiantis tvarkomas įkaitas, pvz., kai apskaičiuojama dienos kintamoji garantinė įmoka.
137. Jeigu vertinamų vertybinių popierių rinkos vertė nežinoma, duomenis teikianti sandorio šalis turėtų naudoti atsarginį variantą – paskutinę žinomą rinkos kainą.
138. Sandorio šalys pagal poreikį turėtų naudoti valiutos XML žymas visuose kainų laukuose, kad teisingai pažymėtų atitinkamus vertės ir sumos laukus, ypač kai jos yra skirtingomis valiutomis. Taip pat žr. pavyzdį 5.2.1.8 skirsnyje.
139. Kai siekdama pateikti tikslų vertinimą sandorio šalis naudoja valiutos kursą, reikėtų remtis atitinkamu ECB kursu. Jeigu valiutoms konvertuoti ECB valiutos kurso nėra, sandorio šalys turėtų susitarti tarpusavyje, kurį valiutos kursą jos naudos vertinimo ir duomenų teikimo tikslais.

4.14 Vertybinio popieriaus, naudojamo kaip užtikrinimo priemonė, CFI kodo duomenų teikimas

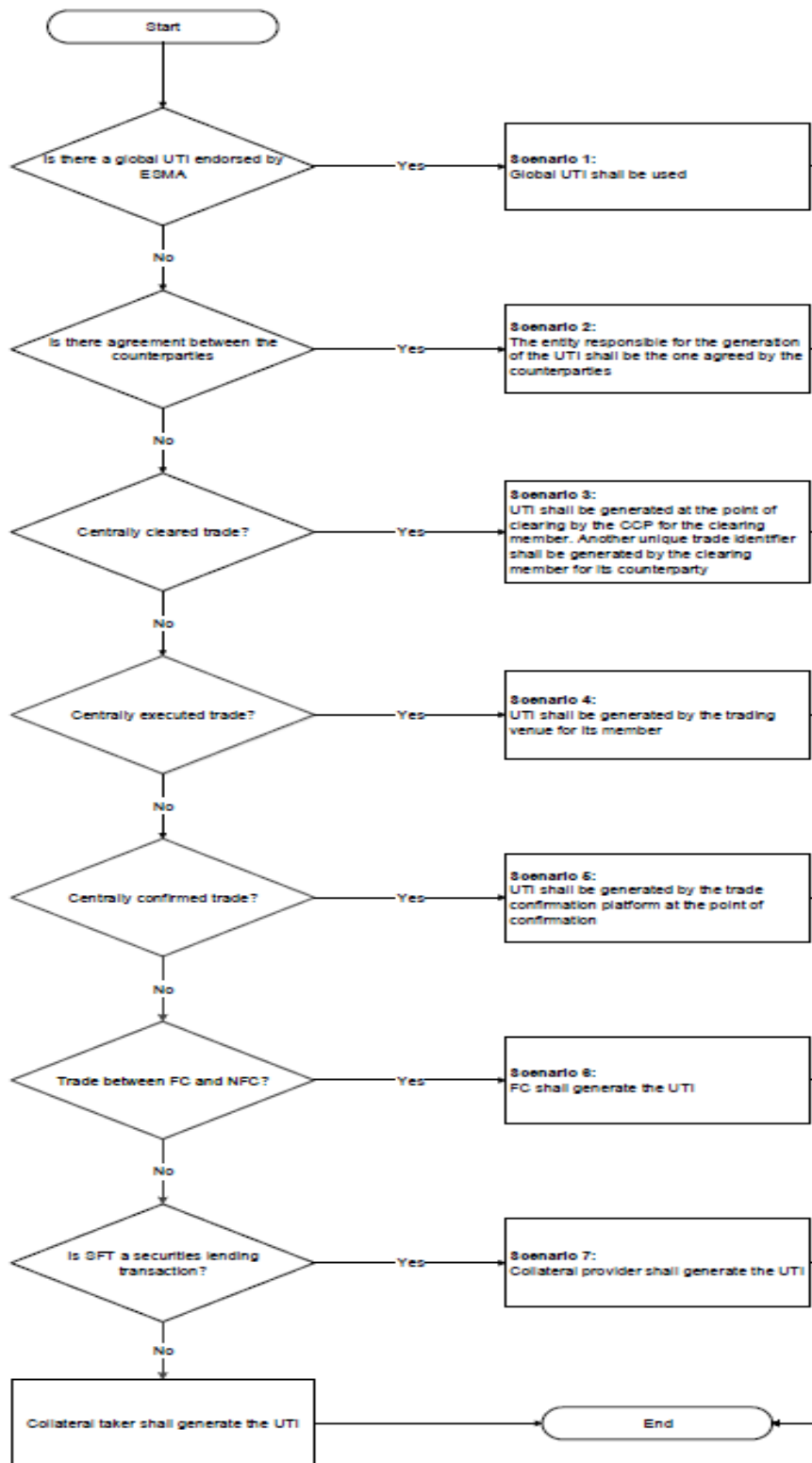
140. Kai vertybinis popierius naudojamas kaip užtikrinimo priemonė, to vertybinio popieriaus CFI kodą reikėtų nurodyti paskolų ir užtikrinimo priemonių duomenų lentelės 42 ir 79 laukuose. Šis laukas netaikomas biržos prekėms.
141. Sandorio šalys turėtų visuomet naudoti oficialius CFI kodų šaltinius. Šiuo tikslu reikėtų naudoti atitinkamos nacionalinės numeravimo agentūros (NNA) duomenis. Išsamesnė ANNA informacija skelbiama šiuo adresu: <http://www.anna-web.org/standards/about-identification-standards/>; arba ją skelbia atitinkama vertybinio popieriaus NNA.
142. Sandorio šalys turėtų pateikti tik galiojančius CFI kodus. Jeigu oficialiuose šaltiniuose CFI kodo nėra, dėl jo turėtų susitarti sandorio šalys, nes CFI kodas yra derinamas laukas.

4.15 Telkimas laikotarpio pabaigoje

143. Sandorio šalys, nusprendusios teikti duomenis ankstesne prašoma atsiskaitymo data (PAD), turėtų pateikti išsamius ir tikslius atitinkamų sandorių laikotarpio pabaigoje duomenis, įskaitant kasdien atnaujinamą įkaitą nurodant veiksmo rūšį COLU. Jeigu jos praneša apie dalį savo VPĮFS, jos turėtų pateikti išsamią ir tikslią informaciją apie garantinę įmoką ir pakartotinio naudojimo duomenis, kaip numatyta Duomenų teikimo TS priedo 3 ir 4 lentelėse.
144. Jeigu atitinkama PAD taikoma abiem sandorio šalims, siekdamos kuo labiau sumažinti su derinimu susijusias pertraukas, jos turėtų susitarti, kurią dieną jos atidės VPĮFS. Bet kuriuo atveju apie sandorių telkimą laikotarpio pabaigoje reikėtų pranešti per PAD+190. Jeigu duomenis teikianti sandorio šalis, kurios PAD dar neatėjo, nusprendžia pateikti duomenis apie sandorius laikotarpio pabaigoje, ji turėtų užtikrinti, kad apie kiekvieną VPĮFS būtų pranešama, kaip paaiškinta 146 punkte.
145. Jeigu sandorio šalys taip nuspręstų, išsamius duomenis apie atidėtus VPĮFS, t. y. duomenis apie visus VPĮFS, kurie galioja tam tikru metu po pirmosios PAD iki pirmiau nurodyto termino, galima teikti ir savanoriškai.
146. Apie sandorį laikotarpio pabaigoje reikėtų pranešti veiksmo rūšies 2.98 lauke nurodant NEWT. Lauke „įvykdymo laiko žyma“ (2.12 laukas) reikėtų nurodyti pirminę įvykdymo laiko žymą. Lauke „įskaitymo data (pradžios data)“ (2.13 laukas) reikėtų nurodyti pirminę įskaitymo datą, nebent ji būtų pakeista dėl su VPĮFS susijusių atsiskaitymo problemų. Kituose duomenų laukuose reikėtų nurodyti būklę duomenų teikimo metu. Apie ankstesnius gyvavimo ciklo įvykius atskirai pranešti nereikėtų.

4.16 UTI formavimas ir struktūra

147. Toliau esančioje schemoje pavaizduotas UTI formavimo procesas.



148. Kalbant apie VPĮFS, kuriems atlikta tarpuskaita, apie kiekvieną VPĮFS tarp pagrindinės sandorio šalies ir jos tarpuskaitos narių ir tarp tarpuskaitos narių ir jų klientų reikėtų pranešti nurodant skirtingus UTI.

149. Reikėtų pažymėti, kad sandorio šalių susitarimas dėl UTI praktiškai yra atsarginis variantas, kaip numatyta techniniuose standartuose, nes dauguma subjektų formuoja UTI taikydamos principu „iš viršaus žemyn“ pagrįstą metodą. Šalys vis dėlto gali sudaryti tokį susitarimą ir tokiu atveju turėtų jo laikytis visais susitarime numatytais atvejais.
150. Neterminuotų VPĮFS atveju sandorio šalys turėtų išlaikyti to VPĮFS pirminį UTI ir kiekvieną sykį jį pratęsdamos neturėtų vėl kurti naujo UTI.
151. UTI neformuojanti sandorio šalis turėtų turėti galimybę į savo sistemas arba už duomenų teikimą atsakingo subjekto ar duomenis teikiančio subjekto sistemas įtraukti UTI, kurį pateikė jį suformavusi sandorio šalis.
152. Sandorio šalys turėtų įsdiegti atitinkamas technines priemones, atitinkančias duomenų, kuriais keičiamasi, kiekį, kad užtikrintų, kad UTI būtų pateikiamas į įtraukiamas laiku. Jeigu kyla sunkumų dėl UTI formavimo ar pateikimo, sandorio šalys turėtų užtikrinti, kad laiku išspręstų visas UTI formavimo ir pateikimo problemas ir pateiktų duomenis iki VPĮFS duomenų teikimo termino.
153. Jeigu pats UTI yra neteisingas, prekybos sandorį reikėtų panaikinti ir pateikti naujo sandorio duomenis su teisingu UTI.
154. Kalbant apie UTI formatą, VPĮFS sandorio šalys gali apsvarstyti galimybę naudoti CPSS ir IOSCO gaires, pagal kurias rekomenduojama, kad naujus UTI sudarytų nuoseklus toliau išvardytų elementų derinys:
 - a. UTI formuojančio subjekto LEI, galiojantis UTI formavimo metu, ir
 - b. to subjekto sukurta unikali vertė (ta vertė turi būti unikali tik tokių to subjekto suformuotų verčių rinkinyje, nes visuotinį unikalumą užtikrins derinys su LEI).

4.17 Naudos gavėjų nustatymas ir jų duomenų teikimas

155. Įprastas atvejis (bet gali būti ir kitų) – skėtinių fondų ir subfondų struktūros, kuriose skėtinis fondas yra sandorio šalis, o subfondas ar subfondai yra naudos gavėjai.
156. Taip pat gali būti atveju, kai naudos gavėjas yra tikslinių fondų grupė; tokiais atvejais tokiai tikslinių fondų grupei nustatyti reikėtų naudoti LEI⁷.

4.18 Vertybinių popierių emitento ir vertybinių popierių nustatymas

157. Sandorio šalys turėtų nurodyti paskolintų ar pasiskolintų vertybinių popierių emitento (-ų) LEI, vertybinių popierių, naudojamų kaip užtikrinimo priemonė, emitento (-ų) LEI ir vertybinių popierių ISIN kodus.
158. Teikdamos tokią informaciją sandorio šalys turėtų užtikrinti atitiktį su ISIN ir emitento LEI, pateiktais pagal patvirtinimo taisykles.

⁷ Kaip nurodyta 2012 m. FSB ataskaitos „Finansų rinkoms skirtas bendras juridinio asmens identifikatorius“ rekomendacijoje Nr. 8, turto grupėms arba kitoms atskirtoms juridinio asmens dalims gali būti priskiriamos atskiros teisės ir prievolės esant pakankamam nepriklausomumo nuo to juridinio asmens lygiui; jos gali atitikti LEI priskyrimo reikalavimus. Tai taip pat atitinka standartą ISO 17442:2012 dėl juridinių asmenų identifikatorių.

4.19 Procedūra, taikoma, kai sandorio šaliai įvyksta emitento įvykis

159. Subjektas su nauju LEI (pvz., sujungtas ar įsigyjantis subjektas; toliau – naujas subjektas) turėtų pranešti SDS, kuriai (kurioms) teikia duomenis, apie pakeitimą ir paprašyti atnaujinti neapmokėto VPĮFS identifikatorių, kaip nurodyta toliau 162 punkte. Jeigu identifikatoriaus pakeitimas susijęs su susijungimu ar įsigijimu, sujungtas ar įsigyjantis subjektas taip pat turėtų tinkamai atnaujinti įsigyto ir (arba) sujungto subjekto LEI įrašą. Kai taikytina, sandorio šalis taip pat turėtų teikti informaciją apie šalies pakeitimą.
160. Jeigu emitento restruktūrizavimo įvykiai daro poveikį visiems neapmokėtiems VPĮFS, SDS turėtų nustatyti visus neapmokėtus VPĮFS, kuriuose subjekto tapatybė nustatoma pagal senąjį LEI bet kuriame iš laukų („Pranešimą teikiančios sandorio šalies ID“, „Kitos sandorio šalies ID“) ir pakeisti senąjį LEI naujuoju.
161. Kiti emitento restruktūrizavimo įvykiai, kaip antai (bet ne tik) dalinis įsigijimas, atskirtosios įmonės, gali padaryti poveikį tik neapmokėtų VPĮFS poaibiui; tokiu atveju naujas subjektas turėtų atitinkamai pateikti SDS VPĮFS, kuriems tas įvykis padarė poveikį, UTI kodus.
162. Tai daroma vykdant tokį kontroliuojamą procesą:
- naujas subjektas turėtų pateikti rašytinius dokumentus SDS, kuriai (kurioms) jis pateikė savo VPĮFS duomenis ir prašė pakeisti LEI dėl emitento įvykio. Dokumentuose reikėtų aiškiai pateikti tokią informaciją: i) susijungimo, įsigijimo ar kitame emitento įvykyje dalyvaujančių subjektų LEI, ii) naujo subjekto LEI, iii) pakeitimo datą ir iv) atitinkamų neapmokėtų VPĮFS UTI kodus.

Susijungimo ar įsigijimo atveju į dokumentus reikėtų įtraukti įrodymus, kad emitento įvykis įvyko ar įvyks, ir reikėtų tinkamai juos pasirašyti. Kiek įmanoma, subjektas turėtų pateikti prašomą informaciją iš anksto, kad pakeitimas būtų įtraukiamas ne atgaline data, o nuo iii punkte nurodytos datos. Reikėtų pažymėti, kad laiku neatnaujinus naujojo LEI subjekto teikiami pranešimai bus atmetami, jeigu toks subjektas anksčiau buvo identifikuojamas pagal senąjį LEI esant atitinkamam statusui (t. y. „Išleista“, „Bus perleista“ ar „Bus archyvuota“) ir tas statusas buvo vėliau pakeistas į „Sujungta“.
 - SDS turėtų paskelbti šią informaciją visoms kitoms SDS pateikdama specialią rinkmeną, kurioje nurodoma i) senas LEI, ii) naujas LEI ir iii) data, nuo kurios reikėtų atlikti pakeitimą. Kiek įmanoma, rinkmeną reikėtų paskelbti iš anksto, kad pakeitimas būtų įtraukiamas ne atgaline data, o nuo iii punkte nurodytos datos.
 - Kai nustatomas koks nors sujungtas subjektas, kiekvienai iš VPĮFS sandorio šalių apie pakeitimą turėtų pranešti SDS, kuriai jos teikia duomenis
 - SDS taip pat turėtų pranešti reguliavimo institucijoms, turinčioms prieigą prie atnaujintų su VPĮFS susijusių duomenų.
 - Kai taikytina, SDS turėtų atnaujinti 1.12 lauką „Kitos sandorio šalies valstybė“.
 - Pakeitimai turėtų būti saugomi kiekvienos SDS pildomame duomenų teikimo žurnale.
163. Paskesni pranešimai turėtų būti patvirtinami, kaip įprasta, pagal GLEIF ir nepatvirtinus turėtų būti atmetami.
164. Taigi esant naujam LEI subjektas nebūtinai teikia apie tai duomenis.

165. Pirmiau išdėstytos procedūros nereikėtų laikyti, jeigu sandorio šalys pateikia klaidingus savo identifikavimo duomenis. Tokiu atveju jos turėtų pateikti VPĮFS pranešimą nurodydamos veiksmo rūšį EROR, susitarti dėl naujo UTI su kita sandorio šalimi ir pateikti išsamius ir tikslus VPĮFS duomenis.

4.20 Duomenų teikimas per laipsniško taikymo laikotarpį

166. Sandorio šalys, kurioms dar netaikoma pareiga teikti duomenis, turėtų pateikti sandorio šaliai, kuriai jau atsirado pareiga teikti duomenis, visą svarbią informaciją pagal Duomenų teikimo TS. Informacija, kurią reikėtų pateikti duomenis teikiančiai sandorio šaliai, telpa į 2 duomenų laukus. Tie duomenų laukai – „Kita sandorio šalis“, „Kitos sandorio šalies filialas“ ir „Kitos sandorio šalies valstybė“. Tuose duomenų laukuose esančią informaciją reikėtų laiku pateikti duomenis teikiančiai sandorio šaliai.
167. Jeigu sandorio šalims, kurioms dar netaikoma pareiga teikti duomenis, taip lengviau, jos gali pradėti teikti duomenis anksčiau atitinkamos duomenų teikimo pradžios datos, nurodytos VPĮFSR 33 straipsnio 2 dalies a punkte. Jeigu sandorio šalis, kuriai dar netaikoma pareiga teikti duomenis, nuspręstų pranešti apie sandorius, ji turėtų laikytis 144 punkto šių gairių 4.15 skirsnyje.

5 VPĮFSR laukų lentelės

168. Duomenų teikimo TRS 1 straipsnio 1 dalyje numatyta: „Pagal Reglamento (ES) 2015/2365 4 straipsnio 1 dalį teikiamame pranešime pateikiami su atitinkamu VPĮFS susiję išsamūs ir tikslūs duomenys, nustatyti priedo 1, 2, 3 ir 4 lentelėse“. 5.1–5.6 skirsniuose nurodytais naudojimo atvejais nebūtinai užpildomi visi laukai, susiję su atitinkamu VPĮFS; dėmesys sutelkiamas į konkrečius duomenų laukų skirsnius siekiant pateikti detalesnius ir išsamesnius patarimus dėl duomenų teikimo be reikalo nekartoiant ar neįtraukiant kitų duomenų elementų.
169. Patvirtinimo taisyklėse pateikiamos išsamios rekomendacijos dėl taikytinų laukų pagal VPĮFS rūšį, veiksmo rūšį ir lygį ir atitinkamus priklausomybės ryšius.
170. Toliau esančiuose skirsniuose pateikiami įvairūs scenarijai ir atitinkamos lentelės, kuriose paaiškinama, kaip apie tuos scenarijus reikėtų pranešti. Kiekvienoje lentelėje pateikiami duomenų teikimo laukai pagal VPĮFSR techninius standartus. Skiltyje „Laukas“ nurodomas kiekvieno lauko pavadinimas, o skiltyje „Pavyzdys“ pateikiamas pavyzdys, kas įtraukiama į tą lauką. Paskutinėje skiltyje „XML pranešimas“ nurodomas XML pranešimo, kurį reikėtų pateikti pranešant apie prekybos sandorį, formatas.
171. Jeigu pagal konkretų scenarijų nenurodoma kitaip, visiems 5 skirsnyje aptartiems scenarijams taikoma tokia bendroji informacija:

A sandorio šalis yra finansų sandorio šalis, kurios LEI yra 12345678901234500000

B sandorio šalis yra Prancūzijos finansų sandorio šalis, kurios LEI yra ABCDEFGHIJKLMNOPQRST

C sandorio šalis yra MVĮ ne finansų sandorio šalis, kurios LEI yra 123456789ABCDEFGHIJK

D sandorio šalies LEI yra 11223344556677889900

E maklerio LEI yra 88888888888888888888

F agento skolintojo LEI yra BBBBBBBBBBBBBBBBBBBBBB

G trišalio agento LEI yra 77777777777777777777

H vertybinius popierius saugančio banko LEI yra AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA

I trečioji šalis siūlo duomenų teikimo paslaugas; jos LEI yra LEI 12345123451234512345

J sandorio šalis taip pat veikia kaip tarpuskaitos narė; jos LEI yra CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC

K KIPVPS fondo LEI yra LEI UUUUUUUUUU1111111111, o L KIPVPS valdymo įmonės LEI yra UUUUUUUUUU2222222222

M AIF LEI yra AAAAAAAAAA1111111111, o N AIF valdymo įmonės LEI yra AAAAAAAAAA2222222222

O pagrindinės sandorio šalies LEI yra BBBBBBBBBB1111111111

Vokietijos vertybinių popierių emitento LEI yra NNNNNNNNNNNNNNNNNNNN

Ispanijos vertybinių popierių emitento LEI yra EEEEEEEEEEEEEEEEEEEE

Prancūzijos vertybinių popierių emitento LEI yra FFFFFFFFFFFFFFFFFFFF

Nyderlandų vertybinių popierių emitento LEI yra DDDDDDDDDDDDDDDDDDDDD

Italijos vertybinių popierių emitento LEI yra IIIIIIIIIIIIIIIIIIIII

Bendrojo vertybinių popierių emitento LEI yra GGGGGGGGGGGGGGGGGGGG

Prancūzijos pagrindinio indekso akcijų emitento LEI yra 529900S21EQ1BO4ESM68

P prekybos vietos MIC yra XWAR

Vertybiniai popieriai identifikuojami pagal šiuos ISIN kodus:

- a. Vokietijos obligacijos (įprastos): DE0010877643
- b. Ispanijos nuolatinės obligacijos: ES0010877643
- c. Prancūzijos obligacijos: FR0010877643
- d. Nyderlandų obligacijos: NL0010877643
- e. Prancūzijos pagrindinio indekso akcijos: FR0000120271

- f. Kiti Prancūzijos vertybiniai popieriai: FR0010877000
- g. Užtikrinimo priemonių krepšelis: GB00BH4HKS39
- h. 1 užtikrinimo priemonės komponentas: IT00BH4HKS39
- i. 2 užtikrinimo priemonės komponentas: FR00BH4HKS39

Vertybiniai popieriai klasifikuojami pagal šiuos CFI kodus:

- a. Įprastos vyriausybės obligacijos: DBFTFR
- b. Nuolatinės vyriausybės obligacijos: DBFTPR
- c. Akcijos: ESVUFN

Nepildomi pilki lentelių laukai nėra taikomi šiems konkreitiems pavyzdžiams, bet įtraukiami dėl aiškumo.

Nurodomas naudojimo atvejų taikomumas įvairių rūšių VPĮFS. Taip pat paaiškinamas faktinis duomenų teikimas pagal ISO 20022 XML schemas.

5.1 Sandorio šalies duomenys

172. Atlikus VPĮFS tarpuskaitą kiekviena sandorio šalis tarpuskaitos nario lauke turėtų nurodyti savo tarpuskaitos narį.
173. Kai galima savanoriškai pavesti duomenų teikimą arba paskirstyti atsakomybę, duomenis teikiantis subjektas arba už duomenų teikimą atsakingas subjektas turėtų teikti sandorio šalių duomenis atskirai, o paskolos ir įkaito duomenis – dėl kiekvienos dviejų šalių, kurių duomenys teikiami.
174. Naudojimo atvejais, susijusiais su dviem ar daugiau toliau nurodytų naudojimo atvejų, duomenis teikiančios sandorio šalys arba už duomenų teikimą atsakingi subjektai turėtų teikti visus svarbius duomenis remdamiesi toliau pateiktomis gairėmis.

7 lent. Naudojimo atvejai

	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

7 lent. Naudojimo atvejai

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

7 lent. Naudojimo atvejai

	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 Dvišaliais VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaita, tarp būstinių

175. 8 lent. parodoma, kokių rūšių vertybinių popierių įsigijimo finansavimo sandorius dvi būstinės gali sudaryti grynai dvišaliu pagrindu.

8 lent. VPĮFS, kuriems taikomi naudojimo atvejai

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

176. 9 lent. parodoma, kaip teikiami duomenys apie dvišalį sandorį, kai duomenis teikianti sandorio šalis (A sandorio šalis) taip pat teikia savo pranešimus (t. y. atskiro duomenis teikiančio subjekto nėra). A sandorio šalis taip pat yra šio sandorio naudos gavėja ir CVPD dalyvė.

9 lent. Dvišaliai VPJFS, kuriems neatlikta tarpuskaityti tarp būstinių			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2021-02-01T15:15:15Z	<pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty> <LEI>1234567890123450000</LEI> </RptSubmitgNtty> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>1234567890123450000</LEI> </Id> <Ntr> <FI> <Clssfctn>CDTI</Clssfctn> </FI> </Ntr> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> <CtryCd>FR</CtryCd> </OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI>1234567890123450000</LEI> </NttyRspnsblForRpt> <OthrPtyData> <StlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt> <LEI>1234567890123450000</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </StlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> </pre>
2	Report submitting entity	{LEI} of counterparty A	
3	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	
4	Nature of the reporting counterparty	F	
5	Sector of the reporting counterparty	CDTI	
6	Additional sector classification		
7	Branch of the reporting counterparty		
8	Branch of the other counterparty		
9	Counterparty side	GIVE	
10	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	
12	Country of the other Counterparty	FR	
13	Beneficiary		
14	Tri-party agent		
15	Broker		
16	Clearing member		
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of counterparty A	
18	Agent lender		

9 lent. Dvišaliai VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaita, tarp būstinių			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.1.2 Dvišaliai VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaita, tarp filialų

10 lent. VPĮFS, kuriems taikomi naudojimo atvejai			
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	Y

177. 11 lent. pateikiamas pavyzdys, kaip teikti duomenis apie dviejų sandorio šalių filialų sudarytą dvišalį sandorį. Juridiniai asmenys (būstinės) identifikuojami pagal atitinkamus LEI, o filialų valstybės – pagal ISO valstybės kodus. A sandorio šalis taip pat yra CVPD dalyvė.

11 lent. Dvišaliai VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaita, tarp filialų			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty> <LEI>12345678901234500000</LEI> </RptSubmitgNtty> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </pre>
2	Report submitting entity	{LEI} of counterparty A	
3	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	
4	Nature of the reporting counterparty	F	
5	Sector of the reporting counterparty	CDTI	
6	Additional sector classification		
7	Branch of the reporting counterparty	FR	

11 lent. Dvišaliai VPJFS, kuriems neatlikta tarpuskaityta, tarp filialų

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

5.1.3 Dvišaliai VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaita, su naudos gavėjais

12 lent. VPĮFS, kuriems taikomi naudojimo atvejai			
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	N

178. 13 lent. pateikiamas dvišalio sandorio, kuriam neatlikta tarpuskaita, pavyzdys, kai A sandorio šalis nėra sandorio naudos gavėja. Naudos gavėja yra D sandorio šalis. A sandorio šalis taip pat yra CVPD dalyvė.

13 lent. Dvišaliai VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaita, su naudos gavėjais			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty> <LEI>12345678901234500000</LEI> </RptSubmitgNtty> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> <Ntr> <FI> <Clssfctn>CDTI</Clssfctn> </FI> </Ntr> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> <CtryCd>FR</CtryCd> </OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> </pre>
2	Report submitting entity	{LEI} of counterparty A	
3	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	
4	Nature of the reporting counterparty	F	
5	Sector of the reporting counterparty	CDTI	
6	Additional sector classification		
7	Branch of the reporting counterparty		
8	Branch of the other counterparty		
9	Counterparty side	GIVE	
10	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	
12	Country of the other Counterparty	FR	
13	Beneficiary	{LEI} of counterparty D	

13 lent. Dvišaliai VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaita, su naudos gavėjais			
No	Field	Example	XML Message
14	Tri-party agent		<LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt> <OthrPtyData> <Bnfcry>
15	Broker		
16	Clearing member		
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of counterparty A	<LEI>11223344556677889900</LEI> </Bnfcry> <SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt>
18	Agent lender		<LEI>12345678901234500000</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

5.1.4 VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaita, su makleriais, atsiskaitant su vertybinius popierius saugančiu banku

14 lent. VPĮFS, kuriems taikomi naudojimo atvejai			
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	N

179. Pagal 15 lent. pateiktą scenarijų A sandorio šalis sudaro sandorį su B sandorio šalimi. A sandorio šalis pasitelkia H vertybinius popierius saugantį banką, kuris atitinkamai nurodomas 1.17 lauke. Be to, A sandorio šalis naudojasi E maklerio paslaugomis.

15 lent. VPJFS, kuriems neatlikta tarpuskaity, su makleriais, atsiskaitant su vertybinius popierius saugančiu banku

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

15 lent. VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaityta, su makleriais, atsiskaitant su vertybinius popierius saugančiu banku

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

5.1.5 VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaityta, su makleriu, agentu skolintoju ir trišaliu agentu

16 lent. VPĮFS, kuriems taikomi naudojimo atvejai

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

180. Pagal 17 lent. pateiktą scenarijų A sandorio šalis sudaro sandorį su B sandorio šalimi. A sandorio šalis pasitelkia F agentą skolintoją ir G trišalį agentą. Be to, A sandorio šalis naudoja E maklerio paslaugomis. A sandorio šalis yra CVP dalyvė.

17 lent. VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaityta, su makleriu, agentu skolintoju ir trišaliu agentu

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty> <LEI>12345678901234500000</LEI> </pre>
2	Report submitting entity	{LEI} of counterparty A	
3	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	
4	Nature of the reporting counterparty	F	

17 lent. VPJFS, kuriems neatlikta tarpuskaityti, su makleriu, agentu skolintoju ir trišaliu agentu

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

17 lent. VPJFS, kuriems neatlikta tarpuskaita, su makleriu, agentu skolintoju ir trišaliu agentu

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

5.1.6 VPJFS, kuriems neatlikta tarpuskaita, su makleriu, agentu skolintoju ir trišaliu agentu, atsiskaitant su CVPD dalyviu, kuris nėra nė vienas iš tų subjektų ir savanoriškai pavedant duomenų teikimą trečiajai šaliai.

18 lent. VPJFS, kuriems taikomi naudojimo atvejai

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

181. Pagal 19 lent. pateiktą scenarijų A sandorio šalis sudaro sandorį su B sandorio šalimi. A sandorio šalis pasitelkia F agentą skolintoją ir G trišalį agentą. Be to, A sandorio šalis naudojami E maklerio ir H vertybinius popierius saugančio banko paslaugomis. Galiausiai A sandorio šalis paveda duomenų teikimą I trečiajai šaliai.

19 lent. VPJFS, kuriems neatlikta tarpuskaita, su makleriu, agentu skolintoju ir trišaliu agentu, atsiskaitant su CVPD dalyviu, kuris nėra nė vienas iš tų subjektų ir savanoriškai pavedant duomenų teikimą trečiajai šaliai

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01- 01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty> </pre>
2	Report submitting entity	{LEI} of third party I	
3	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	
4	Nature of the reporting counterparty	F	
5	Sector of the reporting counterparty	CDTI	<pre> <LEI>12345123451234512345</LEI> </RptSubmitgNtty> </pre>

19 lent. VPJFS, kuriems neatlikta tarpuskaityti, su makleriu, agentu skolintoju ir trišaliu agentu, atsiskaitant su CVPD dalyviu, kuris nėra nė vienas iš tų subjektų ir savanoriškai pavadant duomenų teikimą trečiajai šaliai

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

19 lent. VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaityta, su makleriu, agentu skolintoju ir trišaliu agentu, atsiskaitant su CVPD dalyviu, kuris nėra nė vienas iš tų subjektų ir savanoriškai pavadant duomenų teikimą trečiajai šaliai

No	Field	Example	XML Message
			<pre> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.1.7 VPĮFS, kuriems atlikta tarpuskaityta, su makleriu, agentu skolintoju ir trišaliu agentu

20 lent. VPĮFS, kuriems taikomi naudojimo atvejai

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

182. 21 lent. parodoma, kaip pildomi duomenų laukai VPĮFS, kuriems atlikta tarpuskaityta, atveju. Laukai pildomi neatsižvelgiant į sandorio šalies turimos pagrindinės sandorio šalies priegos rūšį. Visuomet turėtų būti nurodytas subjektas, kuris yra tarpuskaitytos narįs.
183. A sandorio šalis kreipiasi į pagrindinę sandorio šalį per J tarpuskaitytos narį. Ji taip pat naudojami E maklerio, F agento skolintojo ir G trišalio agento paslaugomis. A sandorio šalis taip pat yra CVPD dalyvė.
184. Reikėtų pažymėti, kad pagrindinės sandorio šalies laukas susijęs su 2 lentele („Sandorių šalių, paskolų ir įkaitų duomenys“), tad jo pildymas paaiškinamas 5.2 skirsnyje.

21 lent. VPĮFS, kuriems atlikta tarpuskaityta, su makleriu, agentu skolintoju ir trišaliu agentu

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

21 lent. VPJFS, kuriems atlikta tarpuskaita, su makleriu, agentu skolintoju ir trišaliu agentu

No	Field	Example	XML Message
5	Sector of the reporting counterparty	CDTI	<LEI>12345678901234500000</LEI>
6	Additional sector classification		</RptSubmitgNtty> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
7	Branch of the reporting counterparty		
8	Branch of the other counterparty		<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id>
9	Counterparty side	GIVE	<Ntr> <FI>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	<Clssfctn>CDTI</Clssfctn> </FI> </Ntr>
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	<Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
12	Country of the other counterparty	FR	
13	Beneficiary		<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id>
14	Tri-party agent	{LEI} of tri-party agent G	<CtryCd>FR</CtryCd> </OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt>
15	Broker	{LEI} of broker E	
16	Clearing member	{LEI} of counterparty J	<LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt> <OthrPtyData>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of counterparty A	<TrptyAgt>
18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<LEI>77777777777777777777</LEI> </TrptyAgt> <Brkr> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Brkr> <ClrMmb> <LEI>CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC</LEI> </ClrMmb> <SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt> <LEI>12345678901234512345</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> <AgtLndr>

21 lent. VPĮFS, kuriems atlikta tarpuskaita, su makleriu, agentu skolintoju ir trišaliu agentu			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB </LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.1.8 VPĮFS, kuriems atlikta tarpuskaita, su makleriu, agentu skolintoju ir trišaliu agentu, atsiskaitant su CVPD dalyviu, kuris nėra nė vienas iš tų subjektų ir savanoriškai pavedant duomenų teikimą trečiajai šaliai.

22 lent. VPĮFS, kuriems taikomi naudojimo atvejai			
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	N

185. Panašiai, kaip ankstesniame pavyzdyje, 23 lent. parodoma, kaip pildyti duomenų teikimo laukus VPĮFS, kuriam atlikta tarpuskaita, atveju, kai A sandorio šalis kreipiasi į pagrindinę sandorio šalį per J tarpuskaitos narį. Ji taip pat naudojasi E maklerio, F agento skolintojo ir G trišalio agento paslaugomis. Be to, šiame pavyzdyje už sandorį atsiskaitoma su H subjektu, kuris nėra nė viena iš sandorio šalių; duomenis teikianti sandorio šalis paveda duomenų teikimą I trečiajai šaliai.

186. Reikėtų pažymėti, kad laukai pildomi neatsižvelgiant į sandorio šalies turimos pagrindinės sandorio šalies prieigos rūšį. Visuomet turėtų būti nurodytas subjektas, kuris yra tarpuskaitos narys.

23 lent. VPJFS, kuriems atlikta tarpuskaity, su makleriu, agentu skolintoju ir trišaliu agentu, atsiskaitant su CVPD dalyviu, kuris nėra nė vienas iš tų subjektų ir savanoriškai pavedant duomenų teikimą trečiajai šaliai

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>

23 lent. VPĮFS, kuriems atlikta tarpuskaity, su makleriu, agentu skolintoju ir trišaliu agentu, atsiskaitant su CVPD dalyviu, kuris nėra nė vienas iš tų subjektų ir savanoriškai pavedant duomenų teikimą trečiajai šaliai

No	Field	Example	XML Message
			<pre> </ClrMmb> <SttlmPties> <CntrlSctiesDpstryPtcpt> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSctiesDpstryPtcpt> </SttlmPties> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB </LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.1.9 KIPVPS fondo sudaryti VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaity

24 lent. VPĮFS, kuriems taikomi naudojimo atvejai			
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	Y

187. 25 lent. parodoma, kaip pranešama apie K KIPVPS fondo sudarytą VPĮFS. Pagal VPĮFSR 4 straipsnio 3 dalį L KIPVPS valdymo įmonė atsako už KIPVPS duomenų teikimą, tad ji nurodoma ir 2.2 lauke „Pranešimą teikiantis subjektas“, ir 2.10 lauke „Už pranešimą atsakingas subjektas“. Už sandorį atsiskaitoma su H vertybinius popierius saugančiu banku.

25 lent. KIPVPS fondo sudaryti VPJFS, kuriems neatlikta tarpuskaita			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty> <LEI>UUUUUUUUUUU2222222222</LEI> </RptSubmitgNtty> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>UUUUUUUUUUU1111111111</LEI> </Id> <Ntr> <FI> <Clssfctn>UCIT</Clssfctn> </FI> </Ntr> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> <CtryCd>FR</CtryCd> </OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI>UUUUUUUUUUU2222222222</LEI> </NttyRspnsblForRpt> <OthrPtyData> <SttlmPties> <CntrlSctiesDpstryPtcpt> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSctiesDpstryPtcpt> </SttlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> </LnData> ... </LnData> <CollData> ... </pre>
2	Report submitting entity	{LEI} of UCITS management company L	
3	Reporting counterparty	{LEI} of UCITS K	
4	Nature of the reporting counterparty	F	
5	Sector of the reporting counterparty	UCIT	
6	Additional sector classification		
7	Branch of the reporting counterparty		
8	Branch of the other counterparty		
9	Counterparty side	GIVE	
10	Entity responsible for the report	{LEI} of UCITS management company L	
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		

25 lent. KIPVPS fondo sudaryti VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaita			
No	Field	Example	XML Message
			... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

5.1.10 KIPVPS fondo sudaryti VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaita; KIPVPS valdymo įmonė paveda duomenų teikimą trečiajai šaliai

26 lent. VPĮFS, kuriems taikomi naudojimo atvejai			
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	Y

188. 27 lent. parodoma, kaip pranešama apie K KIPVPS fondo sudarytą VPĮFS. Pagal VPĮFSR 4 straipsnio 3 dalį L KIPVPS valdymo įmonė atsako už KIPVPS duomenų teikimą, tad ji nurodoma 2.10 lauke „Už pranešimą atsakingas subjektas“, tačiau ji nusprendžia pavesti duomenų teikimą I trečiajai šaliai, kuri nurodoma 2.2 lauke „Pranešimą teikiantis subjektas“. Už sandorį atsiskaitoma su H vertybinius popierius saugančiu banku.

27 lent. KIPVPS fondo sudaryti VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaita			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty> <LEI>12345123451234512345</LEI> </RptSubmitgNtty> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>UUUUUUUUUUU1111111111</LEI> </Id> <Ntr>
2	Report submitting entity	{LEI} of third party I	
3	Reporting counterparty	{LEI} of UCITS K	
4	Nature of the reporting counterparty	F	
5	Sector of the reporting counterparty	UCIT	
6	Additional sector classification		
7	Branch of the reporting counterparty		
8	Branch of the other counterparty		

27 lent. KIPVPS fondo sudaryti VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaita			
No	Field	Example	XML Message
9	Counterparty side	GIVE	<FI> <Clssfctn>UCIT</Clssfctn>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of UCITS management company L	</FI> </Ntr> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty>
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	<OthrCtrPty> <Id>
12	Country of the other counterparty	FR	<LEI>ABCDEFGHIJKLMN</LEI> </Id> <CtryCd>FR</CtryCd>
13	Beneficiary		</OthrCtrPty>
14	Tri-party agent		<NttyRspnsblForRpt>
15	Broker		<LEI>UUUUUUUUUU2222222222</LEI>
16	Clearing member		</NttyRspnsblForRpt>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of custodian bank H	<OthrPtyData> <SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt>
18	Agent lender		<LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt>

5.1.11 AIF sudaryti VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaita

28 lent. VPĮFS, kuriems taikomi naudojimo atvejai			
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	Y

189. 29 lent. parodoma, kaip pranešama apie M AIF sudarytą VPĮFS. Pagal VPĮFSR 4 straipsnio 3 dalį N AIF valdymo įmonė atsako už AIF duomenų teikimą, tad ji nurodoma ir 2.2 lauke „Pranešimą teikiantis subjektas“, ir 2.10 lauke „Už pranešimą atsakingas subjektas“. Už sandorį atsiskaitoma su H vertybinius popierius saugančiu banku.

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

29 lent. AIF sudaryti VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaita			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.1.12 VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaita, kai naudojamosi užsakomosiomis fondo portfelio valdymo paslaugomis

190. Jeigu portfelio valdymo paslaugos užsakomos iš kito subjekto, kuris nėra fondo valdymo įmonė, tas subjektas turėtų būti nurodomas tik kaip makleris, jeigu jis atlieka tokį vaidmenį. Antraip toks subjektas, panašiai, kaip kitų subjektų, kurie gali tiesiogiai ar netiesiogiai dalyvauti VPĮFS, atveju, neturėtų būti nurodomas jokiame lauke
191. Pagal 31 lent. pateiktą scenarijų M AIF portfelio valdymas pavedamas kitam subjektui, kuris nevykdo maklerio veiklos. Už sandorį atsiskaitoma su H vertybinius popierius saugančiu banku.

30 lent. VPĮFS, kuriems taikomi naudojimo atvejai			
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	Y

31 lent. VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaita, kai naudojamosi užsakomosiomis fondo portfelio valdymo paslaugomis			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty> </pre>
2	Report submitting entity	{LEI} of AIF management company N	
3	Reporting counterparty	{LEI} of AIF M	
4	Nature of the reporting counterparty	F	

31 lent. VPJFS, kuriems neatlikta tarpuskaita, kai naudojami užsakomomis fondo portfelio valdymo paslaugomis

No	Field	Example	XML Message
5	Sector of the reporting counterparty	AIFD	<pre> <LEI>AAAAAAAAAA2222222222</LEI> </RptSubmitgNtty> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>AAAAAAAAAA1111111111</LEI> </Id> <Ntr> <FI> <Clssfctn>AIFD</Clssfctn> </FI> </Ntr> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN</LEI> </Id> <CtryCd>FR</CtryCd> </OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI>AAAAAAAAAA2222222222</LEI> </NttyRspnsblForRpt> <OthrPtyData> <Brkr> <LEI> AAAAAAAAAA2222222222</LEI> </Brkr> </OthrPtyData> <StlmPties> <CntrlSctiesDpstryPtcpt> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSctiesDpstryPtcpt> </StlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </pre>
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	{LEI} of AIF management company N	
16	Clearing member		
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of custodian bank H	
18	Agent lender		

31 lent. VPĮFS, kuriems neatlikta tarpuskaita, kai naudojamosi užsakomosiomis fondo portfelio valdymo paslaugomis

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

5.2 Paskolų ir užtikrinimo priemonių duomenys

192. Užpildžius sandorio šalių duomenų laukus, užpildomi ir įvairių naudojimo atvejų paskolų ir užtikrinimo priemonių duomenų laukai. Taip pat paaiškinamas duomenų teikimas pagal ISO 20002 XML schemas. Tai padės sandorio šalims pildyti laukus.
193. Kiekviename poskirsnyje bus trumpas nagrinėjamiems laukams taikomos duomenų teikimo logikos aprašymas.

5.2.1 Pranešimas apie veiksmų rūšis sandorio lygmeniu ir pozicijos lygmeniu.

5.2.1.1 Naujas dvišalis VPĮFS, kuriam neatlikta tarpuskaita, sandorio lygmeniu

194. 32 lent. parodoma, kaip pildomi duomenų laukai naujo VPĮFS, kuriam neatlikta tarpuskaita, atveju. Dvišalių VPĮFS duomenys sandorio lygmeniu turėtų būti pateikiami taip.

32 lent. Naujas VPĮFS, kuriam neatlikta tarpuskaita, sandorio lygmeniu

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UT11	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> </pre>
5	Cleared	false	
98	Action type	NEWT	
99	Level	TCTN	<pre> <UnqTradldr>UT11</UnqTradldr> <ClrSts> <NonClrd>NORE</NonClrd> </ClrSts> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> <LvITp>TCTN</LvITp> </New> </pre>

32 lent. Naujas VPĮFS, kuriam neatlikta tarpuskaita, sandorio lygmeniu			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.2.1.2 Naujas dvišalis VPĮFS sandorio lygmeniu, kuriam i) tarpuskaita atlikta tą pačią dieną arba ii) vėliau.

195. 33 lent., 34 lent. ir 35 lent. parodoma, kaip sandorio šalis (ne pagrindinė sandorio šalis) turėtų pildyti laukus naujo VPĮFS atveju, kai sandoris i) sudaromas dvišaliu pagrindu ir jo tarpuskaita atliekama tą pačią dieną arba ii) jo tarpuskaita atliekama kitą dieną po jo sudarymo prekybos vietoje. Sandorio šalys turėtų teikti VPĮFS duomenis nurodydamos veiksmo rūšį ETRM, dėl kurios lauke „Tarpuskaita atlikta“ pirmalaikio prekybos sandorio, apie kurį pranešama, nutraukimo negalima nurodyti kaip sandorio, kuriam tarpuskaita neatlikta. Vėliau sandorio šalis turėtų pateikti VPĮFS pranešimą nurodydama veiksmo rūšį NEWT, kad parodytų, jog VPĮFS tarpuskaita yra atlikta. Teikiamų pranešimų seka parodoma atitinkamai 33 lent., 34 lent. ir 35 lent..

33 lent. Naujas dvišalis VPĮFS sandorio lygmeniu, kuriam tarpuskaita atlikta tą pačią dieną arba vėliau			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UT11	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UT11</UnqTradldr> </RpTrad> <ClrSts> <NonClrd>NORE</NonClrd> </ClrSts> </LnData> ... <CollData> ... </CollData> <LvITp>TCTN</LvITp> </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
5	Cleared	false	
98	Action type	NEWT	
99	Level	TCTN	

34 lent. Dvišalio VPJFS nutraukimas sandorio lygmeniu dėl tarpuskaitos, atliktos tą pačią dieną arba vėliau

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

35 lent. Naujas VPJFS sandorio lygmeniu, kuriam atlikta tarpuskaita, susijęs su dvišalio VPJFS tarpuskaita tą pačią dieną arba vėliau

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

⁸ TN kliento požiūriu netaikytina pagrindinės sandorio šalies pranešimui.

35 lent. Naujas VPĮFS sandorio lygmeniu, kuriam atlikta tarpuskaita, susijęs su dvišalio VPĮFS tarpuskaita tą pačią dieną arba vėliau

No	Field	Example	XML Message
			<pre> <LvITp>TCTN</LvITp> </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

196. Įsidėmėkite, kad pagal 33 lent. ir 34 lent. pranešimo nesitikima, jeigu prekybos sandorį prekybos vietoje sudarė sandorio šalys, kurios taip pat yra tarpuskaitos narės, o pagrindinė sandorio šalis tą pačią dieną atliko tarpuskaitą; pranešimo tikimasi tik pagal 35 lent. Be to, 35 lent. parodoma, kaip teikti duomenis, kai VPĮFS, kuriam atlikta tarpuskaita, nėra iš karto įtraukiamas į poziciją (tokiu atveju apie jį reikėtų pranešti nurodant veiksmo rūšį POSC, kaip paaiškinta toliau pateiktuose pavyzdžiuose).

5.2.1.3 Naujas VPĮFS, apie kurį pranešama kaip apie pozicijos komponentą

197. 36 lent. ir 37 lent. parodoma, kaip pildomi duomenų laukai, jeigu apie naują VPĮFS⁹ pranešama kaip apie pozicijos komponentą. Apie VPĮFS, įtrauktus į poziciją, kuriai atlikta pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita, gali būti pranešama taip. Pasirūpinkite, kad 36 lent. ir 37 lent. parodytos sekos būtų kuriamos atsižvelgiant į tai, kad VPĮFS yra sudarytas prekybos vietoje ir pagrindinė sandorio šalis tą pačią dieną atliko jo tarpuskaitą, tad turėtų būti pranešama tik apie VPĮFS, kuriam atlikta tarpuskaita. Kalbant apie VPĮFS, kuriems atlikta pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita, pavyzdžius, jie identifikuojami pagal unikalų sandorio identifikatorių (UTI) PUT11.

198. Kadangi šis variantas papildo duomenų teikimą sandorio lygmeniu, pranešimai teikiami taip. VPĮFS, kuriems atlikta pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita, atveju sandorio šalys neturėtų nurodyti pranešimo sekimo numerio (2.2 laukas):

36 lent. Naujas VPĮFS, sudarytas prekybos vietoje, kuriam pagrindinė sandorio šalis atliko tarpuskaitą tą pačią dieną ir sandorio lygmeniu nurodytas pozicijos komponentas

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <PosCmpnt> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> </pre>
5	Cleared	true	
98	Action type	POSC ¹⁰	
99	Level	TCTN	

⁹ VPĮFS, kuriems atlikta tarpuskaita, scenarijai yra pažymėti kaip taikytini atpirkimo sandoriams, nors praktiškai tokie scenarijai nelaikomi tikėtiniais. Garantinės įmokos skolinimo atveju pozicijos lygmuo neįmanomas.

¹⁰ Įsidėmėkite, kad apie pirminius prekybos sandorius sandorio lygmeniu reikia pranešti kaip veiksmo rūšį nurodant pozicijos komponentą.

36 lent. Naujas VPĮFS, sudarytas prekybos vietoje, kuriam pagrindinė sandorio šalis atliko tarpuskaitą tą pačią dieną ir sandorio lygmeniu nurodytas pozicijos komponentas

No	Field	Example	XML Message
			<pre> <RpTrad> <UnqTradldr>UT12</UnqTradldr> <ClrSts> <Clrd> ... </Clrd> </ClrSts> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> <LvITp>TCTN</LvITp> </PosCmpnt> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

37 lent. Naujas VPĮFS, kuriam atlikta pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita ir apie kurį pranešama pozicijos lygmeniu

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

¹¹ Nepaisant neprivalomo pobūdžio, dvišaliu pagrindu sudarytų VPĮFS negalima pateikti vienu prekybos sandoriu, tad tarpuskaita atliekama dėl visų pozicijos lygmeniu pateiktų pranešimų.

¹² Šiame pavyzdyje sukuriamą naują poziciją. Jeigu sandoris, kuriam atlikta tarpuskaita, įtraukiamas į esamą poziciją, apie jį pranešama kaip apie tos pozicijos pakeitimą (nurodant veiksmo rūšį MODI).

¹³ Įsidėmėkite, kad apie galutinį VPĮFS, kuriam atlikta tarpuskaita, reikėtų pranešti pozicijos lygmeniu, o pranešimą pozicijos lygmeniu galima naudoti tik kaip prekybos sandorio lygmens pranešimo papildymą, tad tikimasi, kad bus pranešama pagal 36 lent. ir 37 lent. lenteles.

37 lent. Naujas VPĮFS, kuriam atlikta pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita ir apie kurį pranešama pozicijos lygmeniu

No	Field	Example	XML Message
			<pre> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> <LvITp>PSTN</LvITp> </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.2.1.4 VPĮFS pakeitimas sandorio lygmeniu

199. 38 lent. parodoma, kaip pildomi duomenų teikimo laukai, jeigu anksčiau pateiktas VPĮFS sandorio lygmeniu buvo pakeistas.

38 lent. VPĮFS pakeitimas sandorio lygmeniu

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UT11	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <Mod> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> </pre>
98	Action type	MODI	
99	Level	TCTN	<pre> <UnqTradldr>UT11</UnqTradldr> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> <LvITp>TCTN</LvITp> </Mod> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.2.1.5 VPĮFS, kuriam atlikta pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita, pakeitimas pozicijos lygmeniu

200. 39 lent. parodoma, kaip pildomi duomenų laukai, jeigu VPĮFS, kuriam atlikta pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita ir apie kurį anksčiau pranešta pozicijos lygmeniu, buvo pakeistas. Taip yra dėl papildomų sandorio lygmeniu sudarytų VPĮFS, kuriems pagrindinė sandorio šalis atliko tarpuskaitą tą pačią ar kitą dieną, įtraukimo. Įtraukus sandorį į poziciją pirminio sandorio lygmens pranešimo pakeisti negalima, bet, jeigu informacija buvo pateikta neteisingai, tokį VPĮFS galima pataisyti.

39 lent. VPĮFS, kuriam atlikta pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita, pakeitimas pozicijos lygmeniu			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	PUTI1	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <Mod> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>PUTI1</UnqTradldr> <ClrSts> <Clrd> ... </Clrd> </ClrSts> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> <LvITp>PSTN</LvITp> </Mod> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
5	Cleared	true	
98	Action type	MODI	
99	Level	PSTN	

5.2.1.6 VPĮFS pataisymas sandorio lygmeniu

201. 40 lent. parodoma, kaip pildomi duomenų laukai, kai reikia pataisyti duomenų laukus, kurie buvo neteisingai užpildyti ankstesniame pranešime apie VPĮFS sandorio lygmeniu.

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

5.2.1.7 VPĮFS, kuriam atlikta pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita, pataisymas pozicijos lygmeniu

202. 41 lent. parodoma, kaip papildomi duomenų laukai, kai reikia pataisyti duomenų laukus, kurie buvo neteisingai užpildyti ankstesniame pranešime apie VPĮFS, kuriam atlikta pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita, pozicijos lygmeniu. Pirminio sandorio lygmens pranešimo taisyti nereikia, jeigu jis buvo pateiktas teisingai.

41 lent. VPĮFS, kuriam atlikta pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita, pataisymas pozicijos lygmeniu			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	PUTI1	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <Crrctn> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> </pre>
5	Cleared	true	
98	Action type	CORR	
99	Level	PSTN	

41 lent. VPĮFS, kuriam atlikta pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita, pataisymas pozicijos lygmeniu

No	Field	Example	XML Message
			<pre> <ClrSts> <Clrd> ... </Clrd> </ClrSts> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> <LvITp>PSTN</LvITp> </Crrctn> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.2.1.8 VPĮFS vertinimas (tik VPSS atveju)

203. 42 lent. parodoma, kaip pildomi duomenų laukai, kai sudarius VPSS sandorį atnaujinamas vertybinių popierių vertinimas. Sandorio šalis nustato, kad paskolintų vertybinių popierių vertė yra 1 000 000 EUR ir šiuo atveju tai sutampa su paskolos verte (2.56 laukas); tai netaikytina veiksmo rūšiai VALU. Šiuo atveju sandorio šalis pateikia paskolintų vertybinių popierių vertinimą (2.57 laukas) valiuta, kuria suteikta paskola. Rinkos vertės valiuta nurodoma XML žyma.

42 lent. VPĮFS vertinimas (tik VPSS atveju)

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

42 lent. VPĮFS vertinimas (tik VPSS atveju)			
No	Field	Example	XML Message
			<pre></TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt></pre>

5.2.1.9 Pranešimas apie sandorio lygmeniu užtikrinto VPĮFS įkaito atnaujinimą

204. Bet kokia informacija apie įkaitą turėtų būti pateikiama nurodant tik veiksmo rūšį COLU, o sandorio lygmeniu užtikrintų VPĮFS atveju taip pat turėtų būti nurodomas užtikrinto sandorio UTI, kaip parodyta 43 lent. Pranešimo apie užtikrinimo priemones ypatumai paaiškinami 5.4 skirsnyje.
205. Šis pavyzdys taip pat gali būti taikomas pranešant apie VPĮFS, apie kurį pranešama pozicijos lygmeniu, įkaitą, jeigu įkaitas yra priskirtas prie pozicijos.

43 lent. Pranešimas apie užtikrinto VPĮFS įkaito atnaujinimą sandorio lygmeniu			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<pre><SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt></pre>
98	Action type	COLU	
99	Level		

206. Be to, VPĮFS įtraukus į poziciją apie bet kokį įkaito atnaujinimą reikėtų pranešti jį susiejant su ta pozicija, o ne su pirminiu VPĮFS.

5.2.1.10 Pranešimas apie grynosios pozicijos lygmeniu užtikrinto VPĮFS įkaito atnaujinimą

207. Bet kokia informacija apie įkaitą turėtų būti pateikiama nurodant tik veiksmo rūšį COLU, o grynosios pozicijos lygmeniu užtikrintų VPĮFS atveju UTI galima nenurodyti, kaip parodyta 44 lent. Pranešimo apie užtikrinimo priemones ypatumai paaiškinami 5.4 skirsnyje.

44 lent. Pranešimas apie gryniosios pozicijos lygmeniu užtikrinto VPĮFS įkaito atnaujinimą

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

5.2.1.11 Pirmalaikis VPĮFS nutraukimas

208. 45 lent. parodoma, kaip pildomi duomenų laukai, kai nutraukiamas neterminuotas VPĮFS arba anksčiau laiko nutraukiamas terminuotas VPĮFS. Šiuo naudojimo atveju lygis, t. y. sandorio ar pozicijos, kuriuo pranešama apie VPĮFS, nėra svarbus, nes 2.99 laukas „Lygis“ šiai veiksmo rūšiai netaikomas.

45 lent. Pirmalaikis VPĮFS nutraukimas

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

5.2.1.12 VPĮFS pripažinimas klaidingu

209. 46 lent. parodoma, kaip pildomi duomenų laukai, jeigu panaikinamas visas netinkamai pateiktas pranešimas, susijęs su VPĮFS, kuris taip ir nebuvo sudarytas arba kuriam nebuvo taikomi VPĮFS duomenų teikimo reikalavimai, bet apie kurį buvo pranešta SDS per klaidą. Šiuo naudojimo atveju lygis, t. y. sandorio ar pozicijos, kuriuo pranešama apie VPĮFS, nėra svarbus, nes 2.99 laukas „Lygis“ šiai veiksmo rūšiai netaikomas.

46 lent. VPĮFS pripažinimas klaidingu sandorio lygmeniu			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <Err> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <UnqTradIdr>UTI1</UnqTradIdr> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </Err> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
98	Action type	EROR	
99	Level		

5.3 Paskolų duomenys

210. Toliau esančiuose skirsniuose paaiškinama, kaip pildyti tam tikrus laukus, susijusius su konkrečiomis sandorio paskolos pusės charakteristikomis. Taip duomenis teikiančios sandorio šalys galės tiesiogiai įvertinti informaciją, kurią turėtų teikti dėl kiekvieno konkretaus duomenų skirsnio, kai taikytina.

211. Patvirtinimo taisyklėse pateikiamos išsamios rekomendacijos dėl taikytinų laukų pagal VPĮFS rūšį, veiksmo rūšį ir lygį ir atitinkamus priklausomybės ryšius.

212. Visuose pavyzdžiuose ir naudojimo atvejuose toliau pateikiami atsitiktiniu būdu suformuoti kodai; nė vienas iš jų nėra susijęs su vertybiniais popieriais ar subjektu.

5.3.1 Įvykio datos duomenų teikimas

213. Sandorio šalys turėtų turėti omenyje, kad remdamosi dėl tam tikros įvykio datos pateikta informacija valdžios institucijos galėtų susidaryti aiškų vaizdą apie su tam tikrais VPĮFS (jų rinkiniu) susijusiomis pozicijomis dienas, kurią buvo sudarytas VPĮFS, pabaigoje. Sandorio šalys turėtų pateikti įvykio datą remdamosi 4.9.6 skirsniu.

5.3.2 Pranešimas apie VPĮFS, kuriems atlikta / neatlikta tarpuskaita

5.3.2.1 Viešas pasiūlymas dėl VPĮFS, kuriems atlikta tarpuskaita

214. Kai prekybos sandorio tarpuskaita atliekama taikant viešo pasiūlymo modelį, tarpuskaita vyksta VPĮFS sudarymo metu.
215. 47 lent. parodoma, kaip pildomi duomenų laukai susiklosčius pirmiau apibūdintai situacijai O pagrindinės sandorio šalies ir TN kliento požiūriu, nes šiuo atveju jie sutampa.
216. Reikėtų užpildyti šią duomenų laukų grupę:
- lauke „Tarpuskaita atlikta“ (2.5 laukas) nurodoma reikšmė „true“ („taip“);
 - laukas „Tarpuskaitos laiko žyma“ (2.6 laukas) pildomas taip pat, kaip 2.12 laukas „Įvykdymo laiko žyma“;
 - lauke „Pagrindinė sandorio šalis“ (2.7 laukas) nurodomas O pagrindinės sandorio šalies LEI.

47 lent. Pagrindinės sandorio šalies ir TN požiūriu			
No	Field	Example	XML Message
2	Report tracking number		<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData>
5	Cleared	true	<Rpt> <New>
6	Clearing timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<CtrPtyData> ...
7	CCP	{LEI} of CCP O	</CtrPtyData> ...
9	Master agreement Type	OTHR	<LnData> <RpTrad>
10	Other master agreement type	CCPClearing Conditions	<ExctnDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</ExctnDtTm> <ClrSts> <Clrd> <CCP>
12	Execution timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<LEI>BBBBBBBBBB1111111111</LEI> </CCP> <ClrDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</ClrDtTm> </Clrd> </ClrSts> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>OTHR</Tp> </Tp> <OthrMstrAgrmtDtls>CCPClearingConditions</OthrMstrAgrmtDtls> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData>

47 lent. Pagrindinės sandorio šalies ir TN požiūriu			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.3.2.2 VPĮFS, kuriam atlikta tarpuskaita, taikant novacijos modelį

217. Kai prekybos sandorio tarpuskaita atliekama taikant novacijos modelį, tarpuskaita vyksta VPĮFS sudarymo metu.
218. 48 lent. ir 49 lent. parodoma, kaip pildomi laukai atitinkamai O pagrindinės sandorio šalies ir TN požiūriu, kai O pagrindinė sandorio šalis atlieka VPĮFS tarpuskaitą taikydama novacijos modelį.
219. Šiuo požiūriu reikėtų užpildyti šią duomenų laukų grupę:
- lauke „Pranešimo sekimo numeris“ (2.2 laukas) reikėtų nurodyti ankstesnį UTI (VPĮFS, kuriam atlikta pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita, atveju tai dvišalio sandorio UTI), bet jį nurodo tik TN ir jo klientas (ne pagrindinė sandorio šalis);
 - lauke „Tarpuskaita atlikta“ (2.5 laukas) nurodoma reikšmė „true“ („taip“);
 - laukas „Tarpuskaitos laiko žyma“ (2.6 laukas) yra po 2.12 lauko „Įvykdymo laiko žyma“;
 - lauke „Pagrindinė sandorio šalis“ (2.7 laukas) nurodomas O pagrindinės sandorio šalies LEI.

48 lent. VPĮFS, kuriam atlikta tarpuskaita, taikant novacijos modelį pagrindinės sandorio šalies požiūriu			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI2	<pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UTI2</UnqTradldr> <ExctnDtTm>2020-04- 22T14:41:07Z</ExctnDtTm> <ClrSts> </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	

48 lent. VPJFS, kuriam atlikta tarpuskaity, taikant novacijos modelį pagrindinės sandorio šalies požičiūriū

No	Field	Example	XML Message
12	Execution timestamp	2020-04-22T14:41:07Z	<pre> <Clrd> <CCP> <LEI>BBBBBBBBBB1111111111</LEI> </CCP> <ClrDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</ClrDtTm> </Clrd> </ClrSts> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>OTHR</Tp> </Tp> <OthrMstrAgrmtDtIs>CCPClearingConditions</OthrMstrAgrmtDtIs> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

220. 49 lent. parodomas pavyzdys TN požičiūriū. Kliento požičiūriū laukai turėtų būti pildomi taip pat.

49 lent. VPJFS, kuriam atlikta tarpuskaity, taikant novacijos modelį TN požičiūriū

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI2	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradIdr>UTI2</UnqTradIdr> <ExctnDtTm>2020-04-22T14:41:07Z</ExctnDtTm> <ClrSts> </pre>
2	Report tracking number	UTI1	
5	Cleared	true	
6	Clearing timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	
7	CCP	{LEI} of CCP O	
9	Master agreement Type	OTHR	
10	Other master agreement type	CCPClearing Conditions	

49 lent. VPJFS, kuriam atlikta tarpuskaita, taikant novacijos modelį TN požiūriu			
No	Field	Example	XML Message
12	Execution timestamp	2020-04-22T14:41:07Z	<pre> <Clrd> <CCP> <LEI>BBBBBBBBBB1111111111</LEI> </CCP> <ClrDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</ClrDtTm> <RptTrckgNb>UT11</RptTrckgNb> </Clrd> </ClrSts> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>OTHR</Tp> </Tp> <OthrMstrAgrmtDtls>CCPClearingConditions</OthrMstrAgrmtDtls> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.3.2.3 VPJFS, kuriam atlikta pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita, taikant DBV modelį

221. Kai prekybos sandorio tarpuskaita atliekama taikant DBV modelį, tarpuskaita vyksta VPJFS sudarymo metu.
222. 2.19 lauke nurodoma, ar už sandorį buvo atsiskaityta taikant pateikimo pagal vertę mechanizmą.
223. 50 lent. parodoma, kaip pildomi duomenų laukai O pagrindinės sandorio šalies požiūriu. Šiuo požiūriu reikėtų užpildyti šią duomenų laukų grupę:
 - a. lauke „Tarpuskaita atlikta“ (2.5 laukas) nurodoma reikšmė „true“ („taip“);
 - b. laukas „Tarpuskaitos laiko žyma“ (2.6 laukas) yra po 2.12 lauko „Įvykdymo laiko žyma“;
 - c. lauke „Pagrindinė sandorio šalis“ (2.7 laukas) nurodomas O pagrindinės sandorio šalies LEI.

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

51 lent. TN požiūriu			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI2	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> </pre>
2	Report tracking number	UTI1	

51 lent. TN požiūriu			
No	Field	Example	XML Message
5	Cleared	true	<Rpt> <New>
6	Clearing timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<CtrPtyData> ...
7	CCP	{LEI} of CCP O	</CtrPtyData> ...
9	Master agreement Type	OTHR	<LnData> <RpTrad>
10	Other master agreement type	CCPClearing Conditions	<UnqTradIdr>UTI2</UnqTradIdr> <ExctnDtTm>2020-04-22T14:41:07Z</ExctnDtTm>
12	Execution timestamp	2020-04-22T14:41:07Z	<ClrSts> <Clrd> <CCP>
19	Delivery by Value (“DBV”) indicator	true	<LEI>BBBBBBBBBB1111111111</LEI> </CCP> <ClrDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</ClrDtTm> <RptTrckgNb>UTI1</RptTrckgNb> </Clrd> </ClrSts> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>OTHR</Tp> </Tp> <OthrMstrAgrmtDtls>CCPClearingConditions</OthrMstrAgrmtDtls> </MstrAgrmt> <DlvryByVal>true</DlvryByVal> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

5.3.2.4 VPĮFS, kuriam neatlikta tarpuskaita

224. Lauke „Tarpuskaita atlikta“ (2.5 laukas) nurodoma reikšmė „false“ („ne“), kaip parodyta 52 lent. Kiti su tarpuskaita susiję laukai nepildomi. Laukas „Įvykdymo laiko žyma“ užpildomas.

52 lent. VPĮFS, kuriam neatlikta tarpuskaity			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UT11	
2	Report tracking number		<pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradIdr>UT11</UnqTradIdr> <ExctnDtTm>2020-04-22T14:41:07Z</ExctnDtTm> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre>
5	Cleared	false	
6	Clearing timestamp		
7	CCP		
12	Execution timestamp	2020-04-22T14:41:07Z	

5.3.3 Prekybos vieta

225. Laukas „Prekybos vieta“ (2.8 laukas) turėtų būti pildomas atsižvelgiant į sudaryto VPĮFS rūšį. Sandorio šalys visuomet turėtų naudoti MIC segmentą.
226. Jeigu VPĮFS sudaromas automatinėse prekybos sistemose (ATS) arba maklerių sandorių platformoje, reikėtų nurodyti platformos MIC. Šiame lauke negalima nurodyti LEI.

5.3.4 Pagrindinio susitarimo skirsnis

5.3.4.1 Dokumentuotas VPĮFS su pagrindiniu susitarimu iš sąrašo

227. Jeigu naudojamas pagrindinis susitarimas, reikėtų užpildyti šiuos laukus:
- „Pagrindinio susitarimo rūšis“ (2.9 laukas);
 - „Pagrindinio susitarimo versija“ (2.11 laukas), kai 2.9 lauke nurodoma kita vertė nei BIAG, CSDA ar OTHR.
228. Jeigu pagrindinio susitarimo (kuris nėra BIAG, CSDA ar OTHR) versijos nėra, lauke „Pagrindinio susitarimo versija“ sandorio šalys turėtų nurodyti susitarimo pasirašymo metus.

229. Apie VPĮFS pagal CVPD neįvykdytų įsipareigojimų vykdymo programas reikėtų pranešti pagrindinio susitarimo rūšies CSDA atveju.
230. 53 lent. parodoma, kaip pildomi laukai, jeigu VPĮFS sudaromas pagal 2011 m. GMRA pagrindinį susitarimą.

53 lent. Dokumentuotas VPĮFS su pagrindiniu susitarimu iš sąrašo			
No	Field	Example	XML Message
9	Master agreement type	GMRA	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> <Vrsn>2011</Vrsn> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
10	Other master agreement type		
11	Master agreement version	2011	

5.3.4.2 Dokumentuotas VPĮFS su susitarimu, kurio nėra sąrašė

231. Kai naudojamas pagrindinis susitarimas, kurio nėra sąrašė (pvz., pagrindinės sandorio šalies tarpuskaitos sąlygos novacijos būdu sudaromų sandorių atveju arba pagrindinio maklerio paslaugų dvišalių susitarimų atveju skolinant garantinę įmoką), reikėtų užpildyti šiuos laukus:
- „Pagrindinio susitarimo rūšis“ (2.9 laukas);
 - „Kita pagrindinio susitarimo rūšis“ (2.10 laukas), kai 2.9 lauke nurodoma reikšmė OTHR.
232. 54 lent. parodoma, kaip pildomi laukai, jeigu VPĮFS sudaromas pagal pagrindinį susitarimą, kurio nėra sąrašė, ir daroma nuoroda į O pagrindinės sandorio šalies atpirkimo sandorių taisyklių sąvadą.

54 lent. Dokumentuotas VPĮFS su susitarimu, kurio nėra sąrašė

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

5.3.4.3 Nedokumentuotas VPĮFS

233. Nedokumentuoto VPĮFS atveju reikėtų užpildyti šiuos laukus (žr. 55 lent.):

- lauke „Pagrindinio susitarimo rūšis“ (2.9 laukas) reikėtų nurodyti OTHR;
- lauke „Kita pagrindinio susitarimo rūšis“ (2.10 laukas) reikėtų nurodyti „Nedokumentuota“.

55 lent. Nedokumentuotas VPĮFS

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

55 lent. Nedokumentuotas VPĮFS			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>OTHR</Tp> </Tp> <OthrMstrAgrmtDtIs>Undocumented</Oth rMstrAgrmtDtIs> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.3.5 Sandorio sudarymas ir pradžia

234. Dviejuose pavyzdžiuose toliau parodoma, kaip pranešama apie VPĮFS sudarymą, kai a) jis pradedamas vykdyti nedelsiant ir b) jam nustatyta vėlesnė įskaitymo data.
235. Įskaitymo data turėtų būti suprantama kaip sutarta atsiskaitymo data, kaip apibrėžta TRS 2.13 lauke. Jeigu numatyta įskaitymo dieną laikinai nepavyko atsiskaityti, dėl to nereikia teikti papildomo pranešimo (pvz., „Pakeitimas“), nebent sandorio šalys susitartų pakeisti arba nutraukti sandorį dėl nepavykusio atsiskaitymo (tokiu atveju reikia atitinkamai pranešti apie pakeitimo ar nutraukimo įvykį).

5.3.5.1 Neatidėliotinas sandoris

236. 56 lent. parodoma, kaip pildomi laukai, jeigu sandoris yra sudarytas ir pradedamas vykdyti po dviejų dienų, t. y. atsiskaitymo ciklas ES. Tai neatidėliotinas VPĮFS.

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

56 lent. Neatidėliotinas sandoris			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> <ValDt>2020-04-24</ValDt> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.3.5.2 Išankstinis sandoris

237. 57 lent. parodoma, kaip pildomi laukai, jeigu sandoris pradedamas vykdyti praėjus vienam mėnesiui po jo sudarymo; tai reiškia, kad toks sandoris yra išankstinis VPĮFS.

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

5.3.6 VPĮFS terminas

238. Pranešdamos apie minimalų pranešimo laikotarpį (2.16 laukas) sandorio šalys turėtų pateikti informaciją apie darbo dienas remdamosi darbo dienos apibrėžtimi atitinkamame pagrindiniame susitarime arba dvišaliame susitarime, kuris taikomas VPĮFS.

239. Kai šis laukas taikytinas VPĮFS, kurio šalutinės aplinkybės nėra įtrauktos į Duomenų teikimo TS, kaip antai padengiamiesiems atpirkimo sandoriams, sandorio šalys turėtų pateikti informaciją apie anksčiausią pareikalavimo datą (2.17 laukas), jeigu ji yra.
240. Sandorio šalys turėtų pateikti informaciją apie minimalų pranešimo laikotarpį (2.16 laukas) dėl neterminuotų atpirkimo sandorių, t. y. 2.21 lauke nurodoma reikšmė „true“ („taip“), ir dėl neapibrėžtos trukmės ir pratęstinių atpirkimo sandorių, t. y. 2.22 lauke nurodoma ETSB ir EGRN.
241. Sandorio šalys turėtų užpildyti 2.17 lauką „Anksčiausia pareikalavimo data“ dėl VPĮFS, kuriems numatyta nutraukimo pasirinkimo galimybė. Jeigu sandorio šalys nesutarė dėl naujos anksčiausios pareikalavimo datos, jos turėtų nurodyti pirminę VPĮFS taikytiną anksčiausią pareikalavimo datą.

5.3.6.1 Neterminuotas sandoris

242. 58 lent. parodoma, kaip pildomi laukai, jeigu sandorio šalys susitaria dėl neterminuoto sandorio, kurio minimalus pranešimo laikotarpis, susijęs su sandorio nutraukimu, yra 1 diena.

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

5.3.6.2 Terminuotas sandoris

243. 59 lent. parodoma, kaip pildomi laukai, kai sandorio šalys susitaria galutiniame (ateities) VPĮFS etape pakeisti grynusius pinigus, vertybinius popierius ar biržos prekes įkaitu 2020 m. gegužės 22 d.
244. Pavyzdyje minimalus darbo dienų skaičius, kuriam likus viena iš sandorio šalių turi informuoti kitą sandorio šalį apie šio VPĮFS nutraukimą, yra 5.
245. Anksčiausia data, kada grynųjų pinigų skolintojas turi teisę pareikalauti lėšų dalį arba nutraukti sandorį, yra 2020 m. gegužės 7 d. Nors šis scenarijus nėra įprastas, jis vis tiek galimas.

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

5.3.7 Nutraukimo pasirinkimo galimybė

246. ESMA pažymi, kad 2.22 lauke sandorio šalys turėtų nurodyti vieną iš šių reikšmių: EGRN, ETSB ar NOAP. 2.21 lauke nurodoma viena iš šių verčių: „true“ („taip“) ar „false“ („ne“). Jeigu 2.22 lauke „Nutraukimo pasirinkimo galimybė“ nurodoma ETSB, šiame lauke nurodoma reikšmė „false“ („ne“).
247. Jeigu VPĮFS yra pareikalautinas arba padengiamasis, sandorio šalys turėtų pateikti šią informaciją lauke „Anksčiausia pareikalavimo data“ (2.17 laukas).

5.3.8 Susitarimai dėl bendrųjų ir specialiųjų užtikrinimo priemonių

248. Laukas „Bendrosios užtikrinimo priemonės rodiklis“ (2.18 laukas) taikomas tik vertybiniais popieriais, suteiktiems kaip užtikrinimo priemonė, bet ne paskolintiems vertybiniais popieriais.
249. Remiantis TRS ir siekiant laikytis PRSR naudojamų duomenų teikimo nurodymų, visais atvejais, kai įkaito davėjas gali pasirinkti vertybinį popierių, skirtą pateikti kaip užtikrinimo priemonė, iš įvairių iš anksto nustatytus kriterijus atitinkančių vertybinių popierių, reikėtų nurodyti GENE. Tai pasakytina ir apie automatinės prekybos sistemos, kurią, pavyzdžiui, valdo pagrindinės sandorio šalys, teikiamas BUP priemonės (bet ne tik) ir sandorius, kurių įkaitą valdo trišalis agentas. Daugumos VPSS susitarimų atveju taip pat dažniausiai turėtų būti naudojama reikšmė GENE. SPEC turėtų būti nurodoma tik tais atvejais, kai įkaito gavėjas prašo kaip užtikrinimo priemonę suteikti konkretaus ISIN kodo vertybinius popierius.
250. Duomenų teikimas apie užtikrinimą gryniosios pozicijos pagrindu (2.73 laukas) yra atskiras klausimas, kuris nėra tiesiogiai susijęs su susitarimo dėl užtikrinimo priemonių rūšimi. BUP platformoje vykdomi sandoriai gali būti užtikrinami vieno sandorio pagrindu arba gryniosios pozicijos pagrindu. Sandorio šalys turėtų apie juos atitinkamai pranešti. Duomenų teikimas dėl užtikrinimo priemonių krepšelių paaiškinamas 5.4.2 skirsnyje dėl užtikrinimo.
251. Kai VPĮFS buvo iš pradžių sudarytas kaip BUP, bet po įvykdymo buvo paskirstyti konkretūs įkaito gavėjo pasirinkti vertybiniai popieriai, jis nedelsiant virsta konkrečiu užtikrinimo priemonės sandoriu. VPĮFS pranešimą su veiksmo rūšimi MODI reikėtų pateikti peržiūrėjus vertę 2.18 lauke ir apie atitinkamą įkaitą reikėtų pranešti nurodant veiksmo rūšį COLU.
252. Nebent sandorio šalys būtų susitarusios kitaip, apie trišalius atpirkimo sandorius reikėtų pranešti 2.18 lauke „Bendrosios užtikrinimo priemonės rodiklis“ nurodant GENE.
253. 60 lent., 61 lent. ir 62 lent. pateikiami trys pavyzdžiai, kaip pildyti lauką „Bendrosios užtikrinimo priemonės rodiklis“ (2.18 laukas). Įsidėmėkite, kad tai galbūt nėra visi įmanomi atvejai.

5.3.8.1 Specialioji užtikrinimo priemonė perleidžiant nuosavybės teises

254. 60 lent. parodoma, kaip pildomi laukai, jeigu VPĮFS taikomas specialiosios užtikrinimo priemonės susitarimas (2.18 lauke įrašoma SPEC) ir dėl tokio įkaito perleidžiamos nuosavybės teisės (2.20 lauke įrašoma TTCA).

60 lent. Nuosavybės teisių perleidimas suteikiant specialiąją užtikrinimo priemonę			
No	Field	Example	XML Message
18	General collateral indicator	SPEC	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <GnlColl>SPEC</GnlColl> <DlvryByVal>>false</DlvryByVal> <CollDlvryMtd>TTCA</CollDlvryMtd> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>
19	Delivery By Value ('DBV') indicator	false	
20	Method used to provide collateral	TTCA	

5.3.8.2 Bendrosios užtikrinimo priemonės įkeitimas

255. 61 lent. parodoma, kaip pildomi laukai, jeigu VPĮFS taikomas bendrosios užtikrinimo priemonės susitarimas (2.18 lauke įrašoma GENE) ir tokiam įkaitui taikomas vertybinių popierių kaip finansinio įkaito susitarimas (2.20 lauke įrašoma SICA).

61 lent. Bendrosios užtikrinimo priemonės įkeitimas			
No	Field	Example	XML Message
18	General collateral indicator	GENE	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <GnlColl>GENE</GnlColl> <DlvryByVal>>false</DlvryByVal> <CollDlvryMtd>SICA</CollDlvryMtd> </RpTrad> </LnData>
19	Delivery By Value ('DBV') indicator	false	
20	Method used to provide collateral	SICA	

61 lent. Bendrosios užtikrinimo priemonės įkeitimas			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.3.8.3 Nuosavybės teisių perleidimas suteikiant bendrąją DBV užtikrinimo priemonę

256. 62 lent. parodoma, kaip pildomi laukai, jeigu VPĮFS taikomas bendrosios užtikrinimo priemonės susitarimas (2.18 lauke įrašoma GENE) ir dėl tokio įkaito perleidžiamos nuosavybės teisės (2.20 lauke įrašoma TTCA). Už sandorį atsiskaitoma naudojant DBV mechanizmą (2.19 lauke įrašoma TRUE).

62 lent. Nuosavybės teisių perleidimas suteikiant bendrąją DBV užtikrinimo priemonę			
No	Field	Example	XML Message
18	General collateral indicator	GENE	<pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <GnlColl>GENE</GnlColl> <DivryByVal>true</DivryByVal> </pre>
19	Delivery By Value ('DBV') indicator	true	
20	Method used to provide collateral	TTCA	<pre> <CollDivryMtd>TTCA</CollDivryMtd> </RpTrad> </LnData> ... <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.3.9 Fiksuotosios ar kintamosios normos

257. Sudarydamos VPĮFS sandorio šalys gali susitarti dėl VPĮFS paskolos pusės naudoti fiksuotąją normą ar kintamąją normą. Laukuose „Fiksuotoji norma“ (2.23 laukas) ir „Pakoreguota kintamoji norma“ (2.35 laukas) galima nurodyti neigiamas vertes.

258. Pateikdamos kintamųjų normų duomenis sandorio šalys turėtų nurodyti atitinkamą normą ir taikytiną intervalą. Sandorio šalys turėtų atnaujinti šią informaciją tik kai susitaria pakeisti normą ar intervalą, bet ne kasdien.
259. Tam tikros kintamosios normos, kaip antai ESTER, SOFR ir kt., buvo nustatytos paskelbus TRS ir Duomenų teikimo TJS. Jos taip pat turi ISO kodus. Sandorio šalys turėtų naudoti jau sutartus kodus, kad informacija būtų teikiama nuosekliau. Kai yra kitų kintamųjų normų, kurioms nėra priskirtas ISO kodas, sandorio šalys turėtų pateikti nuoseklų raidinį skaitmeninį kodą.
260. Sandorio šalys turėtų pildyti 2.35 lauką „Pakoreguota norma“ ir 2.36 lauką „Normos data“ tik iš anksto susitarusios sudarant sandorį ateityje pakeisti normas. Kiti fiksuotųjų ar kintamųjų normų pakeitimai turėtų būti atitinkamai nurodomi 2.23 ir 2.25 laukuose.
261. Sandorio šalys neturėtų 2.23 lauke ar 2.25 lauke nurodytų jokių normų, susijusių su trumposios pozicijos rinkos verte (2.71 laukas).

5.3.9.1 Fiksuotoji norma. Pirminis pranešimas

262. Kai sandorio šalys sudaro fiksuotųjų normų VPİFS, jos turėtų pildyti 2.23 ir 2.24 laukus, kaip parodyta 63 lent. Šiuo atveju metams nustatyta palūkanų norma yra „-0,23455“ taikant dienų skaičiavimo susitarimą Actual360 („A004“).

63 lent. Fiksuotoji norma. Pirminis pranešimas			
No	Field	Example	XML Message
1	UTI	UTI1	<pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <UnqTradIdr>UTI1</UnqTradIdr> <RpTrad> <IntrstRate> <Fxd> <Rate>-0.23455</Rate> <DayCntBsis> <Cd>A004</Cd> </DayCntBsis> </Fxd> </IntrstRate> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </pre>
23	Fixed rate	-0.23455	
24	Day count convention	A004	
98	Action type	NEWT	

63 lent. Fiksuotoji norma. Pirminis pranešimas

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

5.3.9.2 Fiksuotoji norma. Pakeitimas

263. Kai sandorio šalys susitaria pakeisti fiksuotąją normą, t. y. pakartotinai nustatyti VPĮFS normą, jos turėtų pranešti apie pakeitimą 2.23 lauke ir 2.24 lauke, kaip parodyta 64 lent. Šiuo atveju naujoji metams nustatyta palūkanų norma yra „0,12345“ taikant naujajį dienų skaičiavimo susitarimą Actual365Fixed („A005“).

64 lent. Fiksuotoji norma. Pakeitimas

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

5.3.9.3 Kintamoji norma. Pirminis pranešimas

264. 65 lent. parodoma, kaip pildomi laukai, kai sandorio šalys sudarė VPĮFS pasirinkusios pagrindinę normą EONIA (25 laukas), kurios kintamosios normos bazinis laikotarpis

išreiškiamas dienomis (2.26 laukas) naudojant 1 dienos laikotarpio sveikąjį daugiklį (2.27 laukas).

265. Sandorio šalys taip pat susitarė dėl vienos savaitės laikotarpio, kalbant apie kintamosios normos mokėjimų dažnį (2.28 laukas), naudojant 1 savaitės laikotarpio sveikąjį daugiklį (2.29 laukas), aprašant, kaip dažnai sandorio šalys keičiasi mokėjimais.
266. Šiuo atveju kintamoji norma atnaujinama po tam tikro dienų skaičiaus laikotarpio (2.30 laukas) naudojant 1 dienos daugiklį (2.31 laukas).
267. Šiuo atveju bazinių punktų, kuriuos reikia pridėti (arba atimti, jeigu tai neigiama vertė, kuri gali būti įrašoma šiame lauke), skaičius kaip kintamosios palūkanų normos intervalas, siekiant nustatyti paskolos palūkanų normą, yra „5“ (2.32 laukas).

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

65 lent. Kintamoji norma. Pirminis pranešimas

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

5.3.9.4 Kintamosios normos koregavimo laukai

268. Apie kintamosios normos koregavimą reikėtų pranešti, kaip susitarė sandorio šalys. Gali būti įrašomos neigiamos vertės.

5.3.10 Atpirkimo sandorių ir BSB / SBB sandorių pagrindinės sumos

269. 73 lentelėje parodoma, kaip pildomi laukai, jeigu įskaitymo dieną pagrindinė suma yra 10 162 756,90 EUR, o termino suėjimo dieną pagrindinė suma yra 10 161 551,48 EUR.

270. Kai pagrindinės sumos vertė termino suėjimo dieną (2.38 laukas) dar nežinoma, pagal patvirtinimo taisykles šio lauko galima nepildyti. Vėliau, kai vertė tampa žinoma, lauką reikėtų atnaujinti.

271. Lyginamųjų rodiklių atveju tikėtiną pagrindinę sumą termino suėjimo dieną reikėtų nurodyti teikiant pranešimą ir jai keičiantis – atnaujinti.

66 lent. Atpirkimo sandorių ir BSB / SBB sandorių pagrindinės sumos

No	Field	Example	XML Message
37	Principal amount on the value date	10162756.90	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <PrncplAmt> <ValDtAmt Ccy="EUR">10162756.9</ValDtAmt> <MtrtyDtAmt Ccy="EUR">10161551.48</MtrtyDtAmt> </PrncplAmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </pre>
38	Principal amount on the maturity date	10161551.48	
39	Principal amount currency	EUR	

66 lent. Atpirkimo sandorių ir BSB / SBB sandorių pagrindinės sumos			
No	Field	Example	XML Message
			</SciesFincgRptgTxRpt>

5.3.11 Vertybinių popierių skolinimo paskolos pusė

272. VPSS atveju prekybos sandorio paskolos pusėje yra vertybinis popierius, kurį duomenis teikiančios sandorio šalys turėtų vertinti nuosekliai. Laukas „Vertybinių popierių arba biržos prekių kaina“ (2.49 laukas) turėtų būti pildomas valiuta, kuria nustatyta vertybinio popieriaus arba biržos prekių kaina. Ši valiuta turėtų būti nurodoma lauke „Kainos valiuta“ (2.50 laukas). Be to, į vertybinio popieriaus kainą nereikėtų įtraukti jokio garantinės įmokos nustatymo reikalavimo, diskonto, antkainio, papildomo mokesčio ir kt.; juos reikėtų įtraukti į įkaito rinkos vertę (2.88 laukas), net jeigu jie apskaičiuojami sandorio paskolos pusėje.
273. Kalbant apie 2.46 lauką „Kiekis arba nominali suma“, nominalią sumą reikėtų nurodyti tik dėl obligacijų. Nominalią sumą reikėtų nurodyti pirmine valiuta, nurodyta lauke „Nominalios sumos valiuta“ (2.48 laukas). Apie kitus vertybinius popierius reikėtų pranešti nurodant jų kiekį; tokiu atveju lauką „Matavimo vienetas“ (2.47 laukas) reikia užpildyti, o lauką „Nominalios sumos valiuta“ (2.48 laukas) palikti tuščią.
274. Paskolos vertė apskaičiuojama valiuta, kuri yra vertybinio popieriaus valiuta, pagal toliau pateiktą formulę, o ne valiuta, kuria dvi sandorio šalys sudarė sandorį. Tačiau rinkos vertė yra sandorio šalių paskolintų vertybinių popierių vertinimas. Šis vertinimas gali būti kita valiuta nei paskolinto vertybinio popieriaus valiuta. Taip pat žr. pavyzdį 5.2.1.8 skirsnyje.
275. Paskolos vertė apskaičiuojama taip:

Paskolos vertė (2.56 laukas) =

Kiekis arba nominali suma (2.46 laukas)

* *„Vertybinių popierių arba biržos prekių kaina“ (2.49 laukas)*

276. Gali būti atveju, kai paskolintų vertybinių popierių (arba kaip užtikrinimo priemonė naudojamų vertybinių popierių) vertinimas yra neįmanomas, nes nėra kainų informacijos. Tai pasakytina, pavyzdžiui, apie sustabdytas akcijas ar kai kuriuos fiksuotojo pajamingumo vertybinius popierius nelikvidžiuose rinkos segmentuose. Sudariusios VPĮFS, kuriame naudojami tokie vertybiniai popieriai, sandorio šalys turėtų pateikti vertinimą, kaip susitarta sutartyje. Jeigu gaunama nauja kainos informacija, abi sandorio šalys turėtų pateikti vertinimo atnaujinimus lauke „Rinkos vertė“ (2.57 laukas).

5.3.12 Vertybiniai popieriai

5.3.12.1 Vertybinių popierių / įkaito kokybė

277. Laukuose „Vertybinio popieriaus kokybė“ (2.51 laukas) ir „Užtikrinimo priemonės kokybė“ (2.90 laukas) duomenis teikiantys subjektai turėtų pateikti vieną iš Duomenų teikimo TĮS nurodytų verčių.

278. Vertę NOAP reikėtų naudoti dėl šių užtikrinimo priemonių rūšių (2.94 laukas): pagrindinio indekso akcijos (MEQU), kitos akcijos (OEQU) ir kitas turtas (OTHR), kurioms kredito reitingai netaikomi, kaip tai suprantama pagal Reglamentą (EB) Nr. 1060/2009 (KRAR)¹⁴. Vertę NOTR turėtų būti naudojama tik priemonėms, kurių reitingą galima nustatyti, bet kurios kredito reitingo neturi.
279. Norėdamos pranešti šią informaciją ir siekdamos išvengti, kad nebūtų akklai vadovaujamosi kredito reitingais, kaip numatyta KRA reglamento 5a straipsnyje, sandorio šalys turėtų remtis savo vidaus vertybinių popierių kokybės vertinimu, kurį gali sudaryti vienos ar kelių KRA išorės reitingai.
280. Pateikiama vertė turėtų kuo tiksliau perteikti vertybinio popieriaus charakteristikas. Kai pildant 2.51 lauką naudojamosi išorės reitingais kaip įvesties duomenimis, idealiu atveju sandorio šalys turėtų pagrįsti savo vertinimą ne emitento, o priemonės reitingu, jeigu jis yra. Konkretūs vertybinio popieriaus charakteristikas turėtų perteikti valiuta (vietos ar užsienio valiuta) ir terminas (trumpalaikis ar ilgalaikis).
281. Sandorio šalys turėtų teikti vertybinio popieriaus kokybės informaciją kuo nuosekliau, nes ji bus naudojama vykstant derinimui. Tačiau ESMA sužinojo apie galimus apribojimus, dėl kurių subjektai gali nesidalyti tokia informacija; tokiu atveju duomenis teikiančios sandorio šalys turėtų nurodyti vertę, geriausiai atitinkančią jų vidaus vertinimą.

5.3.12.2 Obligacijos

282. Obligacijų atveju kainą reikėtų nurodyti procentais, o ne dešimtaine vieneto trupmena.
283. 67 lent. parodoma, kaip pildomi laukai, kai VPĮFS susijęs su investicinį reitingą turinčiais vyriausybės vertybiniais popieriais, laikomais skolos priemone (obligacijomis), kurių nominali suma yra 100 000 000 EUR.
284. Šiame pavyzdyje vertybinius popierius išleido Vokietijos emitentas (2.53 laukas), identifikuojamas pagal jo LEI (2.54 laukas).
285. Vertybinio popieriaus kaina išreiškiama procentais: 99,5 proc. (2.49 laukas), valiuta – euro (2.50 laukas), o vertybinių popierių terminas sueina 2030 m. balandžio 22 d. (2.50 laukas).
286. VPĮFS paskolos vertė yra 99 500 000 EUR (2.56 laukas) ir skolininkas neturi išimtinės galimybės skolintis iš skolinio vertybinių popierių portfelio (2.68 laukas).

67 lent. Obligacijos			
No	Field	Example	XML Message
40	Type of asset	SECU	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData>
41	Security identifier	{ISIN}	
42	Classification of a security	{CFI}	

¹⁴ Pagal KRAR 3 straipsnį „kredito reitingas – nuomonė apie subjekto, skolos ar finansinio įsipareigojimo, skolos vertybinių popierių, privilegijuotųjų akcijų ar kitų finansinių priemonių arba tokios skolos ar finansinio įsipareigojimo, skolos vertybinių popierių, privilegijuotųjų akcijų ar kitų finansinių priemonių emitento kreditingumą, pateikta naudojant nustatytą ir apibrėžtą reitingo kategorijų vertinimo skalę“.

5.3.12.3 Pagrindinio indekso akcijos

287. 68 lent. parodoma, kaip pildomi laukai, kai VPĮFS susijęs su pagrindinį indeksą sudarančiomis akcijomis, t. y. pagrindinio indekso akcijomis (2.55 laukas), kurių skaičius yra 100 000 (2.46 laukas). 2.48 laukas netaikomas, nes 2.46 lauke nurodomas skaičius, o ne nominali suma.
288. Pranešdamos apie akcijas sandorio šalys turėtų nurodyti MEQU, jeigu jos tokiomis laikomos pagal Komisijos įgyvendinimo reglamentą 2016/1646.
289. Turto rūšis vėl yra vertybinis popierius (2.40 laukas), nurodomas kaip akcijos (2.42 laukas). Vertybinio popieriaus kokybė šios rūšies vertybiniams popieriams netaikoma (2.51 laukas).
290. Šiame pavyzdyje vertybinius popierius išleido Vokietijos emitentas (2.53 laukas), identifikuojamas pagal jo LEI (2.54 laukas).
291. Vertybinių popierių kaina išreiškiama vienetais; ji yra 9,95 EUR (2.49 laukas ir 2.50 laukas). Kadangi pagrindinė finansinė priemonė yra akcijos, vertybinių popierių termino suėjimo dienos nėra, tad 2.52 lauką reikėtų užpildyti, kaip numatyta ISO 8601, ir įrašyti „9999-12-31“.
292. VPĮFS paskolos vertė yra 995 000 EUR (2.56 laukas) ir skolininkas neturi išimtinės galimybės skolintis iš skolintojo vertybinių popierių portfelio (2.68 laukas).

68 lent. Pagrindinio indekso akcijos			
No	Field	Example	XML Message
40	Type of asset	SECU	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <SctiesLndg> <AsstTp> <Scty> <Id>DE0010877643</Id> </Scty> </AsstTp> </SctiesLndg> <ClssfctnTp>ESVUFN</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <Qty>100000</Qty> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">9.95</Amt> </MntryVal> </UnitPric> <Qlty>NOAP</Qlty> <Mtrty>9999-12-31</Mtrty> </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	

68 lent. Pagrindinio indekso akcijos			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> <Issr> <Id> <LEI> NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN </LEI> </Id> <Jurisdiction>DE</Jurisdiction> </Issr> <Tp> <Cd>MEQU</Cd> </Tp> <ExclsvArrgmt>false</ExclsvArrgmt> </Scty> </AsstTp> <LnVal Ccy="EUR">995000</LnVal> </SctiesLndg> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.3.12.4 Kiti vertybiniai popieriai be termino suėjimo dienos

293. 69 lent. parodoma, kaip pildomi laukai, kai VPĮFS susijęs su vertybiniais popieriais, kurie nėra įtraukti į sąrašą TJS I priedo 2.55 lauke. Šiuo atveju 2.55 lauke reikėtų nurodyti vertę „Kitas turtas“. Vertybinių popierių skaičius yra 100 000 (2.46 laukas). 2.48 laukas netaikomas, nes 2.46 lauke nurodomas skaičius, o ne nominali suma.
294. Turto rūšis vėl yra vertybinis popierius (2.40 laukas), nurodomas kaip ESVUFN (2.42 laukas). Vertybinio popieriaus kokybė šios rūšies vertybiniam popieriui netaikoma (2.51 laukas).
295. Šiame pavyzdyje vertybinius popierius išleido Prancūzijos emitentas (2.53 laukas), identifikuojamas pagal jo LEI (2.54 laukas)
296. Vertybinių popierių kaina išreiškiama vienetais; šiame pavyzdyje ji yra 99,5 EUR (2.49 laukas ir 2.50 laukas). Vertybinių popierių termino suėjimo dienos nėra, tad 2.52 lauką reikėtų užpildyti, kaip numatyta ISO 8601, ir įrašyti „9999-12-31“.
297. VPĮFS paskolos vertė yra 9 950 000 EUR (2.56 laukas) ir skolininkas neturi išimtinės galimybės skolintis iš skoliniojo vertybinių popierių portfelio (2.68 laukas).

69 lent. Kiti vertybiniai popieriai be termino suėjimo dienos

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

5.3.13 VPĮFS su biržos prekėmis. Biržos prekių skolinimas

298. 70 lent. parodoma, kaip pildomi laukai, kai VPĮFS susijęs su biržos prekėmis (2.40 laukas): energija yra bazinė prekė (2.43 laukas), nafta – prekės pakategorė (2.44 laukas), o Brent nafta – papildoma prekės pakategorė (2.45 laukas).

299. Šiame pavyzdyje 100 000 kiekis (2.46 laukas) matuojamas bareliais (47 laukas), o vieno BARL kaina yra 60 USD (49 laukas ir 50 laukas).

300. Paskolos vertė – 6 000 000 (56 laukas).

70 lent. VPĮFS su biržos prekėmis

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

70 lent. VPJFS su biržos prekėmis			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> <UnitPric> <MntryVal> <Amt Ccy="USD">60</Amt> </MntryVal> </UnitPric> </Cmmdty> </AsstTp> <LnVal Ccy="USD">6000000</LnVal> </SctiesLndg> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.3.14 VPSS su grynųjų pinigų grąžinimu

301. 71 lent. parodoma, kaip pildomi laukai, kai sandorio šalys susitaria dėl kintamosios grąžinamos normos, grindžiamos EONIA indeksu (2.59 laukas), kurios bazinis laikotarpis išreiškiamas dienomis (2.60 laukas) naudojant 1 dienos laikotarpio sveikąjį daugiklį (2.61 laukas).
302. Sandorio šalys taip pat susitaria dėl kintamosios grąžinamos palūkanų normos mokėjimų vienos savaitės dažnumu (2.62 laukas ir 2.63 laukas). Įsidėmėkite, kad abu laukai nėra privalomi sudarant sandorius, kuriems nėra nustatomas kintamosios grąžinamos palūkanų normos mokėjimų dažnis.
303. Kintamoji norma atnaujinama po tam tikro dienų skaičiaus laikotarpio (2.64 laukas) naudojant 1 dienos daugiklį (2.65 laukas)
304. Bazinių punktų, kuriuos reikia pridėti (arba atimti, jeigu tai neigiama vertė, kuri gali būti įrašoma šiame lauke), skaičius kaip kintamosios palūkanų normos intervalas, siekiant nustatyti paskolos palūkanų normą, yra „5“ (2.66 laukas).

71 lent. VPSS su grynujų pinigų gražinimu			
No	Field	Example	XML Message
58	Fixed rebate rate		<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData>
59	Floating rebate rate	EONA	<New> ...
60	Floating rebate rate reference period - time period	DAYS	<CtrPtyData> ...
61	Floating rebate rate reference period - multiplier	1	</CtrPtyData> <LnData>
62	Floating rebate rate payment frequency - time period	WEEK	...
63	Floating rebate rate payment frequency - multiplier	1	<RbtRate> <Fltg> <RefRate> <Indx>EONA</Indx> </RefRate>
64	Floating rebate rate reset frequency - time period	DAYS	<Term> <Unit>DAYS</Unit> <Val>1</Val>
65	Floating rebate rate reset frequency - multiplier	1	</Term> <PmtFrqcy> <Unit>WEEK</Unit> <Val>1</Val>
66	Spread of the rebate rate	5	</PmtFrqcy> <RstFrqcy> <Unit>DAYS</Unit> <Val>1</Val> </RstFrqcy> <BsisPtSprd>5</BsisPtSprd> </Fltg> </RbtRate> </SctiesLndg> </TxLnData> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </TradData> ... </SctiesFincgRptgTxRpt>

5.3.15 VPSS su mokesčiu: VPSS su nepiniginiu įkaitu, VPSS su lėšų sujungimu ir neužtikrintas VPSS

305. VPSS su mokesčiu gali būti trijų rūšių VPSS: VPSS su nepiniginiu įkaitu, VPSS su lėšų sujungimu ir neužtikrintas VPSS. Visų trijų rūšių atveju vadovaujamesi ta pačia duomenų teikimo logika.
306. 72 lent. nurodoma vertė, kurią sandorio šalys įrašo 67 lauke „Skolinimo mokestis“, kai sudaro VPSS su nepiniginiu įkaitu, VPSS lėšų sujungimu ar neužtikrintą VPSS (VPSS be gražinimo). Šiuo atveju skolinimo mokestis sudaro 1,23456 proc.; laukas užpildomas nenurodant procentų ženklo, naudojamo tik XML žymose.

72 lent. Nepigininis įkaitas			
No	Field	Example	XML Message
67	Lending fee	1.23456	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <SctiesLndg> <LndgFee>1.23456</LndgFee> </SctiesLndg> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.3.16 Garantinės įmokos paskolos suma ir trumposios pozicijos rinkos vertė

307. Bendra negražintos garantinės įmokos paskolos suma (2.69 laukas) turėtų būti nurodoma kaip 0 (kai klientas turi bendrą grynujų paskolą / ilgąją pinigų srauto poziciją) arba kaip teigiama vertė (kai klientas turi bendrą grynujų debetą / trumpąją pinigų srauto poziciją bazine valiuta). Bazinę valiutą reikėtų nurodyti visais atvejais, kaip nustatyta pagrindinio maklerio ir jo kliento dvišaliame susitarime.
308. Bendra garantinės įmokos paskolos vertė apskaičiuojama remiantis pavienėmis garantinės įmokos paskolos sudedamosiomis dalimis pagal valiutą (2.33 ir 2.34 laukai). Šiuos laukus reikėtų užpildyti tiek kartų, kiek reikia, kad būtų nurodytos visos sąskaitoje naudojamos valiutos. Taip valdžios institucijos galės stebėti kliento grynujų pinigų debetą (t. y. garantinės įmokos paskolas) įvairiomis valiutomis palyginti tik su grynuoju debetu bazine valiuta ir grynujų paskolą įvairiomis valiutomis, naudojamą kaip užtikrinimo

priemonė. Atsižvelgiant į bendrą garantinės įmokos skolinimo sumą, grynąjį kliento debetą tam tikra valiuta reikėtų nurodyti kaip teigiamą vertę kartu nurodant valiutą, o grynąją kliento paskolą reikėtų nurodyti kaip neigiamą vertę.

309. Trumposios pozicijos rinkos vertę visuomet reikėtų nurodyti kaip vertę, išreikštą garantinės įmokos paskolos bazine valiuta, kaip nustatyta dvišaliame susitarime (2.70 laukas). Dėl kiekvieno UTI reikėtų nurodyti vieną pinigų sumą, tad trumposios pozicijos rinkos vertę reikėtų nurodyti kaip grynąją vertę dienos pabaigoje. Kalbant apie negražintą garantinės įmokos paskolą, grynąją grynųjų paskolą, naudojamą trumposios pozicijos rinkos vertei užtikrinti, reikėtų nurodyti kaip neigiamą vertę (2.33 laukas) kartu nurodant jos valiutą (2.34 laukas).
310. Kai garantinės įmokos paskolos suma yra 0, t. y. kai klientas turi grynąją grynųjų paskolą bazine valiuta, ir trumposios pozicijos rinkos vertė taip pat yra 0, 2.33, 2.69 ir 2.71 laukuose taip pat reikėtų įrašyti 0. Apie nulįnį įkaito atnaujinimą taip pat reikėtų pranešti, kaip paaiškinta 5.4.4 skirsnyje.

5.3.16.1 Teigiami ir neigiami likučiai kai kuriomis valiutomis ir grynasis debetas bazine valiuta

311. 73 lent. parodoma, kaip pildomi laukai grynojo debeto bazine valiuta atveju; šiame konkrečiame pavyzdyje kreditas yra išreikštas USD, o debetas – GBP ir EUR. Dėl paprastumo šiame pavyzdyje USD ir EUR bei GBP ir EUR valiutos kursai laikomi lygiais 1.

73 lent. Teigiami ir neigiami likučiai kai kuriomis valiutomis ir debetas bazine valiuta			
No	Field	Example	XML Message
33	Margin lending currency amount	-100000	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <MrgnLndg> <OutsdngMrgnLnAmt Ccy="EUR">150000</OutsdngMrgnLnAmt> <ShrtMktValAmt Ccy="EUR">0</ShrtMktValAmt> <MrgnLnAttr> <Amt> <Amt Ccy="USD">- 100000</Amt> <Amt Ccy="GBP">50000</Amt> <Amt Ccy="EUR">100000</Amt> </Amt> </MrgnLnAttr> </pre>
34	Margin lending currency	USD	
33	Margin lending currency amount	50000	
34	Margin lending currency	GBP	
33	Margin lending currency amount	150000	
34	Margin lending currency	EUR	
69	Outstanding margin loan	100000	
70	Base currency of outstanding margin loan	EUR	
71	Short market value	0	

73 lent. Teigiami ir neigiami likučiai kai kuriomis valiutomis ir debetas bazine valiuta			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> </MrgnLndg> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.3.16.2 Grynasis kreditas bazine valiuta ir trumposios pozicijos rinkos vertė

312. 74 lent. parodoma, kaip pildomi laukai gryniosios grynųjų paskolos bazine valiuta (GBP) atveju, tad negražinta garantinės įmokos paskola nurodoma kaip 0 ir klientas naudoja grynųjų paskolą ne bazine valiuta (USD) kaip užtikrinimo priemonę siekdamas iš dalies padengti trumposios pozicijos rinkos vertę.

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

74 lent. Kreditas bazine valiuta ir teigiama trumposios pozicijos rinkos vertė			
No	Field	Example	XML Message
			<pre></TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt></pre>

5.3.16.3 Grynas kreditas bazine valiuta nesant trumposios pozicijos rinkos vertės

313. 75 lent. parodoma, kaip pildomi laukai grynujų paskolos bazine valiuta (EUR) atveju nesant trumposios pozicijos rinkos vertės. Kadangi nėra negrąžintos garantinės įmokos paskolos arba trumposios pozicijos rinkos vertės, apie grynujų paskolą pranešti nereikia (nes ji nėra naudojama kaip garantinės įmokos paskolos ar trumposios pozicijos rinkos vertės užtikrinimo priemonė). Vis dėlto pranešimą reikia pateikti siekiant informuoti valdžios institucijas apie nulinį likutį. Reikėtų nurodyti bazinę valiutą, dėl kurios pirma susitarta pirminėje sutartyje.

75 lent. Kreditas bazine valiuta nesant trumposios pozicijos rinkos vertės			
No	Field	Example	XML Message
33	Margin lending currency amount	0	<pre><SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <MrgnLndg> <OutsdngMrgnLnAmt Ccy="EUR">0</OutsdngMrgnLnAmt> <ShrtMktValAmt Ccy="EUR">0</ShrtMktValAmt> <MrgnLnAttr> <Amt> <Amt Ccy="USD">0</Amt> </Amt> </MrgnLnAttr> </MrgnLndg> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt></pre>
34	Margin lending currency	USD	
69	Outstanding margin loan	0	
70	Base currency of outstanding margin loan	EUR	
71	Short market value	0	

5.4 Užtikrinimo priemonės duomenys

314. Toliau esančiuose skirsniuose paaiškinama, kaip pildyti tam tikrus laukus, susijusius su konkrečiomis VPĮFS įkaito charakteristikomis. Taip duomenis teikiančios sandorio šalys galėtų tiesiogiai įvertinti informaciją, kurią turėtų teikti dėl kiekvieno konkretaus duomenų skirsnio, kai taikytina.
315. Patvirtinimo taisyklėse pateikiamos išsamios rekomendacijos dėl taikytinų laukų pagal VPĮFS rūšį, veiksmo rūšį ir atitinkamus priklausomybės ryšius.

5.4.1 VPSS užtikrinimo duomenų teikimas

316. Priklausomai nuo to, ar VPSS yra užtikrintas ar neužtikrintas, sandorio šalys turėtų teikti šią informaciją 2.72 lauke „Neužtikrinto vertybinių popierių skolinimo (VPS) žyma“.

5.4.1.1 Neužtikrintas VPSS

317. 2.72 lauke „Neužtikrinto vertybinių popierių skolinimo (VPS) žyma“ sandorio šalys turėtų nurodyti „true“ („taip“), kai vertybinių popierių skolinimas nėra užtikrintas, bet vis tiek vyksta kaip VPSS sandoris.

5.4.1.2 Užtikrintas VPSS

318. Lauke „Neužtikrinto vertybinių popierių skolinimo (VPS) žyma“ (2.72 laukas) sandorio šalys turėtų nurodyti „false“ („ne“), kai VPSS sandoris yra užtikrintas arba kai sandorio šalys susitaria užtikrinti prekybos sandorį, bet dar nežinoma, kaip bus paskirstytas įkaitas.

5.4.2 Užtikrinimas

319. Kai teikiant duomenis užtikrinimo priemonių krepšelis nėra žinomas, 2.96 lauke reikėtų nurodyti NTAV. Tas pats pasakytina apie atpirkimo sandorius, vykdomus BUP platformose. Tokiu atveju sandorio šalys turėtų atnaujinti informaciją apie užtikrinimo priemonių krepšelio nustatymą, kai tik ją turės, taip pat atnaujinti informaciją apie įkaito komponentus ne vėliau nei kitą darbo dieną po įskaitymo datos.
320. Kai užtikrinama nesinaudojant užtikrinimo priemonių krepšeliu, ESMA tikisi, kad sandorio šalys praneš apie atitinkamus įkaito elementus.

5.4.2.1 Vienas sandoris su užtikrinimo priemonių krepšeliu

321. 76 lent. parodoma, kaip pildomi laukai, kai dviem atskirais VPĮFS prekiaujama naudojant užtikrinimo priemonių krepšelį (2.96 laukas), identifikuojamą pagal ISIN kodą GB00BH4HKS39. Naudojant užtikrinimo priemonių krepšelį gali būti prekiaujama keliais VPĮFS neužtikrinant jų gryniosios pozicijos pagrindu. VPĮFS užtikrinami sandorio lygmeniu (2.73 lauke nurodoma FALSE).

76 lent. Vienas sandoris su užtikrinimo priemonių krepšeliu			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>1234567890123450000</LEI> </Id> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UT1</UnqTradldr> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <NetXpsrCollstnInd>>false</NetXpsrCollstnInd> <Bsktldr> <Id>GB00BH4HKS39</Id> </Bsktldr> </RpTrad> </CollData> ... </New> </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.9	Counterparty side	GIVE	
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UT1	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	FALSE	
96	Collateral basket identifier	{ISIN}	
98	Action type	NEWT	
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.9	Counterparty side	GIVE	
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UT12	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	FALSE	
96	Collateral basket identifier	{ISIN}	
98	Action type	NEWT	

76 lent. Vienas sandoris su užtikrinimo priemonių krepšeliu

No	Field	Example	XML Message
			<pre> </Rpt> <Rpt> <New> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>1234567890123450000</LEI> </Id> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UT12</UnqTradldr> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <NetXpsrCollstnInd>>false</NetXpsrCollstnInd> <Bsktldr> <Id>GB00BH4HKS39</Id> </Bsktldr> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> </pre>

76 lent. Vienas sandoris su užtikrinimo priemonių krepšeliu

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

5.4.2.2 Vienas sandoris nustatant krepšelį, kuris teikiant duomenis buvo nežinomas

322. 77 lent. parodoma, kaip pildomi laukai, kai sudaromas vienas sandoris, užtikrinamas naudojant užtikrinimo priemonių krepšelį, tais atvejais, kai duomenų teikimo metu tas krepšelis dar nebuvo nustatytas (2.96 lauke įrašoma NTAV).

323. VPĮFS užtikrinamas vieno sandorio lygmeniu (2.73 laukas). VPĮFS užtikrinamas sandorio lygmeniu (2.73 lauke nurodoma FALSE).

77 lent. Vienas sandoris, kai duomenų teikimo metu krepšelis nežinomas

No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre><SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>1234567890123450000</LEI> </Id> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id></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	NTAV	
98	Action type	NEWT	
			<pre><LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp></pre>

77 lent. Vienas sandoris, kai duomenų teikimo metu krepšelis nežinomas

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

5.4.2.3 Užtikrinimas grynosios pozicijos pagrindu naudojant krepšelį

324. 78 lent. parodoma, kaip pildomi laukai, kai yra du sandoriai, užtikrinami naudojant užtikrinimo priemonių krepšelį (2.96 laukas) grynosios pozicijos pagrindu (2.73 lauke nurodoma TRUE), identifikuojant pagal ISIN kodą GB00BH4HKS39. Šis pavyzdys nereiškia, kad visi BUP sandoriai sudaromi grynosios pozicijos pagrindu. Sandorio šalys turėtų pranešti apie VPĮFS, kai jie sudaromi.

325. Reikėtų pažymėti, kad VPĮFS užtikrinant grynosios pozicijos pagrindu naudojant krepšelį, į COLU pranešimus reikėtų įtraukti pavienius užtikrinimo priemonių komponentus. Krepšelio ISIN kodas pateikiamas tik kol bus apsispręsta dėl vertybinių popierių paskirstymo. Apie užtikrinimo priemonių komponentus reikėtų pranešti pateikiant duomenis apie jų būklę dienos pabaigoje.

78 lent. Grynosios pozicijos pagrindu naudojant krepšelį

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

78 lent. Gryniosios pozicijos pagrindu naudojant krepšelį

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI1	</Id> <Sd>GIVE</Sd>
3	Event date	24/04/2020	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id>
96	Collateral basket identifier	{ISIN}	</OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr>
98	Action type	NEWT	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	</OthrPtyData> </CtrPtyData>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	</CtrPtyData> <LnData> <RpTrad>
1.9	Counterparty side	GIVE	<UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender	<EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI2	</Tp> </MstrAgrmt>
3	Event date	24/04/2020	</RpTrad>
9	Master agreement	GMRA	</LnData> <CollData>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<RpTrad>
96	Collateral basket identifier	{ISIN}	<NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd>
98	Action type	NEWT	<Bsktldr> <Id>GB00BH4HKS39</Id> </Bsktldr> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> <Rpt> <New> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id>

78 lent. Gynosios pozicijos pagrindu naudojant krepšelį

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

5.4.2.4 Užtikrinimas grynosios pozicijos pagrindu nustatant krepšelį, kuris teikiant duomenis buvo nežinomas

326. 79 lent. parodoma, kaip pildomi laukai, kai sandoris nėra užtikrinamas naudojant užtikrinimo priemonių krepšelį (2.96 lauke įrašoma NTAV) grynosios pozicijos pagrindu (2.73 lauke įrašoma TRUE).

327. Sandoris užtikrinamas grynosios pozicijos pagrindu (2.73 laukas).

79 lent. Grynosios pozicijos pagrindu, kai duomenų teikimo metu krepšelis nežinomas			
No	Field	Example	XML Message
73	Collateralisation of net exposure	true	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> <RpTrad> ... </RpTrad> </CollData> </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
96	Collateral basket identifier	NTAV	
98	Action type	NEWT	

5.4.3 Piniginis įkaitas

328. 80 lent. parodoma, kaip pildomi laukai grynujų pinigų gražinimo ir lėšų sujungimo atvejais sudarant VPSS sandorį. Šiame pavyzdyje sandoris užtikrinamas 1 000 000 EUR piniginiu įkaitu (2.76 laukas ir 2.77 laukas). Šiuo atveju duomenų teikimo scenarijus yra toks pat, kaip veiksmų rūšių NEWT ir COLU atveju.

80 lent. Piniginis įkaitas			
No	Field	Example	XML Message
76	Cash collateral amount	1000000	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> </pre>

80 lent. Piniginis įkaitas			
No	Field	Example	XML Message
77	Cash collateral currency	EUR	<pre> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Csh> <Amt Ccy="EUR">1000000</Amt> </Csh> </AsstTp> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.4.4 Nulinio įkaito duomenų teikimas

329. Siekiant supaprastinti duomenų teikimą, kai įkaitas yra 0, apie įkaitą visuomet reikėtų pranešti kaip apie piniginį įkaitą, nurodant, kad piniginio įkaito suma lygi 0, o užtikrinimo priemonės komponento rūšis yra CASH, neatsižvelgiant į tai, ar įkaito, kuris buvo anksčiau naudojamas tam VPĮFS, rūšis buvo vertybiniai popieriai, biržos prekės ar gryniesi pinigai.
330. 81 lent. parodoma, kaip pildomi laukai, kai įkaitas yra 0, o užtikrinimo priemonės komponento rūšis yra vertybiniai popieriai, biržos prekės (tik atpirkimo ir BSB / SBB sandorių atveju) arba gryniesi pinigai.

81 lent. Nulinio įkaito duomenų teikimas vertybinių popierių, biržos prekių ir grynųjų pinigų atveju			
No	Field	Example	XML Message
75	Type of collateral component	CASH	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> </pre>
76	Cash collateral amount	0	
77	Cash collateral currency	EUR	

81 lent. Nulinio įkaito duomenų teikimas vertybinių popierių, biržos prekių ir grynųjų pinigų atveju

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

5.4.5 Vertybinių popierių įkaito laukai

331. Kalbant apie vertybinius popierius, kurių duomenų nėra, duomenis privaloma pateikti iki įskaitymo datos + 1 diena. Dėl su atsiskaitymu susijusių problemų žr. šių gairių 5.4.8 skirsnį. Dėl užtikrinimo priemonių krepšelių, kai duomenys teikiami tik vieną kartą, žr. šių gairių 5.4.2 skirsnį.

5.4.5.1 Vertės sumažinimas

332. Sandorio šalys turėtų teikti įkaito duomenis laikydamosi Duomenų teikimo TRS priedo 2 lentelės.

333. Užtikrinimo priemonės rinkos vertę (2.88 laukas) reikėtų nurodyti tikrąja verte atskaičius vertės sumažinimą. Kitaip tariant, į užtikrinimo priemonės rinkos vertę reikėtų įtraukti *visą* įkaito davėjo suteiktą įkaitą, įskaitant paskirtą, bet dar neapmokėtą įkaitą, prieš atskaitant vertės sumažinimą.

334. Visų rūšių VPĮFS atveju vertės sumažinimą arba garantinę įmoką (2.89 laukas) reikėtų nurodyti ISIN lygmeniu kaip procentinę dalį. Atpirkimo sandorių atveju dėl vertės sumažinimo susitariama sutartyje; ji turėtų būti nustatyta visai VPĮFS trukmei, nebent sandorio šalys susiderėtų dėl vertės sumažinimo iš naujo. Vertės sumažinimas apskaičiuojamas kaip 1 atėmus grynųjų pinigų ir įkaito vertės skirtumą, padauginus iš 100. Pavyzdžiui, sudarant atpirkimo sandorį, kai grynųjų pinigų vertė yra 100, o įkaito – 105, vertės sumažinimas yra $100 * [1 - (100 / 105)] = 4,7619$; reikėtų nurodyti „4,7619“. Portfelio lygmens atpirkimo sandorio vertės sumažinimo atveju (t. y. kai sandorio šalims susitarus visam atpirkimo sandorių užtikrinimo priemonių portfeliui taikomas vienodas vertės sumažinimas) taikomi tokie pat principai. Kaip nurodyta Duomenų teikimo TRS, apie portfelio lygmens vertės sumažinimą taip pat reikėtų pranešti ISIN lygmeniu, t. y. tuos duomenis reikėtų pakartoti dėl kiekvieno portfelyje esančio ISIN kodo (ir grynųjų pinigų, jeigu jie taip pat įtraukti į portfelį):

335. VPSS atveju lauke „Vertės sumažinimas arba garantinė įmoka“ (2.89 laukas) reikėtų nurodyti tik vertės sumažinimą, kuris taikomas įkaito pusei. O garantinės įmokos reikalavimai nustatomi pagal užtikrinimo priemonės rinkos vertę (2.88 laukas) ir piniginio įkaito sumą (2.76 laukas). Taigi užtikrinimo priemonės rinkos vertę ir piniginio įkaito sumą taip pat reikėtų atnaujinti atsižvelgiant į įvairius papildymus (kaip antai paskolos antkainius), pradedamus taikyti vykdant sandorį.
336. 82 lent. parodomi įkaito duomenys, susiję su VPSS sandoriu, kurio metu 100 000 EUR vertės vertybinius popierius skolinamasi pateikiant 100 000 EUR piniginį įkaitą (2.76 laukas ir 2.77 laukas), t. y. vertė nesumažinama, vadinasi, vertės sumažinimą reikėtų nurodyti kaip 0 (2.89 laukas).

82 lent. Piniginis įkaitas be vertės sumažinimo			
No	Field	Example	XML Message
76	Cash collateral amount	100000	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Csh> <Amt Ccy="EUR">100000</Amt> </Csh> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
77	Cash collateral currency	EUR	
89	Haircut or margin	0	

337. 83 lent. parodomas 100 000 EUR vertės paskolintas vertybinis popierius, užtikrintas 105 000 USD piniginiu įkaitu (2.76 laukas ir 2.77 laukas), tad garantinė įmoka paskolos pusėje yra 105 proc.

83 lent. Piniginis įkaitas užsienio valiuta su garantine įmoka			
No	Field	Example	XML Message
76	Cash collateral amount	105000	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Csh> <Amt Ccy="USD">105000</Amt> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> </Csh> </AsstTp> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>
77	Cash collateral currency	USD	
89	Haircut or margin	0	

338. Mišraus įkaito pavyzdyje (84 lent.) 100 000 EUR vertės paskolinti vertybiniai popieriai užtikrinami 55 000 EUR piniginiu įkaitu (2.76 laukas) ir 60 000 EUR nepiniginiu įkaitu (2.88 laukas). Įtraukiamas ir garantinės įmokos reikalavimas (nenurodytas) paskolos pusėje, taikomas ir piniginiam, ir nepiniginiam įkaitui, ir vertybinių popierių, naudojamų kaip užtikrinimo priemonė, vertė sumažinama 5 proc. 2.89 lauke dėl piniginio įkaito įrašomas 0, o dėl vertybinių popierių, naudojamų kaip užtikrinimo priemonė, – 5.

84 lent. Mišrus įkaitas su vertės sumažinimu ir garantine įmoka			
No	Field	Example	XML Message
76	Cash collateral amount	55000	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> ...
77	Cash collateral currency	EUR	
89	Haircut or margin	0	
88	Collateral market value	60000	
89	Haircut or margin	5	

84 lent. Mišrus įkaitas su vertės sumažinimu ir garantine įmoka

No	Field	Example	XML Message
			<pre> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <MktVal Ccy="EUR">60000</MktVal> </Scty> </RpTrad> </CollData> <HrcutOrMrgn>5</HrcutOrMrgn> <Csh> <Amt Ccy="EUR">55000</Amt> </Csh> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> </AsstTp> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

339. Apie neigiamą vertės sumažinimą galima pranešti, jeigu įkaito vertė yra mažesnė nei paskolos vertė. Vertės sumažinimo ženklas neturėtų kisti priklausomai nuo sandorio šalies pobūdžio.
340. 85 lent. parodomas atpirkimo sandoris, užtikrinamas vertybinių popierių krepšeliu (šį kartą be grynųjų pinigų) ir portfelio lygmens vertės sumažinimas taikomas visiems įkeistiems vertybiniams popieriams. Tas pats vertės sumažinimas turėtų būti nurodomas dėl kiekvieno užtikrinimo priemonės komponento portfelyje (įskaitant grynuosius pinigus, jeigu jie įtraukti į portfelį). 150 000 EUR vertės paskola užtikrinama dviem vertybiniais popieriais, 110 000 EUR – A vertybiniu popieriumi ir 50 000 EUR – B vertybiniu popieriumi. Suminė pateikto įkaito rinkos vertė yra 160 000 EUR, t. y. portfelio lygmens vertės sumažinimas yra toks: $100 * [1 - (150 / 160)] = 6,25 \%$. Tai vertė, kurią reikėtų nurodyti 2.89 lauke dėl kiekvieno ISIN kodo. Panašiai, pateikiant užtikrinimą grynosios pozicijos pagrindu (2.73 laukas), tą patį vertės sumažinimą reikėtų nurodyti dėl kiekvieno atskiro vertybinio popieriaus.

85 lent. Užtikrinimo priemonių portfelis su portfelio lygmens vertės sumažinimu

No	Field	Example	XML Message
88	Collateral market value	110000	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> </pre>
89	Haircut or margin	6.25	

85 lent. Užtikrinimo priemonių portfelis su portfelio lygmens vertės sumažinimu			
No	Field	Example	XML Message
88	Collateral market value	50000	<pre> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <MktVal Ccy="EUR">110000</MktVal> </pre>
89	Haircut or margin	6.25	<pre> <HrcutOrMrgn>6.25</HrcutOrMrgn> </Scty> <Scty> <MktVal Ccy="EUR">50000</MktVal> <HrcutOrMrgn>6.25</HrcutOrMrgn> </Scty> </AsstTp> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

341. Garantinės įmokos skolinimo atveju, kai vertės sumažinimas arba garantinės įmokos reikalavimas taikomas visam užtikrinimo priemonių portfeliui, 2.89 lauke nurodytą vertę reikėtų pakartoti dėl visų ISIN kodų ir grynųjų pinigų elementų. Priešingu atveju, jeigu vertės sumažinimas taikomas kiekvienam vertybiniam popieriui atskirai, reikėtų teikti duomenis apie vertės sumažinimą ar garantinę įmoką konkrečiam ISIN kodui (toku pat formatu, kaip kitų VPĮFS atveju, t. y. procentais).

5.4.5.2 Užtikrinimo priemonės rūšis

342. Sandorio šalys turėtų nurodyti užtikrinimo priemonės rūšį (2.94 laukas) pasirinkdamos vieną iš šių verčių:

- a. GOVS – vyriausybės vertybiniai popieriai;
- b. SUNS – viršvalstybinių emitentų ir agentūrų išleisti vertybiniai popieriai;

- c. FIDE – bankų ir kitų finansų įstaigų išleisti skolos vertybiniai popieriai (įskaitant padengtas obligacijas);
 - d. NFIDE – ne finansų įstaigų išleisti įmonių skolos vertybiniai popieriai (įskaitant padengtas obligacijas);
 - e. SEPR – vertybiniais popieriais pakeisti produktai (įskaitant ABS, CDO, CMBS, RMBS, ABCP);
 - f. MEQU – pagrindinio indekso akcijos (įskaitant konvertuojamas obligacijas);
 - g. OEQU – kitos akcijos (įskaitant konvertuojamas obligacijas);
 - h. OTHR – kitas turtas (įskaitant savitarpio fondų akcijas).
343. Kitų vertybinių popierių atveju sandorio šalys gali remtis kitais oficialiais šaltiniais, kad neatitikimų ir derinimo problemų pavojus būtų kuo mažesnis. Kalbant apie vyriausybės vertybinių popierių apibrėžtį, duomenis teikiantys subjektai turėtų remtis FST standartų dėl VPĮFS duomenų rinkimo 19 išnaša ir taikyti susitarime „Bazelis III“ įtvirtintą standartizuotą metodą. Jeigu vienai iš sandorio šalių susitarimo „Bazelis III“ reikalavimai netaikomi, sandorio šalys turėtų susitarti, kokią vertę įrašyti į šį lauką.
344. Lauko „Pagrindinio indekso akcijos“ ir lauko „Kitos akcijos“ skirtumas suderinamas su FST standartais. Tačiau FST nariai patys sprendžia, kurie indeksai turėtų būti laikomi pagrindiniais, jeigu jie yra apibrėžti atsižvelgiant į bendrojo FST ir BBPK susitarimo dėl vertės sumažinimo sudarant VPĮFS, kuriems netaikoma pagrindinės sandorio šalies tarpuskaity, įgyvendinimą.
345. ESMA TĮS dėl pagrindinių indeksų ir pripažintų biržų pagal Kapitalo reikalavimų reglamentą (KRR)¹⁵ pateikiamas pagrindinių indeksų sąrašas (I priedo 1 ir 2 lentelės). Į sąrašą įtraukti akcijų ir konvertuojamųjų obligacijų indeksai, susiję su turtu ES viduje ir už jos ribų. Šis sąrašas turėtų būti naudojamas kaip orientyras akcijas ir konvertuojamas obligacijas priskiriant prie pagrindinio indekso arba kitų.

5.4.5.3 Užtikrinimo priemonės pakartotinio naudojimo galimybė

346. Sandorio šalys turėtų pildyti šį lauką atsižvelgdamos tik į sutartyje įtvirtintą galimybę pakartotinai naudoti įkaitą. Kai lauke „Užtikrinimo priemonės pateikimo būdas“ (2.20 laukas) nurodoma TTCA ar SIUR, lauke „Užtikrinimo priemonės pakartotinio naudojimo galimybė“ (2.95 laukas) visuomet reikėtų įrašyti TRUE. Į veiklos apribojimus ar reglamentavimo reikalavimus, dėl kurių pakartotinis naudojimas gali būti neįmanomas, šiuo atveju atsižvelgti nereikėtų. Sutartinė pakartotinio naudojimo galimybė turėtų būti įtvirtinta pagrindiniame susitarime, kuriame apibūdinama sudarant VPĮFS naudojamos įkaito sutarties rūšis.
347. Pavyzdžiui, pagrindinė sandorio šalis, TTCA atveju perduodanti VPĮFS įkaitą iš vieno TN kitam, turėtų pranešti, kad įkaitą galima naudoti pakartotinai, net jeigu tai neįmanoma pagal pagrindinės sandorio šalies tarpuskaity sąlygas. Tas pats pasakytina apie KIPVPS: gautą nepiniginį įkaitą, kurį galima naudoti pakartotinai, reikėtų taip ir nurodyti, net jeigu

¹⁵ 2016 m. rugsėjo 13 d. Komisijos įgyvendinimo reglamentas (ES) 2016/1646.

pagal ESMA parengtas ETF ir kitų KIPVPS klausimų sprendimo gaires jo neleidžiama naudoti pakartotinai.

348. Galiausiai įsidėmėkite, kad pildant lauką „Užtikrinimo priemonės pakartotinio naudojimo galimybė“ neatsižvelgiama į tai, ar įkaitas buvo ar bus pakartotinai naudojamas. Tik kai įkaitas panaudojamas pakartotinai (įskaitant pagal VPSS sutartį pasiskolintų vertybinių popierių naudojimą), reikėtų papildomai pateikti pakartotinio naudojimo pranešimą (žr. 5.6.1 skirsnį).

5.4.5.4 Įprastos obligacijos

349. 86 lent. parodoma, kaip pranešama apie įprastas obligacijas, naudojamas kaip įkaitas 2020 m. balandžio 24 d.
350. Šiuo atveju 102 000 000 EUR vertės Vokietijos vyriausybės skolos vertybiniai popieriai, identifikuojami pagal ISIN kodą DE0010877643 ir nurodomi kaip DBFTFR, kurių vertės sumažinimas yra 2 proc., o terminas sueina 2030 m. balandžio 22 d., buvo panaudoti kaip užtikrinimo priemonė sudarant atpirkimo sandorį. Vertybiniai popieriai yra žinomi ir jų duomenys pateikiami laikantis duomenų teikimo tvarkaraščio kartu su kita paskolos pusės informacija. Vertybinių popierių kokybė – investicinį reitingą turintys vertybiniai popieriai (INVG), o įkaitą galima naudoti pakartotinai. Lentelėje dėmesys sutelkiamas tik į laukus, kurie yra svarbūs teikiant įkaito duomenis.
351. Įkaito nominalios sumos ar kiekio valiutos galima nenurodyti, bet ją reikėtų nurodyti, jeigu nurodoma nominali suma. Kai nurodomas kiekis (pvz., akcijos), šio lauko pildyti nereikėtų.
352. Kalbant apie įkaito įskaitymo datą, šis laukas taikomas tik VPSS sandoriams, kai įkaitas apmokamas iš anksto.
353. Vieneto kainos (2.87 laukas) apibrėžtyje nurodyta, kad į vertę, apie kurią pranešama, reikėtų įtraukti sukauptas palūkanas už palūkaninius vertybinius popierius, t. y. „purviną kainą“.

86 lent. Įprastos obligacijos			
No	Field	Example	XML Message
3	Event date	2020-04-24	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> </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		

86 lent. Įprastos obligacijos			
No	Field	Example	XML Message
87	Price per unit	102	<Scty> <Id>DE0010877643</Id>
88	Collateral market value	102000000	<ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp>
89	Haircut or margin	2	<NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">100000000</Amt>
90	Collateral quality	INVG	</NmnlVal> </QtyOrNmnlVal>
91	Maturity date of the security	2030-04-22	<UnitPric> <Ptrg>102</Ptrg>
92	Jurisdiction of the issuer	DE	</UnitPric> <MktVal
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	Ccy="EUR">102000000</MktVal>
94	Collateral type	GOVS	<HrcutOrMrgn>2</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty>
95	Availability for collateral reuse	true	<Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id>
98	Action type	NEWT	<LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN </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 Nuolatinės obligacijos

354. 87 lent. parodoma, kaip pranešama apie 102 000 000 EUR vertės Ispanijos vyriausybės nuolatinės obligacijos, naudojamas kaip užtikrinimo priemonė. Taikomas 2 proc. vertės sumažinimas. Vertybiniai popieriai yra žinomi ir jų duomenys pateikiami laikantis duomenų teikimo tvarkaraščio kartu su kita paskolos pusės informacija. Vertybinių popierių kokybė –

investicinį reitingą turintys vertybiniai popieriai (INVG), o įkaitą galima naudoti pakartotinai. Lentelėje dėmesys sutelkiamas tik į laukus, kurie yra svarbūs teikiant įkaito duomenis.

355. Įkaito nominalios sumos ar kiekio valiutos galima nenurodyti, bet ją reikėtų nurodyti, jeigu nurodoma nominali suma. Kai nurodomas kiekis (pvz., akcijos), šio lauko pildyti nereikėtų.
356. Kalbant apie įkaito įskaitymo datą, šis laukas taikomas tik VPSS sandoriams, kai įkaitas apmokamas iš anksto.
357. Vieneto kainos (2.87 laukas) apibrėžtyje nurodyta, kad į vertę, apie kurią pranešama, reikėtų įtraukti sukauptas palūkanas už palūkaninius vertybinius popierius, t. y. „purviną kainą“.

87 lent. Nuolatinės obligacijos			
No	Field	Example	XML Message
3	Event date	2020-04-24	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <Id>ES0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTPR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">100000000</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>102</Ptrg> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">102000000</MktVal> <HrcutOrMrgn>2</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>9999-12-31</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>EEEEEEEEEEEEEEEEEEEE </LEI> </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	
94	Collateral type	GOVS	
95	Availability for collateral reuse	true	
98	Action type	NEWT	

87 lent. Nuolatinės obligacijos			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> </Id> <JursdctnCtry>ES</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.4.5.6 Pagrindinio indekso akcijos

358. 88 lent. parodoma, kaip pranešama apie pagrindinio indekso akcijas MEQU, naudojamas kaip užtikrinimo priemonė: šiuo atveju – iš viso 105 000 000 EUR vertės Prancūzijos CAC40 akcijos, CFI kodas – ESVUFN, 5 proc. vertės sumažinimas. Vertybiniai popieriai yra žinomi ir jų duomenys pateikiami laikantis duomenų teikimo tvarkaraščio kartu su kita paskolos pusės informacija. Lauke „Užtikrinimo priemonės kokybė“ įrašoma NOAP, nes šiems vertybiniais popieriams reitingas netaikomas. Juos galima naudoti pakartotinai.
359. Įkaito nominalios sumos ar kiekio valiutos galima nenurodyti, bet ją reikėtų nurodyti, jeigu nurodoma nominali suma. Kai nurodomas kiekis (pvz., akcijos), šio lauko pildyti nereikėtų.
360. Kalbant apie įkaito įskaitymo datą, šis laukas taikomas tik VPSS sandoriams, kai įkaitas apmokamas iš anksto.
361. Vieneto kainos (2.87 laukas) apibrėžtyje nurodyta, kad į vertę, apie kurią pranešama, reikėtų įtraukti sukauptas palūkanas už palūkaninius vertybinius popierius, t. y. „purviną kainą“.

88 lent. Pagrindinio indekso akcijos			
No	Field	Example	XML Message
3	Event date	2020-04-24	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </pre>
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	

88 lent. Pagrindinio indeksu akcijų			
No	Field	Example	XML Message
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	</CtrPtyData>
83	Collateral quantity or nominal amount	10000000	<LnData> <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> ESUVFN
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> </RpTrad> </CollData> ... </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

5.4.6 Kintamosios garantinės įmokos nustatymas sandorio lygmeniu sudarant VPĮFS, kuriems netaikoma pagrindinės sandorio šalies tarpuskaity

362. Šiame poskirsnyje daromos nuorodos į VPSS ar atpirkimo sandorius yra tik pavyzdžiai, susiję su įvairiais pagrindiniais susitarimais. Tačiau kitų rūšių VPĮFS, kaip antai BSB / SBB sandorių ar VPĮFS su biržos prekėmis, duomenis reikėtų teikti remiantis tais pačiais principais.
363. Be to, šiame poskirsnyje pateikiami pavyzdžiai susiję su kintamosios garantinės įmokos nustatymu pavienių VPĮFS lygmeniu. O kitame skirsnyje pateiktais pavyzdžiais bus rodoma, kaip teikti kintamosios garantinės įmokos nustatymo duomenis, kai užtikrinimas pateikiamas grynosios pozicijos pagrindu.
364. Užtikrinimo priemonių komponentų, naudojamų nustatant kintamąją garantinę įmoką grynosios pozicijos pagrindu, neigiami ženklai parodo būklę dienos pabaigoje, o ne tos dienos srautą. Skaičiai gali sutapti, bet skirtumas yra esminis. Taigi sandorio šalys turėtų atitinkamai pranešti apie kiekvieno užtikrinimo priemonės komponento būklę dienos pabaigoje. Papildomi nurodymai pateikiami 373 punkte.
365. Dėl paprastumo pavyzdžiuose toliau vertės sumažinimas nurodomas kaip 0. Sandorio šalys turėtų nurodyti vertės sumažinimą, apskaičiuotą remiantis 5.4.5.1 skirsniu.

5.4.6.1 VPSS sandorio kintamosios garantinės įmokos nustatymas įkaito davėjui papildomai suteikiant tuos pačius vertybinius popierius

366. 89 lent. parodomas VPSS sandorio kintamosios garantinės įmokos atnaujinimas palyginti su 86 lent. pateiktu įprastos obligacijos pavyzdžiu: užtikrinimo priemonės, pateiktos siekiant kompensuoti obligacijos kainos sumažėjimą nuo 102 iki 100,99, nominalios sumos padidėjimas 1 000 099, kaip pranešė įkaito davėjas. Ir įkaito davėjas, ir įkaito gavėjas turėtų teikti informaciją apie įkaitą visiškai vienodai, kaip paaiškinta 89 lent.

89 lent. VPSS sandorio kintamosios garantinės įmokos atnaujinimas			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHijklmnopqrst</LEI> </Id> </CtrPtyData> </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of the agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI1	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMSLA	
73	Collateralisation of net exposure	FALSE	

89 lent. VPSS sandorio kintamosios garantinės įmokos atnaujinimas			
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	101000099	</CtrPtyData> </CtrPtyData>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<LnData> <SctiesLndg>
86	Price currency		
87	Price per unit	100.99	<UnqTradIdr>UT11</UnqTradIdr> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt>
88	Collateral market value	102000000	<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>DBFTFR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<NmnlVal> <Amt
98	Action type	COLU	Ccy="EUR">101000099</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100.99</Ptrg> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">102000000</MktVal> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN </LEI>

89 lent. VPSS sandorio kintamosios garantinės įmokos atnaujinimas			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> </Id> <JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> <NetXpsrCollstnInd>>false</NetXpsrCollstnInd> </Collsd> </SctiesLndg> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.4.6.2 Atpirkimo sandorio kintamosios garantinės įmokos nustatymas įkaito davėjui papildomai suteikiant tuos pačius vertybinius popierius

367. 90 lent. parodomas atpirkimo sandorio kintamosios garantinės įmokos atnaujinimas palyginti su 86 lent. pateiktu įprastos obligacijos pavyzdžiu: užtikrinimo priemonės, pateiktos siekiant kompensuoti obligacijos kainos sumažėjimą nuo 102 iki 100,99, nominalios sumos padidėjimas 1 000 099, kaip pranešė įkaito davėjas. Ir įkaito davėjas, ir įkaito gavėjas turėtų teikti informaciją apie įkaitą visiškai vienodai, kaip paaiškinta 90 lent.

90 lent. Atpirkimo sandorio kintamosios garantinės įmokos atnaujinimas			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of the agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI1	
3	Event date	24/04/2020	

90 lent. Atpirkimo sandorio kintamosios garantinės įmokos atnaujinimas			
No	Field	Example	XML Message
9	Master agreement	GMRA	<OthrCtrPty> <Id>
73	Collateralisation of net exposure	FALSE	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id>
75	Type of the collateral component	SECU	</OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	</OthrPtyData> </CtrPtyData>
83	Collateral quantity or nominal amount	101000099	</CtrPtyData> <LnData>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt>
86	Price currency		<UnqTradldr>UT1</UnqTradldr>
87	Price per unit	100.99	<MstrAgrmt> <Tp>
88	Collateral market value	102000000	<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">101000099</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal>
98	Action type	COLU	<UnitPric> <Ptrg>100.99</Ptrg> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">102000000</MktVal> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id>

90 lent. Atpirkimo sandorio kintamosios garantinės įmokos atnaujinimas			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> <LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN </LEI> </Id> <JurisdictionCtry>DE</JurisdictionCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> <NetXpsrCollstnInd>>false</NetXpsrCollstnInd> </RpTrad> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.4.6.3 VPSS sandorio kintamosios garantinės įmokos nustatymas grąžinant tuos pačius vertybinius popierius įkaito davėjui

368. 91 lent. parodomas kitos užtikrinimo priemonės atnaujinimas palyginti su 86 lent. pateiktu pavyzdžiu: užtikrinimo priemonės, pateiktos siekiant kompensuoti obligacijos kainos padidėjimą nuo 102 iki 103,03, nominalios sumos sumažėjimas 999 709 EUR, kaip pranešė įkaito davėjas. Ir įkaito davėjas, ir įkaito gavėjas turėtų teikti informaciją apie įkaitą visiškai vienodai, kaip paaiškinta 91 lent.

91 lent. VPSS sandorio kintamosios garantinės įmokos nustatymas grąžinant tuos pačius vertybinius popierius įkaito davėjui			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of the agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI1	

91 lent. VPSS sandorio kintamosios garantinės įmokos nustatymas gražinant tuos pačius vertybinius popierius įkaito davėjui

No	Field	Example	XML Message
3	Event date	24/04/2020	<LEI>12345678901234500000</LEI>
9	Master agreement	GMSLA	</Id> </RptgCtrPty>
73	Collateralisation of net exposure	FALSE	<OthrCtrPty> <Id>
75	Type of the collateral component	SECU	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</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>
83	Collateral quantity or nominal amount	99000291	</OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<LnData> <SctiesLndg> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt>
86	Price currency		<UnqTradldr>UT1</UnqTradldr>
87	Price per unit	103.03	<MstrAgrmt> <Tp>
88	Collateral market value	102000000	<Tp>GMSLA</Tp> </Tp>
89	Haircut or margin	0	</MstrAgrmt> </SctiesLndg>
90	Collateral quality	INVG	</LnData> <CollData>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	<SctiesLndg> <Collsd>
92	Jurisdiction of the issuer	DE	<AsstTp> <Scty> <Id>DE0010877643</Id>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp>
94	Collateral type	GOVS	<QtyOrNmnlVal> <NmnlVal>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<Amt Ccy="EUR">99000291</Amt> </NmnlVal>
98	Action type	COLU	</QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>103.03</Ptrg> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">102000000</MktVal>

91 lent. VPSS sandorio kintamosios garantinės įmokos nustatymas gražinant tuos pačius vertybinius popierius įkaito davėjui

No	Field	Example	XML Message
			<pre> <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> </Collsd> </SctiesLndg> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.4.6.4 Atpirkimo sandorio kintamosios garantinės įmokos nustatymas gražinant tuos pačius vertybinius popierius įkaito davėjui

369. 92 lent. parodomas kitos užtikrinimo priemonės atnaujinimas palyginti su 86 lent. pateiktu pavyzdžiu: užtikrinimo priemonės, pateiktos siekiant kompensuoti obligacijos kainos padidėjimą nuo 102 iki 103,03, nominalios sumos sumažėjimas 999 709 EUR, kaip pranešė įkaito davėjas. Ir įkaito davėjas, ir įkaito gavėjas turėtų teikti informaciją apie įkaitą visiškai vienodai, kaip paaiškinta 92 lent.

92 lent. Atpirkimo sandorio kintamosios garantinės įmokos nustatymas gražinant tuos pačius vertybinius popierius įkaito davėjui

No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <UnqTradldr>UT11</UnqTradldr> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <Id>DE0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> </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	
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	

92 lent. Atpirkimo sandorio kintamosios garantinės įmokos nustatymas gražinant tuos pačius vertybinius popierius įkaito davėjui

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

5.4.7 VPĮFS, kuriems netaikoma pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita, kintamosios garantinės įmokos nustatymas pateikiant užtikrinimą gryniosios pozicijos pagrindu

370. Jeigu užtikrinama gryniosios pozicijos pagrindu, be įkaito, kuriuo keičiamasi sudarant sandorį, sandorio šalys gali susitarti užtikrinti paskolas, kurios buvo sudarytos pagal tokios pat rūšies pagrindinį susitarimą, gryniosios vertės pagrindu.
371. Taigi būna atveju, kai įkaito gavėjas gali gražinti kai kuriuos užtikrinimo priemonės komponentus, kuriuos įkaito davėjas buvo pateikęs gryniosios vertės pagrindu. Tai daroma siekiant užtikrinti, kad įkaitas neviršytų užtikrintų sandorių rinkinio vertės arba kad įkaitas neviršytų jokios vertės sumažinimo ar garantinės įmokos ribos, dėl kurios sandorio šalys gali būti susitarusios.
372. Taip pat būna atveju, kai įkaito gavėjo gražinami vertybiniai popieriai nėra visiškai tie patys vertybiniai popieriai, kuriuos iš pradžių pateikė įkaito davėjas. Tokiu atveju būtina nustatyti perdavimo kryptį, kad būtų galima teisingai apskaičiuoti pozicijas ir užtikrinimo lygį.
373. Taigi, siekiant užtikrinti įkaito duomenų teikimo nuoseklumą, kai užtikrinama gryniosios pozicijos pagrindu:
- kai dvi sandorio šalys keičiasi įkaitu sudarydamos VPĮFS, kuriems netaikoma pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita, nustatant kintamąją garantinę įmoką gryniosios pozicijos pagrindu, XML schemoje tos sandorio šalys turėtų nurodyti vertybinių popierių sumą ir vertybinių popierių, kurių ženklas perteikia kiekvieno vertybinio popieriaus būklę jų pačių požiūriu, rinkos vertę;
 - jeigu įkaito davėjas prideda papildomą įkaitą kaip kintamąją garantinę įmoką, jis turėtų nurodyti naują užtikrinimo priemonės rinkos vertę gryniosios pozicijos pagrindu su neigiamu ženklu;
 - jeigu įkaito gavėjas gražina dalį to paties papildomo įkaito, kurį jis jau pateikė kaip kintamąją garantinę įmoką, jis turėtų nurodyti naują grynąją užtikrinimo priemonės rinkos vertę gryniosios pozicijos pagrindu su teigiamu ženklu, o įkaito davėjas turėtų nurodyti naują grynąją užtikrinimo priemonės rinkos vertę su neigiamu ženklu;
 - jeigu įkaito davėjas gauna užtikrinimo priemonių komponentus, kurie skiriasi nuo iš pradžių pateiktų užtikrinimo priemonių komponentų, jis turėtų nurodyti tų naujų užtikrinimo priemonių komponentų rinkos vertę su teigiamu ženklu;
 - kita vertus, įkaito gavėjas turėtų su teigiamu ženklu nurodyti užtikrinimo priemonių komponentus, kurie buvo gauti nustatant kintamąją garantinę įmoką, ir su neigiamu ženklu – užtikrinimo priemonių komponentus, pateiktus įkaito davėjui, kurie skiriasi nuo iš pradžių gautų užtikrinimo priemonių komponentų.
374. Toks duomenų teikimas taikytinas tik COLU pranešimams, kai i) užtikrinama gryniosios pozicijos pagrindu ir ii) nėra nurodytas užtikrinimo priemonės komponento (-ų) UTI. Toks duomenų teikimas nėra taikytinas paskirstant įkaitą kiekvienam sandoriui.
375. Kai užtikrinama gryniosios pozicijos pagrindu, sandorio šalys turėtų išsiųsti COLU pranešimus dėl kiekvieno sandorio lygmeniu užtikrinto VPĮFS ir vieną COLU pranešimą dėl įkaito, naudojamo kaip kintamoji garantinė įmoka.

5.4.7.1 Grynoji pozicija. Kintamosios garantinės įmokos nustatymas sujungiant lėšas, kai sudaromas VPSS sandoris, užtikrinamas piniginiu įkaitu sandorio lygmeniu

376. 93 lent. pateiktame pavyzdyje VPSS sandoriai iš pradžių užtikrinami piniginiu įkaitu (VPSS su grynujų pinigų grąžinimu), o vėliau sandorio šalys nustato kintamąją garantinę įmoką ir ją susieja su lėšų sujungimu.

377. Gryniesiems pinigams vertės mažinimas paprastai netaikomas ir šiuo atveju paskolos pusės garantinė įmoka taip pat laikoma lygia nuliui. Konkrečiai kalbant apie vertės mažinimą ir garantines įmokas, sandorio šalys turėtų remtis 5.4.5.1 poskirsnio gairėmis 5.4.4 skirsnyje.

93 lent. Grynoji pozicija. Kintamosios garantinės įmokos nustatymas sujungiant lėšas, kai sudaromas VPSS sandoris, užtikrinamas piniginiu įkaitu sandorio lygmeniu			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </LnData> <SciesLndg> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> </SciesLndg> </TradData> </Rpt> <UnqTradIdr>UTI1</UnqTradIdr> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMSLA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </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	

93 lent. Grynoji pozicija. Kintamosios garantinės įmokos nustatymas sujungiant lėšas, kai sudaromas VPSS sandoris, užtikrinamas piniginiu įkaitu sandorio lygmeniu

No	Field	Example	XML Message
3	Event date	24/04/2020	</SctiesLndg> </LnData>
9	Master agreement	GMSLA	<CollData> <SctiesLndg>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<Collsd> <AsstTp>
75	Type of the collateral component	CASH	<Scty> </Scty>
76	Cash collateral amount	100000000	<Csh> <Amt Ccy="EUR">100000000</Amt>
77	Cash collateral currency	EUR	</Csh> </AsstTp>
98	Action type	COLU	<NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	</Collsd> </SctiesLndg> </CollData>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	... </CollUpd>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	</Rpt> <Rpt> <CollUpd> <CtrPtyData> <CtrPtyData>
3	Event date	24/04/2020	<RptgCtrPty> <Id>
9	Master agreement	GMSLA	<LEI>12345678901234500000</LEI>
75	Type of the collateral component	CASH	</Id> </RptgCtrPty>
76	Cash collateral amount	5000000	<OthrCtrPty> <Id>
77	Cash collateral currency	EUR	<LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr>
98	Action type	COLU	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <SctiesLndg> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <UnqTradIdr>UT12</UnqTradIdr>

93 lent. Grynoji pozicija. Kintamosios garantinės įmokos nustatymas sujungiant lėšas, kai sudaromas VPSS sandoris, užtikrinamas piniginiu įkaitu sandorio lygmeniu

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

93 lent. Grynoji pozicija. Kintamosios garantinės įmokos nustatymas sujungiant lėšas, kai sudaromas VPSS sandoris, užtikrinamas piniginiu įkaitu sandorio lygmeniu

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

5.4.7.2 Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas

378. 94 lent. parodomas su trimis UTI, kurie iš pradžių buvo užtikrinti kiekvienam sandoriui, susijęs įkaitas. Tačiau šie trys atpirkimo sandoriai buvo įtraukti į užskaitos sandorius ir vėliau pateikiant užtikrinimo priemonių duomenis nurodomi įkaito elementai, susiję su pavieniais VPĮFS, identifikuojamais pagal jų UTI, ir įkaitas, naudojamas užtikrinimui grynosios pozicijos pagrindu.

94 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas

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

94 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas

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>ABCDEFGHIJKLMN</LEI>
75	Type of the collateral component	SECU	</Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	</AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData>
83	Collateral quantity or nominal amount	100000000	</CtrPtyData> <LnData>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt>
86	Price currency		<UnqTradlDr>UTI1</UnqTradlDr>
87	Price per unit	100	<MstrAgrmt> <Tp>
88	Collateral market value	100000000	<Tp>GMRA</Tp> </Tp>
89	Haircut or margin	0	</MstrAgrmt> </RpTrad>
90	Collateral quality	INVG	</LnData> <CollData> <RpTrad>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	<AsstTp> <Scty>
92	Jurisdiction of the issuer	DE	<Id>DE0010877643</Id>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal>
94	Collateral type	GOVS	<Amt
95	Availability for collateral reuse	TRUE	Ccy="EUR">100000000</Amt> </NmnlVal>

94 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas

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>

94 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas

No	Field	Example	XML Message
9	Master agreement	GMRA	<JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	</Issr> <Tp>
75	Type of the collateral component	SECU	<Cd>GOVS</Cd> </Tp>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	</Scty> </AsstTp>
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	<NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd>
84	Collateral unit of measure		</RpTrad> </CollData>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	... </CollUpd>
86	Price currency		</Rpt> <Rpt>
87	Price per unit	100	<CollUpd> <CtrPtyData> <CtrPtyData>
88	Collateral market value	50000000	<RptgCtrPty> <Id>
89	Haircut or margin	0	<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id>
90	Collateral quality	INVG	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	<Id>
92	Jurisdiction of the issuer	FR	<LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	</OthrCtrPty> <OthrPtyData>
94	Collateral type	GOVS	<AgtLndr>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr>
98	Action type	COLU	</OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<LnData> <RpTrad>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	<EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <UnqTradIdr>UTI2/UnqTradIdr> <MstrAgrmt>

94 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas

No	Field	Example	XML Message
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI3	</MstrAgrmt> </RpTrad>
3	Event date	24/04/2020	</LnData> <CollData>
9	Master agreement	GMRA	<RpTrad> <AsstTp>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<Scty> <Id>FR0010877643</Id>
75	Type of the collateral component	SECU	<ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">50000000</Amt>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	</NmnlVal> </QtyOrNmnlVal>
83	Collateral quantity or nominal amount	5000000	<UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric>
84	Collateral unit of measure		<MktVal Ccy="EUR">50000000</MktVal>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty>
86	Price currency		<Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr>
87	Price per unit	100	<Id>
88	Collateral market value	5000000	<LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI> </Id>
89	Haircut or margin	0	<JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry> </Issr>
90	Collateral quality	INVG	<Tp>
91	Maturity date of the security	22/04/2040	<Cd>GOVS</Cd> </Tp>
92	Jurisdiction of the issuer	NL	<AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	</Scty> </AsstTp>
94	Collateral type	GOVS	<NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	</RpTrad> </CollData>
98	Action type	COLU	...

94 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas

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

94 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas

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>
88	Collateral market value	2000000	<Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp>
89	Haircut or margin	0	<AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse>
90	Collateral quality	INVG	</Scty> </AsstTp>
91	Maturity date of the security	22/04/2040	
92	Jurisdiction of the issuer	ES	<NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	</RpTrad> </CollData> ... </CollUpd>
94	Collateral type	GOVS	</Rpt>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<Rpt> <CollUpd> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
98	Action type	COLU	<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
			<LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI>

94 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas

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

94 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas

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

5.4.7.3 Grynoji pozicija. VPSS sandorių, užtikrintų sujungiant nepiniginius įkaitus, kintamosios garantinės įmokos nustatymas gražinant įkaito davėjui lygiaverčius, bet ne tuos pačius vertybinius popierius

379. 95 lent. parodomas sudėtingesnis užtikrinimo priemonės atnaujinimas. Įkaitas nėra pateikiamas kiekvienam sandoriui; pirminis sandoris sudaromas pateikiant užtikrinimo priemonių grupę. Šiame pavyzdyje padidėjo vieno iš vertybinių popierių, naudojamų pozicijai užtikrinti, kaina (Vokietijos vyriausybės obligacijų kaina padidėjo nuo 102 iki 103,3), bet įkaito gavėjui reikalingos Vokietijos vyriausybės obligacijos, o įkaito davėjas sutinka priimti Prancūzijos vyriausybės obligacijas. Dvi sandorio šalys susitaria dėl tokio pakeitimo: įkaito gavėjas gražina 2 000 000 EUR įkeistų Prancūzijos vyriausybės obligacijų nominalia suma. Taigi tie 2 060 000 EUR, kuriais viršijama įkeistų Vokietijos obligacijų rinkos vertė, kompensuojami 2 060 000 EUR rinkos vertės įkeistomis Prancūzijos obligacijomis, kurias turi įkaito davėjas (t. y. su neigiamu ženklų įkaito gavėjo požiūriu); taip atkuriami pirminė grynoji įkaito pusiausvyra.
380. Reikėtų pažymėti, kad laukai, susiję su vertybiniais popieriais pasikartojančiame užtikrinimo priemonių duomenų skirsnyje, pakartojami du kartus, kad būtų pateikti visi svarbūs duomenys. Abu vertybinius popierius galima naudoti pakartotinai.
381. Įkaito davėjas ir įkaito gavėjas turėtų teikti informaciją apie įkaitą, kaip paaiškinta 95 lent., nurodydamos atitinkamus užtikrinimo priemonių komponentų, naudojamų nustatant kintamąją garantinę įmoką grynosios pozicijos pagrindu, ženklus, kaip nurodyta 373 punkte.

95 lent. Grynoji pozicija. VPSS sandorių, užtikrintų sujungiant įkaitus, kintamosios garantinės įmokos nustatymas gražinant įkaito davėjui lygiaverčius, bet ne tuos pačius vertybinius popierius			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN</LEI> </Id> </OthrCtrPty> </CtrPtyData> </Rpt> </CollUpd> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of the agent lender F	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMSLA	
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	
75	Type of the collateral component	SECU	

95 lent. Grynoji pozicija. VPSS sandorių, užtikrintų sujungiant įkaitus, kintamosios garantinės įmokos nustatymas gražinant įkaito davėjui lygiaverčius, bet ne tuos pačius vertybinius popierius

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>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	</LnData> <CollData>
92	Jurisdiction of the issuer	DE	<SctiesLndg> <Collsd>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<AsstTp> <Scty> <Id>DE0010877643</Id>
94	Collateral type	GOVS	<ClssfctnTp>DBFTPR</ClssfctnTp>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt
75	Type of the collateral component	SECU	Ccy="EUR">101000000</Amt> </NmnlVal>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	</QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>103.03</Ptrg>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	</UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">104060300</MktVal>
83	Collateral quantity or nominal amount	-2000000	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty>
86	Price currency		<Issr>
87	Price per unit	103.015	<Id>

95 lent. Grynoji pozicija. VPSS sandorių, užtikrintų sujungiant įkaitus, kintamosios garantinės įmokos nustatymas gražinant įkaito davėjui lygiaverčius, bet ne tuos pačius vertybinius popierius

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

95 lent. Grynoji pozicija. VPSS sandorių, užtikrintų sujungiant įkaitus, kintamosios garantinės įmokos nustatymas gražinant įkaito davėjui lygiaverčius, bet ne tuos pačius vertybinius popierius

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

5.4.7.4 Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas gražinant įkaito davėjui lygiaverčius, bet ne tuos pačius vertybinius popierius

382. 96 lent. pateiktas pavyzdys yra 94 lent. pateikto pavyzdžio tęsinys. Šiuo atveju vienas iš pateiktų vertybinių popierių gražinamas kaip kintamoji garantinė įmoka, bet ji didesnė nei pirma pateikta kintamoji garantinė įmoka.

96 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas gražinant įkaito davėjui lygiaverčius, bet ne tuos pačius vertybinius popierius

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

96 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas gražinant įkaito davėjui lygiaverčius, bet ne tuos pačius vertybinius popierius

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> <Qty>INVG</Qty>
86	Price currency		<Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr>
87	Price per unit	100	<Id>

96 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas gražinant įkaito davėjui lygiaverčius, bet ne tuos pačius vertybinius popierius

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

96 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas gražinant įkaito davėjui lygiaverčius, bet ne tuos pačius vertybinius popierius

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>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</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>

96 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas gražinant įkaito davėjui lygiaverčius, bet ne tuos pačius vertybinius popierius

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>

96 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas gražinant įkaito davėjui lygiaverčius, bet ne tuos pačius vertybinius popierius

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

96 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas gražinant įkaito davėjui lygiaverčius, bet ne tuos pačius vertybinius popierius

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

96 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas gražinant įkaito davėjui lygiaverčius, bet ne tuos pačius vertybinius popierius

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

96 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas gražinant įkaito davėjui lygiaverčius, bet ne tuos pačius vertybinius popierius

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

96 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas gražinant įkaito davėjui lygiaverčius, bet ne tuos pačius vertybinius popierius

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

5.4.7.5 Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas naudojant grynuosius pinigus (97 lent.)

383. Šis pavyzdys yra ankstesnių pavyzdžių dėl kintamosios garantinės įmokos nustatymo grynosios pozicijos pagrindu naudojant vertybinius popierius variantas. Trys VPIFS, identifikuojami pagal UTI1, UTI2 ir UTI3, užtikrinami sandorio lygmeniu vertybiniais popieriais, o vėliau nustatydamos kintamąją garantinę įmoką sandorio šalys susitarė pateikti grynuosius pinigus. Papildomus grynuosius pinigus pozicijai padengti pateikia įkaito davėjas.

97 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu grynaisiais pinigais ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> </RpTrad> <UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr> <MstrAgrmt> <Tp> </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	

97 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu grynaisiais pinigais ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas

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>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN</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>

97 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu grynaisiais pinigais ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas

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>

97 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu grynaisiais pinigais ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas

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> </CtrPtyData> </CtrPtyData>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<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> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI3	</RpTrad>
3	Event date	24/04/2020	</LnData>
9	Master agreement	GMRA	<CollData> <RpTrad>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<AsstTp> <Scty>
75	Type of the collateral component	SECU	<Id>FR0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	Ccy="EUR">50000000</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal>
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	<UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg>
84	Collateral unit of measure		</UnitPric> <MktVal
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	Ccy="EUR">50000000</MktVal>
86	Price currency		<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn>

97 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu grynaisiais pinigais ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas

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>
77	Cash collateral currency	EUR	</OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr>
98	Action type	COLU	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData>

97 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu grynaisiais pinigais ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas

No	Field	Example	XML Message
			<pre> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <UnqTradIdr>UTI3</UnqTradIdr> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <Id>NL0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR </ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <Qty>50000000</Qty> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">10</Amt> </MntryVal> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">50000000</MktVal> </MntryVal> </RpTrad> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>DDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDD </LEI> </Id> <JursdctnCtry>NL</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>MEQU</Cd> </Tp> </pre>

97 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu grynaisiais pinigais ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas

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

97 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu grynaisiais pinigais ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas

No	Field	Example	XML Message
			<pre> <AsstTp> <Csh> <Amt Ccy="EUR">2000000</Amt> </Csh> </AsstTp> <NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd> </RpTrad> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.4.7.6 Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas. Tą konkrečią dieną palūkanos pozicijai neskačiuojamos, tad kintamosios garantinės įmokos nereikia

384. 98 lent. išsamiau paaiškinamas 97 lent. pateiktas pavyzdys, bet šiuo atveju yra parodytas svarbus elementas, kad dienos pabaigoje nebesikeičiama papildomais įkaitais, kurie būtų kintamoji garantinė įmoka, skirta pateikti užtikrinimą grynosios pozicijos pagrindu. Duomenys teikiami remiantis panašia logika, kaip tuo atveju, kai pateikiama informacija apie nulinį įkaitą, kaip paaiškinta 5.4.4 skirsnyje.

98 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas. Tą konkrečią dieną palūkanos pozicijai neskačiuojamos, tad kintamosios garantinės įmokos nereikia

No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>1234567890123450000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> </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	

98 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas. Tą konkrečią dieną palūkanos pozicijai neskaičiuojamos, tad kintamosios garantinės įmokos nereikia

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

98 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas. Tą konkrečią dieną palūkanos pozicijai neskačiuojamos, tad kintamosios garantinės įmokos nereikia

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

98 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas. Tą konkrečią dieną palūkanos pozicijai neskaičiuojamos, tad kintamosios garantinės įmokos nereikia

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

98 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas. Tą konkrečią dieną palūkanos pozicijai neskačiuojamos, tad kintamosios garantinės įmokos nereikia

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>
75	Type of the collateral component	SECU	<AsstTp> <Scty>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<Id>FR0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR </ClssfctnTp>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	<QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">50000000</Amt>
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	</NmnlVal> </QtyOrNmnlVal>
84	Collateral unit of measure		<UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	</UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">50000000</MktVal>
86	Price currency		
87	Price per unit	100	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty>
88	Collateral market value	50000000	<Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id>
89	Haircut or margin	0	<LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI> </Id>
90	Collateral quality	INVG	
91	Maturity date of the security	22/04/2040	<JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry> </Issr>
92	Jurisdiction of the issuer	NL	<Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	
94	Collateral type	GOVS	<AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse> </Scty>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	</AsstTp>
98	Action type	COLU	<NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	</RpTrad> </CollData> ...

98 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas. Tą konkrečią dieną palūkanos pozicijai neskačiuojamos, tad kintamosios garantinės įmokos nereikia

No	Field	Example	XML Message
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	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	0	<LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id>
77	Cash collateral currency	EUR	</OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr>
98	Action type	COLU	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <UnqTradldr>UTI3</UnqTradldr> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <Id>NL0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal>

98 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas. Tą konkrečią dieną palūkanos pozicijai neskaiciuojamos, tad kintamosios garantinės įmokos nereikia

No	Field	Example	XML Message
			<pre> <Amt Ccy="EUR">50000000</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">50000000</MktVal> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>DDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDD </LEI> </Id> <JursdctnCtry>NL</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>MEQU</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> <NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> </RpTrad> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> <Rpt> <CollUpd> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> </pre>

98 lent. Grynoji pozicija. Atpirkimo sandorių, iš pradžių užtikrintų sandorio lygmeniu ir vėliau įtrauktų į užskaitos sandorius, kintamosios garantinės įmokos nustatymas. Tą konkrečią dieną palūkanos pozicijai neskaiciuojamos, tad kintamosios garantinės įmokos nereikia

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

5.4.8 Iš anksto apmokėtas VPSS įkaitas

385. Teikiant duomenis apie aiškų įkaito paskirstymą grynajai pozicijai, užtikrinimo priemonės atnaujinimo pranešime reikėtų nurodyti sandorio šalių LEI, pagrindinį susitarimą, įkaito įskaitymo datą ir konkretų įkaito paskirstymą, kad užtikrinimo priemonės atnaujinimą būtų galima susieti su sudarytais VPĮFS. Laukas „Užtikrinimo priemonės įskaitymo data“ (2.74 laukas) taikytinas tik VPSS sandoriams.
386. Įvykio data – tai numatyta įkaito atsiskaitymo data. Palyginant sandorio šalių LEI, pagrindinį susitarimą ir pirminio prekybos sandorio pranešimo datos laukus ir laukus, užpildytus atnaujinant užtikrinimo priemones, galima nustatyti, kuriems prekybos sandoriams taikomas grynosios neapmokėtos sumos įkaito atnaujinimas. 99 lent. pateiktame pavyzdyje apie įkaitą reikėtų pranešti remiantis numatyta atsiskaitymo data, kuri yra 2020 m. balandžio 23 d. ir kuri yra nurodyta lauke „Įvykio data“ (2.3 laukas). Lauke „Užtikrinimo priemonės įskaitymo data“ (2.74 laukas) nurodoma data, nuo kurios užtikrinimo priemonės atnaujinimas taikomas negražintoms paskoloms (t. y. nuo 2020 m. balandžio 24 d. įkaitas nebėra apmokamas iš anksto). Taigi siekiant nustatyti, kuriems VPĮFS taikomas užtikrinimo priemonės atnaujinimas, užtikrinimo priemonės įskaitymo data siejama su VPĮFS, kurių sandorio šalių LEI ir pagrindinis susitarimas yra tie patys, įskaitymo data ir termino suėjimo data.

99 lent. Iš anksto apmokamas įkaitas			
No	Field	Example	XML Message
3	Event date	2020-04-23	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <SctiesLndg> <EvtDt>2020-04-23</EvtDt> </SctiesLndg> </LnData> <CollData> <SctiesLndg> <Collsd> <CollValDt>2020-04- 24</CollValDt> <AsstTp> <Scty> <Id>DE0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">100000000</Amt>
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	

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

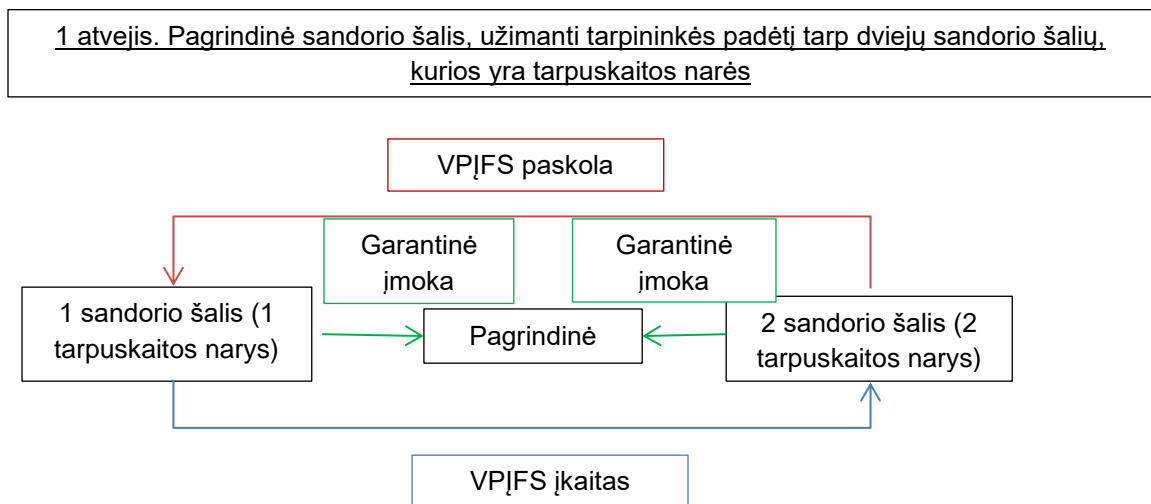
5.4.9 Sandorių, kuriems atlikta tarpuskaita, portfelis

387. Užpildydamos 2.97 lauką („Portfelio kodas“) sandorio šalys turėtų užtikrinti, kad tas kodas jų pranešimuose būtų naudojamas nuosekliai. Jeigu pagal kodą identifikuojamas portfelis, kuriuo užtikrinami sandoriai, apimantys ir išvestines priemones, sandorio šalys turėtų naudoti tą patį kodą, kuris yra naudojamas teikiant duomenis pagal ERIR.
388. Be to, lauko „Portfelio kodas“ vertė nebūtinai turi būti visuotinai unikali, bet ji turi būti naudojama nuosekliai. Kadangi 2.97 lauke pateikiama nesutampanti vertė, sandorio šalys neprivalo susitarti dėl vertės.

5.5 Garantinės įmokos duomenys

389. Šiame skirsnyje nurodytus duomenis turėtų teikti visos sandorio šalys, kurių VPĮFS taikoma pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita, nebent toms sandorio šalims būtų taikomas privalomas delegavimas pagal 4 straipsnio 2 dalį ir tokiu atveju duomenis turėtų teikti tame straipsnyje nurodytas subjektas.
390. Siekdami turėtų galimybę naudotis pagrindinės sandorio šalies paslaugomis, garantinę įmoką pagrindinei sandorio šaliai pateikia ir 1 TN, ir 2 TN. Garantinę įmoką sudaro pirminė garantinė įmoka ir kintamoji garantinė įmoka¹⁶. Garantinė įmoka, kurią tarpuskaitos nariai pateikia pagrindinei sandorio šaliai, nėra tiesiogiai susijusi su VPĮFS įkaitu. Pagrindinė sandorio šalis naudoja garantinę įmoką, kad padengtų visų rūšių riziką, kylančią dėl sandorių, kurių tarpuskaitą ji atlieka atitinkamiems tarpuskaitos nariams. Garantine įmoka, kurią tarpuskaitos nariai pateikia pagrindinei sandorio šaliai, taip pat galima padengti riziką, kylančią dėl kitų sandorių, ne VPĮFS, kaip antai dėl prekybos išvestinėmis finansinėmis priemonėmis.

5.5.1 Pagrindinė sandorio šalis, užimanti tarpininkės padėtį tarp dviejų sandorio šalių, kurios yra tarpuskaitos narės

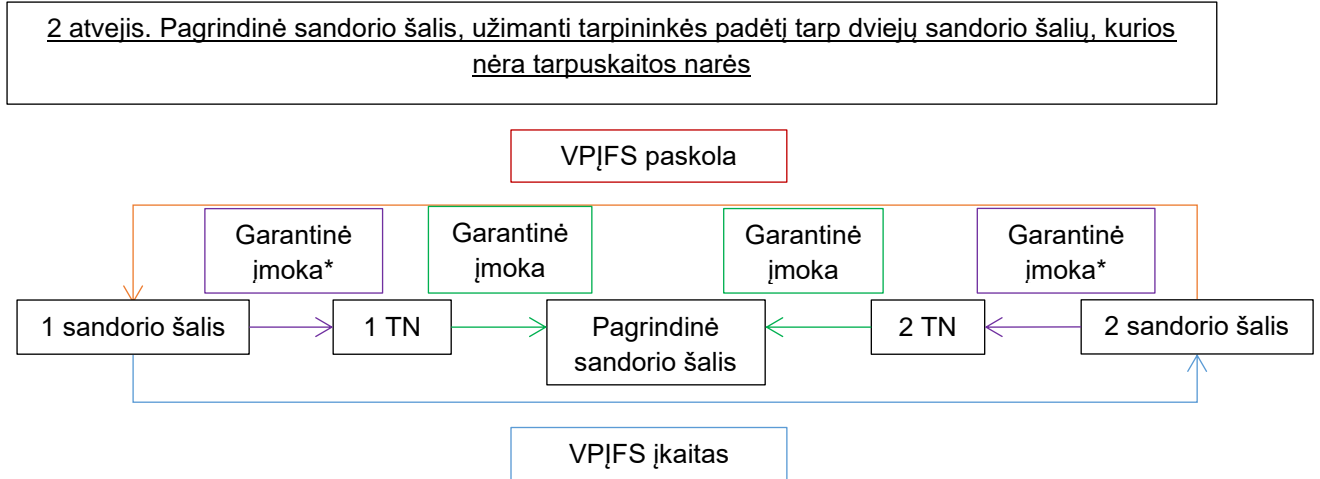


391. Kai pati sandorio šalis nėra tarpuskaitos narė, garantinė įmoka, kurią ji pateikia tarpuskaitos nariui (žr. „garantinę įmoką*“ toliau 2 atvejo pavyzdyje), gali skirtis nuo garantinės įmokos, kurią tarpuskaitos narys pateikia pagrindinei sandorio šaliai.

¹⁶ Gali būti ir perteklinė garantinė įmoka, kuri būtų užtikrinimo priemonės dalis, viršijanti reikiamą lygį.

5.5.2 Pagrindinė sandorio šalis, užimanti tarpininkės padėtį tarp dviejų sandorio šalių, kurios nėra tarpuskaitos narės

•



5.5.3 Informacijos apie garantinę įmoką pateikimas

392. Jeigu yra ir trečioji keitimosi garantinėmis įmokomis rūšis, sandorio šalys turėtų susitarti ir nuosekliai apie ją pranešti kaip apie pirminę garantinę įmoką arba kintamąją garantinę įmoką.
393. Pirminės garantinės įmokos, kintamosios garantinės įmokos ir perteklinio įkaito duomenys teikiami atskirais skaičiais, kiekvieną iš kurių sudaro bendroji gauto, pateikto ir (arba) įkeisto visų klasių turto vertė (prieš vertės sumažinimą). Jeigu portfelyje, kuriam atlikta tarpuskaita, išvestinių finansinių priemonių nėra, rekomenduojama naudoti pagrindinės sandorio šalies bazinę valiutą, bet, jeigu yra išvestinių finansinių priemonių, apie kurias reikia pranešti pagal ERIR, reikėtų naudoti tą pačią valiutą.
394. Garantinės įmokos informacija taikytina tik VPĮFS, kuriems atlikta pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita. 100 lent. parodytu atveju subjektas naudoja užtikrinimui tą patį portfelį, kaip pagal ERIR. Duomenis teikianti sandorio šalis, J sandorio šalis, kuri taip pat yra tarpuskaitos narė, naudojasi deleguotomis duomenų teikimo paslaugomis, kurias teikia D sandorio šalis. Ji praneša, kad pirminė garantinė įmoka, kuri buvo pateikta O pagrindinei sandorio šaliai, yra 1 000 000 EUR, o kintamoji garantinė įmoka – 300 000 EUR. Sandorio šalis taip pat praneša, kad įkaito perteklius sudaro 100 000 EUR.

100 lent. Garantinės įmokos duomenys			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<SciesFincgRptgTxMrgnDataRpt> <TradData> <Rpt> <TradUpd>
2	Event date	2020-04-23	

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

5.6 Pakartotinio naudojimo duomenys, grynujų pinigų reinvestavimas ir finansavimo šaltiniai

395. Kaip pabrėžiama TRS, logika, kuria vadovaujasi Duomenų teikimo TS priedo 4 lentelėje, skiriasi nuo kitų lentelių logikos ir nebus naudojama derinimo tikslais, nes šios

informacijos negalima susieti su pavieniais sandoriais. Vietoj to duomenis teikiančio subjekto lygmeniu teikiami suvestiniai duomenys apie pakartotinį nepiniginio įkaito naudojimą, piniginio įkaito reinvestavimą ir finansavimo šaltinius.

396. Be to, jeigu duomenys apie pakartotinį įkaito naudojimą, grynujų pinigų reinvestavimą ar finansavimo šaltinius pateikiami skirtingu metu, veiksmo rūšis NEWT nurodoma tik pirmajame pranešime dėl atitinkamo duomenis teikiančios sandorio šalies ir už duomenų teikimą atsakingo subjekto derinio, neatsižvelgiant į tai, kurie laukai yra pildomi. Paskesnius pranešimus dėl tokio derinio reikėtų teikti nurodant atitinkamą veiksmo rūšį.

5.6.1 Pakartotinis įkaito naudojimas

397. Apie pakartotinį įkaito naudojimą pranešama naudojant FST susitarime¹⁷ nustatytą formulę, kuri įtraukta ir į TRS. Rinkos dalyviai paprastai neatskiria nuosavo turto nuo įkaito, kurį gavo iš sandorio šalių (jeigu įkeistus vertybinius popierius galima naudoti pakartotinai). Taigi FST formulė parengta taip, kad subjektai turėtų pateikti pakartotinai naudojamo įkaito sumos įvertį remdamiesi jį gauta įkaito dalimi palyginti su nuosavu turtu.
398. Pareiga teikti duomenis taikoma tik VPĮFS; vadinasi, ji netaikoma vertybiniams popieriams, kurie buvo pateikti ar gauti kaip kitų sandorių užtikrinimo priemonė. Kitaip tariant, įkaito, pateikto garantinės įmokos nustatymo tikslais, sudarant sandorius su išvestinėmis finansinėmis priemonėmis ar bet kokius kitus sandorius, kurie nepatenka į VPĮFSR taikymo sritį, kaip nagrinėjama 4.2.1 skirsnyje, į formulę įtraukti nereikėtų.
399. Tai taip pat reiškia, kad apie pakartotinio naudojimo formulės sudedamąsias dalis nereikėtų atskirai pranešti ESMA. Vietoj to duomenis teikiantys subjektai turėtų pateikti tik įvertį, nustatytą pagal formulę ISIN lygmeniu.
400. Kai įkaitas faktiškai nėra pakartotinai naudojamas, duomenų lauką reikėtų palikti tuščią. Kai įkaitas nebėra pakartotinai naudojamas, lauke „Pakartotinio naudojimo atnaujinimas“ (REUU) reikėtų įrašyti 0.
401. Jeigu duomenų teikimas deleguojamas, sandorio šalis, kuriai pavedama teikti duomenis, neatsako už apskaičiuotojo pakartotinio įkaito naudojimo duomenų teikimą. Ne finansų sandorio šalys turi pačios apskaičiuoti numatomą pakartotinį naudojimą ir laiku pateikti įvertį už duomenų teikimą atsakingai sandorio šaliai.
402. Jeigu sandorio šalys pageidauja pranešti apie faktinį, o ne apskaičiuotąjį pakartotinį naudojimą, jos gali tai daryti.
403. FST susitarime terminas „įkaitas“ bendrai apibrėžiamas atsižvelgiant į jo ekonominę funkciją, t. y. reikėtų suprasti, kad tai vertybiniai popieriai, nepriklausomai nuo teisinės sandorio struktūros. Kalbant apie taikymo sritį, tai reiškia, kad *gautas įkaitas, kurį galima pakartotinai naudoti*, – tai:
- a. vertybiniai popieriai, gauti kaip atvirkštinio atpirkimo sandorių ir BSB sandorių užtikrinimo priemonė;

¹⁷ FST. Pakartotinis nepiniginio įkaito naudojimas. Priemonės ir parametrai. <http://www.fsb.org/wp-content/uploads/Non-cash-Collateral-Re-Use-Measures-and-Metrics.pdf>

- b. vertybiniai popieriai, pasiskolinti vertybinių popierių skolinimosi sandoriuose;
 - c. vertybiniai popieriai, gauti kaip vertybinių popierių skolinimo sandorių užtikrinimo priemonė;
 - d. vertybiniai popieriai, gauti kaip papildomas įkaitas, siekiant įvykdyti su VPĮFS susijusius kintamosios garantinės įmokos reikalavimus.
404. Pirminių garantinių įmokų, kurias įsipareigota pateikti ir kurios yra izoliuotos ir nenaudojamos (pvz., išvestinių finansinių priemonių atveju) bei kurių dėl to negalima naudoti pakartotinai, į įvertį įtraukti nereikėtų.
405. Garantinės įmokos skolinimo atveju galimybę naudoti įkaitą pakartotinai lemia ne tik su sandoriu susijusios įkaito sutarties rūšis, bet ir sutartyje nustatytos ribos („pakartotinio įkeitimo ribos“), dėl kurių susitarė pagrindinis makleris ir jo klientas. Tokia riba apskaičiuojama kaip fiksuota negražintos dienos garantinės įmokos paskolos sumos dalis procentais. Kad įkaitą būtų galima naudoti pakartotinai, vertybinius popierius, kurie gali būti pakartotinai įkeisti, laikantis ribos reikia pirma pervesti iš kliento sąskaitos į pagrindinio maklerio nuosavą sąskaitą. ESMA siūlo atliekant skaičiavimus pagal pakartotinio naudojimo formulę į *gautą įkaitą, kurį galima pakartotinai naudoti*, nereikėtų įtraukti įkeistų vertybinių popierių, kurių negalima pervesti į pagrindinio maklerio nuosavą sąskaitą dėl sutartyje nustatytos pakartotinio įkeitimo ribos. Pateiktų, bet nepaskirstytų vertybinių popierių įtraukti nereikėtų. Jeigu tokie vertybiniai popieriai būtų įtraukti, įkaito, kuris faktiškai naudojamas pakartotinai, suma būtų pervertinta.
406. Panašiai, pateiktą įkaitą sudaro:
- a. vertybiniai popieriai, pateikti kaip atpirkimo sandorių ir SBB sandorių užtikrinimo priemonė;
 - b. paskolinti vertybiniai popieriai;
 - c. vertybiniai popieriai, pateikti kaip vertybinių popierių skolinimosi sandorių užtikrinimo priemonė;
 - d. vertybiniai popieriai, pateikti kaip įkaitas, siekiant įvykdyti su VPĮFS susijusius kintamosios garantinės įmokos reikalavimus.
407. Vertybinių popierių, gautų ar pateiktų sudarant sandorius, kurie nepatenka į VPĮFSR taikymo sritį, įskaitant VPĮFS, sudaromus su ECBS sandorio šalimis, į pakartotinio naudojimo formulę įtraukti nereikėtų.
408. Pagrindinės sandorio šalys į savo pakartotinio naudojimo įverčius neturėtų įtraukti įkeistų vertybinių popierių, pervedamų tarp tarpuskaitos narių jiems atliekant pagrindinės sandorio šalies tarpuskaitą. Tai pasakytina ir apie gautą įkaitą, ir apie pakartotinai naudojamą įkaitą, kurie yra formulės sudedamosios dalys. Pačių šių įkeistų vertybinių popierių pagrindinė sandorio šalis pakartotinai nenaudoja, nes vertybinių popierių pervedimas labiau sietinas su novacijos procesu, kuris vyksta, kai pagrindinė sandorio šalis užima tarpininkės padėtį tarp dviejų pirminių sandorio šalių. Įkeisti vertybiniai popieriai, gauti kaip garantinė įmoka, turėtų būti įtraukiami į įverčius, kai taikytina; tikimasi, kad pagrindinės sandorio šalys praneš apie visus pakartotinio naudojimo atvejus joms vykdant kitą veiklą. Tai gali būti izdo veikla ir bet kokios kitos rūšies priemonė ar

mechanizmas (pvz., atvirkštinės vertybinių popierių paskolos), kuriuos pagrindinės sandorio šalys gali būti įsidedusios.

409. Kalbant apie į FST susitarimą įtrauktus pakartotinio įkaito naudojimo parametrus¹⁸, juos tiesiogiai apskaičiuos nacionalinės ar pasaulinės institucijos remdamosi subjektų pateiktais pakartotinio įkaito naudojimo duomenimis. Siekdamas nustatyti pakartotinio naudojimo lygį institucijos turės apskaičiuoti vardiklį remdamosi duomenimis, kuriuos subjektai pateikė 2 lentelėje.

5.6.1.1 Finansų sandorio šalis arba ne MVĮ ne finansų sandorio šalis pakartotinai naudoja vertybinius popierius nedeleguodama duomenų teikimo

410. 101 lent. parodomas atvejis, kai B sandorio šalis pateikia duomenis apie pakartotinai naudojamų vertybinių popierių, kurių ISIN kodas yra IT00BH4HKS39, vertę 10 000 000 EUR sumai.

101 lent. Finansų sandorio šalis arba ne MVĮ ne finansų sandorio šalis pakartotinai naudoja vertybinius popierius nedeleguodama duomenų teikimo			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd> ... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptgCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </NttyRspnsblForRpt> </CtrPtyData> <CollCmpnt> <Scty> <ISIN>IT00BH4HKS39</ISIN> <ReuseVal> <Estmtd Ccy="EUR">10000000</Estmtd> </ReuseVal> </Scty> </CollCmpnt>
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	
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	

¹⁸9 Žr. FST susitarimo dėl pakartotinio nepiniginio įkaito naudojimo 4 skirsnį.

101 lent. Finansų sandorio šalis arba ne MVĮ ne finansų sandorio šalis pakartotinai naudoja vertybinius popierius nedeleguodama duomenų teikimo

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

5.6.1.2 Finansų sandorio šalis arba ne MVĮ ne finansų sandorio šalis pakartotinai naudoja vertybinius popierius deleguodama duomenų teikimą

411. 102 lent. parodomas atvejis, kai A sandorio šalis paveda duomenų teikimą B sandorio šaliai. Ji pateikia duomenis apie pakartotinai naudojamų vertybinių popierių, kurių ISIN kodas yra IT00BH4HKS39, vertę 10 000 000 EUR sumai.

102 lent. Finansų sandorio šalis arba ne MVĮ ne finansų sandorio šalis pakartotinai naudoja vertybinius popierius deleguodama duomenų teikimą

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

102 lent. Finansų sandorio šalis arba ne MVĮ ne finansų sandorio šalis pakartotinai naudoja vertybinius popierius deleguodama duomenų teikimą

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

5.6.1.3 MVĮ ne finansų sandorio šalis pakartotinai naudoja vertybinius popierius su viena sandorio šalimi

412. 103 lent. parodomas atvejis, kai C sandorio šalis yra MVŠ ne finansų sandorio šalis, sudariusi VPĮFS tik su vienu subjektu, B sandorio šalimi (finansų sandorio šalimi). B sandorio šalis pateikia duomenis apie pakartotinai naudojamų vertybinių popierių, kurių ISIN kodas yra IT00BH4HKS39, vertę 10 000 000 EUR sumai.

103 lent. MVĮ ne finansų sandorio šalis pakartotinai naudoja vertybinius popierius su viena sandorio šalimi

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<pre> <SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd> ... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty> <LEI>123456789ABCDEFGHJKLM</LEI> </RptgCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI> ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </NttyRspnsblForRpt> </CtrPtyData> <CollCmpnt> </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	

103 lent. MVĮ ne finansų sandorio šalis pakartotinai naudoja vertybinius popierius su viena sandorio šalimi			
No	Field	Example	XML Message
10	Reused collateral currency	EUR	<pre> <Scty> <ISIN>IT00BH4HKS39</ISIN> <ReuseVal> <Estmtd Ccy="EUR">10000000</Estmtd> </ReuseVal> </Scty> </CollCmpnt> <EvtDt>2020-04-23</EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> </pre>
18	Action type	REUU	

5.6.1.4 MVĮ ne finansų sandorio šalis pakartotinai naudoja vertybinius popierius su keliomis sandorio šalimis

413. 104 lent. ir 105 lent. pateikiama informacija, kurią reikėtų pranešti, kai MVĮ ne finansų sandorio šalis pakartotinai naudoja vertybinius popierius su keliomis sandorio šalimis. Šiame pavyzdyje yra dvi lentelės. Tačiau gali būti tiek lentelių, kiek yra sandorio šalių, su kuriomis MVĮ ne finansų sandorio šalis sudarė VPĮFS ir vėliau pakartotinai naudojo įkaitą.
414. Šiuo atveju C sandorio šalis yra MVĮ ne finansų sandorio šalis, sudariusi VPĮFS su dviem subjektais, B sandorio šalimi ir D sandorio šalimi. B sandorio šalis pateikia duomenis apie pakartotinai naudojamų vertybinių popierių, kurių ISIN kodas yra IT00BH4HKS39, vertę 10 000 000 EUR sumai 104 lent. D sandorio šalis pateikia duomenis apie pakartotinai naudojamų vertybinių popierių, kurių ISIN kodas yra FR00BH4HKS3, vertę 2 000 000 EUR sumai 105 lent.

104 lent. MVĮ ne finansų sandorio šalis pakartotinai naudoja vertybinius popierius su keliomis sandorio šalimis (1)			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<pre> <SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd> ... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> </pre>
2	Event date	2020-04-23	
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty B	
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty C	

104 lent. MVĮ ne finansų sandorio šalis pakartotinai naudoja vertybinius popierius su keliomis sandorio šalimis (1)

No	Field	Example	XML Message
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty B	<pre> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty> <LEI>123456789ABCDEF</LEI> </RptgCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN</LEI> </NttyRspnsblForRpt> </CtrPtyData> <CollCmpnt> <Scty> <ISIN> IT00BH4HKS39</ISIN> <ReuseVal> <Estmtd Ccy="EUR">10000000</Estmtd> </ReuseVal> </Scty> </CollCmpnt> <EvtDt>2020-04-23</EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> </pre>
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	

105 lent. MVĮ ne finansų sandorio šalis pakartotinai naudoja vertybinius popierius su keliomis sandorio šalimis (2)

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T18:41:07Z	<pre> <SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd> ... <RptgDtTm>2020-04- 22T16:41:07Z</RptgDtTm> <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> <LEI>11223344556677889900</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty> </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	{LEI} of counterparty D	

105 lent. MVĮ ne finansų sandorio šalys pakartotinai naudoja vertybinius popierius su keliomis sandorio šalimis (2)

No	Field	Example	XML Message
6	Type of collateral component	SECU	<pre> <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> </pre>
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 Piniginio įkaito reinvestavimas

415. Sandorio šalys gali pateikti duomenis apie piniginio įkaito reinvestavimą, kai gryniesi pinigai yra naudojami VPSS sandoriuose kaip užtikrinimo priemonė ir vėliau juos reinvestuoja tiesiogiai skoliniojas (įkaito gavėjas) arba skoliniojo vardu – agentas. Apie reinvestavimą pranešama neatsižvelgiant į dalyvaujančios finansų sandorio šalies rūšį ir kt. Tai susiję su jo padėtimi atitinkamuose VPĮFS.
416. Duomenis laukuose „Reinvestavimo rūšis“ (4.12 laukas) ir „Reinvestuotų pinigų suma“ (4.13 laukas) reikėtų suskirstyti pagal reinvestuojamo piniginio įkaito valiutą (4.14 laukas). Kadangi tikimasi, kad sandorio šalys pateiks vieną reinvestavimo normą nesuskirstydamos duomenų pagal valiutą, reinvestavimo normą (4.11 laukas) reikėtų apskaičiuoti kaip svartinį vidurkį remiantis reinvestuotų pinigų suma (4.13 laukas), konvertavus į reinvestuotų pinigų valiutą (4.14 laukas).
417. Taip pat įtraukiami gryniesi pinigai, gauti garantinės įmokos nustatymo tikslais vykdant VPĮFS, kuriems netaikoma pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita, ir vėliau reinvestuojami.
418. Apie grynuosius pinigus, gautus skolinant garantinę įmoką ir vėliau reinvestuojamus, nereikėtų pranešti kaip apie piniginio įkaito reinvestavimą. Dėl piniginio įkaito duomenų teikimo garantinės įmokos skolinimo atveju žr. 5.3.16 skirsnį.

419. Jeigu duomenis teikianti sandorio šalis negali atskirti nuosavų grynujų pinigų nuo grynujų pinigų, gautų kaip piniginis įkaitas, grynujų pinigų reinvestavimo sumą reikėtų apskaičiuoti taikant tą pačią metodiką, kaip nepiniginio įkaito atveju.
420. Pagrindinių sandorio šalių gaunamo piniginio įkaito (vykdant garantinės įmokos nustatymo reikalavimus) ir piniginio įkaito reinvestavimo duomenys jau skelbiami viešai vykdant CPSS ir IOSCO viešo kiekybinės informacijos atskleidimo reikalavimus¹⁹. Nors duomenys pagal VPĮFSR teikiami kasdien (o ne kas ketvirtį, kaip kiekybinės informacijos atskleidimo atveju), dėl palyginamo išsamumo lygio ir renkamos informacijos rūšies nebūtinai reikia teikti papildomus pranešimus. Taigi pagrindinės sandorio šalies piniginio įkaito reinvestavimas neįtraukiamas.
421. Galiausiai, kalbant apie piniginio įkaito reinvestavimo duomenų teikimą, sandorio šalys taip pat turėtų atsižvelgti į visas paskesnes gaires ar patikslinimus, kuriuos šioje srityje teikia FST.

5.6.2.1 Finansų sandorio šalis arba ne MVĮ ne finansų sandorio šalis reinvestuoja grynuosius pinigus nedeleguodama duomenų teikimo

422. 106 lent. parodomas atvejis, kai B sandorio šalis praneša apie savo 100 000 EUR grynujų pinigų reinvestavimą esant 1,5 proc. normai atpirkimo sandorių rinkoje.

106 lent. Finansų sandorio šalis arba ne MVĮ ne finansų sandorio šalis reinvestuoja grynuosius pinigus nedeleguodama duomenų teikimo			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd> ... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptgCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI>
2	Event date	2020-04-23	
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty B	
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty B	
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty B	
11	Reinvestment Rate	1.5	
12	Type of re-invested cash investment	REPM	
13	Re-invested cash amount	100000	

¹⁹ CPSS ir IOSCO, 2015 m. vasario mėn., „Pagrindinėms sandorio šalims skirti viešo kiekybinės informacijos atskleidimo standartai“.
<https://www.bis.org/cpmi/publ/d125.pdf>

106 lent. Finansų sandorio šalis arba ne MVĮ ne finansų sandorio šalis reinvestuoja grynuosius pinigus nedeleguodama duomenų teikimo

No	Field	Example	XML Message
14	Re-invested cash currency	EUR	<pre> </NttyRspnsblForRpt> </CtrPtyData> <CollCmpnt> <Csh> <RinvstdCsh> <Tp>REPM</Tp> <RinvstdCshAmt Ccy="EUR">100000</RinvstdCshAmt> </RinvstdCsh> </pre>
18	Action type	REUU	<pre> <CshRinvstmtRate>1.5</CshRinvstmtRate> </Csh> </CollCmpnt> <EvtDt> 2020-04-23 </EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> </pre>

5.6.2.2 Finansų sandorio šalis arba ne MVĮ ne finansų sandorio šalis reinvestuoja grynuosius pinigus deleguodama duomenų teikimą

423. 107 lent. parodomas atvejis, kai A sandorio šalis paveda grynujų pinigų reinvestavimo duomenų teikimą B sandorio šaliai. B sandorio šalis praneša apie 100 000 EUR grynujų pinigų reinvestavimą esant 1 proc. normai atpirkimo sandorių rinkoje.

107 lent. Finansų sandorio šalis arba ne MVĮ ne finansų sandorio šalis reinvestuoja grynuosius pinigus deleguodama duomenų teikimą

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

107 lent. Finansų sandorio šalis arba ne MVĮ ne finansų sandorio šalis reinvestuoja grynuosius pinigus deleguodama duomenų teikimą

No	Field	Example	XML Message
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	<LEI>ABCDEFGHIJKLMN</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty>
11	Reinvestment Rate	1	
12	Type of re-invested cash investment	REPM	<LEI>12345678901234500000</LEI> </RptgCtrPty> <NttyRspnsblForRpt>
13	Re-invested cash amount	100000	<LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt> </CtrPtyData> <CollCmpnt> <Csh> <RinvstdCsh> <Tp>REPM</Tp> <RinvstdCshAmt Ccy="EUR">100000</RinvstdCshAmt> </RinvstdCsh>
14	Re-invested cash currency	EUR	
18	Action type	REUU	<CshRinvstmtRate>1</CshRinvstmtRate> </Csh> </CollCmpnt> <EvtDt> 2020-04-23 </EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt>

5.6.2.3 MVĮ ne finansų sandorio šalis reinvestuoja grynuosius pinigus su viena sandorio šalimi

424. 108 lent. parodomas atvejis, kai C sandorio šalis yra MVĮ ne finansų sandorio šalis, sudaranti VPĮFS tik su vienu subjektu, B sandorio šalimi. Be sandorio šalis praneša apie 100 000 EUR piniginių įkaito reinvestavimą esant 1 proc. normai atpirkimo sandorių rinkoje.

108 lent. MVĮ ne finansų sandorio šalis reinvestuoja grynuosius pinigus su viena sandorio šalimi

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<pre> <SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd> ... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> <LEI>ABCDEF GHIJKLMNOPQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty> <LEI>123456789ABCDEFGHIJK</LEI> </RptgCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI>ABCDEF GHIJKLMNOPQRST</LEI> </NttyRspnsblForRpt> </CtrPtyData> <CollCmpnt> <Csh> <RinvstdCsh> <Tp>REPM</Tp> <RinvstdCshAmt Ccy="EUR">100000</RinvstdCshAmt> </RinvstdCsh> <CshRinvstmtRate>1</CshRinvstmtRate> </Csh> </CollCmpnt> <EvtDt> 2020-04-23 </EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> </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 MVĮ ne finansų sandorio šalis reinvestuoja grynuosius pinigus su keliomis sandorio šalimis

425. 109 lent. ir 110 lent. pateikiama informacija, kurią reikėtų pranešti, kai MVĮ ne finansų sandorio šalis reinvestuoja įkaitą su keliomis sandorio šalimis. Šiame pavyzdyje yra dvi

lentelės. Tačiau gali būti tiek lentelių, kiek yra sandorio šalių, su kuriomis MVĮ ne finansų sandorio šalis sudarė VPĮFS ir vėliau reinvestavo piniginį įkaitą.

426. Šiuo atveju C sandorio šalis yra MVĮ ne finansų sandorio šalis, sudariusi VPĮFS su dviem subjektais, B sandorio šalimi ir D sandorio šalimi. B sandorio šalis nurodo 100 000 EUR reinvestuoto piniginių įkaito sumą 109 lent. D sandorio šalis nurodo 100 000 EUR reinvestuoto piniginių įkaito sumą 110 lent.

109 lent. MVĮ ne finansų sandorio šalis reinvestuoja grynuosius pinigus su keliomis sandorio šalimis (1)			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData>
2	Event date	2020-04-23	<Rpt> <CollReuseUpd>
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty B	... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm>
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty C	<CtrPtyData> <RptSubmitgNtty>
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty B	<LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty>
11	Reinvestment Rate	1	<LEI>123456789ABCDEFGHJKLM</LEI> </RptgCtrPty>
12	Type of re-invested cash investment	REPM	<NttyRspnsblForRpt>
13	Re-invested cash amount	100000	<LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
14	Re-invested cash currency	EUR	</CtrPtyData> <CollCmpnt> <Csh> <RinvstdCsh> <Tp>REPM</Tp> <RinvstdCshAmt Ccy="EUR">100000</RinvstdCshAmt> </RinvstdCsh>
18	Action type	REUU	<CshRinvstmtRate>1</CshRinvstmtRate> </Csh> </CollCmpnt> <EvtDt> 2020-04-23 </EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData>

109 lent. MVĮ ne finansų sandorio šalis reinvestuoja grynuosius pinigus su keliomis sandorio šalimis (1)

No	Field	Example	XML Message
			</SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt>

110 lent. MVĮ ne finansų sandorio šalis reinvestuoja grynuosius pinigus su keliomis sandorio šalimis (2)

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 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>
11	Reinvestment Rate	1	<LEI>123456789ABCDEFGHIJK</LEI> </RptgCtrPty>
12	Type of re-invested cash investment	REPM	<NttyRspnsblForRpt>
13	Re-invested cash amount	100000	<LEI>11223344556677889900</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>

110 lent. MVĮ ne finansų sandorio šalis reinvestuoja grynuosius pinigus su keliomis sandorio šalimis (2)

No	Field	Example	XML Message
			</SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt>

5.6.3 Pakartotinis nulinio nepiniginio įkaito naudojimas ir grynujų pinigų reinvestavimas

427. 111 lent. parodoma, kaip pildomi laukai, kai nėra nei pakartotinio nepiniginio įkaito naudojimo, net piniginio įkaito reinvestavimo. Taigi sandorio šalys turėtų teikti duomenis, kaip 111 lent.

428. Šiuo atveju TRS „Reinvestuotos piniginės investicijos rūšis“ 4 lentelės 12 lauke reikėtų įrašyti „Kita“.

111 lent. Pakartotinis nulinio piniginio įkaito naudojimas

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

111 lent. Pakartotinis nulinio piniginio įkaito naudojimas			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> </pre>

5.6.4 Finansavimo šaltiniai

429. Su finansavimo šaltiniais susijusius laukus reikėtų pildyti tik jeigu yra negražinta garantinės įmokos paskola arba trumposios pozicijos rinkos vertė. Duomenis teikiančios sandorio šalys arba už duomenų teikimą atsakingi subjektai turėtų teikti šią informaciją duomenis teikiančios sandorio šalies lygmeniu, o ne pavienio sandorio lygmeniu.
430. 112 lent. parodomas atvejis, kai B sandorio šalis praneša apie 5 000 000 EUR sumą kaip finansavimo šaltinius garantinės įmokos paskoloms finansuoti atpirkimo sandorių rinkoje.

112 lent. Finansavimo šaltiniai			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt>
2	Event date	2020-04-23	<TradData>
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty B	<Rpt>
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty B	<Crrctn>
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty B	<RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm>
15	Funding sources	REPO	<CtrPtyData>
16	Market value of the funding sources	5000000	<RptSubmitgNtty>
17	Funding sources currency	EUR	<LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI>
18	Action type	REUU	</RptSubmitgNtty>
			<RptgCtrPty>
			<LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI>
			</RptgCtrPty>
			<NttyRspnsblForRpt>
			<LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI>
			</NttyRspnsblForRpt>
			</CtrPtyData>
			<CollCmpnt>
			...
			</CollCmpnt>
			<EvtDt>
			2020-04-23
			</EvtDt>

112 lent. Finansavimo šaltiniai			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> <FndgSrc> <Tp>REPO</Tp> <MktVal Ccy="EUR">5000000</MktVal> </FndgSrc> </Crrctn> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> </pre>

6 Grįžtamoji informacija apie atmetimą

431. Duomenų rinkimo TRS 1 straipsnio 1 dalyje numatomi įvairūs patikrinimai, kuriuos SDS turi atlikti siekdama užtikrinti pagal VPĮFSR 4 straipsnį pateiktų VPĮFS duomenų teisingumą ir išsamumą.
432. SDS turėtų pateikti grįžtamąją informaciją apie atmetimą pagal šias atmetimo kategorijas:
- pateiktų duomenų schemos patvirtinimą pagal Duomenų rinkimo TRS 1 straipsnio 1 dalies b punktą;
 - duomenis teikiančio subjekto leidimą, kaip numatyta Duomenų rinkimo TRS 1 straipsnio 1 dalies c punkte;
 - loginį pateiktų duomenų patvirtinimą pagal Duomenų rinkimo TRS 1 straipsnio 1 dalies d–j punktuose;
 - veiklos taisyklės arba pateiktų duomenų turinio patvirtinimą pagal Duomenų rinkimo TRS 1 straipsnio 1 dalies k punktą, kaip numatyta šiose gairėse.
433. Reikėtų pažymėti, kad SDS patvirtina subjekto autentiškumą jungiantis prie SDS sistemos. Tad konkreti grįžtamoji informacija apie atmetimą nebus teikiama.
434. SDS turėtų patikrinti rinkmenos atitiktį XML schemai (tikrinama visos rinkmenos ir konkrečių VPĮFS pranešimų sintaksė). Jeigu rinkmena nesuderinama, atmetama visa rinkmena (visi į ją įtraukti sandoriai) ir nurodoma priežastis, kad rinkmena yra „sugadinta“.
435. Kaip nustatyta Duomenų rinkimo TRS 1 straipsnio c punkte, toks patikrinimas turėtų vykti patvirtinant SDS teikiamus pranešimus; nors leidimų suteikimo santykius galima nustatyti jungiantis, leidimą teikti duomenis taip pat reikėtų tikrinti duomenų teikimo lygmeniu ir SDS turėtų atmesti visus tokio patikrinimo nepaėjusius teikiamus duomenis išsiųsdama atitinkamą grįžtamosios informacijos pranešimą.
436. SDS turėtų naudoti atitinkamą ISO 20022 XML pranešimą, kad pateiktų prie tos SDS prisijungusiems subjektams grįžtamąją informaciją apie patvirtinimą. Pranešdamos sandorio šalims apie atmetimą SDS turėtų naudoti duomenų teikimo laukuose pateiktus kodus.
437. Gavusios pranešimą apie atmetimą duomenis teikiančios sandorio šalys ar už duomenų teikimą atsakingas subjektas turėtų tiesiogiai arba per duomenis teikiantį subjektą teikti

teisingus ir išsamius pranešimus iki VPJFSR 4 straipsnio 1 dalyje nustatyto duomenų teikimo termino.

438. Jeigu rinkmenoje yra 3 sandoriai, bet jie nėra patvirtinami, iš statistinių duomenų matyti, kad rinkmena priimta ir 3 sandoriai yra atmesti.
439. Jeigu duomenų rinkmenoje, kurią pateikė duomenis teikianti sandorio šalis, už duomenų teikimą atsakingas subjektas arba pranešimą teikiantis subjektas, yra rimta schemos klaida ir sandorių patvirtinti neįmanoma, pranešama apie 1 rinkmenos atmetimą.
440. Be pirmiau pateiktos informacijos, SDS taip pat pateiks kiekvienai duomenis teikiančiai sandorio šaliai, už duomenų teikimą atsakingam subjektui ar pranešimą teikiančiam subjektui, kai taikytina, dienos pabaigos pranešimą (auth.084.001.01), kuriame pateikiama ši informacija:

113 lent. Grįžtamoji informacija apie atmetimą			
No.	Field	Details to be reported	XML Message
1	Number of files received	Numeric values	<pre> <SciesFincgRptgTxStsAdv> <TxRptStsAndRsn> <Rpt> <RptSttstcs> <TtlNbOfRpts>2</TtlNbOfRpts> </Rpt> </TxRptStsAndRsn> <TtlNbOfRptsAccptd>1</TtlNbOfRptsAccptd> <TtlNbOfRptsRjctd>1</TtlNbOfRptsRjctd> <NbOfRptsRjctdPerErr> <DtldNb>1</DtldNb> <RptSts> <MsgRptld>ReportID</MsgRptld> <Sts>RJCT</Sts> <DtldVldtnRule> <Id>RuleID</Id> <Desc>Rule description</Desc> </DtldVldtnRule> </RptSts> </NbOfRptsRjctdPerErr> </RptSttstcs> <TxSttstcs> <TtlNbOfTxS>2</TtlNbOfTxS> </TxSttstcs> <TtlNbOfTxSAccptd>1</TtlNbOfTxSAccptd> <TtlNbOfTxSRjctd>1</TtlNbOfTxSRjctd> <NbOfTxSRjctd> <Txld> <Tx> <RptgCtrPty> </pre>
2	No. of files accepted	Numeric values	
3	No. of files rejected	Numeric values	
4	File identification	Textual value	
5	Rejection reason	Error code	
6	Rejection description	Error description	
7	Number of SFTs received	Numeric values	
8	Number of SFTs accepted	Numeric values	
9	Number of SFT s rejected	Numeric values	
10	Identification of the SFT		
11	Reporting counterparty	Table A Field 3	
12	UTI	Table B Field 1	
13	Other counterparty	Table A Field 11	
14	Master agreement type	Table B Field 9	
15	Rejection reason	Error codes	
16	Rejection description	Error description	

		<pre> <LEI>1234567890123450000</LEI> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <LEI>1234567890123450000</LEI> </OthrCtrPty> <UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>OTHR</Tp> </Tp> <Vrsn>2019</Vrsn> </MstrAgrmt> </Tx> </TxId> <Sts>RJCT</Sts> <DtldVldtnRule> <Id>RuleID</Id> <Desc>Rule description</Desc> </DtldVldtnRule> </NbOfTxsrjctd> </TxSttscs> </Rpt> </TxRptStsAndRsn> </SctiesFincgRptgTxStsAdv< </pre>
--	--	--

441. Taip bus užtikrinama, kad tais atvejais, kai duomenis teikianti sandorio šalis arba už duomenų teikimą atsakingas subjektas neteikia pranešimų tiesiogiai SDS ir tik turi sąskaitą, kurią galima peržiūrėti, jie turėtų turėti galimybę nuodugniai suprasti, kaip jie vykdo pareigą teikti duomenis pagal VPĮFSR.

7 Grįžtamoji informacija apie derinimą

442. Atlikdamos derinimo procesą tarp SDS, SDS suskirsto paskolas poromis, i) suderina paskolas pagal derinamus paskolų duomenų laukus ir kartu ii) suderina įkaitą pagal derinamus įkaito duomenų laukus. Taigi įkaitas nėra suskirstomas poromis, neatsižvelgiant į tai, ar prekybos sandorio įkaitas ar gryniosios pozicijos įkaitas. Poromis reikėtų suskirstyti tik paskolas, o įkaitai, susiję su prekybos sandorio įkaito ar gryniosios pozicijos įkaito paskolomis, bus derinami. SDS neturėtų suskirstyti poromis įkaito ir tokiu atveju, jeigu viena šalis nepateikia gryniosios pozicijos įkaito, kiekvienas įkeičiamas turto objektas įtraukiamas į derinimo rezultatų statuso ataskaitą kaip „nesuderintas“ ir užtikrinimo priemonės suderinimo statusas bus „Nesuderinta“.

114 lent. Derinimo kategorijos

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. Gavusi ir priėmusi patikrintą pranešimą, kurio veiksmo rūšis yra EROR, SDS turėtų pašalinti atitinkamą VPĮFS iš derinimo proceso nedelsdama, t. y. jau iš kito derinimo ciklo.
444. Be to, jokio VPĮFS negalima atgaivinti, tad VPĮFS reikėtų pašalinti iš derinimo proceso 30 dienų po termino suėjimo datos arba pirmalaikio nutraukimo, t. y. kai duomenys teikiami nurodant veiksmo rūšį „Nutraukimas / pirmalaikis nutraukimas“ arba „Pozicijos komponentas“ laikantis Tikrinimo TRS 2 straipsnio 2 dalies h punkto sąlygų. Be to, derinant įkaito duomenis, pranešimai skiriasi nuo paskolos pranešimų tuo, kad šiuo atveju nėra termino suėjimo datų. Įkaito grynosios pozicijos pagrindu atveju tai reiškia, kad jo data yra susijusi su VPĮFS paskolos pusės data. Taigi SDS turėtų siekti suderinti šią informaciją per laikotarpį iki trisdešimties dienų po nutraukimo arba paskutinės paskolos, įtrauktos į grynosios pozicijos užtikrinimą, termino suėjimo. Be to, grynosios pozicijos įkaito derinimo statusas pakartojamas dėl visų į grynosios pozicijos užtikrinimą įtrauktų VPĮFS.
445. Kai duomenų teikimo reikalavimai taikomi abiem sandorio šalims, jos turėtų užtikrinti, kad VPĮFS, apie kuriuos pranešama, poravimo statusas būtų „Porinis“, paskolos suderinimo statusas – „Suderinta“, o užtikrinimo priemonės suderinimo statusas – „Suderinta“.
446. Tam SDS pateiks joms toliau išdėstytą pranešimą su išsamia informacija apie kiekvieno VPĮFS, apie kurį pranešta ir kuriam atliekamas derinimas, suderinimo statusą:

115 lent. Grįžtamoji informacija apie derinimą

No.	Field		Details to be reported	XML Message
1	Reporting counterparty	Unique key	Table A Field 3	<code><SctiesFincgRptgRcncltnStsAdv
<RcncltnData>
<Rpt>
<PairgRcncltnSts></code>
2	UTI		Table B Field 1	
3	Other counterparty		Table A Field 11	
4	Master agreement type		Table B Field 9	
	Report status		Paired/Reconciled	<code><DtldNbOfRpts>2</DtldNbOfRpts>
<DtldSts>PARD</DtldSts>
</PairgRcncltnSts>
<RcncltnRpt></code>
	Reporting timestamp	Information on the last reporting timestamp	Table A Field 1	<code>...
<Txld>
<RptgCtrPty></code>

115 lent. Grįžtamoji informacija apie derinimą				
No.	Field		Details to be reported	XML Message
		pertaining to the SFT that is reconciled		<LEI>12345678901234500000</LEI> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty>
	Modification status	Information if the transaction subject of reconciliation was modified	True/False	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </OthrCtrPty> <UnqTradIdr>UTI10</UnqTradIdr> </Txld> <Modfd>>true</Modfd> <RcncltnSts> <RptgData> <NotMtchd> <CtrPty1>
	No Reconciliation required	Indication that the transaction is not subject of reconciliation	True/False	<LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CtrPty1> <CtrPty2>
	Matching status		True/False	
	Loan reconciliation status		reconciled/not reconciled	<LEI>EEEEEEEEEEEEEEEEEEEE</LEI> </CtrPty2> <MtchgCrit> <LnMtchgCrit> <TermntnDt> <Val1>2019-04-20 </Val1> <Val2>2019-04-21 </Val2> </TermntnDt> </LnMtchgCrit> <CollMtchgCrit> <CmpntTp> <Scty> <Qty>
	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	
	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	<Val1>1234</Val1> <Val2>1243</Val2> </Qty> </Scty> </CmpntTp> </CollMtchgCrit> </MtchgCrit> </NotMtchd> </RptgData> </RcncltnSts>

115 lent. Grįžtamoji informacija apie derinimą				
No.	Field		Details to be reported	XML Message
				</RcncltnRpt> </Rpt> </RcncltnData> </SctiesFincgRptgRcncltnStsAdv<

447. VPĮFS pašalinus iš derinimo proceso, tuos VPĮFS taip pat reikėtų pašalinti iš derinimo pranešimų, teikiamų sandorio šalims ir institucijoms. Savo sistemose SDS turėtų išsaugoti paskutinį tokių VPĮFS suderinimo statusą.

8 Grįžtamoji informacija apie trūkstamą įkaitą

448. Reikėtų nurodyti, ar VPĮFS yra užtikrintas ar ne. Jeigu VPĮFS yra užtikrintas, įkaito informaciją reikia pateikti iš karto, kai ji tampa žinoma.
449. Jeigu teikiant duomenis įkaito informacija dar nežinoma, konkretūs įkaito duomenys 2.75–2.94 laukuose neįrašomi. Vietoj to užpildomas 2.96 laukas, jame įrašant užtikrinimo priemonių krepšelio ISIN kodą arba NTAV. VPĮFS pranešimas bus priimtas.
450. Remiantis Duomenų rinkimo TRS 3 straipsnio c punktu, dienos pabaigoje SDS parengia pranešimą, kuriame pateikia „unikalius sandorio identifikatorius, žyminčius VPĮFS, kurių atžvilgiu įgyvendinimo reglamento (ES) 2019/363 I priedo 2 lentelės 72 laukelyje įrašyta „klaidingas“, o informacija apie užtikrinimo priemonę tos pačios lentelės 73–96 laukeliuose dar nebuvo pranešta“. Atsižvelgiant į tai, kad informacija apie pavienius užtikrinimo priemonės komponentus pateikiama 2.75–2.94 laukuose siekiant priminti subjektams pateikti konkrečią informaciją apie įkaitą, SDS turėtų parengti trūkstamo įkaito ataskaitą, kurioje nurodomi VPĮFS, apie kuriuos sandorio šalis yra pranešusi kaip apie užtikrintus sandorius ir dėl kurių užpildytas tik 2.96 laukas, UTI.
451. Kadangi tikimasi, kad vienos dienos VPĮFS įkaitas nebus paskirstomas, siekdamas užtikrinti, kad sandorio šalys naudotų šiuos duomenis veiksmingai ir naudingai, SDS turėtų į šį pranešimą įtraukti VPĮFS, tenkinančius visas toliau išvardytas sąlygas:
- VPĮFS, kurių 2.72 lauke įrašyta „false“ („ne“) ir informacija pateikiama tik 2.96 lauke;
 - VPĮFS, kurių įvykdymo laiko žymos datos dalis ir termino suėjimo data ar nutraukimo data nesutampa;
 - VPĮFS, kuriems taikomas derinimas.

9 Kaip teikti informaciją valdžios institucijoms

9.1 Prieigos prie duomenų suteikimo terminai

452. Kalbant apie prieigos prie duomenų savalaikiškumą, SDS turėtų įgyvendinti savo vidaus procesus taip, kad pagal 4 straipsnio 1 dalies f punktą valdžios institucija nedelsiant turėtų

tiesioginę prieigą prie išsamių VPĮFS duomenų per trisdešimt dienų po jos prašymo suteikti jai prieigą pateikimo.

453. SDS turėtų naudoti valdžios institucijų pateiktą informaciją pagal atitinkamą Prieigos prie duomenų TRS nustatytą formą. VPĮFS duomenys apie filialus ir patronuojamąsias įmones turėtų būti teikiami valdžios institucijoms taip pat atsižvelgiant į turimus LEI ryšių duomenis.
454. Be to, suteikdamos prieigą prie sandorio šalių teikiamų duomenų, kaip numatyta VPĮFSR 4 straipsnyje, į veiklos ir būklės rinkmenas SDS turėtų įtraukti VPĮFS, apie kuriuos pranešama sandorio ir pozicijos lygmenimis.
455. Kalbant apie reikalavimus dėl Prieigos prie duomenų TRS 4 straipsnio 2 dalies k punkto, prieiga turėtų būti suteikiama dėl biržos prekių, jeigu galima nustatyti atitinkamas tokių prekių valstybes nares.
456. Kalbant apie reikalavimus dėl Prieigos prie duomenų TRS 4 straipsnio 2 dalies n punkto, kai reikėtų suteikti prieigą prie VPĮFS centrinio banko išleista valiuta, prieiga prie duomenų turėtų aprėpti visus su vertinimu nesusijusius laukus, kuriuose naudojama valiuta. Jeigu tą pačią valiutą išleidžia kelios institucijos, kaip euro atveju, jos visos turėtų turėti prieigą prie tokių VPĮFS.
457. Kalbant apie reikalavimus dėl Prieigos prie duomenų TRS 4 straipsnio 2 dalies o punkto, kai reikėtų suteikti prieigą prie VPĮFS, susijusių su lyginamaisiais rodikliais, kuriuos pateikia administratorius ir kuriems VPĮFSR 12 straipsnio 2 dalyje nurodytas subjektas turi įgaliojimus, SDS turėtų užtikrinti, kad būtų gaunama informacija, patvirtinanti atitinkamų administratorių įgaliojimus dėl tokių lyginamųjų rodiklių.

9.2 Praktiniai prieigos prie duomenų aspektai

458. Kalbant apie VPĮFS duomenis, teikiamus pagal Duomenų teikimo TRS priedo 1–4 lenteles, įskaitant naujausią VPĮFS, kurių terminas dar nesuėjęs arba dėl kurių nebuvo pranešimų su veiksmo rūšimi „Klaida“, „Nutraukimas / pirmalaikis nutraukimas“ ar „Pozicijos komponentas“, kaip nurodyta Duomenų teikimo TĮS I priedo 2 lentelės 98 lauke, prekybos būklę, SDS turėtų naudoti toliau išvardytus XML formatus.
459. Atitinkami prekybos veiklos pranešimai: auth.052.001.01 (sandorio šalis, paskola ir įkaitas), auth.070.001.01 (garantinė įmoka), auth.071.001.01 (pakartotinis įkaito naudojimas). Atitinkami būklės pranešimai: 079.001.01 (sandorio šalis, paskola ir įkaitas), auth.085.001.01 (garantinė įmoka), auth.086.001.01 (pakartotinis įkaito naudojimas). Šie šablonai atnaujinti atsižvelgiant į atnaujinimą ir paaiškinimus, susijusius su šablonais i) atpirkimo sandorių įkaito ir BSB sandorių įkaito duomenims teikti, ii) garantinės įmokos skolinimo įkaito duomenims teikti, iii) grynosios pozicijos įkaito duomenims teikti ir iv) daugelio įkeisto turto objektų duomenims teikti.
460. Be to, tuos pačius šablonus reikia naudoti ir tais atvejais, kai SDS ruošia atsakymus ir į pasikartojančias užklausas, ir į *ad hoc* užklausas dėl paskolų ir užtikrinimo priemonių duomenų. SDS neprivalo suteikti prieigos prie garantinių įmokų ir pakartotinio naudojimo duomenų pagal *ad hoc* užklausas, nes nė viename iš dviejų pranešimų nėra laukų, dėl kurių galima pateikti užklausa.

116 lent. VPĮFS pranešimas. Sandorio šalių, paskolų ir užtikrinimo priemonių duomenys			
No.	Field	Details to be reported	XML schema
1	Reportable field	Table 1 Field 1 to Field 18 Table 2 Field 1 to Field 99	<pre> <SctiesFincgRptgTxStatRpt> <Stat> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> <RcncltnFlg> ... </RcncltnFlg> <CtrctMod> ... </CtrctMod> ... </Stat> ... </SctiesFincgRptgTxStatRpt> </pre>

461. Be to, teikdamos garantinės įmokos ir pakartotinio naudojimo duomenis sandorio šalys, už duomenų teikimą atsakingas subjektas ar duomenis teikiantis subjektas pateikia galutinės būklės duomenis. Tai netrukdo duomenis teikiančiai sandorio šaliai už duomenų teikimą atsakingam subjektui ar duomenis teikiančiam subjektui pateikti šią informaciją keliomis partijomis.

462. Veiklos pranešime auth.070.001.01 (garantinė įmoka), visuose VPĮFS garantinės įmokos pranešimuose, kurie buvo pateikti tam tikrą dieną, ir būklės pranešime auth.085.001.01 SDS turėtų pranešti valdžios institucijoms apie naujausią visų VPĮFS garantinių įmokų, apie kurias buvo pranešta dėl atitinkamos įvykio datos, būklę arba, jeigu dėl tam tikros datos informacijos nėra, – naujausią pateiktą informaciją.

117 lent. VPĮFS pranešimas. Garantinės įmokos duomenys			
No.	Field	Details to be reported	XML schema
1	Reportable field	Table 3 Field 1 to Field 20	<pre> <SctiesFincgRptgMrgnDataTxStatRpt> <Stat> ... <CtrPty> ... </pre>

117 lent. VPĮFS pranešimas. Garantinės įmokos duomenys			
No.	Field	Details to be reported	XML schema
			</CtrPty> <CollPrftfId>...</CollPrftfId> <PstdMrgnOrColl> ... </PstdMrgnOrColl> <RcvdMrgnOrColl> ... </RcvdMrgnOrColl> <RcncltnFlg> ... </RcncltnFlg> <CtrctMod> ... </CtrctMod> ... </Stat> ... </SctiesFincgRptgMrgnDataTxStatRpt>

463. Suteikdamos prieigą prie pakartotinio naudojimo duomenų, susijusių su MVĮ ne finansų sandorio šalimis, SDS turėtų pateikti valdžios institucijoms visą informaciją, kuri buvo pateikta nurodant veiksmo rūšį NEWT ir REUU ir yra susijusi su duomenis teikiančia sandorio šalimi ir konkrečia įvykio data. Siekdamas nustatyti taikytinus atvejus SDS turėtų naudoti laukus „Už pranešimą atsakingas subjektas“ ir „Pranešimą teikiantis subjektas“. Kai tam tikra duomenis teikianti sandorio šalis yra susijusi daugiau nei su vienu už duomenų teikimą atsakingu subjektu ir jie pasitelkia tą patį duomenis teikiančią subjektą, SDS turėtų pateikti visus pranešimus apie pakartotinį įkaito naudojimą tai įvykio datai, kurie buvo pateikti dėl duomenis teikiančios sandorio šalies.

464. Veiklos pranešime auth.071.001.01, visuose VPĮFS pranešimuose dėl pakartotinio įkaito naudojimo, kurie buvo pateikti tam tikrą dieną, ir būklės pranešime auth.086.001.01 SDS turėtų pranešti valdžios institucijoms apie naujausią visų VPĮFS pranešimų dėl pakartotinio įkaito naudojimo, pateiktų dėl atitinkamos įvykio datos, būklę arba, jeigu dėl tam tikros datos informacijos nėra, – naujausią pateiktą informaciją.

118 lent. VPĮFS pranešimas. Pakartotinio naudojimo duomenys			
No.	Field	Details to be reported	XML schema
1	Reportable field	Table 4 Field 1 to Field 18	<SctiesFincgRptgReusdCollDataTxStatRpt> <Stat> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <CollCmpnt>

118 lent. VPĮFS pranešimas. Pakartotinio naudojimo duomenys			
No.	Field	Details to be reported	XML schema
			... </CollCmpnt> ... <FndgSrc> ... </FndgSrc> <RcncltnFlg> ... </RcncltnFlg> <CtrctMod> ... </CtrctMod> ... </Stat> ... </SctiesFincgRptgReusdCollDataTxStatRpt>

465. Kalbant apie svarbius duomenis SDS atmetuose VPĮFS pranešimuose, įskaitant visus VPĮFS pranešimus, kurie buvo atmeti ankstesnę darbo dieną ir jų atmetimo pagrindus, kaip nurodyta Duomenų tikrinimo TRS I priedo 2 lentelėje, SDS turėtų naudoti tokį pat XML šabloną, kaip 113 lent. Grįžtamoji informacija apie atmetimą.

119 lent. Pranešimas apie atmetimą				
No.	Field	Additional information	Details to be reported	XML schema
1	Number of files received		Numeric values	
2	No. of files accepted		Numeric values	
3	No. of files rejected		Numeric values	
4	File identification		Textual value	
5	Rejection reason		Error code	
6	Rejection description		Error description	
7	Number of SFT received		Numeric values	
8	No. of SFT accepted		Numeric values	
9	No. of SFT s rejected		Numeric values	
10	Identification of the SFT			
11	Reporting counterparty	Unique key of the SFT	Table 1 Field 3	
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. Kalbant apie visų VPĮFS, apie kuriuos pranešta ir kuriems SDS atliko derinimo procedūrą pagal Duomenų tikrinimo TRS (išskyrus VPĮFS, kurių terminas yra pasibaigęs arba dėl kurių likus daugiau nei mėnesiui iki derinimo proceso datos buvo gauti VPĮFS pranešimai su veiksmo rūšimis „Klaida“, „Nutraukimas / pirmalaikis nutraukimas“ ar „Pozicijos komponentas“), suderinimo statusą, SDS turėtų naudoti tokį pat XML šabloną, kaip 115 lent. Grįžtamoji informacija apie derinimą.
467. XSD buvo atnaujintas, kad būtų galima teikti suderinimo vertes dėl daugelio užtikrinimo priemonių elementų abiem sandorio šalims, už duomenų teikimą atsakingam subjektui, duomenis teikiančiam subjektui ir valdžios institucijoms.
468. Įkaito suderinimo rezultatus reikėtų pateikti tik vieną kartą dėl visų prekybos sandorių, kuriems taikomas tos pačios rūšies pagrindinis susitarimas ir kurių grynoji užtikrinimo pozicija yra TRUE.

120 lent. VPĮFS suderinimo statuso pranešimas				
No.	Field	Additional information	Details to be reported	XML schema
1	Reporting counterparty	Unique key	Table 1 Field 3	
2	UTI		Table 2 Field 1	
3	Other counterparty		Table 1 Field 11	
4	Master agreement type		Table 2 Field 9	
5	Report status		Paired/Reconciled	
6	Reporting timestamp	Information on the last reporting timestamp pertaining to the SFT that is reconciled	Table 1 Field 1	
7	Modification status	Information if the transaction subject of reconciliation was modified	True/False	
8	No Reconciliation required	Indication that the transaction is not subject of reconciliation	True/False	
9	Matching status		True/False	
10	Loan reconciliation status		reconciled/not reconciled	
11	Reportable loan fields subject of reconciliation	Only not reconciled fields are to be reported, both values subject of 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. Gavusios užklausą SDS turėtų patikrinti, ar užklausa teisinga ir ar ją galima apdoroti jų sistemose. Jeigu duomenų užklausa neteisinga (pvz., neatitinka reikalavimų), SDS siunčia valdžios institucijai grįžtamosios informacijos pranešimą, kuriame nurodo, kad užklausa netinkama ir įtraukia klaidos rūšies aprašymą.

```

<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. Gavusios ir patikrinusios *ad hoc* duomenų užklausas SDS jas vykdo kuo greičiau, taip pat ne darbo dienomis. Laikas, per kurį reikia atsakyti į *ad hoc* užklausas, nustatytas Prieigos prie duomenų TRS 5 straipsnio 4 dalyje:

- a. kai prašoma suteikti prieigą prie neapmokėtų VPĮFS arba VPĮFS, kurių terminas yra suėjęs arba dėl kurių likus ne daugiau nei vieniems metams iki prašymo pateikimo datos buvo pateikti pranešimai su veiksmų rūšimis „Klaida“, „Nutraukimas / pirmalaikis nutraukimas“ ar „Pozicijos komponentas“, kaip nurodyta Duomenų teikimo TĮS I priedo 2 lentelės 98 lauke, duomenų: ne vėliau nei 12:00 val. suderintuoju pasauliniu laiku (UCT) pirmąją kalendorinę dieną po dienos, kurią buvo pateiktas prašymas dėl prieigos;
- b. kai prašoma suteikti prieigą prie VPĮFS, kurių terminas yra suėjęs arba dėl kurių likus daugiau nei vieniems metams iki prašymo pateikimo datos buvo pateikti pranešimai su veiksmų rūšimis „Klaida“, „Nutraukimas / pirmalaikis nutraukimas“ ar „Pozicijos komponentas“, kaip nurodyta Duomenų teikimo TĮS I priedo 2 lentelės 98 lauke, duomenų: ne vėliau nei per tris darbo dienas po prašymo suteikti prieigą pateikimo;
- c. kai prašoma suteikti prieigą prie VPĮFS duomenų, patenkančių į a ir b punktus: ne vėliau nei per tris darbo dienas po prašymo suteikti prieigą pateikimo.

471. Jeigu duomenų užklausa pateikta likus mažiau nei vienai dienai iki pirmosios vykdymo datos, pirmąjį vykdymą galima atidėti iki kitos vykdymo dienos, atsižvelgiant į užklaustos parametrus.

472. Jeigu užklauskos nepavyksta įvykdyti dėl techninių priežasčių, SDS išsiunčia į ESMA sistemą pranešimą apie klaidą. Pranešime apie klaidą reikėtų aprašyti įvykusios klaidos rūšį.
473. Atsakydama į kiekvieną duomenų užklausą SDS parengia atsakymo rinkmeną, kurioje pateikiami duomenys apie visus vertybinių popierių įsigijimo finansavimo sandorius, atitinkančius valdžios institucijos nustatytus paieškos kriterijus:
- ad hoc* užklauskos atveju sukuriama vienkartinio atsakymo rinkmena (viena atsakymo rinkmena vienai užklausiai);
 - pasikartojančios užklauskos atveju atsakymų rinkmenos sukuriamos reguliariai, atsižvelgiant į valdžios institucijos nustatytą dažnį.
474. SDS turėtų leisti VPĮFSR 12 straipsnio 2 dalyje išvardytiems subjektams nustatyti prieigos prie duomenų dažnį ne tik kasdien. Nustatydamos didžiausią pasikartojančios užklauskos vykdymo laikotarpį, SDS turėtų atsižvelgti į VPĮFSR 12 straipsnio 2 dalyje išvardytų subjektų poreikius ir apriboti jų sistemų veikimui kylančią riziką.
475. Prieigos prie duomenų TRS 5 straipsnyje nenurodyti laikotarpiai, kurių SDS turėtų laikytis, kai atlieka planinę techninę priežiūrą, darančią poveikį SDS paslaugoms, susijusioms su valdžios institucijų prieiga prie duomenų, neatsižvelgiant į naudojamą kanalą ar formatą.
476. SDS turėtų kruopščiai planuoti planinę techninę priežiūrą, darančią poveikį SDS paslaugoms, susijusioms su valdžios institucijų prieiga prie duomenų, kad ji nesutaptų su darbo dienomis, nustatytomis pagal Sąjungoje nuosekliai derinamą kalendorių, kaip antai „Target2“. Jeigu išskirtinėmis aplinkybėmis ji sutampa su tokia darbo diena, planinė techninė priežiūra turėtų būti vykdoma ne įprastomis darbo valandomis, t. y. labai anksti ryte arba labai vėlai vakare. SDS turėtų užtikrinti, kad tokia planinė techninė priežiūra nebūtų vykdoma taip, kad valdžios institucijos negalėtų laiku gauti informacijos apie išvestines finansines priemones.
477. SDS turėtų pranešti elektroninėmis priemonėmis visoms valdžios institucijoms apie planinės techninės priežiūros darbų pradžios ir pabaigos datą ir laiką.
478. Jeigu SDS vykdo metinį planinės techninės priežiūros darbų, darančių poveikį SDS paslaugoms, susijusioms su valdžios institucijų prieiga prie duomenų, planavimą, SDS turėtų kasmet pranešti apie tokį planavimą visoms valdžios institucijoms bent prieš tris darbo dienas. Be to, reikėtų kuo anksčiau ir likus bent trimis darbo dienoms iki planinės techninės priežiūros, darančios poveikį SDS paslaugoms, susijusioms su valdžios institucijų prieiga prie duomenų, pradžios datos teikti konkrečius papildomus pranešimus apie planinę techninę priežiūrą, darančią poveikį SDS paslaugoms, susijusioms su valdžios institucijų prieiga prie duomenų, apie kurią nėra pranešama kasmet.
479. SDS turėtų registruoti visus svarbius pranešimus, kad ESMA prašymu juos būtų galima jai pateikti. Planinės techninės priežiūros pranešimų įrašuose reikėtų nurodyti bent šią informaciją: pranešimo laiko žymą, planinės techninės priežiūros, darančios poveikį SDS paslaugoms, susijusioms su valdžios institucijų prieiga prie duomenų, pradžios ir pabaigos laiko žymą ir atitinkamą naudotojų, kuriems pateikti pranešimai, sąrašą.
480. Tikrindamos prašymus pagal Prieigos prie duomenų TRS 5 straipsnio 5 dalį, SDS turėtų patvirtinti prašymų dėl prieigos prie duomenų gavimą ir patikrinti jų teisingumą ir išsamumą kuo anksčiau ir ne vėliau nei per šešiasdešimt minučių po atitinkamų planinės techninės

priežiūros darbų, darančių poveikį SDS paslaugoms, susijusioms su valdžios institucijų prieiga prie duomenų, pabaigos.

481. Jeigu prieiga prie duomenų suteikiama pagal Prieigos prie duomenų TRS 5 straipsnio 4 dalies a punktą, SDS turėtų siekti įvykdyti prašymą kuo anksčiau ir ne vėliau nei 12:00 val. suderintuoju pasauliniu laiku (UCT) pirmąją kalendorinę dieną po dienos, kurią buvo užbaigti planinės techninės priežiūros darbai, darantys poveikį SDS paslaugoms, susijusioms su valdžios institucijų prieiga prie duomenų. 5 straipsnio 4 dalies b ir c punktuose nustatyti laiko terminai lieka nepakitę.
482. Neplaninės techninės priežiūros atveju SDS turėtų laikytis Prieigos prie duomenų TRS 5 straipsnio 4 ir 5 dalyse nurodytų laiko terminų, į kuriuos taip pat atsižvelgiama vertinant, ar SDS laikosi reikalavimų. SDS turėtų pranešti ESMA apie neplaninę techninę priežiūrą laikydamosi savo procedūrų.
483. SDS rengia išvesties duomenų rinkmenas ISO 20022 XML formatu. Išvesties duomenų rinkmenose turėtų būti pateikiamas VPIFS duomenų poaibis, susijęs tik su valdžios institucijos teisiniais įgaliojimais, kaip numatyta Prieigos prie duomenų TRS 1 ir 2 straipsniuose.
484. Išvesties duomenų rinkmenose pateikiama sandorių duomenų poaibis, atitinkantis duomenų užklausoje nustatytus kriterijus. Kai atsakant į užklausą rasta daug įrašų, atsakymas pateikiamas sukuriant daug rinkmenų.
485. Kiekvieno prekybos sandorio išvesties duomenų rinkmena aprėpia visus TRS ir TJS nurodytus laukus, kurių duomenis SDS pateikė sandorio šalys. Duomenų užklausos kriterijais reikėtų riboti tik užklausos parametrų (laukų, dėl kurių galima teikti užklausą) skaičių ir atitinkamai į išvesties duomenų rinkmeną įtraukiamų įrašų skaičių, bet ne kiekvieno prekybos sandorio informacijos aprėptį (t. y. prekybos sandorio laukų skaičių).
486. Jeigu vykdant užklausą pagal ją nerasta jokių sandorių, SDS turėtų išsiųsti atitinkamą grįžtamosios informacijos pranešimą.