

KOMMISSIONENS GENNEMFØRELSESFORORDNING (EU) 2017/105**af 19. oktober 2016**

om ændring af gennemførelsesforordning (EU) nr. 1247/2012 om gennemførelsesmæssige tekniske standarder for formatet for og hyppigheden af handelsindberetninger til transaktionsregistre i henhold til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 648/2012 om OTC-derivater, centrale modparter og transaktionsregistre

(EØS-relevant tekst)

EUROPA-KOMMISSIONEN HAR —

under henvisning til traktaten om Den Europæiske Unions funktionsmåde,

under henvisning til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 648/2012 af 4. juli 2012 om OTC-derivater, centrale modparter og transaktionsregistre ⁽¹⁾, særlig artikel 9, stk. 6, og

ud fra følgende betragtninger:

- (1) I henhold til Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) nr. 1247/2012 ⁽²⁾ skal der anvendes foreløbige enhedsidentifikatorer, hvis der ikke findes en identifikator for juridiske enheder. En infrastruktur, som gør det muligt at tildele identifikatorer for juridiske enheder til enheder, er for nylig blevet tilgængelig, og markedsdeltagerne er blevet vant til at anvende sådanne identifikatorer for juridiske enheder. Derfor bør identifikatorer for juridiske enheder nu være det eneste middel, der er tilladt med henblik på at identificere juridiske enheder.
- (2) Det er særdeles vanskeligt at fastlægge, om den indberettende modpart er køber eller sælger i en aftale i forbindelse med swaptaler, da sådanne aftaler indebærer udveksling af finansielle instrumenter mellem parterne. Derfor bør der indføres særlige bestemmelser med henblik på at sikre, at det nøjagtigt og konsekvent fastlægges, hvem der er købere, og hvem der er sælgere i swaptaler.
- (3) De kompetente myndigheder har med henblik på at fastlægge modparternes reelle eksponeringer brug for fuldstændige og nøjagtige oplysninger om den sikkerhedsstillelse, som de pågældende parter har udvekslet. Der bør derfor fastsættes særlige bestemmelser, som sikrer en konsekvent tilgang til indberetning af sikkerhedsstillelse for en given derivataftale eller portefølje.
- (4) Nøjagtig klassificering og præcis identifikation af derivater er af afgørende betydning for effektiv anvendelse af data og meningsfuld dataaggregering på tværs af transaktionsregistre og bidrager derfor til de målsætninger, som Rådet for Finansiell Stabilitet fastsatte i Feasibility Study on Aggregation of OTC Derivatives Trade Repository Data ⁽³⁾, der blev offentliggjort den 19. september 2014. Indberetningskravene vedrørende klassificering og identifikation af derivater bør derfor ændres, således at disse oplysninger er til rådighed for de kompetente myndigheder i deres helhed.
- (5) For at tage højde for indberetning af nye typer derivataftaler, der nu som følge af finansielle nyskabelser er til rådighed og handles med jævne mellemrum, bør swaptioner og spreadbets tilføjes til listen over kategorier af derivataftaler. Da der som led i de igangværende finansielle nyskabelser fremkommer nye typer derivataftaler, er det mere generelt vigtigt at sikre, at alle nye typer derivataftaler, som ikke er omfattet af en eksisterende klassificering, alligevel kan indberettes. Derfor bør kategorien »andet« i klassificeringen af typer derivataftaler bibeholdes.
- (6) Hvis to modparter ikke kan nå til enighed om, hvem af dem der bør generere en entydig transaktionsidentifikator inden for den givne indberetningsfrist, kan de to indberetninger vedrørende den samme transaktion muligvis ikke identificeres og sættes i forbindelse med hinanden på korrekt vis. Det er derfor nødvendigt at fastlægge kriterier for generering af entydige transaktionsidentifikatorer med henblik på at forhindre, at den samme transaktion tælles med to gange.

⁽¹⁾ EUT L 201 af 27.7.2012, s. 1.

⁽²⁾ Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) nr. 1247/2012 af 19. december 2012 om gennemførelsesmæssige tekniske standarder for formatet for og hyppigheden af handelsindberetninger til transaktionsregistre i henhold til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 648/2012 om OTC-derivater, centrale modparter og transaktionsregistre (EUT L 352 af 21.12.2012, s. 20).

⁽³⁾ http://www.fsb.org/wp-content/uploads/r_140919.pdf.

- (7) Modparter vil muligvis finde det særdeles vanskeligt at indhente alle de relevante oplysninger om transaktioner, som blev afsluttet før startdatoen for indberetning. I betragtning af de deraf følgende vanskeligheder med at indberette afsluttede transaktioner og det forhold, at sådanne transaktioner ikke øger den systemiske risiko, bør fristen for indberetning af afsluttede transaktioner forlænges fra 3 til 5 år fra startdatoen for indberetning.
- (8) For at sikre fuldstændig harmonisering af de data, der indberettes til transaktionsregistre, og derfor muliggøre konsekvent tolkning og aggregering heraf bør de standarder og formater, der skal anvendes i indberetninger af transaktioner, præciseres nærmere. Indberetningskravene vedrørende dataformater bør også ændres. Modparter og transaktionsregistre bør derfor indrømmes tilstrækkelig tid til at træffe alle nødvendige foranstaltninger med henblik på at efterkomme de ændrede krav.
- (9) Gennemførelsesforordning (EU) nr. 1247/2012 bør derfor ændres.
- (10) Denne forordning er baseret på det udkast til gennemførelsesmæssige tekniske standarder, som Den Europæiske Værdipapir- og Markedstilsynsmyndighed (ESMA) har forelagt Kommissionen.
- (11) I overensstemmelse med artikel 15 i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 1095/2010 ⁽¹⁾ har ESMA foretaget åbne offentlige høringer om udkastet til gennemførelsesmæssige tekniske standarder, analyseret de potentielle omkostninger og fordele i forbindelse hermed samt anmodet interessentgruppen for værdipapirer og markeder, der er nedsat i henhold til artikel 37 i nævnte forordning, om en udtalelse —

VEDTAGET DENNE FORORDNING:

Artikel 1

I gennemførelsesforordning (EU) nr. 1247/2012 foretages følgende ændringer:

- 1) Artikel 3 affattes således:

»Artikel 3

Identifikation af modparter og andre enheder

I indberetninger skal der anvendes en identifikator for juridiske enheder (legal entity identifier) til identifikation af:

- a) en berettiget modtager, der er en juridisk person
- b) en mæglerenhed
- c) en central modpart (CCP)
- d) et clearingmedlem
- e) en modpart, der er en juridisk person
- f) en enhed, der indgiver oplysninger.«

- 2) Som artikel 3a og 3b indsættes:

»Artikel 3a

Modpartsside

- 1. Den i felt 14 i bilagets tabel 1 omhandlede modpartsside til derivataftalen skal fastlægges i overensstemmelse med stk. 2-10.
- 2. I tilfælde af optioner og swaptioner identificeres den modpart, der har retten til at udnytte optionen, som køber, og den modpart, der sælger optionen og modtager en præmie, som sælger.

⁽¹⁾ Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 1095/2010 af 24. november 2010 om oprettelse af en europæisk tilsynsmyndighed (Den Europæiske Værdipapir- og Markedstilsynsmyndighed), om ændring af afgørelse nr. 716/2009/EF og om ophævelse af Kommissionens afgørelse 2009/77/EF (EUT L 331 af 15.12.2010, s. 84).

3. I tilfælde af futures og forwards, der ikke vedrører valutaer, identificeres den modpart, der køber instrumentet, som køber, og den modpart, der sælger instrumentet, som sælger.
4. I tilfælde af swaps, der vedrører værdipapirer, identificeres den modpart, der bærer risikoen ved prisudsving i det underliggende værdipapir og modtager sikkerhedsbeløbet, som køber, og den modpart, der betaler sikkerhedsbeløbet, som sælger.
5. I tilfælde af swaps, der vedrører renter eller inflationsindeks, identificeres den modpart, der betaler den faste rente, som køber, og den modpart, der modtager den faste rente, som sælger. I tilfælde af basiswaps identificeres den modpart, der betaler spread, som køber, og den modpart, der modtager spread, som sælger.
6. I tilfælde af cross-currency swaps og swaps og forwards, der vedrører valutaer, identificeres den modpart, der modtager den valuta, der står først i alfabetisk rækkefølge efter International Organization for Standardization ISO 4217-standarden, som køber, og den modpart, der leverer den pågældende valuta, som sælger.
7. I tilfælde af swaps, der vedrører udbytte, identificeres den modpart, der modtager de tilsvarende faktiske udbytteudbetalinger, som køber, og den modpart, der betaler udbyttet og modtager den faste rente, som sælger.
8. I tilfælde af derivatinstrumenter til overførsel af kreditrisiko, bortset fra optioner og swaptioner, identificeres den modpart, der køber beskyttelsen som køber, og den modpart, der sælger beskyttelsen, som sælger.
9. I tilfælde af derivataftaler, der vedrører råvarer, identificeres den modpart, der modtager den i indberetningen specificerede råvare, som køber, og den modpart, der leverer råvaren, som sælger.
10. I tilfælde af fremtidige renteaftaler (forward rate agreements) identificeres den modpart, der betaler den faste rente, som køber, og den modpart, der modtager den faste rente, som sælger.

Artikel 3b

Sikkerhedsstillelse

1. Den i felt 21 i bilagets tabel 1 omhandlede type sikkerhedsstillelse for derivataftalen skal identificeres af den indberettende modpart i overensstemmelse med stk. 2-5.
2. Hvis der ikke findes en aftale om sikkerhedsstillelse mellem modparterne, eller hvis det i aftalen om sikkerhedsstillelse mellem modparterne hedder, at den indberettende modpart hverken stiller initialmargin eller variationsmargin i forhold til derivataftalen, identificeres sikkerhedsstillelsen for derivataftalen som sikkerhedsstillelse af typen ingen sikkerhedsstillelse.
3. Hvis det i aftalen om sikkerhedsstillelse mellem modparterne hedder, at den indberettende modpart kun regelmæssigt stiller variationsmargin i forhold til derivataftalen, identificeres sikkerhedsstillelsen for derivataftalen som sikkerhedsstillelse af typen delvis sikkerhedsstillelse.
4. Hvis det i aftalen om sikkerhedsstillelse mellem modparterne hedder, at den indberettende modpart stiller initialmargin og regelmæssigt variationsmargin, og at den anden modpart enten kun stiller variationsmargin eller ikke stiller nogen margin i forhold til derivataftalen, identificeres sikkerhedsstillelsen for derivataftalen som sikkerhedsstillelse af typen envejsikkerhedsstillelse.
5. Hvis det i aftalen om sikkerhedsstillelse mellem modparterne hedder, at begge modparter stiller initialmargin og regelmæssigt variationsmargin i forhold til derivataftalen, identificeres sikkerhedsstillelsen for derivataftalen som sikkerhedsstillelse af typen fuld sikkerhedsstillelse.«

3) Artikel 4 affattes således:

»Artikel 4

Angivelse, identifikation og klassificering af derivater

1. I indberetninger skal et derivat angives på grundlag af aftaletype og aktivklasse i overensstemmelse med stk. 2 og 3.
2. Derivatet skal angives i felt 1 i bilagets tabel 2 som en af følgende aftaletyper:
 - a) finansiel differencekontrakt
 - b) fremtidig renteaftale (forward rate agreement)
 - c) forward
 - d) future
 - e) option
 - f) spreadbet
 - g) swap
 - h) swaption
 - i) andet.
3. Derivatet skal angives i felt 2 i bilagets tabel 2 som en af følgende aktivklasser:
 - a) råvarer og emissionskvoter
 - b) lån
 - c) valuta
 - d) aktier
 - e) rentesats.
4. Hvis derivater ikke tilhører en af de aktivklasser, der er angivet i stk. 3, skal modparterne i indberetningen angive den aktivklasse, som ligner derivatet mest. Begge modparter skal angive den samme aktivklasse.
5. Derivatet skal identificeres i felt 6 i bilagets tabel 2 ved hjælp af følgende koder, hvis de findes:
 - a) en kode i henhold til ISO 6166 International Securities Identification Number (ISIN) eller en kode i henhold til Alternative Instrument Identifier (AII) indtil anvendelsesdatoen for den delegerede retsakt, vedtaget af Kommissionen i henhold til artikel 27, stk. 3, i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 600/2014 (*)
 - b) en ISIN-kode fra anvendelsesdatoen for den delegerede retsakt, vedtaget af Kommissionen i henhold til artikel 27, stk. 3, i forordning (EU) nr. 600/2014.Hvis der anvendes en AII-kode, skal den fuldstændige AII-kode anvendes.
6. Den i stk. 5 omhandlede fuldstændige AII-kode skal være resultatet af en sammenkædning af følgende seks elementer:
 - a) kode i henhold til ISO 10383 Market Identifier Codes (MIC) for den markedsplads, hvor derivatet handles, angivet med anvendelse af 4 alfanumeriske tegn
 - b) kode, tildelt af markedspladsen, som entydigt er knyttet til et bestemt underliggende instrument og en bestemt afviklingstype og andre kendetegn ved aftalen, angivet med anvendelse af op til 12 alfanumeriske tegn

- c) et enkelt bogstav, som viser, om instrumentet er en option eller en future, angivet som »O«, hvis det er en option, og som »F«, hvis det er en future
- d) et enkelt bogstav, som viser, om instrumentet er en put- eller call-option, angivet som »P«, hvis det er en put-option, og som »C«, hvis det er en call-option; hvis instrumentet er blevet identificeret som en future i overensstemmelse med litra c), angives det som »F«
- e) gennemførelsesdato eller udløbsdato for en derivataftale angivet i ISO 8601-standardens ÅÅÅÅ-MM-DD-format
- f) strikeprisen for en option, angivet ved anvendelse af op til 19 tegn, herunder op til fem decimaler uden foranstillede eller efterstillede nuller. Som decimaltegn anvendes et punktum. Negative værdier er ikke tilladt. Hvis instrumentet er en future, skal strikeprisen angives med nul.

7. Derivatet skal klassificeres i felt 4 i bilagets tabel 2 ved anvendelse af en kode i henhold til ISO 10692 Classification of Financial Instruments (CFI) for produkter, der er identificeret ved hjælp af en kode i henhold til ISO 6166 ISIN eller en AII-kode.

8. Derivater, for hvilke der ikke findes en kode i henhold til ISO 6166 ISIN eller en AII-kode, skal klassificeres ved hjælp af en tildelt kode. Den pågældende kode skal være:

- a) entydig
- b) neutral
- c) pålidelig
- d) open source
- e) skalerbar
- f) tilgængelig
- g) til rådighed med et rimeligt omkostningsgrundlag
- h) omfattet af en passende forvaltningsramme.

9. Indtil ESMA har godkendt den i stk. 8 omhandlede kode, skal derivater, for hvilke der ikke findes en kode i henhold til ISO 6166 ISIN eller en AII-kode, klassificeres ved anvendelse af en kode i henhold til ISO 10692 CFI.

(*) Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 600/2014 af 15. maj 2014 om markeder for finansielle instrumenter og om ændring af forordning (EU) nr. 648/2012 (EUT L 173 af 12.6.2014, s. 84).«

4) Som artikel 4a og 4b indsættes:

»Artikel 4a

Entydig transaktionsidentifikator

1. Indberetninger skal identificeres enten ved hjælp af en global entydig transaktionsidentifikator godkendt af ESMA eller i mangel af en sådan ved hjælp af en entydig transaktionsidentifikator, som modparterne er enige om.

2. Hvis modparterne ikke er enige om, hvilken enhed der er ansvarlig for at generere den entydige transaktionsidentifikator, som skal knyttes til indberetningen, skal modparterne fastlægge, hvilken enhed der er ansvarlig for at generere en entydig transaktionsidentifikator, i overensstemmelse med følgende:

- a) for centralt gennemførte og clearede transaktioner skal den entydige transaktionsidentifikator genereres i forbindelse med clearing, nærmere bestemt af den centrale modpart (CCP) for clearingmedlemmet. Clearingmedlemmet skal generere en anden entydig transaktionsidentifikator for sin modpart
- b) for centralt gennemførte, men ikke centralt clearede transaktioner skal den entydige transaktionsidentifikator genereres af handelsstedet for dettes medlem

- c) for centralt bekræftede og clearede transaktioner skal den entydige transaktionsidentifikator genereres i forbindelse med clearing, nærmere bestemt af den centrale modpart (CCP) for clearingmedlemmet. Clearingmedlemmet skal generere en anden entydig transaktionsidentifikator for sin modpart
 - d) for transaktioner, der bekræftes centralt ved hjælp af elektroniske midler, men som ikke cleares centralt, skal den entydige transaktionsidentifikator genereres af den platform, hvor transaktionerne bekræftes, i forbindelse med bekræftelse
 - e) for alle andre transaktioner end de i litra a)-d) omhandlede gælder følgende:
 - i) hvis finansielle modparter handler med ikke-finansielle modparter, skal de finansielle modparter generere den entydige transaktionsidentifikator
 - ii) hvis ikke-finansielle modparter, som ligger over clearinggrænseværdien, handler med ikke-finansielle modparter, som ligger under clearinggrænseværdien, skal de ikke-finansielle modparter, som ligger over clearinggrænseværdien, generere den entydige transaktionsidentifikator
 - iii) for alle andre transaktioner end de i nr. i) og ii) omhandlede skal sælger generere den entydige transaktionsidentifikator.
3. Den modpart, som genererer den entydige transaktionsidentifikator, skal underrette den anden modpart om den pågældende entydige transaktionsidentifikator rettidigt, således at sidstnævnte kan opfylde sin indberetningsforpligtelse.

Artikel 4b

Handelssted

Derivataftalens handelssted angives i felt 15 i bilagets tabel 2 som følger:

- a) indtil anvendelsesdatoen for den delegerede retsakt, vedtaget af Kommissionen i henhold til artikel 27, stk. 3, i forordning (EU) nr. 600/2014:
 - i) for et handelssted inden for Unionen, ved hjælp af en kode i henhold til ISO 10383 Market Identifier Code (MIC) offentliggjort på ESMA's websted i det register, der er oprettet på grundlag af oplysninger indsendt af kompetente myndigheder i henhold til artikel 13, stk. 2, i Kommissionens forordning (EF) nr. 1287/2006 (*)
 - ii) for et handelssted uden for Unionen, ved hjælp af en kode i henhold til ISO 10383 MIC opført på den liste over MIC-koder, der føres og opdateres af ISO, og som er offentliggjort på ISO's websted
- b) fra anvendelsesdatoen for den delegerede retsakt, vedtaget af Kommissionen i henhold til artikel 27, stk. 3, i forordning (EU) nr. 600/2014, ved hjælp af en kode i henhold til ISO 10383 MIC

(*) Kommissionens forordning (EF) nr. 1287/2006 af 10. august 2006 om gennemførelse af Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2004/39/EF for så vidt angår registreringsforpligtelser for investeringsselskaber, indberetning af transaktioner, markedsgennemsigthed, optagelse af finansielle instrumenter til handel samt definitioner af begreber med henblik på nævnte direktiv (EUT L 241 af 2.9.2006, s. 1).«

5) Artikel 5, stk. 4, affattes således:

»4. Følgende derivataftaler, som ikke er udestående på startdatoen for indberetning af en bestemt derivatklasse, skal indberettes til et transaktionsregister inden fem år efter den pågældende dato:

- a) derivataftaler, som blev indgået før den 16. august 2012, og som stadig var udestående den 16. august 2012
- b) derivataftaler, som blev indgået den eller efter den 16. august 2012.«

6) Bilaget erstattes af teksten i bilaget til nærværende forordning.

Artikel 2

Denne forordning træder i kraft på tyvendedagen efter offentliggørelsen i *Den Europæiske Unions Tidende*.

Den anvendes fra den 1. november 2017, bortset fra artikel 1, nr. 5), som anvendes fra ikrafttrædelsesdatoen.

Denne forordning er bindende i alle enkeltheder og gælder umiddelbart i hver medlemsstat.

Udfærdiget i Bruxelles, den 19. oktober 2016.

På Kommissionens vegne

Jean-Claude JUNKER

Formand

BILAG

»BILAG

Tabel 1

Modpartsdata

	Felt	Format
	Aftalens parter	
1	Tidsstempel for indberetningen	Datoformat i henhold til ISO 8601 og klokkeslætsformat i henhold til Coordinated Universal Time (UTC), ÅÅÅÅ-MM-DDTt:mm:ssZ
2	ID for den indberettende modpart	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI), 20 alfanumeriske tegn..
3	ID-type for den anden modpart	»LEI« for kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) »CLC« for kundekode
4	Den anden modparts ID	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI), 20 alfanumeriske tegn. Kundekode (op til 50 alfanumeriske tegn)..
5	Den anden modparts land	Landekode i henhold til ISO 3166, 2 bogstaver
6	Den indberettende modparts branche	Taksonomi for finansielle modparter: A = livsforsikringsselskab, der er meddelt tilladelse i henhold til Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2009/138/EF ⁽¹⁾ C = kreditinstitut, der er meddelt tilladelse i henhold til Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2013/36/EU ⁽²⁾ F = investeringsselskab, der er meddelt tilladelse i henhold til Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2004/39/EF ⁽³⁾ I = forsikringsselskab, der er meddelt tilladelse i henhold til direktiv 2009/138/EF L = alternativ investeringsfond forvaltet af forvaltere af alternative investeringsfonde (FAIF'er), der er meddelt tilladelse eller registreret i henhold til Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2011/61/EU ⁽⁴⁾ O = arbejdsmarkedsrelateret pensionskasse som defineret i artikel 6, litra a), i Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2003/41/EF ⁽⁵⁾ R = genforsikringsselskab, der er meddelt tilladelse i henhold til direktiv 2009/138/EF U = institut for kollektiv investering i værdipapirer (investeringsinstitut) og dets administrationsselskab, godkendt i henhold til Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2009/65/EF ⁽⁶⁾ Taksonomi for ikke-finansielle modparter: Følgende kategorier svarer til hovedafdelingerne i den statistiske nomenklatur for økonomiske aktiviteter i Det Europæiske Fællesskab (NACE) som defineret i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EF) nr. 1893/2006 ⁽⁷⁾ 1 = Landbrug, jagt, skovbrug og fiskeri 2 = Råstofindvinding 3 = Fremstillingsvirksomhed 4 = El-, gas- og fjernvarmeforsyning

	Felt	Format
		5 = Vandforsyning, kloakvæsen, affaldshåndtering og rensning af jord og grundvand 6 = Byggeri og anlægsvirksomhed 7 = Engroshandel og detailhandel; reparation af motorkøretøjer og motorcykler 8 = Transport og godshåndtering 9 = Overnatningsfaciliteter og restaurationsvirksomhed 10 = Information og kommunikation 11 = Pengeinstitut- og finansvirksomhed, forsikring 12 = Fast ejendom 13 = Liberale, videnskabelige og tekniske tjenesteydelser 14 = Administrative tjenesteydelser og hjælpetjenester 15 = Offentlig forvaltning og forsvar; socialsikring 16 = Undervisning 17 = Sundhedsvæsen og sociale foranstaltninger 18 = Kultur, forlystelser og sport 19 = Andre serviceydelser 20 = Private husholdninger med ansat medhjælp; husholdningers produktion af varer og tjenesteydelser til eget brug i.a.n. 21 = Ekstraterritoriale organisationer og organer Hvis der indberettes mere end en enkelt aktivitet, angives koderne efter de tilsvarende aktiviteters relative betydning med en bindestreg (»-«) imellem. Udfyldes ikke i tilfælde af CCP'er og andre typer modpart, jf. artikel 1, stk. 5, i forordning (EU) nr. 648/2012
7	Type indberettende modpart	F = Finansiell modpart N = Ikke-finansiell modpart C = Central modpart O = andet
8	Mægler-ID	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI), 20 alfanumeriske tegn
9	ID for indberettende enhed	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI), 20 alfanumeriske tegn
10	ID for clearingmedlem	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI), 20 alfanumeriske tegn
11	ID-type for berettiget modtager	»LEI« for kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) »CLC« for kundekode
12	ID for berettiget modtager	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI), 20 alfanumeriske tegn, eller kundekode på op til 50 alfanumeriske tegn i tilfælde, hvor kunden ikke er berettiget til en LEI-kode

	Felt	Format
13	Handler i egenskab af	P = Principal A = Agent
14	Modpartsside	B = Køber S = Sælger Udfyldes i overensstemmelse med artikel 3a
15	Direkte tilknyttet forretningsmæssige aktiviteter eller likviditetsfinansiering	Y = ja N = nej
16	Clearinggrænseværdi	Y = Over tærsklen N = Under tærsklen
17	Aftalens værdi	Op til 20 numeriske tegn, inklusive decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum. Eventuelt negativt fortegn tæller ikke som et numerisk tegn
18	Valuta for værdien	ISO 4217-valutakode, bogstavkode bestående af 3 tegn
19	Tidsstempel for værdiansættelse	Datoformat i henhold til ISO 8601 og klokkeslætsformat i henhold til Coordinated Universal Time (UTC), ÅÅÅÅ-MM-DDTt:mm:ssZ
20	Værdiansættelsestype	M = Efter mark-to-market-princippet O = Mark-to-model-princippet C = CCP'ers værdiansættelse
21	Sikkerhedsstillelse	U = ingen sikkerhedsstillelse PC = delvis sikkerhedsstillelse OC = envejssikkerhedsstillelse FC = fuld sikkerhedsstillelse Udfyldes i overensstemmelse med artikel 3b
22	Sikkerhedsstillelse på porteføljebasis	Y = ja N = nej
23	Kode for sikkerhedsstillelse på porteføljebasis	Op til 52 alfanumeriske tegn, herunder fire særlige tegn: », — _.« Særlige tegn må ikke anvendes i begyndelsen og slutningen af koden. Der må ikke anvendes mellemrum
24	Stillet initialmargin	Op til 20 numeriske tegn, inklusive decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum
25	Valuta for den stillede initialmargin	ISO 4217-valutakode, bogstavkode bestående af 3 tegn

	Felt	Format
26	Stillet variationsmargin	Op til 20 numeriske tegn, inklusive decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum
27	Valuta for den stillede variationsmargin	ISO 4217-valutakode, bogstavkode bestående af 3 tegn
28	Modtaget initialmargin	Op til 20 numeriske tegn, inklusive decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum
29	Valuta for den modtagne initialmargin	ISO 4217-valutakode, bogstavkode bestående af 3 tegn
30	Modtaget variationsmargin	Op til 20 numeriske tegn, inklusive decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum
31	Valuta for den modtagne variationsmargin	ISO 4217-valutakode, bogstavkode bestående af 3 tegn
32	Overskydende stillet sikkerhed	Op til 20 numeriske tegn, inklusive decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum
33	Valuta for den overskydende stillede sikkerhed	ISO 4217-valutakode, bogstavkode bestående af 3 tegn
34	Overskydende modtaget sikkerhed	Op til 20 numeriske tegn, inklusive decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum
35	Valuta for den overskydende modtagne sikkerhed	ISO 4217-valutakode, bogstavkode bestående af 3 tegn

(¹) Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2009/138/EF af 25. november 2009 om adgang til og udøvelse af forsikrings- og genforsikringsvirksomhed (Solvens II) (EUT L 335 af 17.12.2009, s. 1).

(²) Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2013/36/EU af 26. juni 2013 om adgang til at udøve virksomhed som kreditinstitut og om tilsyn med kreditinstitutter og investeringsselskaber, om ændring af direktiv 2002/87/EF og om ophævelse af direktiv 2006/48/EF og 2006/49/EF (EUT L 176, 27.6.2013, s. 338).

(³) Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2004/39/EF af 21. april 2004 om markeder for finansielle instrumenter, om ændring af Rådets direktiv 85/611/EØF, og 93/6/EØF samt Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2000/12/EF og om ophævelse af Rådets direktiv 93/22/EØF (EUT L 145 af 30.4.2004, s. 1).

(⁴) Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2011/61/EU af 8. juni 2011 om forvaltere af alternative investeringsfonde og om ændring af direktiv 2003/41/EF og 2009/65/EF samt forordning (EF) nr. 1060/2009 og (EU) nr. 1095/2010 (EUT L 174 af 1.7.2011, s. 1).

(⁵) Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2003/41/EF af 3. juni 2003 om arbejdsmarkedsrelaterede pensionskassers aktiviteter og tilsynet hermed (EUT L 235 af 23.9.2003, s. 10).

(⁶) Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2009/65/EF af 13. juli 2009 om samordning af love og administrative bestemmelser om visse institutter for kollektiv investering i værdipapirer (investeringsinstitutter) (EUT L 302 af 17.11.2009, s. 32).

(⁷) Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EF) nr. 1893/2006 af 20. december 2006 om oprettelse af den statistiske nomenklatur for økonomiske aktiviteter NACE rev. 2 og om ændring af Rådets forordning (EØF) nr. 3037/90 og visse EF-forordninger om bestemte statistiske områder (EUT L 393 af 30.12.2006, p. 1).

Tabel 2

Fælles data

	Felt	Format	Berørte typer derivataftaler
	Afdeling 2a — aftaletype		Alle aftaler
1	Aftaletype	CD = Finansielle differencekontrakter FR = Fremtidige renteaftaler (forward rate agreements) FU = Futures FW = Forwards OP = Option SB = Spreadbet SW = Swap ST = Swaption OT = Andet	
2	Aktivklasse	CO = Råvarer og emissionskvoter CR = lån CU = valuta EQ = aktier IR = rentesats	
	Afdeling 2b — Aftaledata		Alle aftaler
3	Type produktklassifikation	C = CFI U = UPI	
4	Produktklassifikation	Kode i henhold til ISO 10692 CFI, bogstavkode bestående af 6 tegn Godkendt UPI	
5	Type produktidentifikation	Angiv den relevante identifikation: I = ISIN A = AII	
6	Produktidentifikation	For produktidentifikator type I: Kode i henhold til ISO 6166 ISIN, 12 alfanumeriske tegn For produktidentifikator type A: Fuldstændig AII-kode i overensstemmelse med artikel 4, stk. 8	

	Felt	Format	Berørte typer derivataftaler
7	Type identifikation af underliggende aktiv	I = ISIN A = AII U = UPI B = Kurv X = Indeks	
8	Identifikation af underliggende aktiv	For identifikation af underliggende aktiv type I: Kode i henhold til ISO 6166 ISIN, 12 alfanumeriske tegn For identifikation af underliggende aktiv type A: Fuldstændig AII-kode i overensstemmelse med artikel 4, stk. 8 For identifikation af underliggende aktiv type U: UPI For identifikation af underliggende aktiv type B: identifikation af alle de enkelte komponenter ved hjælp af ISO 6166 ISIN eller fuldstændig AII-kode i overensstemmelse med artikel 4, stk. 8. Identifikatorer for de enkelte komponenter adskilles med en tankestreg («-«). For identifikation af underliggende aktiv type X: kode i henhold til ISO 6166 ISIN, hvis en sådan foreligger, og ellers indeksets fulde navn som tildelt af indeksproducenten	
9	Notionel valuta 1	ISO 4217-valutakode, bogstavkode bestående af 3 tegn	
10	Notionel valuta 2	ISO 4217-valutakode, bogstavkode bestående af 3 tegn	
11	Leveringsvaluta	ISO 4217-valutakode, bogstavkode bestående af 3 tegn	
	Afdeling 2c — Nærmere oplysninger om transaktionen		Alle aftaler
12	Transaktions-ID	Indtil der foreligger en global entydig transaktionsidentifikator (UTI), op til 52 alfanumeriske tegn, herunder fire særlige tegn: », — _.« Særlige tegn må ikke anvendes i begyndelsen og slutningen af koden. Der må ikke anvendes mellemrum.	
13	Indberetningens referencenummer	Et alfanumerisk felt på op til 52 tegn	
14	Kompleks transaktionskomponent-ID	Et alfanumerisk felt på op til 35 tegn	
15	Handelssted	Kode i henhold til ISO 10383 Market Identifier Code (MIC), 4 alfanumeriske tegn, i overensstemmelse med artikel 4b	

	Felt	Format	Berørte typer derivataftaler
16	Komprimering	Y = aftalen skyldes komprimering N = aftalen skyldes ikke komprimering	
17	Pris/kurs	Op til 20 numeriske tegn, inklusive decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum. Eventuelt negativt fortegn tæller ikke som et numerisk tegn. Hvis prisen indberettes i procentværdier, angives den som en procent, hvor 100 % angives som »100«	
18	Prisnotering	U = Enheder P = Procent Y = Afkast	
19	Valuta for prisen	ISO 4217-valutakode, bogstavkode bestående af 3 tegn	
20	Notionel værdi	Op til 20 numeriske tegn, inklusive decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum. Eventuelt negativt fortegn tæller ikke som et numerisk tegn	
21	Prismultiplikator	Op til 20 numeriske tegn, inklusive decimaler Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum	
22	Mængde	Op til 20 numeriske tegn, inklusive decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum	
23	Forudbetaling	Op til 20 numeriske tegn, inklusive decimaler. Negativt fortegn anvendes til at angive, at betalingen er foretaget, men ikke modtaget. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum. Eventuelt negativt fortegn tæller ikke som et numerisk tegn	

	Felt	Format	Berørte typer derivataftaler
24	Leveringstype	C = Kontant P = Fysisk O = Valgfrit for modparten, eller hvis det afgøres af tredjepart	
25	Tidsstempel for gennemførelse	Datoformat i henhold til ISO 8601 og klokkeslætsformat i henhold til Coordinated Universal Time (UTC), ÅÅÅÅ-MM-DDTt:mm:ssZ	
26	Ikrafttrædelsesdato	ISO 8601-datoformat (ÅÅÅÅ-MM-DD)	
27	Udløbsdato	ISO 8601-datoformat (ÅÅÅÅ-MM-DD)	
28	Ophævelsesdato	ISO 8601-datoformat (ÅÅÅÅ-MM-DD)	
29	Afviklingsdato	ISO 8601-datoformat (ÅÅÅÅ-MM-DD)	
30	Masteraftaletype	Fritekst, felt op til 50 tegn, angivelse af navnet på masteraftalen, hvis en sådan anvendes.	
31	Masteraftaleversion	ISO 8601-datoformat (ÅÅÅÅ-MM-DD)	
	Afdeling 2d — Risikoreduktion/indberetning		Alle aftaler
32	Tidsstempel for bekræftelse	Datoformat i henhold til ISO 8601 og klokkeslætsformat i henhold til Coordinated Universal Time (UTC), ÅÅÅÅ-MM-DDTt:mm:ssZ	
33	Bekræftelsesmiddel	Y = Ikke-elektronisk bekræftelse N = Ingen bekræftelse E = Elektronisk bekræftelse	
	Afdeling 2e — Clearing		Alle aftaler
34	Clearingforpligtelse	Y = ja N = nej	
35	Clearet	Y = ja N = nej	
36	Tidsstempel for clearing	Datoformat i henhold til ISO 8601 og klokkeslætsformat i henhold til Coordinated Universal Time (UTC), ÅÅÅÅ-MM-DDTt:mm:ssZ	
37	CCP	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI), 20 alfanumeriske tegn	

	Felt	Format	Berørte typer derivataftaler
38	Koncernintern	Y = ja N = nej	
	Afdeling 2f — Rentesatser		Rentederivater
39	Fast rente for første ben	Op til 10 numeriske tegn, herunder decimaler, udtrykt som procent, hvor 100 % angives som »100«. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum. Eventuelt negativt fortegn tæller ikke som et numerisk tegn	
40	Fast rente for andet ben	Op til 10 numeriske tegn, herunder decimaler, udtrykt som procent, hvor 100 % angives som »100«. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum. Eventuelt negativt fortegn tæller ikke som et numerisk tegn	
41	Rentedagskonvention for den faste rente for første ben	Nævner/tæller, hvis både nævner og tæller er numeriske tegn, eller udtrykket »Actual«, f.eks. 30/360 eller Actual/365	
42	Rentedagskonvention for den faste rente for andet ben	Nævner/tæller, hvis både nævner og tæller er numeriske tegn, eller udtrykket »Actual«, f.eks. 30/360 eller Actual/365	
43	Betalingshyppighed for den faste rente for første ben — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne udveksler betalinger; følgende forkortelser anvendes: Y = År M = Måned W = Uge D = Dag	

	Felt	Format	Berørte typer derivataftaler
44	Betalingshyppighed for den faste rente for første ben — multiplikator	Hel multiplikator af en tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne udveksler betalinger. Op til 3 numeriske tegn	
45	Betalingshyppighed for den faste rente for andet ben — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne udveksler betalinger; følgende forkortelser anvendes: Y = År M = Måned W = Uge D = Dag	
46	Betalingshyppighed for den faste rente for andet ben — multiplikator	Hel multiplikator af en tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne udveksler betalinger. Op til 3 numeriske tegn	
47	Betalingshyppighed for den variable rente for første ben — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne udveksler betalinger; følgende forkortelser anvendes: Y = År M = Måned W = Uge D = Dag	
48	Betalingshyppighed for den variable rente for første ben — multiplikator	Hel multiplikator af en tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne udveksler betalinger Op til 3 numeriske tegn.	
49	Betalingshyppighed for den variable rente for andet ben — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne udveksler betalinger; følgende forkortelser anvendes: Y = År M = Måned W = Uge D = Dag	
50	Betalingshyppighed for den variable rente for andet ben — multiplikator	Hel multiplikator af en tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne udveksler betalinger. Op til 3 numeriske tegn	

	Felt	Format	Berørte typer derivataftaler
51	Hyppighed for genfastsættelse af den variable rente for første ben — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne genfastsætter den variable rente; følgende forkortelser anvendes: Y = År M = Måned W = Uge D = Dag	
52	Hyppighed for genfastsættelse af den variable rente for første ben — multiplikator	Hel multiplikator af en tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne genfastsætter den variable rente. Op til 3 numeriske tegn	
53	Hyppighed for genfastsættelse af den variable rente for andet ben — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne genfastsætter den variable rente; følgende forkortelser anvendes: Y = År M = Måned W = Uge D = Dag	
54	Hyppighed for genfastsættelse af den variable rente for andet ben — multiplikator	Hel multiplikator af en tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne genfastsætter den variable rente. Op til 3 numeriske tegn	
55	Variabel rente for første ben	Navnet på indekset for den variable rente »EONA« — EONIA »EONS« — EONIA SWAP »EURI« — EURIBOR »EUUS« — EURODOLLAR »EUCH« — EuroSwiss »GCFR« — GCF REPO »ISDA« — ISDAFIX »LIBI« — LIBID »LIBO« — LIBOR »MAAA« — Muni AAA »PFAN« — Pfandbriefe »TIBO« — TIBOR »STBO« — STIBOR »BBSW« — BBSW »JIBA« — JIBAR »BUBO« — BUBOR	

	Felt	Format	Berørte typer derivataftaler
		»CDOR« — CDOR »CIBO« — CIBOR »MOSP« — MOSPRIM »NIBO« — NIBOR »PRBO« — PRIBOR »TLBO« — TELBOR »WIBO« — WIBOR »TREA« — Treasury »SWAP« — SWAP »FUSW« — Future SWAP Eller op til 25 alfanumeriske tegn, hvis reference-satsen ikke er medtaget i overstående liste	
56	Referenceperiode for den variable rente for første ben — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver referenceperioden; følgende forkortelser anvendes: Y = År M = Måned W = Uge D = Dag	
57	Referenceperiode for den variable rente for første ben — multiplikator	Hel multiplikator af en tidsperiode, der beskriver referenceperioden. Op til 3 numeriske tegn	
58	Variabel rente for andet ben	Navnet på indekset for den variable rente »EONA« — EONIA »EONS« — EONIA SWAP »EURI« — EURIBOR »EUUS« — EURODOLLAR »EUCH« — EuroSwiss »GCFR« — GCF REPO »ISDA« — ISDAFIX »LIBI« — LIBID »LIBO« — LIBOR »MAAA« — Muni AAA »PFAN« — Pfandbriefe »TIBO« — TIBOR »STBO« — STIBOR »BBSW« — BBSW »JIBA« — JIBAR »BUBO« — BUBOR »CDOR« — CDOR »CIBO« — CIBOR »MOSP« — MOSPRIM	

	Felt	Format	Berørte typer derivataftaler
		»NIBO« — NIBOR »PRBO« — PRIBOR »TLBO« — TELBOR »WIBO« — WIBOR »TREA« — Treasury »SWAP« — SWAP »FUSW« — Future SWAP Eller op til 25 alfanumeriske tegn, hvis reference-satsen ikke er medtaget i overstående liste	
59	Referenceperiode for den variable rente for andet ben — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver referenceperioden; følgende forkortelser anvendes: Y = År M = Måned W = Uge D = Dag	
60	Referenceperiode for den variable rente for andet ben — multiplikator	Hel multiplikator af en tidsperiode, der beskriver referenceperioden. Op til 3 numeriske tegn	
	Afdeling 2g — Udenlandsk valuta		Valutaderivater
61	Leveringsvaluta 2	ISO 4217-valutakode, bogstavkode bestående af 3 tegn	
62	Valutakurs 1	Op til 10 numeriske tegn, herunder decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum. Eventuelt negativt fortegn tæller ikke som et numerisk tegn	
63	Terminskurs	Op til 10 numeriske tegn, inklusive decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum. Eventuelt negativt fortegn tæller ikke som et numerisk tegn	

	Felt	Format	Berørte typer derivataftaler
64	Valutakursgrundlag	To ISO 4217-valutakoder adskilt med skråstreg (»/«). Den første valutakode angiver basisvalutaen, og den anden noteringsvalutaen.	
	Afdeling 2h — Råvarer og emissionskvoter		Råvare- og emissionskvotederivater
	Generelt		
65	Overordnet råvarekategori	AG = Landbrug EN = Energi FR = Fragt ME = Metaller IN = Indeks EV = Miljø EX = Eksotisk OT = Andet	
66	Varebeskrivelse	Landbrug GO = Korn, olieholdige frø DA = Mejeriprodukter LI = Levende dyr FO = Skovbrugsprodukter SO = Softs SF = Fisk og skaldyr OT = Andet Energi OI = Olie NG = Naturgas CO = Kul EL = El IE = Flere energiformer OT = Andet Fragt DR = Tør WT = Våd OT = Andet Metaller PR = Ædelmetaller NP = Ikke-ædelmetaller Miljø WE = Vejr EM = Emissioner OT = Andet	

	Felt	Format	Berørte typer derivataftaler
	Energi		
67	Leveringssted eller -område	EIC-kode, 16 alfanumeriske tegn Gentages	
68	Forbindelsespunkt	EIC-kode, 16 alfanumeriske tegn	
69	Belastningstype	BL = Basisbelastning PL = Spidsbelastning OP = Uden for spidsbelastning BH = Time/Tidsblokke SH = Shaped GD = Gasdøgn OT = Andet	
	Gentages for felt 70-77		
70	Leveringsintervaller	tt:mmZ	
71	Dato og klokkeslæt for leveringsstart	Datoformat i henhold til ISO 8601 og klokkeslætsformat i henhold til Coordinated Universal Time (UTC), ÅÅÅÅ-MM-DDTt:mm:ssZ	
72	Dato og klokkeslæt for leveringsstop	Datoformat i henhold til ISO 8601 og klokkeslætsformat i henhold til Coordinated Universal Time (UTC), ÅÅÅÅ-MM-DDTt:mm:ssZ	
73	Varighed	N = Minutter H = Time D = Dag W = Uge M = Måned Q = Kvartal S = Sæson Y = Årlig O = Andet.	
74	Ugedage	WD = Hverdage WN = Weekend MO = Mandag TU = Tirsdag WE = Onsdag TH = Torsdag FR = Fredag SA = Lørdag SU = Søndag Det er tilladt at angive flere værdier adskilt med skråstreg (/)	

	Felt	Format	Berørte typer derivataftaler
75	Leveringskapacitet	Op til 20 numeriske tegn, herunder decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum. Eventuelt negativt fortegn tæller ikke som et numerisk tegn	
76	Antal enheder	KW KWh/h KWh/d MW MWh/h MWh/d GW GWh/h GWh/d Therm/d KTherm/d MTherm/d cm/d mcm/d	
77	Pris pr. mængde pr. leverings-tidsinterval	Op til 20 numeriske tegn, inklusive decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum. Eventuelt negativt fortegn tæller ikke som et numerisk tegn	
	Afdeling 2i- Optioner		Aftaler, hvori indgår en option
78	Optionsform	P = Put C = Call O = hvis det ikke kan fastslås, om der er tale om en call- eller put-option	
79	Optionens udnyttelsesmåde	A = amerikansk B = Bermuda- E = europæisk S = asiatisk Der kan angives mere end en enkelt værdi	

	Felt	Format	Berørte typer derivataftaler
80	Strikepris (renteloft/minimumsrentesats)	Op til 20 numeriske tegn, inklusive decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum. Eventuelt negativt fortegn tæller ikke som et numerisk tegn. Hvis strikeprisen indberettes i procentværdier, angives den som en procent, hvor 100 % angives som »100«	
81	Strikeprisnotering	U = Enheder P = Procent Y = Afkast	
82	Udløbsdato for det underliggende aktiv	ISO 8601-datoformat (ÅÅÅÅ-MM-DD)	
	Afdeling 2j — Kreditderivater		
83	Rang	SNDB = Prioriteret gæld, f.eks. Senior Unsecured Debt (Corporate/Financial), Foreign Currency Sovereign Debt (Government) SBOD = Efterstillet gæld, f.eks. Subordinated or Lower Tier 2 Debt (Banks), Junior Subordinated eller Upper Tier 2 Debt (Banks) OTHR = Andet, f.eks. præferenceaktier eller kernekapital (banker) eller andre kreditderivater	
84	Referenceenhed	Landekode i henhold til ISO 3166, 2 bogstaver eller Landekode i henhold til ISO 3166-2, 2 bogstaver, efterfulgt af en tankestreg (»«) og en subnational enhedskode på op til 3 alfanumeriske tegn eller Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI), 20 alfanumeriske tegn	
85	Betalingshyppighed	MNTH = Månedlig QURT = Kvartalsvis MIAN = Halvårlig YEAR = Årlig	
86	Beregningsgrundlag	Nævner/tæller, hvis både nævner og tæller er numeriske tegn, eller udtrykket »Actual«, f.eks. 30/360 eller Actual/365	

	Felt	Format	Berørte typer derivataftaler
87	Serie	Heltalsfelt på op til 5 tegn	
88	Version	Heltalsfelt på op til 5 tegn	
89	Indeksfaktor	Op til 10 numeriske tegn, inklusive decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum	
90	Tranche	T = Opdelt i trancher U = Ikke-opdelt i trancher	
91	Attachment point	Op til 10 numeriske tegn, herunder decimaler, udtrykt som en decimalbrøk mellem 0 og 1. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum	
92	Detachment point	Op til 10 numeriske tegn, herunder decimaler, udtrykt som en decimalbrøk mellem 0 og 1. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum	
	Afdeling 2k — Ændringer af aftalen		
93	Type handling	N = Ny M = Ændring E = Fejl C = Førtidig ophævelse R = Korrektion Z = Komprimering V = Værdiajourføring P = Positionskomponent	
94	Niveau	T = Transaktion P = Position«	