

SFTR

Bakgrund och information om SFTR (Securities Financing Transactions Regulation) för kunder och motparter till Swedbank.

Bakgrund

EUROPAPARLAMENTETS OCH RÅDETS FÖRORDNING (EU) 2015/2365 om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering och om återanvändning (SFTR) syftar till att öka transparens och regulatorisk överblickbarhet avseende transaktioner för värdepappersfinansiering, i huvudsak repor och värdepapperslån. Förordningen är i grunden ett regelverk för transaktionsrapportering och föreskriver att alla transaktioner för värdepappersfinansiering ska rapporteras till ett godkänt s k transaktionsregister.

Vem påverkas och vad ska rapporteras?

Under SFTR-förordningen åläggs parterna i en lånetransaktion med värdepapper att rapportera handelsinformation till godkända transaktionsregister. Dessutom bör parter i transaktionen också rapportera säkerhets- och värderingsuppgifter dagligen så länge transaktionen är öppen.

Rapporteringsskyldighet enligt SFTR gäller för:

- repor och omvända repor;
- köp & återförsäljningstransaktioner;
- utlåning och upplåning av värdepapper & råvaror;
- återanvändning av säkerheter;
- marginalutlåning.

Alla rapporter ska skickas till ett godkänt transaktionsregister på handelsdagen (T) +1. Från och med när de specifika parternas rapporteringsskyldighet träder i kraft gäller följande:

- För finansiella motparter (FC) värdepappersföretag, kreditinstitut, centrala värdepappersförvarare (CSD), centrala clearing motparter (CCP), UCIT, AIF och försäkringsbolag gäller redan rapporteringsskyldigheten.
- Alla motparter som inte är FC, betraktas som icke-finansiella motparter (NFC). Rapporteringsskyldigheten för NFC träder i kraft den 11 januari 2021.

Delegerad rapportering

Under SFTR kan en part delegera rapporteringen till sin motpart, vilket innebär att endast en part genererar rapporterna för båda parter i en transaktion. Detta kallas delegerad rapportering och tillhandahålls som en tjänst från Swedbank från april 2020.

För att få veta mer om bankens delegerade rapporteringslösning, vänligen kontakta er kundansvarige eller rapporteringsteamet för SFTR - SFTR.reporting@swedbank.se

Obligatorisk delegerad rapportering

För en NFC som anses vara en liten NFC, kommer FC-motparten i transaktionen att vara skyldig att rapportera transaktionen på uppdrag av denna mindre NFC. Detta kallas för obligatorisk delegerad rapportering. En liten NFC är en som inte överskrider gränserna för minst två av följande tre kriterier:

- Balansomslutning på 20 miljoner euro
- Nettoomsättning på 40 miljoner euro
- Genomsnittligt antal 250 anställda under räkenskapsåret

Övrig relaterad information

UTI

En unik transaktionsidentifierare (UTI) måste tilldelas varje transaktion och inkluderas i rapporten till ett Trade Repository. Swedbank har möjlighet att tillhandahålla UTI-generation via vår rapporteringslösning.

LEI

Från april 2020 är globala juridiska entitetsidentifierare (LEI) obligatorisk om du som kund vill göra en värdepappersfinansierad transaktion. Utan LEI är det inte möjligt att rapportera transaktioner till myndigheterna i enlighet med SFTR.

Transaktionsregister (TR)

Det finns flera transaktionsregister på marknaden som har godkänts av myndigheterna som transaktionsregister enligt SFTR. Swedbank kommer att rapportera alla transaktioner och rapporter till Regis TR. Swedbank kan dock erbjuda att rapportera delegerade affärer till DTCC, när Swedbank rapporterar transaktioner på uppdrag av kunder i frivillig delegerad rapportering. Vid obligatorisk delegerad rapportering kommer transaktionerna att rapporteras till Regis TR.

Format

Alla uppgifter som skickas till TR kommer att använda ISO20022-standarden för transaktionsregistrering.