

DURCHFÜHRUNGSVERORDNUNG (EU) 2017/105 DER KOMMISSION**vom 19. Oktober 2016****zur Änderung der Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1247/2012 der Kommission zur Festlegung technischer Durchführungsstandards im Hinblick auf das Format und die Häufigkeit von Transaktionsmeldungen an Transaktionsregister gemäß der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister****(Text von Bedeutung für den EWR)**

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

gestützt auf die Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 4. Juli 2012 über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister ⁽¹⁾, insbesondere auf Artikel 9 Absatz 6,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) In der Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1247/2012 der Kommission ⁽²⁾ ist für den Fall, dass für eine juristische Person keine Kennziffer vorhanden ist, die Verwendung einer vorläufigen Kennziffer vorgesehen. Seit kurzem steht eine Infrastruktur für die Zuweisung von Kennziffern für juristische Personen zur Verfügung, und die Marktteilnehmer haben sich mit der Verwendung solcher Kennziffern vertraut gemacht. Daher sollte zur Identifikation von juristischen Personen nun ausschließlich die Kennziffer für die juristische Person verwendet werden können.
- (2) Die Feststellung, ob es sich bei einer meldenden Gegenpartei um den Käufer oder Verkäufer eines Kontrakts handelt, ist im Fall von Swapkontrakten eine besonders komplexe Herausforderung, da solche Kontrakte den Austausch von Finanzinstrumenten zwischen den Vertragsparteien beinhalten. Daher sollten besondere Bestimmungen festgelegt werden, um bei Swapkontrakten eine korrekte und kohärente Bestimmung von Käufer und Verkäufer zu gewährleisten.
- (3) Um die tatsächlichen Risikopositionen von Gegenparteien bestimmen zu können, benötigen die zuständigen Behörden vollständige und exakte Informationen über den Austausch von Sicherheiten zwischen den Gegenparteien. Deshalb sollten spezifische Vorschriften festgelegt werden, die eine kohärente Vorgehensweise für die Meldung der Besicherung auf Ebene des einzelnen Derivatkontrakts oder auf Portfolioebene gewährleisten.
- (4) Die genaue Klassifizierung und präzise Identifizierung von Derivaten ist von zentraler Bedeutung für eine effiziente Datennutzung und eine aussagekräftige Aggregation der Daten über Transaktionsregister hinweg und trägt daher zu den Zielen bei, die der Rat für Finanzstabilität in der am 19. September 2014 veröffentlichten Durchführbarkeitsstudie über die Aggregation von Daten der Transaktionsregister für OTC-Derivate ⁽³⁾ beschrieben hat. Die Meldepflichten bezüglich der Klassifizierung und Identifizierung von Derivaten sollten daher dahin gehend geändert werden, dass die betreffenden Informationen den zuständigen Behörden in vollem Umfang zur Verfügung gestellt werden.
- (5) Um neue Arten von Derivatkontrakten, die aus der Finanzinnovation entstehen und regelmäßig gehandelt werden, melden zu können, sollten Swaptions und Spreadbets in die Liste der Kategorien von Derivatkontrakten aufgenommen werden. Im weiteren Sinne ist es angesichts der kontinuierlichen Finanzinnovation und der daraus resultierenden neuen Arten von Derivatkontrakten wichtig, dafür zu sorgen, dass jegliche neue Arten von Derivatkontrakten, die nicht unter eine bestehende Klassifizierung fallen, gemeldet werden können. Daher ist es angebracht, bei der Klassifizierung der Arten von Derivatkontrakten die Kategorie „Sonstige“ beizubehalten.
- (6) Wenn sich zwei Gegenparteien nicht darauf einigen können, wer von ihnen innerhalb der zugeteilten Meldefrist die eindeutige Geschäftsabschluss-Kennziffer erstellen soll, sind die korrekte Identifizierung und Zuordnung der zwei Meldungen über ein und dieselbe Transaktion gegebenenfalls nicht möglich. Deshalb ist es notwendig, Kriterien für die Erstellung eindeutiger Geschäftsabschluss-Kennziffern festzulegen, um eine Doppelzählung derselben Transaktion zu verhindern.

⁽¹⁾ ABl. L 201 vom 27.7.2012, S. 1.

⁽²⁾ Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1247/2012 der Kommission vom 19. Dezember 2012 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards im Hinblick auf das Format und die Häufigkeit von Transaktionsmeldungen an Transaktionsregister gemäß der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister (ABl. L 352 vom 21.12.2012, S. 20).

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

- (7) Für Gegenparteien kann es mit erheblichen Schwierigkeiten verbunden sein, alle relevanten Informationen über Geschäfte, die vor Meldebeginn abgeschlossen wurden, zu erhalten. Angesichts der daraus resultierenden Komplexität der Meldung abgeschlossener Geschäfte und der Tatsache, dass diese Geschäfte nicht zu einer Erhöhung des Systemrisikos führen, sollte die Frist für die Meldung abgeschlossener Geschäfte von drei auf fünf Jahre ab Meldebeginn verlängert werden.
- (8) Um eine vollständige Harmonisierung der an die Transaktionsregister gemeldeten Daten sicherzustellen und somit eine einheitliche Auslegung und Aggregation dieser Daten zu ermöglichen, sollten die Standards und Formate für die Meldung von Geschäften präzisiert werden. Ferner ist es angebracht, die Meldepflichten im Hinblick auf die Datenformate anzupassen. Daher sollte Gegenparteien und Transaktionsregistern ausreichend Zeit gewährt werden, um alle zur Erfüllung der geänderten Anforderungen erforderlichen Maßnahmen zu ergreifen.
- (9) Die Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1247/2012 sollte daher entsprechend geändert werden.
- (10) Diese Verordnung basiert auf Entwürfen technischer Durchführungsstandards, die der Kommission von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) vorgelegt wurden.
- (11) Die ESMA hat im Einklang mit Artikel 15 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates⁽¹⁾ offene öffentliche Konsultationen zu diesen Entwürfen technischer Durchführungsstandards durchgeführt, die damit verbundenen potenziellen Kosten- und Nutzeneffekte analysiert und die Stellungnahme der nach Artikel 37 der genannten Verordnung eingesetzten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte eingeholt —

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

Artikel 1

Die Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1247/2012 wird wie folgt geändert:

- (1) Artikel 3 erhält folgende Fassung:

„Artikel 3

Identifikation von Gegenparteien und anderen juristischen Personen

Eine Kennziffer für die juristische Person wird in einer Meldung verwendet für:

- a) Begünstigte, bei denen es sich um juristische Personen handelt,
- b) Maklerfirmen,
- c) zentrale Gegenparteien,
- d) Clearingmitglieder,
- e) Gegenparteien, bei denen es sich um juristische Personen handelt,
- f) meldende Unternehmen.“

- (2) Die folgenden Artikel 3a und 3b werden eingefügt:

„Artikel 3a

Seite der Gegenpartei

1. Die in Tabelle 1 Feld 14 des Anhangs genannte Seite der Gegenpartei eines Derivatkontrakts wird gemäß den Absätzen 2 bis 10 bestimmt.
2. Bei Optionen und Swaptions wird die Gegenpartei, die das Recht auf Ausübung der Option innehat, als Käufer und die Gegenpartei, die die Option gegen eine Prämie verkauft, als Verkäufer angegeben.

⁽¹⁾ Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde), zur Änderung des Beschlusses Nr. 716/2009/EG und zur Aufhebung des Beschlusses 2009/77/EG der Kommission (ABl. L 331 vom 15.12.2010, S. 84).

3. Bei Futures und Forwards außer Futures und Forwards, die sich auf Währungen beziehen, wird die Gegenpartei, die das Instrument kauft, als Käufer und die Gegenpartei, die das Instrument verkauft, als Verkäufer angegeben.
4. Bei Swaps, die sich auf Wertpapiere beziehen, wird die Gegenpartei, die das Risiko einer Preisbewegung des zugrunde liegenden Wertpapiers übernimmt und den Wertpapierbetrag erhält, als Käufer und die Gegenpartei, die den Wertpapierbetrag zahlt, als Verkäufer angegeben.
5. Bei Swaps, die sich auf Zinssätze oder Inflationsindizes beziehen, wird die Gegenpartei, die den Festzins zahlt, als Käufer und die Gegenpartei, die den Festzins erhält, als Verkäufer angegeben. Bei Basiswaps wird die Gegenpartei, die den Spread zahlt, als Käufer und die Gegenpartei, die den Spread erhält, als Verkäufer angegeben.
6. Bei Währungsswaps sowie Swaps und Forwards, die sich auf Währungen beziehen, wird die Gegenpartei, die die Währung erhält, die bei einer alphabetischen Sortierung nach den ISO 4217-Codes der Internationalen Organisation für Normung an erster Stelle steht, als Käufer und die Gegenpartei, die diese Währung liefert, als Verkäufer angegeben.
7. Bei Swaps, die sich auf Dividenden beziehen, wird die Gegenpartei, die die äquivalenten tatsächlichen Dividendenzahlungen erhält, als Käufer und die Gegenpartei, die die Dividende zahlt und den Festzins erhält, als Verkäufer angegeben.
8. Bei derivativen Instrumenten zur Übertragung des Kreditrisikos mit Ausnahme von Optionen und Swaptions wird die Gegenpartei, die die Absicherung kauft, als Käufer und die Gegenpartei, die die Absicherung verkauft, als Verkäufer angegeben.
9. Bei Warenderivatkontrakten wird die Gegenpartei, die die in der Meldung genannte Ware erhält, als Käufer und die Gegenpartei, die die Ware liefert, als Verkäufer angegeben.
10. Bei Zinstermingeschäften (Forward Rate Agreements) wird die Gegenpartei, die den Festzins zahlt, als Käufer und die Gegenpartei, die den Festzins erhält, als Verkäufer angegeben.

Artikel 3b

Besicherung

1. Die Art der Besicherung des Derivatkontrakts gemäß Tabelle 1 Feld 21 des Anhangs wird von der meldenden Gegenpartei in Einklang mit den Absätzen 2 bis 5 angegeben.
2. Wenn die Gegenparteien keine Sicherungsvereinbarung geschlossen haben oder in der zwischen den Gegenparteien geschlossenen Sicherungsvereinbarung festgelegt ist, dass die meldende Gegenpartei in Bezug auf den Derivatkontrakt weder Ersteinschuss- noch Nachschusszahlungen hinterlegt, wird der Derivatkontrakt als unbesichert angegeben.
3. Ist in der zwischen den Gegenparteien geschlossenen Sicherungsvereinbarung festgelegt, dass die meldende Gegenpartei in Bezug auf den Derivatkontrakt lediglich regelmäßige Nachschusszahlungen hinterlegt, wird der Derivatkontrakt als teilweise besichert angegeben.
4. Ist in der zwischen den Gegenparteien geschlossenen Sicherungsvereinbarung festgelegt, dass die meldende Gegenpartei die Ersteinschusszahlung und regelmäßige Nachschusszahlungen hinterlegt und die andere Gegenpartei in Bezug auf den Derivatkontrakt entweder lediglich Nachschusszahlungen oder überhaupt keine Einschüsse hinterlegt, wird der Derivatkontrakt als einseitig besichert angegeben.
5. Ist in der zwischen den Gegenparteien geschlossenen Sicherungsvereinbarung festgelegt, dass beide Gegenparteien in Bezug auf den Derivatkontrakt Ersteinschusszahlungen und regelmäßige Nachschusszahlungen hinterlegen, wird der Derivatkontrakt als vollständig besichert angegeben.“

(3) Artikel 4 erhält folgende Fassung:

„Artikel 4

Spezifizierung, Identifizierung und Klassifizierung von Derivaten

1. In einer Meldung wird ein Derivat auf der Grundlage des Kontrakttyps und der Vermögensklasse gemäß den Absätzen 2 und 3 identifiziert.

2. Das Derivat wird in Tabelle 2 Feld 1 des Anhangs als einer der folgenden Kontrakttypen angegeben:

- a) finanzieller Differenzkontrakt,
- b) Zinstermingeschäft,
- c) außerbörslicher Finanzterminkontrakt (Forward),
- d) börsengehandelter Finanzterminkontrakt (Future),
- e) Option,
- f) Spreadbet,
- g) Swap,
- h) Tauschoption (Swaption),
- i) Sonstige.

3. Das Derivat wird in Tabelle 2 Feld 2 des Anhangs als einer der folgenden Vermögensklassen angegeben:

- a) Warenderivat und Emissionszertifikat,
- b) Kreditderivat,
- c) Währungsderivat,
- d) Aktienderivat,
- e) Zinsderivat.

4. Wenn ein Derivat unter keine der in Absatz 3 genannten Vermögensklassen fällt, so geben die Gegenparteien in der Meldung die Vermögensklasse an, die dem Derivat am ähnlichsten ist. Beide Gegenparteien geben die gleiche Vermögensklasse an.

5. Das Derivat wird in Tabelle 2 Feld 6 des Anhangs mittels folgender Angaben identifiziert, sofern verfügbar:

- a) bis zum Datum der Anwendung des von der Kommission gemäß Artikel 27 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates (*) verabschiedeten delegierten Rechtsakts eine internationale Wertpapierkennnummer (ISIN) nach ISO 6166 bzw. eine alternative Instrumentenkennziffer (AII);
- b) ab dem Datum der Anwendung des von der Kommission gemäß Artikel 27 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 verabschiedeten delegierten Rechtsakts eine ISIN.

Bei Verwendung eines AII-Codes ist der vollständige AII-Code anzugeben.

6. Der vollständige AII-Code gemäß Absatz 5 ergibt sich aus der Verkettung folgender sechs Elemente:

- a) Handelsplatz-Identifikationsnummer (MIC) nach ISO 10383 des Handelsplatzes, an dem das Derivat gehandelt wird, bestehend aus vier alphanumerischen Zeichen;
- b) vom Handelsplatz zugewiesener, ausschließlich mit einem bestimmten zugrunde liegenden Instrument, einer bestimmten Abwicklungsart und anderen Eigenschaften des Kontrakts verknüpfter Code, bestehend aus maximal zwölf alphanumerischen Zeichen;

- c) Buchstabe zur Angabe, ob es sich bei dem Instrument um eine Option oder einen Finanzterminkontrakt (Future) handelt, wobei ‚O‘ für Option und ‚F‘ für Future steht;
- d) Buchstabe zur Angabe, ob es sich bei der Option um eine Put- oder eine Call-Option handelt, wobei ‚P‘ für Put und ‚C‘ für Call steht; wurde das Instrument gemäß Buchstabe c als Future identifiziert, wird ‚F‘ angegeben;
- e) Ausübungs- oder Fälligkeitstermin eines Derivatkontrakts gemäß ISO 8601 (JJJJ-MM-TT);
- f) Ausübungspreis einer Option, bestehend aus maximal 19 Ziffern mit bis zu fünf Dezimalstellen ohne vorangestellte oder nachfolgende Nullen. Als Dezimalzeichen wird ein Punkt verwendet. Negative Werte sind nicht zulässig. Handelt es sich bei dem Instrument um ein Future, wird der Ausübungspreis als Null angegeben.

7. Bei Produkten, die mittels eines ISIN-Codes nach ISO 6166 oder eines AII-Codes identifiziert wurden, wird das Derivat in Tabelle 2 Feld 4 des Anhangs mithilfe der Kennziffer zur Klassifizierung von Finanzinstrumenten (CFI) nach ISO 10692 klassifiziert.

8. Derivate, für die es weder einen ISIN-Code nach ISO 6166 noch einen AII-Code gibt, werden mittels eines eigens zugeteilten Codes klassifiziert. Dieser Code muss:

- a) unverwechselbar,
- b) neutral,
- c) verlässlich,
- d) quelloffen,
- e) skalierbar,
- f) zugänglich und
- g) zu vertretbaren Kosten verfügbar sein und
- h) einem angemessenen Entscheidungsrahmen unterliegen.

9. Bis zur Annahme des in Absatz 8 genannten Codes durch die ESMA werden Derivate, für die es weder einen ISIN-Code nach ISO 6166 noch einen AII-Code gibt, mithilfe eines CFI-Codes nach ISO 10692 klassifiziert.

(*) Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 15. Mai 2014 über Märkte für Finanzinstrumente und zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 (ABl. L 173 vom 12.6.2014, S. 84).“

(4) Die folgenden Artikel 4a und 4b werden eingefügt:

„Artikel 4a

Eindeutige Geschäftsabschluss-Kennziffer

1. Meldungen werden entweder über eine von der ESMA angenommene, globale eindeutige Geschäftsabschluss-Kennziffer oder in Ermangelung dessen durch eine von den Gegenparteien vereinbarte eindeutige Geschäftsabschluss-Kennziffer identifiziert.

2. Können sich die Gegenparteien nicht darauf einigen, wer für die Generierung der eindeutigen Geschäftsabschluss-Kennziffer für die Meldung zuständig ist, so bestimmen sie die für die Generierung der eindeutigen Geschäftsabschluss-Kennziffer zuständige Stelle wie folgt:

- a) bei zentral abgewickelten und geclearten Geschäften wird die eindeutige Geschäftsabschluss-Kennziffer beim Clearing durch die zentrale Gegenpartei (CCP) für das Clearingmitglied generiert. Das Clearingmitglied generiert eine andere eindeutige Geschäftsabschluss-Kennziffer für seine Gegenpartei;
- b) bei zentral abgewickelten, aber nicht zentral geclearten Geschäften wird die eindeutige Geschäftsabschluss-Kennziffer vom Handelsplatz der Auftragsausführung für sein Mitglied generiert;

- c) bei zentral bestätigten und geclearten Geschäften wird die eindeutige Geschäftsabschluss-Kennziffer beim Clearing durch die CCP für das Clearingmitglied generiert. Das Clearingmitglied generiert eine andere eindeutige Geschäftsabschluss-Kennziffer für seine Gegenpartei;
 - d) bei auf elektronischem Wege zentral bestätigten, aber nicht zentral geclearten Geschäften wird die eindeutige Geschäftsabschluss-Kennziffer durch die Plattform der Geschäftsbestätigung bei der Bestätigung generiert;
 - e) für alle Geschäfte außer den Geschäften gemäß den Buchstaben a bis d gilt Folgendes:
 - i) bei Geschäften zwischen finanziellen und nichtfinanziellen Gegenparteien wird die eindeutige Geschäftsabschluss-Kennziffer durch die finanzielle Gegenpartei generiert;
 - ii) bei Geschäften zwischen nichtfinanziellen Gegenparteien oberhalb der Clearingschwelle und nichtfinanziellen Gegenparteien unterhalb der Clearingschwelle wird die eindeutige Geschäftsabschluss-Kennziffer durch die nichtfinanzielle Gegenpartei oberhalb der Clearingschwelle generiert;
 - iii) bei allen Geschäften außer den Geschäften gemäß Ziffer (i) und (ii) wird die eindeutige Geschäftsabschluss-Kennziffer durch den Verkäufer generiert.
3. Die Gegenpartei, die die eindeutige Geschäftsabschluss-Kennziffer generiert, teilt diese der anderen Gegenpartei so rechtzeitig mit, dass diese in der Lage ist, ihre Meldepflichten zu erfüllen.

Artikel 4b

Ausführungsplatz

Der Ausführungsplatz des Derivatkontrakts wird in Tabelle 2 Feld 15 des Anhangs wie folgt angegeben:

- a) bis zum Datum der Anwendung des von der Kommission gemäß Artikel 27 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 verabschiedeten delegierten Rechtsakts:
 - i) bei einem Ausführungsplatz innerhalb der Union mittels der Handelsplatz-Identifikationsnummer (MIC) nach ISO 10383 gemäß dem auf der Website der ESMA veröffentlichten Register, das auf der Grundlage der von den zuständigen Behörden gemäß Artikel 13 Absatz 2 der Verordnung (EG) Nr. 1287/2006 der Kommission (*) bereitgestellten Informationen eingerichtet wurde;
 - ii) bei einem Ausführungsplatz außerhalb der Union mittels des MIC-Codes nach ISO 10383 gemäß der Liste von MIC-Codes, die von der ISO gepflegt und aktualisiert und auf der ISO-Website veröffentlicht ist;
- b) ab dem Datum der Anwendung des von der Kommission gemäß Artikel 27 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 verabschiedeten delegierten Rechtsakts eine ISIN mittels des MIC-Codes nach ISO 10383.

(*) Verordnung (EG) Nr. 1287/2006 der Kommission vom 10. August 2006 zur Durchführung der Richtlinie 2004/39/EG des Europäischen Parlaments und des Rates betreffend die Aufzeichnungspflichten für Wertpapierfirmen, die Meldung von Geschäften, die Markttransparenz, die Zulassung von Finanzinstrumenten zum Handel und bestimmte Begriffe im Sinne dieser Richtlinie (Abl. L 241 vom 2.9.2006, S. 1).“

(5) Artikel 5 Absatz 4 erhält folgende Fassung:

„4. Die folgenden Derivatkontrakte, die bei Meldebeginn für die betreffende Derivatekategorie nicht ausstehen, werden einem Transaktionsregister innerhalb von fünf Jahren nach diesem Datum gemeldet:

- a) Derivatkontrakte, die vor dem 16. August 2012 geschlossen wurden und am 16. August 2012 nach wie vor ausstehen;
- b) Derivatkontrakte, die am oder nach dem 16. August 2012 geschlossen wurden.“

(6) Der Anhang erhält die Fassung des Anhangs dieser Verordnung.

Artikel 2

Diese Verordnung tritt am zwanzigsten Tag nach ihrer Veröffentlichung im *Amtsblatt der Europäischen Union* in Kraft.

Sie gilt ab dem 1. November 2017 mit Ausnahme von Artikel 1 Absatz 5, der ab dem Tag des Inkrafttretens gilt.

Diese Verordnung ist in allen ihren Teilen verbindlich und gilt unmittelbar in jedem Mitgliedstaat.

Brüssel, den 19. Oktober 2016

Für die Kommission

Der Präsident

Jean-Claude JUNCKER

ANHANG

„ANHANG

Tabelle 1

Angaben zu den Gegenparteien

	Feld	Format
	Parteien	
1	Meldezeitstempel	Datumsangabe nach ISO 8601, UTC-Zeit (koordinierte Weltzeit) (YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ).
2	ID der meldenden Gegenpartei	Kennziffer der juristischen Person (LEI) nach ISO 17442 (20-stelliger alphanumerischer Code).
3	Art der ID der anderen Gegenpartei	,LEI': Kennziffer der juristischen Person (LEI) nach ISO 17442 ,CLC': Kundenkennziffer
4	ID der anderen Gegenpartei	Kennziffer der juristischen Person (LEI) nach ISO 17442 (20-stelliger alphanumerischer Code). Kundenkennziffer (bis zu 50 alphanumerische Zeichen).
5	Land der anderen Gegenpartei	Ländercode aus zwei Buchstaben nach ISO 3166
6	Sparte, in der die meldende Gegenpartei tätig ist	<p>Taxonomie für finanzielle Gegenparteien:</p> <p>A = gemäß der Richtlinie 2009/138/EG des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽¹⁾ zugelassenes Versicherungsunternehmen</p> <p>C = gemäß der Richtlinie 2013/36/EU des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽²⁾ zugelassenes Kreditinstitut</p> <p>F = gemäß der Richtlinie 2004/39/EG des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽³⁾ zugelassene Wertpapierfirma</p> <p>I = gemäß der Richtlinie 2009/138/EG zugelassenes Versicherungsunternehmen</p> <p>L = alternativer Investmentfonds, der von einem gemäß der Richtlinie 2011/61/EU des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽⁴⁾ zugelassenen oder registrierten Verwalter alternativer Investmentfonds (AIFM) verwaltet wird</p> <p>O = Einrichtungen der betrieblichen Altersversorgung im Sinne von Artikel 6 Buchstabe a der Richtlinie 2003/41/EG des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽⁵⁾</p> <p>R = gemäß der Richtlinie 2009/138/EG zugelassenes Rückversicherungsunternehmen</p> <p>U = gemäß der Richtlinie 2009/65/EG des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽⁶⁾ zugelassene Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) und ihre Verwaltungsgesellschaft</p> <p>Taxonomie für nichtfinanzielle Gegenparteien. Die folgenden Kategorien entsprechen den Hauptabschnitten der statistischen Systematik der Wirtschaftszweige in der Europäischen Gemeinschaft (NACE) gemäß der Verordnung (EG) Nr. 1893/2006 des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽⁷⁾.</p> <p>1 = Land- und Forstwirtschaft, Fischerei</p> <p>2 = Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden</p> <p>3 = verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren</p> <p>4 = Energieversorgung</p>

	Feld	Format
		<p>5 = Wasserversorgung, Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen</p> <p>6 = Baugewerbe/Bau</p> <p>7 = Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen</p> <p>8 = Verkehr und Lagerei</p> <p>9 = Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie</p> <p>10 = Information und Kommunikation</p> <p>11 = Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen</p> <p>12 = Grundstücks- und Wohnungswesen</p> <p>13 = Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen</p> <p>14 = Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen</p> <p>15 = Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung</p> <p>16 = Erziehung und Unterricht</p> <p>17 = Gesundheits- und Sozialwesen</p> <p>18 = Kunst, Unterhaltung und Erholung</p> <p>19 = Erbringung von sonstigen Dienstleistungen</p> <p>20 = Private Haushalte mit Hauspersonal; Herstellung von Waren und Erbringung von Dienstleistungen durch private Haushalte für den Eigenbedarf ohne ausgeprägten Schwerpunkt</p> <p>21 = Exterritoriale Organisationen und Körperschaften</p> <p>Wird mehr als eine Tätigkeit gemeldet, sind die Codes in der Reihenfolge der relativen Bedeutung der betreffenden Tätigkeiten, getrennt durch einen Gedankenstrich („—“), aufzuführen.</p> <p>Im Falle von zentralen Gegenparteien und anderen Gegenparteien im Sinne von Artikel 1 Absatz 5 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 bleibt dieses Feld frei.</p>
7	Art der meldenden Gegenpartei	<p>F = finanzielle Gegenpartei</p> <p>N = nichtfinanzielle Gegenpartei</p> <p>C = zentrale Gegenpartei</p> <p>O = Sonstige</p>
8	Makler-ID	Kennziffer der juristischen Person (LEI) nach ISO 17442 (20-stelliger alphanumerischer Code)
9	ID der meldenden Stelle	Kennziffer der juristischen Person (LEI) nach ISO 17442 (20-stelliger alphanumerischer Code)
10	ID des Clearingmitglieds	Kennziffer der juristischen Person (LEI) nach ISO 17442 (20-stelliger alphanumerischer Code)
11	Art der ID des Begünstigten	<p>,LEI': Kennziffer der juristischen Person (LEI) nach ISO 17442</p> <p>,CLC': Kundenkennziffer</p>
12	ID des Begünstigten	Kennziffer der juristischen Person (LEI) nach ISO 17442 (20-stelliger alphanumerischer Code) oder Kundenkennziffer (bis zu 50 alphanumerische Zeichen), wenn der Kunde keine Kennziffer der juristischen Person erhalten kann

	Feld	Format
13	Eigenschaft, in der die Transaktion vollzogen wird	P = Eigenhändler A = Beauftragter
14	Seite der Gegenpartei	B = Käufer S = Verkäufer Angabe gemäß Artikel 3a
15	Direkte Verbindung zur Geschäftstätigkeit oder zum Liquiditäts- und Finanzmanagement	Y = Ja N = Nein
16	Clearingschwelle	Y = darüber N = darunter
17	Wert des Kontrakts	Bis zu 20 numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen.
18	Währung, in der der Wert des Kontrakts angegeben ist	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
19	Bewertungszeitstempel	Datumsangabe nach ISO 8601, UTC-Zeit (YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ).
20	Art der Bewertung	M = Marktpreisbewertung O = Modellpreisbewertung C = CCP-Bewertung
21	Besicherung	U = unbesichert PC = teilbesichert OC = einseitig besichert FC = vollständig besichert Angabe gemäß Artikel 3b
22	Besicherung auf Portfolioebene	Y = Ja N = Nein
23	Kennziffer des besicherten Portfolios	Bis zu 52 alphanumerische Zeichen, einschließlich vier Sonderzeichen: „ — _‘ Am Anfang und am Ende des Codes sind Sonderzeichen nicht zulässig. Leerzeichen sind nicht zulässig.
24	Hinterlegte Ersteinschusszahlung	Bis zu 20 numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
25	Währung der hinterlegten Ersteinschusszahlung	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen

	Feld	Format
26	Hinterlegte Nachschusszahlung	Bis zu 20 numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
27	Währung der hinterlegten Nachschusszahlung	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
28	Erhaltene Ersteinschusszahlung	Bis zu 20 numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
29	Währung der erhaltenen Ersteinschusszahlung	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
30	Erhaltene Nachschusszahlung	Bis zu 20 numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
31	Währung der erhaltenen Nachschusszahlungen	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
32	Hinterlegte überschüssige Sicherheiten	Bis zu 20 numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
33	Währung der hinterlegten überschüssigen Sicherheiten	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen
34	Erhaltene überschüssige Sicherheiten	Bis zu 20 numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
35	Währung der erhaltenen überschüssigen Sicherheiten	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen

(¹) Richtlinie 2009/138/EG des Europäischen Parlaments und des Rates vom 25. November 2009 betreffend die Aufnahme und Ausübung der Versicherungs- und der Rückversicherungstätigkeit (Solvabilität II) (ABl. L 335 vom 17.12.2009, S. 1).

(²) Richtlinie 2013/36/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 26. Juni 2013 über den Zugang zur Tätigkeit von Kreditinstituten und die Beaufsichtigung von Kreditinstituten und Wertpapierfirmen, zur Änderung der Richtlinie 2002/87/EG und zur Aufhebung der Richtlinien 2006/48/EG und 2006/49/EG (ABl. L 176 vom 27.6.2013, S. 338).

(³) Richtlinie 2004/39/EG des Europäischen Parlaments und des Rates vom 21. April 2004 über Märkte für Finanzinstrumente, zur Änderung der Richtlinien 85/611/EWG und 93/6/EWG des Rates und der Richtlinie 2000/12/EG des Europäischen Parlaments und des Rates und zur Aufhebung der Richtlinie 93/22/EWG des Rates (ABl. L 145, 30.4.2004, S. 1).

(⁴) Richtlinie 2011/61/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 8. Juni 2011 über die Verwalter alternativer Investmentfonds und zur Änderung der Richtlinien 2003/41/EG und 2009/65/EG und der Verordnungen (EG) Nr. 1060/2009 und (EU) Nr. 1095/2010 (ABl. L 174 vom 1.7.2011, S. 1).

(⁵) Richtlinie 2003/41/EG des Europäischen Parlaments und des Rates vom 3. Juni 2003 über die Tätigkeiten und die Beaufsichtigung von Einrichtungen der betrieblichen Altersversorgung (ABl. L 235 vom 23.9.2003, S. 10).

(⁶) Richtlinie 2009/65/EG des Europäischen Parlaments und des Rates vom 13. Juli 2009 zur Koordinierung der Rechts- und Verwaltungsvorschriften betreffend bestimmte Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) (ABl. L 302 vom 17.11.2009, S. 32).

(⁷) Verordnung (EG) Nr. 1893/2006 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 20. Dezember 2006 zur Aufstellung der statistischen Systematik der Wirtschaftszweige NACE Revision 2 und zur Änderung der Verordnung (EWG) Nr. 3037/90 des Rates sowie einiger Verordnungen der EG über bestimmte Bereiche der Statistik (ABl. L 393 vom 30.12.2006, S. 1).

Tabelle 2

Allgemeine Angaben

	Feld	Format	Derivatkontrakttypen
	Abschnitt 2a — Art des Kontrakts		Alle Kontrakte
1	Art des Kontrakts	CD = finanzieller Differenzkontrakt FR = Zinstermingeschäft FU = börsengehandelter Finanzterminkontrakt (Future) FW = außerbörslicher Finanzterminkontrakt (Forward) OP = Option SB = Spreadbet SW = Swap ST = Tauschoption (Swaption) OT = Sonstige	
2	Vermögensklasse	CO = Warenderivate und Derivate von Emissionszertifikaten CR = Kreditderivat CU = Währungsderivat EQ = Aktienderivat IR = Zinsderivat	
	Abschnitt 2b — Angaben zu den Kontrakten		Alle Kontrakte
3	Art der Produktklassifizierung	C = CFI U = UPI	
4	Produktklassifizierung	CFI nach ISO 10692, sechsstelliger alphabetischer Code angenommene UPI	
5	Art der Produktkennung	Angabe des Identifikationstyps: I = ISIN A = AII	
6	Produktkennziffer	Produktkennung, Typ I: ISIN nach ISO 6166, 12-stelliger alphanumerischer Code Produktkennung, Typ A: Vollständiger AII-Code gemäß Artikel 4 Absatz 8	

	Feld	Format	Derivatkontrakttypen
7	Art der Identifizierung der Basiswerte	I = ISIN A = AII U = UPI B = Korb X = Index	
8	Identifizierung der Basiswerte	Identifizierung der Basiswerte, Typ I: ISIN nach ISO 6166, 12-stelliger alphanumerischer Code Identifizierung der Basiswerte, Typ A: vollständiger AII-Code gemäß Artikel 4 Absatz 8 Identifizierung der Basiswerte, Typ U: UPI Identifizierung der Basiswerte, Typ B: Identifizierung aller Bestandteile durch ISIN nach ISO 6166 oder den vollständigen AII-Code gemäß Artikel 4 Absatz 8. Die Kennziffern der einzelnen Komponenten werden durch einen Bindestrich (-) getrennt. Identifizierung der Basiswerte, Typ X: sofern verfügbar, ISIN nach ISO 6166, andernfalls die vom Index-Anbieter zugewiesene vollständige Bezeichnung des Indexes	
9	Nennwährung 1	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen	
10	Nennwährung 2	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen	
11	Zu liefernde Währung	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen	
	Abschnitt 2c — Transaktionsdetails		Alle Kontrakte
12	Transaktions-ID	Bis zur Verfügbarkeit der globalen UTI maximal 52-stelliger alphanumerischer Code, einschließlich vier Sonderzeichen: „ — _.’ Am Anfang und am Ende des Codes sind Sonderzeichen nicht zulässig. Leerzeichen sind nicht zulässig.	
13	Laufende Meldenummer	Alphanumerisches Feld mit bis zu 52 Zeichen	
14	ID für Bestandteile eines komplexen Geschäfts	Alphanumerisches Feld mit bis zu 35 Zeichen	
15	Ausführungsplatz	Handelsplatz-Identifikationsnummer (MIC) nach ISO 10383, vier alphanumerische Zeichen, gemäß Artikel 4b.	

	Feld	Format	Derivatkontrakttypen
16	Zahlenmäßige Reduktion der ausstehenden Kontrakte (Compression)	Y = aus einer solchen Reduktion hervorgegangener Kontrakt N = nicht aus einer solchen Reduktion hervorgegangener Kontrakt	
17	Preis/Satz	Bis zu 20 numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Wird der Preis als Prozentwert mitgeteilt, sollte er als Prozentsatz ausgedrückt werden, wobei 100 % als ‚100‘ angegeben wird.	
18	Preisnotierung	U = Anteile P = Prozentsatz Y = Ertrag	
19	Währung, in der der Preis angegeben ist	Währungskürzel nach ISO 4217, drei alphabetische Zeichen	
20	Nennwert	Bis zu 20 numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen.	
21	Preismultiplikator	Bis zu 20 numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.	
22	Menge	Bis zu 20 numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.	
23	Zahlung bei Abschluss	Bis zu 20 numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen. Das negative Vorzeichen wird verwendet, wenn die Zahlung geleistet wurde, aber nicht eingegangen ist. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen.	

	Feld	Format	Derivatkontrakttypen
24	Art der Lieferung	C = Bar P = Physisch O = Optional für die Gegenpartei oder bei Festlegung durch einen Dritten	
25	Ausführungszeitstempel	Datumsangabe nach ISO 8601, UTC-Zeit (YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ).	
26	Geltungsbeginn	Datumsangabe nach ISO 8601 (YYYY-MM-DD)	
27	Fälligkeitstermin	Datumsangabe nach ISO 8601 (YYYY-MM-DD)	
28	Kontraktende	Datumsangabe nach ISO 8601 (YYYY-MM-DD)	
29	Abrechnungstermin	Datumsangabe nach ISO 8601 (YYYY-MM-DD)	
30	Art des Rahmenvertrags	Freitextfeld mit maximal 50 Zeichen, gegebenenfalls mit Angabe des Namens des genutzten Rahmenvertrags	
31	Fassung des Rahmenvertrags	Datumsangabe nach ISO 8601 (YYYY)	
	Abschnitt 2d — Risikomin- derung/Meldung		Alle Kontrakte
32	Bestätigungszeitstempel	Datumsangabe nach ISO 8601, UTC-Zeit (YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ).	
33	Art der Bestätigung	Y = nichtelektronisch N = unbestätigt E = elektronisch	
	Abschnitt 2e — Clearing		Alle Kontrakte
34	Clearingpflicht	Y = Ja N = Nein	
35	Gecleart	Y = Ja N = Nein	
36	Clearing-Zeitstempel	Datumsangabe nach ISO 8601, UTC-Zeit (YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ).	
37	CCP	Kennziffer der juristischen Person (LEI) nach ISO 17442 20-stelliger alphanumerischer Code	

	Feld	Format	Derivatkontrakttypen
38	Gruppenintern	Y = Ja N = Nein	
	Abschnitt 2f — Zinssätze		Zinsderivate
39	Fester Satz ‚Leg 1‘	Bis zu zehn numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen, ausgedrückt als Prozentsatz, wobei 100 % als ‚100‘ angegeben wird. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen.	
40	Fester Satz ‚Leg 2‘	Bis zu zehn numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen, ausgedrückt als Prozentsatz, wobei 100 % als ‚100‘ angegeben wird. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen.	
41	Festsatzberechnungsmethode ‚Leg 1‘	Zähler/Nenner, wobei Zähler und Nenner numerische Zeichen sind oder ‚Actual‘ alphabetisch dargestellt wird, z. B. 30/360 oder Actual/365	
42	Festsatzberechnungsmethode ‚Leg 2‘	Zähler/Nenner, wobei Zähler und Nenner numerische Zeichen sind oder ‚Actual‘ alphabetisch dargestellt wird, z. B. 30/360 oder Actual/365	
43	Zahlungsfrequenz Festzinsseite ‚Leg 1‘ — Zeitraum	Zeitraum, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien einander Zahlungen leisten, wobei folgende Abkürzungen gelten: Y = Jahr M = Monat W = Woche D = Tag	

	Feld	Format	Derivatkontrakttypen
44	Zahlungsfrequenz Festzinsseite ,Leg 1' — Multiplikator	Ganzzahliger Multiplikator des Zeitraums, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien einander Zahlungen leisten. Bis zu drei numerische Zeichen	
45	Zahlungsfrequenz Festzinsseite ,Leg 2' — Zeitraum	Zeitraum, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien einander Zahlungen leisten, wobei folgende Abkürzungen gelten: Y = Jahr M = Monat W = Woche D = Tag	
46	Zahlungsfrequenz Festzinsseite ,Leg 2' — Multiplikator	Ganzzahliger Multiplikator des Zeitraums, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien einander Zahlungen leisten. Bis zu drei numerische Zeichen	
47	Zahlungsfrequenz variable Seite ,Leg 1' — Zeitraum	Zeitraum, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien einander Zahlungen leisten, wobei folgende Abkürzungen gelten: Y = Jahr M = Monat W = Woche D = Tag	
48	Zahlungsfrequenz variable Seite ,Leg 1' — Multiplikator	Ganzzahliger Multiplikator des Zeitraums, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien einander Zahlungen leisten. Bis zu drei numerische Zeichen	
49	Zahlungsfrequenz variable Seite ,Leg 2' — Zeitraum	Zeitraum, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien einander Zahlungen leisten, wobei folgende Abkürzungen gelten: Y = Jahr M = Monat W = Woche D = Tag	
50	Zahlungsfrequenz variable Seite ,Leg 2' — Multiplikator	Ganzzahliger Multiplikator des Zeitraums, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien einander Zahlungen leisten. Bis zu drei numerische Zeichen	

	Feld	Format	Derivatkontrakttypen
51	Frequenz der Neufestsetzung des variablen Satzes ‚Leg 1‘ — Zeitraum	Zeitraum, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien eine Neufestsetzung des variablen Satzes vornehmen, wobei folgende Abkürzungen gelten: Y = Jahr M = Monat W = Woche D = Tag	
52	Frequenz der Neufestsetzung des variablen Satzes ‚Leg 1‘ — Multiplikator	Ganzzahliger Multiplikator des Zeitraums, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien eine Neufestsetzung des variablen Satzes vornehmen. Bis zu drei numerische Zeichen	
53	Frequenz der Neufestsetzung des variablen Satzes ‚Leg 2‘ — Zeitraum	Zeitraum, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien eine Neufestsetzung des variablen Satzes vornehmen, wobei folgende Abkürzungen gelten: Y = Jahr M = Monat W = Woche D = Tag	
54	Frequenz der Neufestsetzung des variablen Satzes ‚Leg 2‘ — Multiplikator	Ganzzahliger Multiplikator des Zeitraums, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien eine Neufestsetzung des variablen Satzes vornehmen. Bis zu drei numerische Zeichen	
55	Variabler Satz ‚Leg 1‘	Bezeichnung des Indexes, an dem sich der variable Satz orientiert ,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	

	Feld	Format	Derivatkontrakttypen
		,CDOR' — CDOR ,CIBO' — CIBOR ,MOSP' — MOSPRIM ,NIBO' — NIBOR ,PRBO' — PRIBOR ,TLBO' — TELBOR ,WIBO' — WIBOR ,TREA' — Treasury ,SWAP' — SWAP ,FUSW' — Future SWAP Oder bis zu 25 alphanumerische Zeichen, wenn der Referenzsatz oben nicht aufgeführt ist	
56	Referenzzeitraum variable Seite ,Leg 1' — Zeitraum	Angabe des Referenzzeitraums unter Verwendung folgender Abkürzungen: Y = Jahr M = Monat W = Woche D = Tag	
57	Referenzzeitraum variable Seite ,Leg 1' — Multiplikator	Ganzzahliger Multiplikator des Zeitraums zur Beschreibung des Referenzzeitraums. Bis zu drei numerische Zeichen	
58	Variabler Satz ,Leg 2'	Bezeichnung des Indexes, an dem sich der variable Satz orientiert ,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	

	Feld	Format	Derivatkontrakttypen
		,NIBO' — NIBOR ,PRBO' — PRIBOR ,TLBO' — TELBOR ,WIBO' — WIBOR ,TREA' — Treasury ,SWAP' — SWAP ,FUSW' — Future SWAP Oder bis zu 25 alphanumerische Zeichen, wenn der Referenzsatz oben nicht aufgeführt ist	
59	Referenzzeitraum variable Seite ,Leg 2' — Zeitraum	Angabe des Referenzzeitraums unter Verwendung folgender Abkürzungen: Y = Jahr M = Monat W = Woche D = Tag	
60	Referenzzeitraum variable Seite ,Leg 2' — Multiplikator	Ganzzahliger Multiplikator des Zeitraums zur Beschreibung des Referenzzeitraums. Bis zu drei numerische Zeichen	
	Abschnitt 2g — Devisen		Währungsderivate
61	Zu liefernde Währung 2	Währungskürzel nach ISO 4217, dreistelliger alphabetischer Code	
62	Wechselkurs 1	Bis zu 10 numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen.	
63	Devisenterminkurs	Bis zu 10 numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen.	

	Feld	Format	Derivatkontrakttypen
64	Umrechnungsbasis	Zwei Währungs-codes nach ISO 4217, getrennt durch einen Schrägstrich (/). Der erste Währungs-cod e gibt die Basiswährung, der zweite die quotierte Währung an.	
	Abschnitt 2h — Rohstoffe und Emissionszertifikate		Warenderivate und Derivate von Emissionszertifikaten
	Allgemeines		
65	Basiswert	AG = Agrarprodukt EN = Energie FR = Fracht ME = Metalle IN = Index EV = Umwelt EX = Exotisch OT = Sonstige	
66	Nähere Beschreibung des Basiswerts	Agrarprodukt GO = Getreide, Ölsaaten DA = Molkereiprodukte LI = Vieh FO = Forstwirtschaftliche Produkte SO = Weichwaren SF = Meeresfrüchte OT = Sonstige Energie OI = Öl NG = Erdgas CO = Kohle EL = Strom IE = Arbitragegeschäft OT = Sonstige Fracht DR = Trockenfracht WT = Nassfracht OT = Sonstige Metalle PR = Edelmetalle NP = Nichtedelmetalle Umwelt WE = Wetter EM = Emissionen OT = Sonstige	

	Feld	Format	Derivatkontrakttypen
	Energie		
67	Lieferpunkt oder -zone	EIC-Code, 16-stelliger alphanumerischer Code. Wiederholbares Feld.	
68	Kuppelstelle/Kopplungspunkt	EIC-Code, 16-stelliger alphanumerischer Code.	
69	Art der Last	BL = Grundlast PL = Spitzenlast OP = Schwachlast BH = Stunde/Blockstunden SH = geformt („shaped“) GD = Gastag OT = Sonstige	
	Wiederholbarer Abschnitt der Felder 70-77		
70	Lieferzeitspanne	hh:mmZ	
71	Lieferstarttermin und -zeit	Datumsangabe nach ISO 8601, UTC-Zeit (YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ).	
72	Lieferendtermin und -zeit	Datumsangabe nach ISO 8601, UTC-Zeit (YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ).	
73	Dauer	N = Minuten H = Stunde D = Tag W = Woche M = Monat Q = Quartal S = Saison Y = jährlich O = Sonstige	
74	Wochentage	WD = Werktage WN = Wochenende MO = Montag TU = Dienstag WE = Mittwoch TH = Donnerstag FR = Freitag SA = Samstag SU = Sonntag Es können mehrere, durch einen Schrägstrich (/) getrennte Werte angegeben werden.	

	Feld	Format	Derivatkontrakttypen
75	Lieferkapazität	20 numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen.	
76	Mengeneinheit	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	Preis-/Zeitintervallmengen	Bis zu 20 numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen.	
	Abschnitt 2i — Optionen		Kontrakte mit Option
78	Art der Option	P = Put C = Call O = wenn nicht bestimmt werden kann, ob es sich um eine Call- oder Put-Option handelt	
79	Art der Option (mögliche Ausübung)	A = Amerikanische Option B = Bermuda-Option E = Europäische Option S = Asiatische Option Es können mehrere Angaben gemacht werden.	

	Feld	Format	Derivatkontrakttypen
80	Ausübungspreis (Zinsober-/untergrenze)	Bis zu 20 numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts. Ein etwaiges negatives Vorzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Wird der Ausübungspreis als Prozentwert mitgeteilt, sollte er als Prozentsatz ausgedrückt werden, wobei 100 % als ‚100‘ angegeben wird.	
81	Notierung des Ausübungspreises	U = Anteile P = Prozentsatz Y = Ertrag	
82	Fälligkeit des Basiswerts	Datumsangabe nach ISO 8601 (YYYY-MM-DD)	
	Abschnitt 2j — Kreditderivate		
83	Rang	SNDB = Vorrangig, z. B. vorrangige, unbesicherte Schuldtitel (Unternehmen/Finanzinstitute), Staatschuldtitel in Fremdwährung (Regierungen) SBOD = Nachrangig, z. B. nachrangige oder Lower-Tier-2-Schuldtitel (Banken), nachrangige (junior) oder Upper-Tier-2-Schuldtitel (Banken) OTHR = sonstige, z. B. Vorzugsaktien oder Kernkapital (Banken) oder andere Kreditderivate	
84	Referenzeinrichtung	Ländercode aus zwei Buchstaben nach ISO 3166 oder Ländercode aus zwei Buchstaben nach ISO 3166-2, gefolgt von einem Bindestrich (-) und einem Länderuntercode von bis zu drei alphanumerischen Zeichen oder Kennziffer der juristischen Person (LEI) nach ISO 17442 (20-stelliger alphanumerischer Code)	
85	Regelmäßigkeit der Zahlung	MNTH = monatlich QURT = vierteljährlich MIAN = halbjährlich YEAR = jährlich	
86	Berechnungsgrundlage	Zähler/Nenner, wobei Zähler und Nenner numerische Zeichen sind oder ‚Actual‘ alphabetisch dargestellt wird, z. B. 30/360 oder Actual/365	

	Feld	Format	Derivatkontrakttypen
87	Serien	Feldnummer mit bis zu fünf Zeichen	
88	Version	Feldnummer mit bis zu fünf Zeichen	
89	Indexfaktor	Bis zu zehn numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.	
90	Tranche	T = in Tranchen U = nicht in Tranchen	
91	Attachment-Point	Bis zu zehn numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen, ausgedrückt als Dezimalbruch zwischen 0 und 1. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.	
92	Detachment-Point	Bis zu zehn numerische Zeichen, einschließlich Dezimalstellen, ausgedrückt als Dezimalbruch zwischen 0 und 1. Das Dezimalzeichen zählt nicht als numerisches Zeichen. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.	
	Abschnitt 2k — Änderung des Kontrakts		
93	Art der Maßnahme	N = Neu M = Änderung E = Fehler C = vorzeitige Kündigung R = Korrektur Z = Reduktion V = Bewertungsaktualisierung P = Positionskomponente	
94	Ebene	T = Geschäft P = Position“	