

A BIZOTTSÁG (EU) 2017/105 VÉGREHAJTÁSI RENDELETE**(2016. október 19.)**

a tőzsdén kívüli származtatott ügyletekről, a központi szerződő felekről és a kereskedési adattárakról szóló 648/2012/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletnek megfelelően a kereskedési adattáraknak benyújtandó kereskedési jelentések formátumára és gyakoriságára vonatkozó végrehajtási technikai standardok meghatározásáról szóló 1247/2012/EU végrehajtási rendelet módosításáról

(EGT-vonatkozású szöveg)

AZ EURÓPAI BIZOTTSÁG,

tekintettel az Európai Unió működéséről szóló szerződésre,

tekintettel a tőzsdén kívüli származtatott ügyletekről, a központi szerződő felekről és a kereskedési adattárakról szóló, 2012. július 4-i 648/2012/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletre ⁽¹⁾ és különösen annak 9. cikke (6) bekezdésére,

mivel:

- (1) Az 1247/2012/EU bizottsági végrehajtási rendelet ⁽²⁾ előírja, hogy amennyiben nem áll rendelkezésre jogalany-azonosító, ideiglenes jogalany-azonosítót kell használni. A közelmúltban elérhetővé vált olyan infrastruktúra, amely lehetővé teszi jogalany-azonosító hozzárendelését a jogalanyokhoz, és a piaci szereplők megismerték a szóban forgó jogalany-azonosítók használatát. Következésképpen indokolt, hogy mostantól a jogalanyok azonosításának egyetlen megengedett módja a jogalany-azonosító legyen.
- (2) A származtatott csereügyletek esetében különösen bonyolult annak megállapítása, hogy a bejelentő szerződő fél esetében egy ügylet vevőjéről vagy eladójáról van-e szó, mivel az ilyen ügyletek során pénzügyi instrumentumok kicserélésére kerül sor a felek között. Ezért különös szabályokat kell megállapítani annak érdekében, hogy egy származtatott csereügylet vonatkozásában pontosan és egyértelműen meg lehessen határozni a vevőt és az eladót.
- (3) A szerződő felek tényleges kitétségének megállapításához az illetékes hatóságoknak teljes körű és pontos információkra van szükségük az adott szerződő felek között kicserélt biztosítékokról. Ennek megfelelően különös szabályokat kell meghatározni egy adott származtatott ügylet vagy portfólió biztosítékeszközökkel való fedezettségére vonatkozó jelentéstétel egységes módszerének biztosításához.
- (4) A származtatott termékek egyértelmű besorolása és pontos azonosítása elengedhetetlen az adatok hatékony felhasználásához és az adatok kereskedési adattárak közötti észszerű összesítéséhez, és ezáltal hozzájárul a Pénzügyi Stabilitási Tanács által 2014. szeptember 19-én közzétett, a tőzsdén kívüli származtatott termékek kereskedési adattári adatainak összesítésére vonatkozó megvalósíthatósági tanulmányban ⁽³⁾ (Feasibility Study on Aggregation of OTC Derivatives Trade Repository Data) meghatározott célkitűzésekhez. Következésképpen a származtatott termékek besorolásához és azonosításához kapcsolódó bejelentési követelményeket úgy kell módosítani, hogy a releváns információk teljes körűen az illetékes hatóságok rendelkezésére álljanak.
- (5) A pénzügyi innováció következtében elérhetővé vált és rendszeresen kereskedett új típusú származtatott ügyletek bejelentésének lehetővé tételéhez a származtatott ügyletek osztályait tartalmazó listába fel kell venni a csereügyletre szóló opciókat és a különbözetre fogadást. Általánosabban, a folyamatban lévő pénzügyi innovációra és az abból eredő új típusú származtatott ügyletekre tekintettel elengedhetetlen annak biztosítása, hogy be lehessen jelenteni a meglévő besorolás hatálya alá nem tartozó új típusú származtatott ügyleteket. A származtatott termékek típusainak besorolásához helyénvaló ezért fenntartani az „egyéb” kategóriát.
- (6) Amennyiben két szerződő fél nem tud megállapodni arról, hogy a rendelkezésre álló bejelentési időtartamon belül melyiküknek kell egyedi ügyletazonosítót létrehoznia, előfordulhat, hogy egy adott ügyletbe tartozó két bejelentést nem lehet helyesen azonosítani és összekapcsolni. Ezért meg kell határozni az egyedi ügyletazonosítók generálására vonatkozó kritériumokat annak érdekében, hogy elkerülhető legyen egy ügylet megkettőzött beszámítása.

⁽¹⁾ HLL 201., 2012.7.27., 1. o.

⁽²⁾ A Bizottság 2012. december 19-i 1247/2012/EU végrehajtási rendelete a tőzsdén kívüli származtatott ügyletekről, a központi szerződő felekről és a kereskedési adattárakról szóló 648/2012/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletnek megfelelően a kereskedési adattáraknak benyújtandó kereskedési jelentések formátumára és gyakoriságára vonatkozó végrehajtási technikai standardok meghatározásáról (HL L 352., 2012.12.21., 20. o.)

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

- (7) A szerződő felek számára komoly nehézséget jelenthet, hogy megszerezzék a jelentéstétel kezdő időpontját megelőzően lezárt ügyletekre vonatkozó összes releváns információt. A lezárt ügyletek bejelentésének ebből eredő összetettségét, továbbá azt a ténytet, hogy ezek az ügyletek nem fokozzák a rendszerszintű kockázatot, helyénvaló meghosszabbítani a lezárt ügyletek bejelentésére rendelkezésre álló időtartamot a jelentéstétel kezdő időpontjától számított 3 évről 5 évre.
- (8) A kereskedési adattáraknak bejelentett adatok teljes körű harmonizálása és ezáltal az adatok egységes értelmezésének és összesítésének lehetővé tétele érdekében egyértelművé kell tenni az ügyleti jelentésekben használandó standardokat és formátumokat. Indokolt továbbá az adatformátumok tekintetében módosítani a jelentéstételi követelményeket. A szerződő feleknek és a kereskedési adattáraknak ezért elegendő időt kell biztosítani ahhoz, hogy megtegyék a szükséges intézkedéseket a módosított követelményeknek való megfeleléshez.
- (9) Az 1247/2012/EU végrehajtási rendeletet ezért ennek megfelelően módosítani kell.
- (10) Ez a rendelet az Európai Értékpapírpiaci Hatóság (ESMA) által a Bizottságnak benyújtott végrehajtás-technikai standardtervezeten alapul.
- (11) Az ESMA az 1095/2010/EU európai parlamenti és tanácsi rendelet⁽¹⁾ 15. cikkével összhangban nyilvános konzultációkat folytatott e végrehajtás-technikai standardtervezetek kapcsán, elemezte a lehetséges kapcsolódó költségeket és hasznot, és kikérte az említett rendelet 37. cikkében említett Értékpapírpiaci Érdekképviselői Csoport véleményét,

ELFOGADTA EZT A RENDELETET:

1. cikk

Az 1247/2012/EU végrehajtási rendelet a következőképpen módosul:

1. A 3. cikk helyébe a következő szöveg lép:

„3. cikk

Szerződő felek és egyéb jogalanyok azonosítása

A bejelentésben jogalany-azonosítót kell alkalmazni a következők azonosítására:

- a) jogalany kedvezményezett;
- b) bróker jogalany;
- c) központi szerződő fél;
- d) klíringtag;
- e) jogalany szerződő fél;
- f) benyújtó jogalany.”

2. A szöveg a következő 3a. és 3b. cikkel egészül ki:

„3a. cikk

Vétel/eladás jelzése

(1) A származtatott ügyletnek a melléklet 1. táblázata 14. mezőjében említett vételi/eladási oldalát a (2)–(10) bekezdésnek megfelelően kell meghatározni.

(2) Opció ügyletek és csereügyletre szóló opciók esetében azt a szerződő felet kell vevőként azonosítani, aki jogosult az opció gyakorlására, és azt a szerződő felet kell eladóként azonosítani, aki eladja az opciót és megkapja a díjat.

⁽¹⁾ Az Európai Parlament és a Tanács 2010. november 24-i 1095/2010/EU rendelete az európai felügyeleti hatóság (Európai Értékpapírpiaci Hatóság) létrehozásáról, a 716/2009/EK határozat módosításáról és a 2009/77/EK bizottsági határozat hatályon kívül helyezéséről (HL L 331., 2010.12.15., 84. o.).

- (3) A devizához kapcsolódó határidős tőzsdei ügyletektől (future) és tőzsdén kívüli határidős ügyletektől (forward) eltérő határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek esetében azt a szerződő felet kell vevőként azonosítani, aki megveszi az instrumentumot, és azt a szerződő felet kell eladóként azonosítani, aki eladja azt.
- (4) Az értékpapírokhoz kapcsolódó swapügyletek esetében azt a szerződő felet kell vevőként azonosítani, aki viseli az alapul szolgáló értékpapír árfolyammozgásának kockázatát és megkapja a biztosítékösszeget, és azt a szerződő felet kell eladóként azonosítani, aki fizeti a biztosítékösszeget.
- (5) Kamatlábhöz vagy inflációs indexhez kapcsolódó swapügylet esetén azt a szerződő felet kell vevőként azonosítani, aki a rögzített kamatot fizeti, és azt a szerződő felet kell eladóként azonosítani, aki megkapja a rögzített kamatot. Báziswapok esetében azt a szerződő felet kell vevőként azonosítani, aki fizeti a különbözetet, és azt a szerződő felet kell eladóként azonosítani, aki azt megkapja.
- (6) Keresztdevizás swapügyletek, devizaswapok és tőzsdén kívüli határidős devizaügyletek esetében azt a szerződő felet kell vevőként azonosítani, aki megkapja a Nemzetközi Szabványügyi Szervezet (ISO) 4217 szabványa szerinti betűrendben első devizát, és azt a szerződő felet kell eladóként azonosítani, aki szállítja ezt a devizát.
- (7) Az osztalékokhoz kapcsolódó swapügyletek esetében azt a szerződő felet kell vevőként azonosítani, aki megkapja a tényleges osztalékfizetésnek megfelelő ellenértéket, és azt a szerződő felet kell eladóként azonosítani, aki fizeti az osztalékot és megkapja a rögzített kamatot.
- (8) A hitelkockázat átadásához kapcsolódó származtatott instrumentumok esetében (kivéve az opciókat és a csereügyletre szóló opciókat) azt a szerződő felet kell vevőként azonosítani, aki a védelmet megvásárolja, és azt a szerződő felet kell eladóként azonosítani, aki eladja a védelmet.
- (9) Az áruhoz kapcsolódó származtatott ügyletek esetében azt a szerződő felet kell vevőként azonosítani, aki a megadott árut megkapja, és azt a szerződő felet kell eladóként azonosítani, aki szállítja ezt az árut.
- (10) A határidős kamatláb-megállapodások esetében azt a szerződő felet kell vevőként azonosítani, aki a rögzített kamatot fizeti, és azt a szerződő felet kell eladóként azonosítani, aki a rögzített kamatot kapja.

3b. cikk

Biztosítékeszközökkel való fedezettség

- (1) A származtatott ügylet biztosítékeszközökkel való fedezettségének a melléklet 1. táblázata 21. mezőjében meghatározott típusát a bejelentő szerződő félnek a (2)–(5) bekezdéssel összhangban kell azonosítania.
- (2) Ha a szerződő felek nem kötöttek biztosítéki megállapodást, vagy ha a szerződő felek által kötött biztosítéki megállapodás rögzíti, hogy a származtatott ügyletre vonatkozóan a bejelentő fél nem tesz le sem alapletétet, sem változó letétet, a származtatott ügyletet biztosítékeszközökkel nem fedezettként kell azonosítani;
- (3) Ha a szerződő felek által kötött biztosítéki megállapodás rögzíti, hogy a bejelentő fél a származtatott ügyletre vonatkozóan csak rendszeres változó letétet tesz le, a származtatott ügyletet biztosítékeszközökkel részlegesen fedezettként kell azonosítani;
- (4) Ha a szerződő felek által kötött biztosítéki megállapodás rögzíti, hogy a bejelentő fél alapletétet és rendszeres változó letétet tesz le, továbbá a másik szerződő fél a származtatott ügyletre vonatkozóan csak változó letétet tesz le vagy nem tesz le letétet, a származtatott ügyletet biztosítékeszközökkel egyoldalúan fedezettként kell azonosítani;
- (5) Ha a szerződő felek által kötött biztosítéki megállapodás rögzíti, hogy a származtatott ügyletre vonatkozóan mindkét bejelentő fél alapletétet és rendszeres változó letétet tesz le, a származtatott ügyletet biztosítékeszközökkel teljesen fedezettként kell azonosítani.”

3. A 4. cikk helyébe a következő szöveg lép:

„4. cikk

Származtatott ügyletek meghatározása, azonosítása és besorolása

(1) A bejelentésben a származtatott terméket ügylettípus és eszközosztály alapján kell meghatározni a (2) és a (3) bekezdésnek megfelelően.

(2) A származtatott termék típusát a melléklet 2. táblázatának 1. mezőjében kell meghatározni a következő ügylettípusok egyikeként:

- a) különbözetre vonatkozó pénzügyi szerződések;
- b) tőzsdén kívüli határidős kamatláb-megállapodások;
- c) forward ügyletek;
- d) határidős ügyletek;
- e) opciók;
- f) különbözetre fogadás (spreadbet);
- g) swapügyletek;
- h) csereügyletre szóló opciók;
- i) egyéb.

(3) A származtatott terméket a melléklet 2. táblázatának 2. mezőjében kell meghatározni a következő eszközosztályok egyikeként:

- a) áruk és kibocsátási egységek;
- b) hitel;
- c) deviza;
- d) részvény;
- e) kamatláb.

(4) Ha a származtatott termék a (3) bekezdésben meghatározott eszközosztályok egyikébe sem tartozik, a szerződő feleknek a származtatott termékkel a legnagyobb hasonlóságot mutató eszközosztályt kell megadniuk a jelentéstétel során. Mindkét szerződő félnek ugyanazt az eszközosztályt kell megadnia.

(5) A származtatott terméket a melléklet 2. táblázatának 6. mezőjében kell azonosítani a következők megadásával (amennyiben rendelkezésre állnak):

- a) a Bizottság által a 600/2014/EU európai parlamenti és tanácsi rendelet (*) 27. cikke (3) bekezdésének megfelelően elfogadott felhatalmazáson alapuló jogi aktus alkalmazásának kezdő időpontjáig az ISO 6166 szabvány szerinti nemzetközi értékpapír-azonosító szám (ISIN) vagy adott esetben az alternatív eszköazonosító kód (AII).
- b) a Bizottság által a 600/2014/EU rendelet 27. cikke (3) bekezdésének megfelelően elfogadott felhatalmazáson alapuló jogi aktus alkalmazásának kezdő időpontjától az ISIN azonosító szám.

AII kód használata esetén a teljes AII kódot kell megadni.

(6) Az (5) bekezdésben említett teljes AII kód a következő hat elem összefűzéséből adódik:

- a) azon kereskedési helyszín ISO 10383 szabvány szerinti, négy alfanumerikus karakterrel meghatározott piacazonosító kódja (MIC), ahol a származtatott termékkel kereskednek;
- b) a kereskedési helyszín által meghatározott, legfeljebb 12 alfanumerikus karakterből álló kód, amely kizárólag egy adott alapul szolgáló eszközhöz és teljesítési típushoz, továbbá az ügylet egyéb jellemzőihez kapcsolódik;

- c) egy karakter, amely azt jelzi, hogy az eszköz opció vagy határidős tőzsdei ügylet, opció esetében a jelölés „O”, határidős tőzsdei ügylet esetében pedig „F”;
- d) egy karakter, amely azt jelzi, hogy vételi vagy eladási opcióról van-e szó, eladási opció esetében a jelölés „P”, vételi opció esetében pedig „C”; amennyiben az eszközt a c) pontnak megfelelően határidős tőzsdei ügyletként azonosították, a jelzése „F”;
- e) a származtatott ügylet végrehajtásának napja vagy lejáratú időpontja az ISO 8601 szabvány szerinti YYYY-MM-DD formátumban;
- f) egy opció kötési árfolyama, legfeljebb 19 számjegy – ezen belül legfeljebb öt tizedesjegy – megadásával, ahol az első és az utolsó számjegy nem lehet nulla. Tizedesjelként tizedespontot kell használni. Negatív érték nem adható meg. Ha az instrumentum határidős tőzsdei ügylet, ennek az értéknek nullának kell lennie.

(7) Olyan termékek esetében, amelyeket az ISO 6166 szabvány szerinti ISIN kóddal vagy AII kóddal azonosítottak, a származtatott terméket a melléklet 2. táblázatának 4. mezőjében a pénzügyi instrumentumok besorolásához használt, az ISO 10692 szabvány szerinti kóddal (CFI) kell besorolni.

(8) Azokat a származtatott termékeket, amelyekhez nem áll rendelkezésre az ISO 6166 szabvány szerinti ISIN vagy AII, kijelölt kód használatával kell besorolni. Ez a kód:

- a) egyedi;
- b) semleges;
- c) megbízható;
- d) nyílt forrású;
- e) méretezhető;
- f) hozzáférhető;
- g) észszerű költségalapon rendelkezésre áll;
- h) megfelelő irányítási keretrendszer alá tartozik.

(9) Amíg az ESMA nem hagyja jóvá a (8) bekezdésben meghatározott kódot, azon származtatott termékeket, amelyek esetében nem áll rendelkezésre az ISO 6166 szabvány szerinti ISIN kód vagy AII kód, az ISO 10692 szabvány szerinti CFI-kóddal kell besorolni.

(* Az Európai Parlament és a Tanács 2014. május 15-i 600/2014/EU rendelete a pénzügyi eszközök piacairól és a 648/2012/EU rendelet módosításáról (HL L 173., 2014.6.12., 84. o.)”

4. A rendelet a következő 4a. és 4b. cikkel egészül ki:

„4a. cikk

Egyedi ügyletazonosító

(1) A jelentést vagy az ESMA által jóváhagyott globális egyedi ügyletazonosítóval, vagy annak hiányában a szerződő felek által elfogadott egyedi ügyletazonosítóval kell azonosítani.

(2) Amennyiben a szerződő felek nem tudnak megállapodni arról, hogy melyik jogalany felelős a jelentéshez hozzárendelő egyedi ügyletazonosító generálásáért, a szerződő feleknek a következőkkel összhangban kell meghatározniuk az egyedi ügyletazonosító generálásáért felelős jogalanyt:

- a) központilag végrehajtott és elszámolt ügylet esetén a központi szerződő fél generálja az egyedi ügyletazonosítót a klíringtag számára az elszámolásakor. A klíringtagnak egy másik egyedi ügyletazonosítót kell generálnia szerződő fele számára;
- b) központilag végrehajtott, de nem központilag elszámolt ügylet esetén az egyedi ügyletazonosítót a végrehajtás szerinti kereskedési helyszín generálja tagja számára;

- c) központilag visszaigazolt és elszámolt ügylet esetén az egyedi ügyletazonosítót a központi szerződő fél generálja a klíringtag számára az elszámoláskor. A klíringtagnak egy másik egyedi ügyletazonosítót kell generálnia szerződő fele számára;
- d) az elektronikus úton központilag visszaigazolt, de nem központilag elszámolt ügylet esetén az egyedi ügyletazonosítót az ügyletet visszaigazoló platformnak kell generálnia a visszaigazolásakor;
- e) az a)–d) pontban említettektől eltérő valamennyi ügylet esetében a következők alkalmazandók:
- amennyiben pénzügyi szerződő fél kereskedik nem pénzügyi szerződő féllel, a pénzügyi szerződő fél generálja az egyedi ügyletazonosítót;
 - amennyiben az elszámolási értékhatárt meghaladó nem pénzügyi szerződő fél kereskedik az elszámolási értékhatár alá eső nem pénzügyi szerződő féllel, az előbbi szerződő fél generálja az egyedi ügyletazonosítót;
 - az i. és a ii. alpontban nem említett valamennyi egyéb ügylet esetében az eladó generálja az egyedi ügyletazonosítót.
- (3) Az egyedi ügyletazonosítót létrehozó szerződő fél megfelelő időben közli ezt az egyedi ügyletazonosítót a másik szerződő féllel, hogy az utóbbi teljesíteni tudja jelentéstételi kötelezettségét.

4b. cikk

Végrehajtási helyszín

A származtatott ügylet végrehajtásának helyszínét a melléklet 2. táblázatának 15. mezőjében kell azonosítani a következőkkel:

- a) a Bizottság által a 600/2014/EU rendelet 27. cikke (3) bekezdésének megfelelően elfogadott felhatalmazáson alapuló jogi aktus alkalmazásának kezdő időpontjáig:
- az Unión belüli végrehajtási helyszín esetében az ESMA weboldalán – az 1287/2006/EK bizottsági rendelet (*) 13. cikke (2) bekezdésének megfelelően az illetékes hatóságok által biztosított információk alapján összeállított nyilvántartásban – közzétett, ISO 10383 szabvány szerinti piacazonosító kód (MIC);
 - az Unión kívüli végrehajtási helyszín esetében az ISO 10383 szabvány szerinti MIC kód, amelyet a MIC kódok ISO által fenntartott és frissített, továbbá az ISO weboldalán közzétett listája tartalmaz;
- b) a Bizottság által a 600/2014/EU rendelet 27. cikke (3) bekezdésének megfelelően elfogadott felhatalmazáson alapuló jogi aktus alkalmazásának kezdő időpontjától az ISO 10383 szabvány szerinti MIC.

(*) A Bizottság 2006. augusztus 10-i 1287/2006/EK rendelete a 2004/39/EK európai parlamenti és tanácsi irányelvnek a befektetési vállalkozások nyilvántartás-vezetési kötelezettségei, az ügyletek bejelentése, a piac átláthatósága, a pénzügyi eszközök piaci bevezetése, valamint az irányelv alkalmazásában meghatározott kifejezések tekintetében történő végrehajtásáról (HL L 241., 2006.9.2., 1. o.)”

5. Az 5. cikk (4) bekezdésének helyébe a következő szöveg lép:

„(4) A következő származtatott ügyleteket, amelyeket a származtatott termékek adott kategóriájára vonatkozó jelentéstétel kezdő időpontjában lezártak, az említett időponttól számított öt éven belül be kell jelenteni a kereskedési adattárnak:

- amelyek megkötésére 2012. augusztus 16. előtt került sor, és amelyeket 2012. augusztus 16-án még nem zártak le,
- amelyek megkötésére 2012. augusztus 16-án vagy azt követően került sor.”

6. A melléklet helyébe az e rendelet mellékletében meghatározott szöveg lép.

2. cikk

Ez a rendelet az *Európai Unió Hivatalos Lapjában* való kihirdetését követő huszadik napon lép hatályba.

Ez a rendelet 2017. november 1-jétől alkalmazandó, az 1. cikk (5) bekezdésének kivételével, amely a hatálybalépés időpontjától alkalmazandó.

Ez a rendelet teljes egészében kötelező és közvetlenül alkalmazandó valamennyi tagállamban.

Kelt Brüsszelben, 2016. október 19-én.

a Bizottság részéről

az elnök

Jean-Claude JUNCKER

MELLÉKLET

„MELLÉKLET

1. táblázat

A szerződő felek adatai

| | Mező | Formátum |
|---|---|--|
| | Az ügylet szerződő felei | |
| 1 | A bejelentés időbélyegzője | ISO 8601 szabvány szerinti dátumformátum és UTC időformátum (YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ) |
| 2 | A bejelentő szerződő fél azonosítója | Az ISO 17442 szabvány szerinti, 20 alfanumerikus karakterből álló jogalany-azonosító kód (LEI). |
| 3 | A másik szerződő fél azonosítójának típusa | „LEI” – az ISO 17442 szabvány szerinti jogalany-azonosító (LEI) esetén „CLC” – ügyfélkód esetén |
| 4 | A másik szerződő fél azonosítója | Az ISO 17442 szabvány szerinti, 20 alfanumerikus karakterből álló jogalany-azonosító kód (LEI). Ügyfélkód (legfeljebb 50 alfanumerikus karakter). |
| 5 | A másik szerződő fél országa | Az ISO 3166 szabvány szerinti kétbetűs országkód |
| 6 | A bejelentő szerződő fél vállalati szektora | <p>Taxonómia pénzügyi szerződő felek esetén:</p> <p>A = a 2009/138/EK európai parlamenti és tanácsi irányelvvel ⁽¹⁾ összhangban engedélyezett életbiztosító;</p> <p>C = a 2013/36/EU európai parlamenti és tanácsi irányelvvel ⁽²⁾ összhangban engedélyezett hitelintézet;</p> <p>F = a 2004/39/EU európai parlamenti és tanácsi irányelvvel ⁽³⁾ összhangban engedélyezett befektetési vállalkozás;</p> <p>I = a 2009/138/EK irányelvvel összhangban engedélyezett biztosító;</p> <p>L = a 2011/61/EU európai parlamenti és tanácsi irányelvvel ⁽⁴⁾ összhangban engedélyezett vagy nyilvántartásba vett alternatívbefektetési-alap-kezelők (ABAK) által kezelt alternatív befektetési alap;</p> <p>O = a 2003/41/EK európai parlamenti és tanácsi irányelv ⁽⁵⁾ 6. cikke a) pontjának megfelelő foglalkoztatói nyugellátást szolgáltató intézmények;</p> <p>R = a 2009/138/EK irányelvvel összhangban engedélyezett viszontbiztosító;</p> <p>U = a 2009/65/EK európai parlamenti és tanácsi irányelvvel ⁽⁶⁾ összhangban engedélyezett átruházható értékpapírokkal foglalkozó kollektív befektetési vállalkozás (ÁÉKBV) és alapkezelő társasága;</p> <p>Taxonómia nem pénzügyi szerződő felek esetén. A következő kategóriák megfelelnek az Európai Unión belül folyó gazdasági tevékenységek 1893/2006/EK európai parlamenti és tanácsi rendeletben ⁽⁷⁾ meghatározott statisztikai osztályozási rendszere (NACE) fő szakaszainak</p> <p>1 = Mezőgazdaság, erdőgazdálkodás, halászat</p> <p>2 = Bányászat, kőfejtés</p> <p>3 = Feldolgozóipar</p> <p>4 = Villamosenergia-, gáz-, gőzellátás, légkondicionálás</p> |

| | Mező | Formátum |
|----|---------------------------------------|---|
| | | <p>5 = Vízellátás, szennyvíz gyűjtése, kezelése, hulladékgazdálkodás, szennyeződésmérsítés</p> <p>6 = Építőipar</p> <p>7 = Kereskedelem, gépjárműjavítás</p> <p>8 = Szállítás, raktározás</p> <p>9 = Szálláshely-szolgáltatás, vendéglátás</p> <p>10 = Információ, kommunikáció</p> <p>11 = Pénzügyi, biztosítási tevékenység</p> <p>12 = Ingatlanügyletek</p> <p>13 = Szakmai, tudományos, műszaki tevékenység</p> <p>14 = Adminisztratív és szolgáltatást támogató tevékenység</p> <p>15 = Közigazgatás, védelem; kötelező társadalombiztosítás</p> <p>16 = Oktatás</p> <p>17 = Humán-egészségügyi, szociális ellátás</p> <p>18 = Művészet, szórakoztatás, szabadidő</p> <p>19 = Egyéb szolgáltatás</p> <p>20 = Háztartás munkaadói tevékenysége; termék előállítása, szolgáltatás végzése saját fogyasztásra</p> <p>21 = Területen kívüli szervezet</p> <p>Egynél több tevékenység bejelentése esetén a kódokat a megfelelő tevékenységek relatív fontossága szerinti sorrendben kell felsorolni, kötőjellel elválasztva („-”).</p> <p>Központi szerződő felek és a 648/2012/EU rendelet 1. cikkének (5) bekezdése szerinti egyéb típusú szerződő felek esetén üresen kell hagyni.</p> |
| 7 | A bejelentő szerződő fél jellege | <p>F = pénzügyi szerződő fél</p> <p>N = nem pénzügyi szerződő fél</p> <p>C = központi szerződő fél</p> <p>O = egyéb</p> |
| 8 | Bróker azonosítója | Az ISO 17442 szabvány szerinti, 20 alfanumerikus karakterből álló jogalany-azonosító kód (LEI). |
| 9 | Bejelentő jogalany azonosítója | Az ISO 17442 szabvány szerinti, 20 alfanumerikus karakterből álló jogalany-azonosító kód (LEI) |
| 10 | Klíringtag azonosítója | Az ISO 17442 szabvány szerinti, 20 alfanumerikus karakterből álló jogalany-azonosító kód (LEI) |
| 11 | Kedvezményezett azonosítójának típusa | <p>„LEI” – az ISO 17442 szabvány szerinti jogalany-azonosító (LEI) esetén</p> <p>„CLC” – ügyfélkód esetén</p> |
| 12 | Kedvezményezett azonosítója | Az ISO 17442 szabvány szerinti, 20 alfanumerikus karakterből álló jogalany-azonosító kód (LEI) vagy legfeljebb 50 alfanumerikus karakterből álló ügyfélkód, amennyiben az ügyfél nem jogosult jogalany-azonosítóra |

| | Mező | Formátum |
|----|---|--|
| 13 | Kereskedési szerep | P = saját számlára A = ügyfélszámlára |
| 14 | Vétel/eladás jelzése | B = vevő, S = eladó A 3a. cikkben meghatározottak szerint kitöltve |
| 15 | Kereskedelmi tevékenységhez vagy likviditásfinanszírozáshoz közvetlenül kapcsolódik | Y = igen N = nem |
| 16 | Elszámolási értékhatár | Y = értékhatár felett N = értékhatár alatt |
| 17 | Az ügylet értéke | Legfeljebb 20 numerikus karakter, beleértve a tizedesjegyeket. A tizedesjel nem számít numerikus karakternek. A használandó tizedesjel a pont. Negatív szám megadásakor a negatív előjel nem számít numerikus karakternek. |
| 18 | Az érték pénzneme | ISO 4217 szabvány szerinti pénznemkód, 3 alfabetikus karakter |
| 19 | Az értékelés időbélyegzője | ISO 8601 szabvány szerinti dátum UTC időformátumban (YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ) |
| 20 | Értékelés típusa | M = piaci értéken O = modell alapján C = központi szerződő fél értékelése alapján. |
| 21 | Biztosítésközökkel való fedezettség | U = biztosítésközökkel nem fedezett PC = biztosítésközökkel részben fedezett OC = egyoldalúan fedezett FC = teljes mértékben fedezett A 3b. cikkben meghatározottak szerint kitöltve |
| 22 | Biztosítésköz portfóliószint | Y = igen N = nem |
| 23 | Biztosítésközökkel fedezett portfólió kódja | Legfeljebb 52 alfanumerikus karakter, beleértve négy speciális karaktert: „, - _.” A kód elején és végén nem állhat speciális karakter. Szóköz nem megengedett. |
| 24 | Nyújtott alapletét | Legfeljebb 20 numerikus karakter, beleértve a tizedesjegyeket. A tizedesjel nem számít numerikus karakternek. A használandó tizedesjel a pont. |
| 25 | A nyújtott alapletét pénzneme | ISO 4217 szabvány szerinti pénznemkód, 3 alfabetikus karakter |

| | Mező | Formátum |
|----|---------------------------------------|---|
| 26 | Nyújtott változó letét | Legfeljebb 20 numerikus karakter, beleértve a tizedesjegyeket. A tizedesjel nem számít numerikus karakternek. A használandó tizedesjel a pont. |
| 27 | A nyújtott változó letét pénzneme | ISO 4217 szabvány szerinti pénznemkód, 3 alfabetikus karakter |
| 28 | Kapott alapletét | Legfeljebb 20 numerikus karakter, beleértve a tizedesjegyeket. A tizedesjel nem számít numerikus karakternek. A használandó tizedesjel a pont. |
| 29 | A kapott alapletét pénzneme | ISO 4217 szabvány szerinti pénznemkód, 3 alfabetikus karakter |
| 30 | Kapott változó letét | Legfeljebb 20 numerikus karakter, beleértve a tizedesjegyeket. A tizedesjel nem számít numerikus karakternek. A használandó tizedesjel a pont. |
| 31 | A kapott változó letét pénzneme | ISO 4217 szabvány szerinti pénznemkód, 3 alfabetikus karakter |
| 32 | Nyújtott többletbiztosíték | Legfeljebb 20 numerikus karakter, beleértve a tizedesjegyeket. A tizedesjel nem számít numerikus karakternek. A használandó tizedesjel a pont. |
| 33 | A nyújtott többletbiztosíték pénzneme | ISO 4217 szabvány szerinti pénznemkód, 3 alfabetikus karakter |
| 34 | Kapott többletbiztosíték | Legfeljebb 20 numerikus karakter, beleértve a tizedesjegyeket. A tizedesjel nem számít numerikus karakternek. A használandó tizedesjel a pont. |
| 35 | A kapott többletbiztosíték pénzneme | ISO 4217 szabvány szerinti pénznemkód, 3 alfabetikus karakter |

(¹) Az Európai Parlament és a Tanács 2009. november 25-i 2009/138/EK irányelve a biztosítási és viszontbiztosítási üzleti tevékenység megkezdéséről és gyakorlásáról (Szolvencia II.) (HL L 335., 2009.12.17., 1. o.).

(²) Az Európai Parlament és a Tanács 2013. június 26-i 2013/36/EU irányelve a hitelintézetek tevékenységéhez való hozzáférésről és a hitelintézetek és befektetési vállalkozások prudenciális felügyeletéről, a 2002/87/EK irányelv módosításáról, a 2006/48/EK és a 2006/49/EK irányelv hatályon kívül helyezéséről (HL L 176., 2013.6.27., 338. o.).

(³) Az Európai Parlament és a Tanács 2004. április 21-i 2004/39/EK irányelve a pénzügyi eszközök piacairól, a 85/611/EGK és a 93/6/EGK tanácsi irányelv, és a 2000/12/EK európai parlamenti és tanácsi irányelv módosításáról, valamint a 93/22/EGK tanácsi irányelv hatályon kívül helyezéséről (HL L 145., 2004.4.30., 1. o.).

(⁴) Az Európai Parlament és a Tanács 2011. június 8-i 2011/61/EU irányelve az alternatív befektetésialap-kezelőkről, valamint a 2003/41/EK és a 2009/65/EK irányelv, továbbá az 1060/2009/EK és az 1095/2010/EU rendelet módosításáról (HL L 174., 2011.7.1., 1. o.).

(⁵) Az Európai Parlament és a Tanács 2003. június 3-i 2003/41/EK irányelve a foglalkoztatói nyugellátást szolgáltató intézmények tevékenységéről és felügyeletéről (HL L 235., 2003.9.23., 10. o.).

(⁶) Az Európai Parlament és a Tanács 2009. július 13-i 2009/65/EK irányelve az átruházható értékpapírokkal foglalkozó kollektív befektetési vállalkozásokra (ÁÉKBV) vonatkozó törvényi, rendeleti és közigazgatási rendelkezések összehangolásáról (HL L 302., 2009.11.17., 32. o.).

(⁷) Az Európai Parlament és a Tanács 2006. december 20-i 1893/2006/EK rendelete a gazdasági tevékenységek statisztikai osztályozása NACE Rev. 2. rendszerének létrehozásáról és a 3037/90/EGK tanácsi rendelet, valamint egyes meghatározott statisztikai területekre vonatkozó EK-rendeletek módosításáról (HL L 393., 2006.12.30., 1. o.).

2. táblázat

Általános adatok

| | Mező | Formátum | Érintett származtatott- ügylet-típusok |
|---|--|---|---|
| | 2a. szakasz – Ügylettípus | | Minden ügylet |
| 1 | Ügylet típusa | CD = különbözetre vonatkozó pénzügyi szerződések FR = határidős kamatláb-megállapodások FU = határidős ügyletek FW = forward ügyletek OP = opciók SB = különbözetre fogadás SW = swap ST = csereügyletre szóló opció OT = egyéb | |
| 2 | Eszközosztály | CO = áru és kibocsátási egység CR = hitel CU = deviza EQ = részvény IR = kamatláb | |
| | 2b. szakasz – Az ügyletre vonatkozó információk | | Minden ügylet |
| 3 | A termék besorolásának típusa | C = CFI U = UPI | |
| 4 | A termék besorolása | ISO 10692 szabvány szerinti CFI, 6 karakterből álló alfabetikus kód Elfogadott UPI | |
| 5 | Termékazonosító típusa | Adja meg az alkalmazandó azonosítót: I = ISIN A = AII | |
| 6 | Termékazonosító | Az I típusú termékazonosítónál: ISO 6166 szabvány szerinti ISIN, 12 karakterből álló alfanumerikus kód Az A típusú termékazonosítónál: teljes AII kód a 4. cikk (8) bekezdésének megfelelően | |

| | Mező | Formátum | Érintett származtatott- tűgyelet-típusok |
|----|---|---|---|
| 7 | Az alapul szolgáló eszköz azonosítójának típusa | I = ISIN A = AII U = UPI B = kosár; X = index | |
| 8 | Az alapul szolgáló eszköz azonosítója | Alapul szolgáló eszköz, I típus: ISO 6166 szabvány szerinti ISIN, 12 karakterből álló alfanumerikus kód Alapul szolgáló eszköz, A típus: teljes AII kód a 4. cikk (8) bekezdésének megfelelően Alapul szolgáló eszköz, U típus: UPI Alapul szolgáló eszköz, B típus: valamennyi egyedi összetevő ISO 6166 szabvány szerinti ISIN azonosítója vagy a teljes AII kód a 4. cikk (8) bekezdésének megfelelően. Az egyedi összetevők azonosítóit kötőjellel („-”) kell elválasztani. Alapul szolgáló eszköz, X típus: ISO 6166 szabvány szerinti ISIN, amennyiben rendelkezésre áll, egyéb esetben az indexhez az index nyújtója által hozzárendelt teljes név | |
| 9 | Névleges pénznem 1 | ISO 4217 szabvány szerinti pénznemkód, 3 alfabetikus karakter | |
| 10 | Névleges pénznem 2 | ISO 4217 szabvány szerinti pénznemkód, 3 alfabetikus karakter | |
| 11 | Teljesítés pénzneme | ISO 4217 szabvány szerinti pénznemkód, 3 alfabetikus karakter | |
| | 2c. szakasz – Az ügylet részletei | | Minden ügylet |
| 12 | Ügyletazonosító | Amíg nem áll rendelkezésre globális egyedi ügyletazonosító, legfeljebb 52 alfanumerikus karakterből álló kód, beleértve négy speciális karaktert: „. - _.” A kód elején és végén nem állhat speciális karakter. Szóköz nem megengedett. | |
| 13 | A jelentés azonosító száma | Legfeljebb 52 karaktert tartalmazó alfanumerikus mező | |
| 14 | Összetett ügylet összetevőinek azonosítója | Legfeljebb 35 karaktert tartalmazó alfanumerikus mező | |
| 15 | Végrehajtási helyszín | ISO 10383 szabvány szerinti, 4 alfanumerikus karakterből álló piacazonosító kód (MIC) a 4. cikk b) pontjának megfelelően. | |

| | Mező | Formátum | Érintett származtatott- tűgylet-típusok |
|----|-----------------|--|--|
| 16 | Tömörítés | Y = az ügylet tömörítés eredménye N = az ügylet nem tömörítés eredménye | |
| 17 | Ár/ráta | Legfeljebb 20 numerikus karakter, beleértve a tizedesjegyeket. A tizedesjel nem számít numerikus karakternek. A használandó tizedesjel a pont. Negatív szám megadásakor a negatív előjel nem számít numerikus karakternek. Amennyiben az ár megadása százalékos értékkel történik, azt százalékban kell kifejezni, ahol 100 a 100 %-nak felel meg. | |
| 18 | Árjelzés | U = egységek P = százalék Y = hozam | |
| 19 | Az ár pénzneme | ISO 4217 szabvány szerinti pénznemkód, 3 alfabetikus karakter | |
| 20 | Névleges összeg | Legfeljebb 20 numerikus karakter, beleértve a tizedesjegyeket. A tizedesjel nem számít numerikus karakternek. A használandó tizedesjel a pont. Negatív szám megadásakor a negatív előjel nem számít numerikus karakternek. | |
| 21 | Árszorzó | Legfeljebb 20 numerikus karakter, beleértve a tizedesjegyeket. A tizedesjel nem számít numerikus karakternek. A használandó tizedesjel a pont. | |
| 22 | Mennyiség | Legfeljebb 20 numerikus karakter, beleértve a tizedesjegyeket. A tizedesjel nem számít numerikus karakternek. A használandó tizedesjel a pont. | |
| 23 | Előlegfizetés | Legfeljebb 20 numerikus karakter, beleértve a tizedesjegyeket. A negatív előjel a kifizetés teljesítését, nem a kézhezvételét jelzi. A tizedesjel nem számít numerikus karakternek. A használandó tizedesjel a pont. Negatív szám megadásakor a negatív előjel nem számít numerikus karakternek. | |

| | Mező | Formátum | Érintett származtatott- ügylet-típusok |
|----|---|---|---|
| 24 | Teljesítés típusa | C = készpénz P = fizikai O = opcionális a szerződő fél számára vagy harmadik fél határozza meg | |
| 25 | A végrehajtás időbélyegzője | ISO 8601 szabvány szerinti dátum UTC időformátumban (YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ) | |
| 26 | Hatálybalépés napja | ISO 8601 szabvány szerinti dátum YYYY-MM-DD formátumban | |
| 27 | Lejárat időpontja | ISO 8601 szabvány szerinti dátum YYYY-MM-DD formátumban | |
| 28 | Lezárás időpontja | ISO 8601 szabvány szerinti dátum YYYY-MM-DD formátumban | |
| 29 | Kiegyenlítés időpontja | ISO 8601 szabvány szerinti dátum YYYY-MM-DD formátumban | |
| 30 | Keretmegállapodás típusa | Szabad szöveg, legfeljebb 50 karaktert tartalmazó mező, a használt keretmegállapodás nevének azonosítására, ha van ilyen. | |
| 31 | A keretmegállapodás verziója | ISO 8601 szabvány szerinti dátum YYYY formátumban | |
| | 2d. szakasz – Kockázatmérés/kezelés/bejelentés | | Minden ügylet |
| 32 | A visszaigazolás időbélyegzője | ISO 8601 szabvány szerinti dátum UTC időformátumban (YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ) | |
| 33 | Visszaigazolás módja | Y = nem elektronikusan visszaigazolt N = nem visszaigazolt E = elektronikusan visszaigazolt | |
| | 2e. szakasz – Elszámolás | | Minden ügylet |
| 34 | Elszámolási kötelezettség | Y = igen N = nem | |
| 35 | Elszámolva | Y = igen N = nem | |
| 36 | Az elszámolás időbélyegzője | ISO 8601 szabvány szerinti dátum UTC időformátumban (YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ) | |
| 37 | Központi szerződő fél | ISO 17442 szabvány szerinti jogalany-azonosító (LEI) 20 alfanumerikus karakterből álló kód | |

| | Mező | Formátum | Érintett származtatott- tűgylet-típusok |
|----|--|--|---|
| 38 | Csoporton belüli | Y = igen N = nem | |
| | 2f. szakasz – Kamatlábak | | Származtatott kamatláb- ügyletek |
| 39 | Az 1. oldal rögzített kamatlába | Legfeljebb 10 numerikus karakter, beleértve a tizedesjegyeket, százalékban kifejezve, ahol 100 a 100 %. A tizedesjel nem számít numerikus karakternek. A használandó tizedesjel a pont. Negatív szám megadásakor a negatív előjel nem számít numerikus karakternek. | |
| 40 | A 2. oldal rögzített kamatlába | Legfeljebb 10 numerikus karakter, beleértve a tizedesjegyeket, százalékban kifejezve, ahol 100 a 100 %. A tizedesjel nem számít numerikus karakternek. A használandó tizedesjel a pont. Negatív szám megadásakor a negatív előjel nem számít numerikus karakternek. | |
| 41 | A rögzített kamat-számítási időszak napjainak száma – 1. oldal | Számláló/nevező, ahol mindkettő numerikus karakter vagy a „tényleges” kifejezés, például 30/360 vagy tényleges/365 | |
| 42 | A rögzített kamat-számítási időszak napjainak száma – 2. oldal | Számláló/nevező, ahol mindkettő numerikus karakter vagy a „tényleges” kifejezés, például 30/360 vagy tényleges/365 | |
| 43 | A rögzített kamat-fizetés gyakorisága – 1. oldal – időszak | Az az időszak, amely kifejezi, hogy a szerződő felek milyen gyakran teljesítenek egymásnak kifizetéseket, a következő rövidítésekkel: Y – év M – hónap W – hét D – nap | |

| | Mező | Formátum | Érintett származtatott- tűgylet-típusok |
|----|--|--|--|
| 44 | A rögzített kamat-fizetés gyakorisága – 1. oldal – szorzó | Azon időszak egész szorzója, amely leírja, hogy a szerződő felek milyen gyakran teljesítenek egymásnak kifizetéseket. Legfeljebb 3 numerikus karakter. | |
| 45 | A rögzített kamat-fizetés gyakorisága – 2. oldal – időszak | Az az időszak, amely kifejezi, hogy a szerződő felek milyen gyakran teljesítenek egymásnak kifizetéseket, a következő rövidítésekkel: Y – év M – hónap W – hét D – nap | |
| 46 | A rögzített kamat-fizetés gyakorisága – 2. oldal – szorzó | Azon időszak egész szorzója, amely leírja, hogy a szerződő felek milyen gyakran teljesítenek egymásnak kifizetéseket. Legfeljebb 3 numerikus karakter. | |
| 47 | A változó kamat-fizetés gyakorisága – 1. oldal – időszak | Az az időszak, amely kifejezi, hogy a szerződő felek milyen gyakran teljesítenek egymásnak kifizetéseket, a következő rövidítésekkel: Y – év M – hónap W – hét D – nap | |
| 48 | A változó kamat-fizetés gyakorisága – 1. oldal – szorzó | Azon időszak egész szorzója, amely leírja, hogy a szerződő felek milyen gyakran teljesítenek egymásnak kifizetéseket. Legfeljebb 3 numerikus karakter. | |
| 49 | A változó kamat-fizetés gyakorisága – 2. oldal – időszak | Az az időszak, amely kifejezi, hogy a szerződő felek milyen gyakran teljesítenek egymásnak kifizetéseket, a következő rövidítésekkel: Y – év M – hónap W – hét D – nap | |
| 50 | A változó kamat-fizetés gyakorisága – 2. oldal – szorzó | Azon időszak egész szorzója, amely leírja, hogy a szerződő felek milyen gyakran teljesítenek egymásnak kifizetéseket. Legfeljebb 3 numerikus karakter. | |

| | Mező | Formátum | Érintett származtatott-tütylet-típusok |
|----|---|---|--|
| 51 | A változó kamatláb ismételt megállapításának gyakorisága – 1. oldal – időszak | Az az időszak, amely kifejezi, hogy a szerződő felek milyen gyakran állapítják meg ismételten a változó kamatlábat, a következő rövidítésekkel: Y – év M – hónap W – hét D – nap | |
| 52 | A változó kamatláb ismételt megállapításának gyakorisága – 1. oldal – szorzó | Azon időszak egész szorzója, amely leírja, hogy a szerződő felek milyen gyakran állapítják meg ismételten a változó kamatlábat. Legfeljebb 3 numerikus karakter. | |
| 53 | A változó kamatláb ismételt megállapításának gyakorisága – 2. oldal – időszak | Az az időszak, amely kifejezi, hogy a szerződő felek milyen gyakran állapítják meg ismételten a változó kamatlábat, a következő rövidítésekkel: Y – év M – hónap W – hét D – nap | |
| 54 | A változó kamatláb ismételt megállapításának gyakorisága – 2. oldal – szorzó | Azon időszak egész szorzója, amely leírja, hogy a szerződő felek milyen gyakran állapítják meg ismételten a változó kamatlábat. Legfeljebb 3 numerikus karakter. | |
| 55 | Az 1. oldal változó kamatlába | A változó kamatláb indexének neve „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 | |

| | Mező | Formátum | Érintett származtatott-tütylet-típusok |
|----|---|--|--|
| | | „CDOR” – CDOR „CIBO” – CIBOR „MOSP” – MOSPRIM „NIBO” – NIBOR „PRBO” – PRIBOR „TLBO” – TELBOR „WIBO” – WIBOR „TREA” – Treasury „SWAP” – SWAP „FUSW” – Future SWAP Vagy legfeljebb 25 alfanumerikus karakter – ha a fenti lista nem tartalmazza a referencia-kamatláb- bat | |
| 56 | A változó kamatláb referencia-időszaka – 1. oldal – időszak | A referencia-időszakot leíró időszak, a következő rövidítések alkalmazásával: Y – év M – hónap W – hét D – nap | |
| 57 | A változó kamatláb referencia-időszaka – 1. oldal – szorzó | A referencia-időszakot leíró időszak egész szorzója. Legfeljebb 3 numerikus karakter. | |
| 58 | A 2. oldal változó kamatlába | A változó kamatláb indexének neve „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 | |

| | Mező | Formátum | Érintett származtatott-tütylet-típusok |
|----|---|---|--|
| | | <p>„NIBO” – NIBOR „PRBO” – PRIBOR „TLBO” – TELBOR „WIBO” – WIBOR „TREA” – Treasury „SWAP” – SWAP „FUSW” – Future SWAP</p> <p>Vagy legfeljebb 25 alfanumerikus karakter – ha a fenti lista nem tartalmazza a referencia-kamatlábát</p> | |
| 59 | A változó kamatláb referencia-időszaka – 2. oldal – időszak | <p>A referencia-időszakot leíró időszak, a következő rövidítések alkalmazásával:</p> <p>Y – év M – hónap W – hét D – nap</p> | |
| 60 | A változó kamatláb referencia-időszaka – 2. oldal – szorzó | <p>A referencia-időszakot leíró időszak egész szorzója. Legfeljebb 3 numerikus karakter.</p> | |
| | 2 g. szakasz – Deviza | | Származtatott devizaügyletek |
| 61 | Teljesítési pénznem 2 | <p>ISO 4217 szabvány szerinti, 3 alfabetikus karakterből álló pénznemkód</p> | |
| 62 | Átváltási árfolyam 1 | <p>Legfeljebb 10 numerikus karakter, beleértve a tizedesjegyeket.</p> <p>A tizedesjel nem számít numerikus karakternek. A használandó tizedesjel a pont.</p> <p>Negatív szám megadásakor a negatív előjel nem számít numerikus karakternek.</p> | |
| 63 | Forward árfolyam | <p>Legfeljebb 10 numerikus karakter, beleértve a tizedesjegyeket.</p> <p>A tizedesjel nem számít numerikus karakternek. A használandó tizedesjel a pont.</p> <p>Negatív szám megadásakor a negatív előjel nem számít numerikus karakternek.</p> | |

| | Mező | Formátum | Érintett származtatottügylet-típusok |
|----|---|--|---|
| 64 | Árfolyam alapja | Két, ISO 4217 szabvány szerinti pénznemkód „/” jellel elválasztva. Az első pénznemkód jelzi az alapdevizát, a második pedig a jegyzési devizát. | |
| | 2h. szakasz – Áruk és kibocsátási egységek | | Árualapú származtatott termékek és kibocsátás-kereskedelmi derivatívák |
| | Általános információk | | |
| 65 | Árualap | AG = mezőgazdasági EN = energia FR = áruszállítás ME = fémek IN = index EV = környezeti EX = egzotikus OT = egyéb | |
| 66 | Az áru részletei | Mezőgazdasági GO = gabona, olajos magvak DA = tejtermékek LI = állatállomány FO = erdészeti termékek SO = mezőgazdasági termékek (softs) SF = tengeri eredetű élelmiszerek OT = egyéb Energia OI = olaj NG = földgáz CO = szén EL = villamos energia IE = energiaközi termékek OT = egyéb Áruszállítás DR = száraz WT = nedves OT = egyéb Fémek PR = nemesfémek NP = nem nemesfémek Környezeti WE = időjárás EM = kibocsátás OT = egyéb | |

| | Mező | Formátum | Érintett származtatott-tütylet-típusok |
|----|--------------------------------------|---|--|
| | Energia | | |
| 67 | Teljesítési pont vagy zóna | EIC-kód, 16 karakterből álló alfanumerikus kód Ismételhető mező. | |
| 68 | Összekapcsolási pont | EIC-kód, 16 karakterből álló alfanumerikus kód | |
| 69 | Terhelés típusa | BL = alapterhelés PL = csúcsterhelés OP = völgyidőszak BH = óra/időblokk SH = görbealakítás GD = gáznap OT = egyéb | |
| | A 70–77. mező ismételtető szakasza | | |
| 70 | A terhelés teljesítési intervallumai | hh:mmZ | |
| 71 | Teljesítés kezdőnapja és időpontja | ISO 8601 szabvány szerinti dátum UTC időformátumban (YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ) | |
| 72 | Teljesítés zárónapja és időpontja | ISO 8601 szabvány szerinti dátum UTC időformátumban (YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ) | |
| 73 | Időtartam | N = percek H = óra D = nap W = hét M = hónap Q = negyedév S = évszak Y = éves O = egyéb | |
| 74 | A hét napjai | WD = hétköznapok WN = hétvége MO = hétfő TU = kedd WE = szerda TH = csütörtök FR = péntek SA = szombat SU = vasárnap Több érték megadása megengedett, ezeket „/” jellel kell elválasztani. | |

| | Mező | Formátum | Érintett származtatott- tűgylet-típusok |
|----|--------------------------------|---|--|
| 75 | Teljesítési kapacitás | Legfeljebb 20 numerikus karakter, beleértve a tizedesjegyeket. A tizedesjel nem számít numerikus karakternek. A használandó tizedesjel a pont. Negatív szám megadásakor a negatív előjel nem számít numerikus karakternek. | |
| 76 | Mennyiségi egység | 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 | Ár/idejintervallum mennyiségek | Legfeljebb 20 numerikus karakter, beleértve a tizedesjegyeket. A tizedesjel nem számít numerikus karakternek. A használandó tizedesjel a pont. Negatív szám megadásakor a negatív előjel nem számít numerikus karakternek. | |
| | 2i. szakasz – Opciók | | Opciót tartalmazó ügyletek |
| 78 | Az opció típusa | P = eladási C = vételi O = ha nem lehet meghatározni, hogy vételi vagy eladási opcióról van-e szó | |
| 79 | Az opció gyakorlásának típusa | A – amerikai típusú opció B = Bermuda-opció E = európai típusú opció S = ázsiai típusú opció Egynél több érték megengedett. | |

| | Mező | Formátum | Érintett származtatottügylet-típusok |
|----|--|--|--------------------------------------|
| 80 | Kötési árfolyam (plafon/padló) | Legfeljebb 20 numerikus karakter, beleértve a tizedesjegyeket. A tizedesjel nem számít numerikus karakternek. A használandó tizedesjel a pont. Negatív szám megadásakor a negatív előjel nem számít numerikus karakternek. Ha a kötési ár megadása százalékos értékkel történik, azt százalékban kell kifejezni, ahol 100 a 100 %. | |
| 81 | Kötési árfolyam jelzése | U = egységek P = százalék Y = hozam | |
| 82 | Az alapul szolgáló eszköz lejáratának dátuma | ISO 8601 szabvány szerinti dátum YYYY-MM-DD formátumban | |
| | 2j. szakasz – Származtatott hitelügyletek | | |
| 83 | Szenioritás | SNDB = Előresorolt, mint például az előresorolt fedezetlen adósság (vállalati/pénzügyi), devizában denominált államadósság (kormány), SBOD = alárendelt, mint például az alárendelt vagy alsóbb szintű Tier 2 adósság (bankok), junior alárendelt vagy felsőbb szintű Tier 2 adósság (bankok), OTHR = egyéb, például elsőbbségi részvény vagy Tier 1 tőke (bankok) vagy egyéb hitelderivatívák | |
| 84 | Referencia-jogalany | Az ISO 3166 szabvány szerinti kétbetűs országkód vagy Az ISO 3166-2 szabvány szerinti kétbetűs országkód, amelyhez kötőjellel („-”) kapcsolódik az ország aleggységének legfeljebb három alfanumerikus karakterből álló kódja vagy Az ISO 17442 szabvány szerinti, 20 alfanumerikus karakterből álló jogalany-azonosító kód (LEI) | |
| 85 | Fizetés gyakorisága | MNTH = havi QURT = negyedéves MIAN = féléves YEAR = éves | |
| 86 | A számítás alapja | Számláló/nevező, ahol mindkettő numerikus karakter vagy a „tényleges” kifejezés, például 30/360 vagy tényleges/365 | |

| | Mező | Formátum | Érintett származtatott- tűgyelet-típusok |
|----|---|--|---|
| 87 | Sorozat | Legfeljebb öt karakterből álló egész számokat tartalmazó mező | |
| 88 | Verzió | Legfeljebb öt karakterből álló egész számokat tartalmazó mező | |
| 89 | Indextényező | Legfeljebb 10 numerikus karakter, beleértve a tizedesjegyeket. A tizedesjel nem számít numerikus karakternek. A használandó tizedesjel a pont. | |
| 90 | Ügyletrészsorozat | T = ügyletrészsorozatba sorolt U = ügyletrészsorozatba nem sorolt | |
| 91 | Alsó értékhatár | Legfeljebb 10 numerikus karakter, beleértve a tizedesjegyeket, 0 és 1 közötti tizedes törttel kifejezve. A tizedesjel nem számít numerikus karakternek. A használandó tizedesjel a pont. | |
| 92 | Felső értékhatár | Legfeljebb 10 numerikus karakter, beleértve a tizedesjegyeket, 0 és 1 közötti tizedes törttel kifejezve. A tizedesjel nem számít numerikus karakternek. A használandó tizedesjel a pont. | |
| | 2k. szakasz – Az ügylet módosítása | | |
| 93 | Az intézkedés típusa | N = új M = módosítás E = hiba C = idő előtti lezárás R = korrekció Z = tömörítés V = értékelési frissítés P = pozíció-összetevő | |
| 94 | Szint | T = kereskedési P = pozíció” | |