

REGULAMENTUL DE PUNERE ÎN APLICARE (UE) 2017/105 AL COMISIEI**din 19 octombrie 2016****de modificare a Regulamentului de punere în aplicare (UE) nr. 1247/2012 al Comisiei de stabilire a unor standarde tehnice de punere în aplicare în ceea ce privește formatul și frecvența rapoartelor de tranzacție transmise către registrele centrale de tranzacții în conformitate cu Regulamentul (UE) nr. 648/2012 al Parlamentului European și al Consiliului privind instrumentele financiare derivate extrabursiere, contrapărțile centrale și registrele centrale de tranzacții****(Text cu relevanță pentru SEE)**

COMISIA EUROPEANĂ,

având în vedere Tratatul privind funcționarea Uniunii Europene,

având în vedere Regulamentul (UE) nr. 648/2012 al Parlamentului European și al Consiliului din 4 iulie 2012 privind instrumentele financiare derivate extrabursiere, contrapărțile centrale și registrele centrale de tranzacții ⁽¹⁾, în special articolul 9 alineatul (6),

întrucât:

- (1) Regulamentul de punere în aplicare (UE) nr. 1247/2012 al Comisiei ⁽²⁾ prevede utilizarea indicatorilor interimari ai entităților în cazul în care nu este disponibil un identificator al entității juridice. Recent a devenit disponibilă o infrastructură prin care se pot atribui entităților identificatori ai entității juridice, iar participanții la piață s-au familiarizat cu utilizarea acestor identificatori. Prin urmare, identificatorii entității juridice ar trebui să fie de acum singurul mijloc acceptat pentru identificarea entităților juridice.
- (2) Stabilirea calității de cumpărător sau vânzător a unei contrapărți raportoare este o sarcină deosebit de complexă în cazul contractelor derivate swap, întrucât astfel de contracte presupun schimbul de instrumente financiare între părți. Prin urmare, ar trebui stabilite norme specifice pentru a se asigura stabilirea cu acuratețe și cu consecvență a entităților care au calitatea de cumpărător și a celor care au calitatea de vânzător în cadrul contractelor derivate swap.
- (3) Pentru a determina expunerile reale ale contrapărților, autoritățile competente au nevoie de informații complete și exacte privind garanțiile schimbate între acestea. În consecință, ar trebui stabilite norme specifice care să asigure o abordare consecventă în ceea ce privește raportarea garanțiilor constituite pentru un anumit contract sau portofoliu derivat.
- (4) Clasificarea exactă și identificarea cu precizie a instrumentelor financiare derivate este esențială pentru utilizarea eficientă a datelor și pentru agregarea acestora la nivelul registrelor centrale de tranzacții de așa natură încât rezultatul să aibă sens, contribuind astfel la îndeplinirea obiectivelor stabilite de Consiliul pentru stabilitate financiară în cadrul Studiului de fezabilitate privind agregarea datelor referitoare la registrele centrale de tranzacții cu instrumente financiare derivate extrabursiere (*Feasibility Study on Aggregation of OTC Derivatives Trade Repository Data*) ⁽³⁾, publicat la 19 septembrie 2014. Prin urmare, cerințele de raportare referitoare la clasificarea și identificarea instrumentelor financiare derivate ar trebui modificate astfel încât aceste informații să fie puse integral la dispoziția autorităților competente.
- (5) Pentru a permite raportarea referitoare la noi tipuri de contracte derivate care devin disponibile și sunt tranzacționate frecvent ca urmare a inovării din domeniul financiar, swaption-urile și speculațiile financiare de tip spread bet ar trebui adăugate la lista claselor de contracte derivate. Într-o perspectivă mai generală, dat fiind că inovarea financiară continuă să dă naștere la noi tipuri de contracte derivate, este important să se asigure că este posibilă și raportarea tipurilor noi de contracte derivate care nu se încadrează în clasificarea existentă. Prin urmare, este oportună menținerea categoriei „alte” în cadrul clasificării tipurilor de contracte derivate.
- (6) Dacă două contrapărți nu reușesc să stabilească de comun acord care contraparte ar trebui să genereze un identificator unic de tranzacție până la termenul de raportare prevăzut, identificarea corectă și asocierea celor două rapoarte referitoare la aceeași tranzacție se pot dovedi imposibile. Prin urmare, este necesar să se stabilească criterii pentru generarea identificatorilor unici de tranzacție, astfel încât să se evite contabilizarea de două ori a unei tranzacții.

⁽¹⁾ JO L 201, 27.7.2012, p. 1.⁽²⁾ Regulamentul de punere în aplicare (UE) nr. 1247/2012 al Comisiei din 19 decembrie 2012 de stabilire a unor standarde tehnice de punere în aplicare în ceea ce privește formatul și frecvența rapoartelor de tranzacție transmise către registrele centrale de tranzacții în conformitate cu Regulamentul (UE) nr. 648/2012 al Parlamentului European și al Consiliului privind instrumentele financiare derivate extrabursiere, contrapărțile centrale și registrele centrale de tranzacții (JO L 352, 21.12.2012, p. 20).⁽³⁾ http://www.fsb.org/wp-content/uploads/r_140919.pdf

- (7) Contrapărțile se pot confrunta cu dificultăți semnificative în încercarea de a obține toate informațiile relevante privitoare la tranzacțiile care au luat sfârșit înainte de data de început a raportării. Având în vedere complexitatea raportării tranzacțiilor care au luat sfârșit și faptul că astfel de tranzacții nu contribuie la creșterea riscului sistemic, perioada de raportare a tranzacțiilor care au luat sfârșit ar trebui prelungită de la trei la cinci ani de la data de început a raportării.
- (8) Pentru a asigura armonizarea deplină a datelor raportate către registrele centrale de tranzacții, permițând astfel interpretarea și agregarea consecventă a acestora, ar trebui clarificate standardele și formatele care trebuie utilizate în rapoartele de tranzacție. Este, de asemenea, oportun să se modifice cerințele de raportare în ceea ce privește formatele datelor. Prin urmare, contrapărțile și registrele centrale de tranzacții ar trebui să aibă la dispoziție suficient timp pentru a lua toate măsurile necesare conformării la cerințele modificate.
- (9) Prin urmare, Regulamentul de punere în aplicare (UE) nr. 1247/2012 ar trebui modificat în consecință.
- (10) Prezentul regulament se bazează pe proiectul de standarde tehnice de punere în aplicare transmis Comisiei de către Autoritatea Europeană pentru Valori Mobiliare și Piețe (ESMA).
- (11) În conformitate cu articolul 15 din Regulamentul (UE) nr. 1095/2010 al Parlamentului European și al Consiliului ⁽¹⁾, ESMA a organizat consultări publice deschise cu privire la aceste proiecte de standarde tehnice de punere în aplicare, a analizat potențialele costuri și beneficii aferente și a solicitat avizul Grupului părților interesate din domeniul valorilor mobiliare și piețelor, menționat la articolul 37 din regulamentul respectiv,

ADOPTĂ PREZENTUL REGULAMENT:

Articolul 1

Regulamentul de punere în aplicare (UE) nr. 1247/2012 se modifică după cum urmează:

1. Articolul 3 se înlocuiește cu următorul text:

„Articolul 3

Identificarea contrapărților și a altor entități

Un raport utilizează un identificator al entității juridice pentru a identifica:

- (a) un beneficiar care este o persoană juridică;
- (b) o entitate de brokeraj;
- (c) o CPC;
- (d) un membru compensator;
- (e) o contraparte care este o persoană juridică;
- (f) o entitate care transmite raportul.”

2. Se introduc următoarele articole 3a și 3b:

„Articolul 3a

Calitatea contrapărții

- (1) Calitatea contrapărții la contractul derivat menționată în câmpul 14 din tabelul 1 din anexă se determină în conformitate cu alineatele (2)-(10).
- (2) În cazul opțiunilor și swaption-urilor, contraparta care are dreptul de a exercita opțiunea este identificată drept cumpărător, iar contraparta care vinde opțiunea și primește prima este identificată drept vânzător.

⁽¹⁾ Regulamentul (UE) nr. 1095/2010 al Parlamentului European și al Consiliului din 24 noiembrie 2010 de instituire a Autorității europene de supraveghere (Autoritatea europeană pentru valori mobiliare și piețe), de modificare a Deciziei nr. 716/2009/CE și de abrogare a Deciziei 2009/77/CE a Comisiei (JO L 331, 15.12.2010, p. 84).

- (3) În cazul contractelor futures și forward care nu au legătură cu valutele, contrapartea care cumpără instrumentul este identificată drept cumpărător, iar contrapartea care vinde instrumentul este identificată drept vânzător.
- (4) În cazul swap-urilor pe titluri de valoare, contrapartea care suportă riscul modificării prețului titlului de valoare suport și care primește valoarea titlului este identificată drept cumpărător, iar contrapartea care plătește valoarea titlului este identificată drept vânzător.
- (5) În cazul swap-urilor pe rata dobânzii sau pe indici ai inflației, contrapartea care plătește rata fixă este identificată drept cumpărător, iar contrapartea care primește rata fixă este identificată drept vânzător. În cazul swap-urilor variabil-contra-variabil, contrapartea care plătește marja este identificată drept cumpărător, iar contrapartea care primește marja este identificată drept vânzător.
- (6) În cazul swap-urilor valutare și al swap-urilor și contractelor forward pe valute, contrapartea care primește valuta a cărei denumire figurează prima în ordine alfabetică în standardul ISO 4217 al Organizației Internaționale de Standardizare este identificată drept cumpărător, iar contrapartea care livrează valuta este identificată drept vânzător.
- (7) În cazul swap-urilor pe dividende, contrapartea care primește echivalentul plăților de dividende efective este identificată drept cumpărător, iar contrapartea care plătește dividendele și primește rata fixă este identificată drept vânzător.
- (8) În cazul instrumentelor financiare derivate pentru transferul riscului de credit, cu excepția opțiunilor și a swaption-urilor, contrapartea care cumpără protecția este identificată drept cumpărător, iar contrapartea care vinde protecția este identificată drept vânzător.
- (9) În cazul contractelor derivate pe mărfuri, contrapartea care primește marfa indicată în raport este identificată drept cumpărător, iar contrapartea care livrează marfa este identificată drept vânzător.
- (10) În cazul contractelor forward pe rata dobânzii, contrapartea care plătește rata fixă este identificată drept cumpărător, iar contrapartea care primește rata fixă este identificată drept vânzător.

Articolul 3b

Constituirea de garanții

- (1) Tipul de garanții constituite la contractul derivat menționat în câmpul 21 din tabelul 1 din anexă este identificat de contrapartea raportoare în conformitate cu alineatele (2)-(5).
- (2) Dacă între contrapărți nu există un contract de garanții sau dacă un astfel de acord stipulează că contrapartea raportoare nu depune nici o marjă inițială, nici marje de variație referitor la contractul derivat, acesta este identificat drept „fără garanții constituite”.
- (3) Dacă contractul de garanții încheiat între contrapărți stipulează că contrapartea raportoare depune regulat doar marje de variație pentru contractul derivat, acesta este identificat ca având „garanții parțiale”.
- (4) Dacă contractul de garanții dintre contrapărți stipulează că contrapartea raportoare depune marja inițială și apoi depune regulat marje de variație, iar cealaltă contraparte fie depune doar marje de variație, fie nu depune nicio marjă în ceea ce privește contractul derivat, acesta este identificat ca având „garanții unilaterale”.
- (5) Dacă contractul de garanții încheiat între contrapărți stipulează că ambele contrapărți depun marja inițială și apoi depun regulat marje de variație în ceea ce privește contractul derivat, acesta este identificat ca având „garanții integrale”.

3. Articolul 4 se înlocuiește cu următorul text:

„Articolul 4

Specificarea, identificarea și clasificarea instrumentelor financiare derivate

(1) Un instrument financiar derivat este specificat în rapoarte în funcție de tipul de contract și de clasa de active, în conformitate cu alineatele (2) și (3).

(2) În câmpul 1 din tabelul 2 din anexă, instrumentul financiar derivat este specificat ca aparținând unuia dintre următoarele tipuri de contracte:

- (a) contract financiar pe diferență;
- (b) contract forward pe rata dobânzii;
- (c) contract forward;
- (d) contract futures;
- (e) opțiune;
- (f) speculație financiară de tip spread bet;
- (g) swap;
- (h) swaption;
- (i) altele.

(3) În câmpul 2 din tabelul 2 din anexă, instrumentul financiar derivat este specificat ca aparținând uneia dintre următoarele clase de active:

- (a) mărfuri și certificate de emisii;
- (b) credit;
- (c) monedă;
- (d) capitaluri proprii;
- (e) rata dobânzii.

(4) În cazul instrumentelor financiare derivate care nu aparțin niciuneia dintre clasele de active prevăzute la alineatul (3), contrapărțile specifică în raport clasa de active care se aseamănă cel mai mult instrumentului derivat în cauză. Ambele contrapărți specifică aceeași clasă de active.

(5) În câmpul 6 din tabelul 2 din anexă, instrumentul financiar derivat este identificat cu ajutorul următoarelor elemente, dacă acestea sunt disponibile:

- (a) un număr internațional de identificare a valorilor mobiliare (cod ISIN) ISO 6166 sau un cod de identificare a unui instrument alternativ (AII), după caz, până la data aplicării actului delegat adoptat de Comisie în temeiul articolului 27 alineatul (3) din Regulamentul (UE) nr. 600/2014 al Parlamentului European și al Consiliului (*);
- (b) un cod ISIN, de la data aplicării actului delegat adoptat de Comisie în temeiul articolului 27 alineatul (3) din Regulamentul (UE) nr. 600/2014.

Dacă se utilizează un cod AII, acesta trebuie să fie complet.

(6) Codul AII complet prevăzut la alineatul (5) se obține prin concatenarea următoarelor șase elemente:

- (a) codul pentru identificarea piețelor (MIC) ISO 10383 al locului de tranzacționare în care este tranzacționat instrumentul financiar derivat, compus din patru caractere alfanumerice;
- (b) codul, compus din maximum 12 caractere alfanumerice, atribuit de locul de tranzacționare, care este unic pentru un anumit instrument financiar suport, un anumit tip de decontare și alte caracteristici ale contractului;

- (c) un singur caracter, prin care se indică dacă instrumentul este o opțiune sau un contract futures, acest caracter fiind „O” în cazul opțiunilor și „F” în cazul contractelor futures;
 - (d) în cazul opțiunilor, un singur caracter, prin care se indică dacă opțiunea este de tip „put” sau „call”, acest caracter fiind „P” în cazul opțiunilor „put” și „C” în cazul opțiunilor „call”; dacă instrumentul a fost identificat drept contract futures la litera (c), acesta va fi desemnat cu caracterul „F”;
 - (e) data de exercitare sau scadența contractului derivat, exprimată conform standardului ISO 8601, în formatul AAAA-LL-ZZ;
 - (f) prețul de exercitare al opțiunii, exprimat prin maximum 19 cifre, inclusiv maximum cinci zecimale, fără niciun caracter 0 la început sau la sfârșit. Separatorul zecimal utilizat este punctul. Nu sunt permise valorile negative. Dacă instrumentul este un contract futures, prețul de exercitare este 0.
- (7) În câmpul 4 din tabelul 2 din anexă, instrumentul financiar derivat este clasificat cu ajutorul codului CFI (de clasificare a instrumentelor financiare) ISO 10692 pentru produsele identificate printr-un cod ISIN ISO 6166 sau printr-un cod All.
- (8) Instrumentele financiare derivate pentru care nu este disponibil nici un cod ISIN ISO 6166, nici un cod All sunt clasificate printr-un cod desemnat. Acest cod trebuie să fie:
- (a) unic;
 - (b) neutru;
 - (c) fiabil;
 - (d) cu sursă deschisă;
 - (e) scalabil;
 - (f) accesibil;
 - (g) disponibil la un cost rezonabil;
 - (h) supus unui cadru de guvernare adecvat.
- (9) Până când codul prevăzut la alineatul (8) este aprobat de ESMA, instrumentele financiare derivate pentru care nu există nici un cod ISIN ISO 6166, nici un cod All sunt clasificate cu ajutorul unui cod CFI ISO 10692.

(*) Regulamentul (UE) nr. 600/2014 al Parlamentului European și al Consiliului din 15 mai 2014 privind piețele instrumentelor financiare și de modificare a Regulamentului (UE) nr. 648/2012 (JO L 173, 12.6.2014, p. 84)."

4. Se introduc următoarele articole 4a și 4b:

„Articolul 4a

Identificatorul unic de tranzacție

- (1) Un raport este identificat fie printr-un identificator unic de tranzacție aprobat de ESMA, fie, în absența acestuia, printr-un identificator unic de tranzacție convenit de contrapărți.
- (2) În cazul în care contrapărțile nu reușesc să stabilească de comun acord entitatea responsabilă cu generarea identificatorului unic de tranzacție care trebuie atribuit raportului, acestea stabilesc entitatea responsabilă cu generarea identificatorului unic de tranzacție în conformitate cu următoarele reguli:
 - (a) în cazul tranzacțiilor executate și compensate la nivel central, identificatorul unic de tranzacție este generat în momentul compensării de către contrapartea centrală (CPC) pentru membrul compensator. Acesta generează un alt identificator unic de tranzacție pentru contrapartea sa;
 - (b) în cazul tranzacțiilor care sunt executate la nivel central, dar nu și compensate la nivel central, identificatorul unic de tranzacție este generat de locul de tranzacționare în care are loc executarea, pentru membrul său;

- (c) în cazul tranzacțiilor confirmate și compensate la nivel central, identificatorul unic de tranzacție este generat în momentul compensării de către contrapartea centrală (CPC) pentru membrul compensator. Acesta generează un alt identificator unic de tranzacție pentru contrapartea sa;
- (d) în cazul tranzacțiilor care sunt confirmate la nivel central prin mijloace electronice, dar nu sunt compensate la nivel central, identificatorul unic de tranzacție este generat de platforma de confirmare a tranzacțiilor în momentul confirmării;
- (e) în cazul tuturor tranzacțiilor diferite de cele prevăzute la literele (a)-(d), se aplică următoarele reguli:
- (i) dacă o contraparte financiară efectuează tranzacții cu o contraparte nefinanciară, identificatorul unic de tranzacție este generat de contrapartea financiară;
- (ii) dacă o contraparte nefinanciară situată deasupra pragului de compensare efectuează tranzacții cu o contraparte nefinanciară situată sub acest prag, identificatorul unic de tranzacție este generat de cea dintâi;
- (iii) în cazul tuturor tranzacțiilor diferite de cele prevăzute la punctele (i) și (ii), identificatorul unic de tranzacție este generat de vânzător.
- (3) Contrapartea care generează identificatorul unic de tranzacție comunică acest identificator celeilalte contrapărți în timp util, astfel încât aceasta din urmă să fie în măsură să își îndeplinească obligațiile de raportare.

Articolul 4b

Locul de executare

Locul de executare al contractului derivat este identificat în câmpul 15 din tabelul 2 din anexă după cum urmează:

- (a) până la data aplicării actului delegat adoptat de Comisie în temeiul articolului 27 alineatul (3) din Regulamentul (UE) nr. 600/2014:
- (i) pentru locurile de executare situate în Uniune, prin codul pentru identificarea piețelor (MIC) ISO 10383 publicat pe site-ul web al ESMA în registrul creat pe baza informațiilor furnizate de autoritățile competente în temeiul articolului 13 alineatul (2) din Regulamentul (CE) nr. 1287/2006 al Comisiei (*);
- (ii) pentru locurile de executare situate în afara Uniunii, prin codul MIC ISO 10383 inclus în lista codurilor MIC gestionată și actualizată de ISO și publicată pe site-ul web al ISO;
- (b) de la data aplicării actului delegat adoptat de Comisie în temeiul articolului 27 alineatul (3) din Regulamentul (UE) nr. 600/2014, prin codul MIC ISO 10383.

(* Regulamentul (CE) nr. 1287/2006 al Comisiei din 10 august 2006 de punere în aplicare a Directivei 2004/39/CE a Parlamentului European și a Consiliului privind obligațiile întreprinderilor de investiții de păstrare a evidenței și înregistrărilor, raportarea tranzacțiilor, transparența pieței, admiterea de instrumente financiare în tranzacții și definiția termenilor în sensul directivei în cauză (JO L 241, 2.9.2006, p. 1)."

5. La articolul 5, alineatul (4) se înlocuiește cu următorul text:

„(4) Dacă nu sunt în derulare la data de început a raportării pentru o anumită clasă de instrumente financiare derivate, următoarele contracte derivate se raportează către un registru central de tranzacții în termen de cinci ani de la data respectivă:

- (a) contractele derivate care au fost încheiate înainte de 16 august 2012 și erau încă în derulare la 16 august 2012;
- (b) contractele derivate care au fost încheiate la 16 august 2012 sau după această dată.”

6. Anexa se înlocuiește cu textul din anexa la prezentul regulament.

Articolul 2

Prezentul regulament intră în vigoare în a douăzecea zi de la data publicării în *Jurnalul Oficial al Uniunii Europene*.

Se aplică de la 1 noiembrie 2017, cu excepția articolului 1 alineatul (5), care se aplică de la data intrării în vigoare.

Prezentul regulament este obligatoriu în toate elementele sale și se aplică direct în toate statele membre.

Adoptat la Bruxelles, 19 octombrie 2016.

Pentru Comisie
Președintele
Jean-Claude JUNCKER

ANEXĂ

„ANEXĂ

Tabelul 1

Date privind contrapărțile

	Câmp	Format
	Părți contractante	
1	Marca temporală a raportării	Data și ora în conformitate cu standardul UTC (timpul universal coordonat), în formatul ISO 8601, după cum urmează: AAAA-LL-ZZThh:mm:ssZ
2	Identificatorul contrapărții care efectuează raportarea	Identificatorul entității juridice în conformitate cu ISO 17442 (LEI; 20 de caractere alfanumerice).
3	Tipul de identificator al celeilalte contrapărți	„LEI”, reprezentând identificatorul entității juridice în conformitate cu ISO 17442 „CLC”, reprezentând codul de client
4	Identificatorul celeilalte contrapărți	Identificatorul entității juridice în conformitate cu ISO 17442 (LEI; 20 de caractere alfanumerice). Codul de client (până la 50 de caractere alfanumerice).
5	Țara celeilalte contrapărți	ISO 3166 – codul de țară compus din două caractere
6	Sectorul contrapărții care efectuează raportarea	<p>Taxonomia aplicabilă contrapărților financiare:</p> <p>A = întreprindere de asigurări autorizată în conformitate cu Directiva 2009/138/CE a Parlamentului European și a Consiliului (¹)</p> <p>C = instituție de credit autorizată în conformitate cu Directiva 2013/36/UE a Parlamentului European și a Consiliului (²)</p> <p>F = firmă de investiții autorizată în conformitate cu Directiva 2004/39/CE a Parlamentului European și a Consiliului (³)</p> <p>I = instituție de asigurări autorizată în conformitate cu Directiva 2009/138/CE</p> <p>L = fond alternativ de investiții administrat de un AFIA autorizat sau înregistrat în conformitate cu Directiva 2011/61/UE a Parlamentului European și a Consiliului (⁴)</p> <p>O = instituție pentru furnizarea de pensii ocupaționale, în sensul articolului 6 litera (a) din Directiva 2003/41/CE a Parlamentului European și a Consiliului (⁵)</p> <p>R = instituție de reasigurări autorizată în conformitate cu Directiva 2009/138/CE</p> <p>U = Organisme de plasament colectiv în valori mobiliare (OPCVM) și societățile lor de administrare, autorizate în conformitate cu Directiva 2009/65/CE a Parlamentului European și a Consiliului (⁶)</p> <p>Taxonomia aplicabilă contrapărților nefinanciare. Următoarele categorii corespund principalelor secțiuni din Nomenclatorul statistic al activităților economice în Comunitatea Europeană (NACE), astfel cum este definit în Regulamentul (CE) nr. 1893/2006 al Parlamentului European și al Consiliului (⁷)</p> <p>1 = Agricultură, silvicultură și pescuit</p> <p>2 = Industria extractivă</p> <p>3 = Industria prelucrătoare</p> <p>4 = Furnizarea energiei electrice, gazelor naturale, aburului și aerului condiționat</p>

	Câmp	Format
		<p>5 = Distribuția apei; lucrări de canalizare, activități de gestionare a deșeurilor și de depoluare</p> <p>6 = Construcții</p> <p>7 = Comerțul cu ridicata și cu amănuntul; repararea autovehiculelor și motocicletelor</p> <p>8 = Transporturi și depozitare</p> <p>9 = Servicii de cazare și restaurante</p> <p>10 = Informare și comunicații</p> <p>11 = Activități financiare și de asigurări</p> <p>12 = Activități imobiliare</p> <p>13 = Activități specializate, științifice și tehnice</p> <p>14 = Servicii administrative și activități de sprijin</p> <p>15 = Administrație publică și apărare; asigurări sociale obligatorii</p> <p>16 = Educație</p> <p>17 = Activități privind sănătatea umană și asistența socială</p> <p>18 = Arte, spectacole și activități recreative</p> <p>19 = Alte activități de servicii</p> <p>20 = Activități ale gospodăriilor în calitate de angajatori; activități nediferențiate ale gospodăriilor în calitate de producători de bunuri și servicii pentru uz propriu</p> <p>21 = Activități ale organizațiilor și organismelor extrateritoriale</p> <p>Dacă este raportată mai mult de o activitate, codurile se enumeră în ordinea importanței relative a activităților respective, separate prin caracterul „-”.</p> <p>Nu se completează nimic în cazul contrapărților centrale și al tipurilor de contrapărți prevăzute la articolul 1 alineatul (5) din Regulamentul (UE) nr. 648/2012.</p>
7	Natura contrapărții care efectuează raportarea	<p>F = contraparte financiară</p> <p>N = contraparte nefinanciară</p> <p>C = contraparte centrală</p> <p>O = altele</p>
8	Identificatorul brokerului	Identificatorul entității juridice în conformitate cu ISO 17442 (LEI; 20 de caractere alfanumerice).
9	Identificatorul entității raportoare	Identificatorul entității juridice în conformitate cu ISO 17442 (LEI; 20 de caractere alfanumerice)
10	Identificatorul membrului compensator	Identificatorul entității juridice în conformitate cu ISO 17442 (LEI; 20 de caractere alfanumerice)
11	Tipul de identificator al beneficiarului	<p>„LEI”, reprezentând identificatorul entității juridice în conformitate cu ISO 17442</p> <p>„CLC”, reprezentând codul de client</p>
12	Identificatorul beneficiarului	Identificatorul entității juridice în conformitate cu ISO 17442 (LEI; 20 de caractere alfanumerice) sau codul de client, format din până la 50 de caractere alfanumerice, dacă clientul nu este eligibil pentru un identificator al entității juridice

	Câmp	Format
13	Calitatea în care se efectuează tranzacții	P = comitent A = agent
14	Calitatea contrapărții	B = cumpărător S = vânzător Completat în conformitate cu articolul 3a
15	Conexiune directă cu o activitate comercială sau cu o finanțare de trezorerie	Y = Da N = Nu
16	Prag de compensare	Y = Situate peste prag N = Situate sub prag
17	Valoarea contractului	Până la 20 de caractere numerice, inclusiv zecimalele. Separatorul zecimal nu este considerat caracter numeric. Dacă este utilizat, acesta este reprezentat printr-un punct. Semnul negativ, dacă este utilizat, nu este considerat caracter numeric.
18	Moneda în care este exprimată valoarea	Codul monedei în format ISO 4217, trei caractere alfabetice.
19	Marca temporală a evaluării	Data și ora în conformitate cu standardul UTC, în formatul ISO 8601, după cum urmează: AAAA-LL-ZZThh:mm:ssZ
20	Tipul de evaluare	M = raportare la piață O = raportare la model C = evaluarea CPC
21	Nivelul de constituire a garanției	U = fără garanții constituite PC = garanții parțiale OC = garanții univoce FC = garanții integrale Completat în conformitate cu articolul 3b
22	Portofoliu de garanții	Y = Da N = Nu
23	Codul portofoliului de garanții	Până la 52 de caractere alfanumerice, inclusiv patru caractere speciale: „.. - _.” Utilizarea caracterelor speciale nu este permisă la începutul și la sfârșitul codului. Nu se permite utilizarea spațiilor.
24	Marja inițială depusă	Până la 20 de caractere numerice, inclusiv zecimalele. Separatorul zecimal nu este considerat caracter numeric. Dacă este utilizat, acesta este reprezentat printr-un punct.
25	Moneda marjei inițiale depuse	Codul monedei în format ISO 4217, trei caractere alfabetice.

	Câmp	Format
26	Marja de variație depusă	Până la 20 de caractere numerice, inclusiv zecimalele. Separatorul zecimal nu este considerat caracter numeric. Dacă este utilizat, acesta este reprezentat printr-un punct.
27	Moneda marjei de variație depuse	Codul monedei în format ISO 4217, trei caractere alfabetice.
28	Marja inițială primită	Până la 20 de caractere numerice, inclusiv zecimalele. Separatorul zecimal nu este considerat caracter numeric. Dacă este utilizat, acesta este reprezentat printr-un punct.
29	Moneda marjei inițiale primite	Codul monedei în format ISO 4217, trei caractere alfabetice.
30	Marja de variație primită	Până la 20 de caractere numerice, inclusiv zecimalele. Separatorul zecimal nu este considerat caracter numeric. Dacă este utilizat, acesta este reprezentat printr-un punct.
31	Moneda marjei de variație primite	Codul monedei în format ISO 4217, trei caractere alfabetice.
32	Garanțiile excedentare depuse	Până la 20 de caractere numerice, inclusiv zecimalele. Separatorul zecimal nu este considerat caracter numeric. Dacă este utilizat, acesta este reprezentat printr-un punct.
33	Moneda garanțiilor excedentare depuse	Codul monedei în format ISO 4217, trei caractere alfabetice.
34	Garanțiile excedentare primite	Până la 20 de caractere numerice, inclusiv zecimalele. Separatorul zecimal nu este considerat caracter numeric. Dacă este utilizat, acesta este reprezentat printr-un punct.
35	Moneda garanțiilor excedentare primite	Codul monedei în format ISO 4217, trei caractere alfabetice.

(1) Directiva 2009/138/CE a Parlamentului European și a Consiliului din 25 noiembrie 2009 privind accesul la activitate și desfășurarea activității de asigurare și de reasigurare (Solvabilitate II) (JO L 335, 17.12.2009, p. 1).

(2) Directiva 2013/36/UE a Parlamentului European și a Consiliului din 26 iunie 2013 cu privire la accesul la activitatea instituțiilor de credit și supravegherea prudențială a instituțiilor de credit și a firmelor de investiții, de modificare a Directivei 2002/87/CE și de abrogare a Directivelor 2006/48/CE și 2006/49/CE (JO L 176, 27.6.2013, p. 338).

(3) Directiva 2004/39/CE a Parlamentului European și a Consiliului din 21 aprilie 2004 privind piețele instrumentelor financiare, de modificare a Directivelor 85/611/CEE și 93/6/CEE ale Consiliului și a Directivei 2000/12/CE a Parlamentului European și a Consiliului și de abrogare a Directivei 93/22/CEE a Consiliului (JO L 145, 30.4.2004, p. 1).

(4) Directiva 2011/61/UE a Parlamentului European și a Consiliului din 8 iunie 2011 privind administratorii fondurilor de investiții alternative și de modificare a Directivelor 2003/41/CE și 2009/65/CE și a Regulamentelor (CE) nr. 1060/2009 și (UE) nr. 1095/2010 (JO L 174, 1.7.2011, p. 1).

(5) Directiva 2003/41/CE a Parlamentului European și a Consiliului din 3 iunie 2003 privind activitățile și supravegherea instituțiilor pentru furnizarea de pensii ocupaționale (JO L 235, 23.9.2003, p. 10).

(6) Directiva 2009/65/CE a Parlamentului European și a Consiliului din 13 iulie 2009 de coordonare a actelor cu putere de lege și a actelor administrative privind organismele de plasament colectiv în valori mobiliare (OPCVM) (JO L 302, 17.11.2009, p. 32).

(7) Regulamentul (CE) nr. 1893/2006 al Parlamentului European și al Consiliului din 20 decembrie 2006 de stabilire a Nomenclatorului statistic al activităților economice NACE a doua revizuire și de modificare a Regulamentului (CEE) nr. 3037/90 al Consiliului, precum și a anumitor regulamente CE privind domenii statistice specifice (JO L 393, 30.12.2006, p. 1).

Tabelul 2

Date comune

	Câmp	Format	Tipuri de contracte derivate aplicabile
	Secțiunea 2a – Tipul de contract		Toate contractele
1	Tipul de contract	CD = contracte financiare pe diferență FR = contracte forward pe rata dobânzii FU = contracte futures FW = contracte forward OP = opțiuni SB = speculații financiare de tip spread bet SW = swapuri ST = swaption-uri OT = altele	
2	Clasa de active	CO = mărfuri și certificate de emisii CR = credit CU = monedă EQ = capitaluri proprii IR = rata dobânzii	
	Secțiunea 2b – Informații privind contractele		Toate contractele
3	Clasificarea tipului de produs	C = CFI U = UPI	
4	Clasificarea produsului	Cod CFI ISO 10692, compus din 6 caractere alfanumerice UPI aprobat	
5	Tipul de identificare a produsului	A se preciza codul de identificare aplicabil: I = ISIN A = AII	
6	Identificarea produsului	Pentru identificatorul de produs de tipul I: cod ISIN ISO 6166, compus din 12 caractere alfanumerice Pentru identificatorul de produs de tipul A: Codul AII complet, în conformitate cu articolul 4 alineatul (8)	

	Câmp	Format	Tipuri de contracte derivate aplicabile
7	Tipul de identificare a produsului-suport	I = ISIN A = AII U = UPI B = coș X = indice	
8	Identificarea produsului-suport	Pentru identificatorul produsului-suport de tipul I: cod ISIN ISO 6166, compus din 12 caractere alfanumerice Pentru identificatorul produsului-suport de tipul A: cod AII complet, în conformitate cu articolul 4 alineatul (8) Pentru identificatorul produsului-suport de tipul U: UPI Pentru identificatorul produsului-suport de tipul B: identificarea tuturor componentelor individuale printr-un cod ISIN ISO 6166 sau printr-un cod AII complet, în conformitate cu articolul 4 alineatul (8). Identificatorii diferitelor componente sunt separați printr-o liniuță („-”). Pentru identificatorul produsului-suport de tipul X: Codul ISIN ISO 6166, dacă există, în caz contrar denumirea completă a indicelui atribuită de furnizorul acestuia	
9	Moneda noțională 1	Codul monedei în format ISO 4217, trei caractere alfabetice.	
10	Moneda noțională 2	Codul monedei în format ISO 4217, trei caractere alfabetice.	
11	Moneda de livrare	Codul monedei în format ISO 4217, trei caractere alfabetice.	
	Secțiunea 2c – Detalii privind tranzacția		Toate contractele
12	Identificatorul tranzacției	Până când va deveni disponibil un identificator unic de tranzacție global, un cod de până la 52 de caractere alfanumerice care include patru caractere speciale: „- _.” Utilizarea caracterelor speciale nu este permisă la începutul și la sfârșitul codului. Nu se permite utilizarea spațiilor.	
13	Numărul de urmărire a raportării	Un câmp alfanumeric cu până la 52 de caractere.	
14	Identificatorul unei componente a unei tranzacții complexe	Un câmp alfanumeric cu până la 35 de caractere.	
15	Locul de executare	Codul pentru identificarea piețelor (MIC) ISO 10383, patru caractere alfanumerice, în conformitate cu articolul 4 litera (b).	

	Câmp	Format	Tipuri de contracte derivate aplicabile
16	Comprimare	Y = contractul este rezultatul comprimării; N = contractul nu este rezultatul comprimării.	
17	Preț/rată	Până la 20 de caractere numerice, inclusiv zecimalele. Separatorul zecimal nu este considerat caracter numeric. Dacă este utilizat, acesta este reprezentat printr-un punct. Semnul negativ, dacă este utilizat, nu este considerat caracter numeric. Dacă prețul este raportat sub formă de valori procentuale, acesta trebuie exprimat ca procentaj, valoarea de 100 % fiind reprezentată sub forma „100”	
18	Modul în care este exprimat prețul	U = unități P = procentaj Y = randament	
19	Moneda în care este exprimat prețul	Codul monedei în format ISO 4217, trei caractere alfabetice.	
20	Valoare noțională	Până la 20 de caractere numerice, inclusiv zecimalele. Separatorul zecimal nu este considerat caracter numeric. Dacă este utilizat, acesta este reprezentat printr-un punct. Semnul negativ, dacă este utilizat, nu este considerat caracter numeric.	
21	Multiplicatorul de preț	Până la 20 de caractere numerice, inclusiv zecimalele. Separatorul zecimal nu este considerat caracter numeric. Dacă este utilizat, acesta este reprezentat printr-un punct.	
22	Cantitate	Până la 20 de caractere numerice, inclusiv zecimalele. Separatorul zecimal nu este considerat caracter numeric. Dacă este utilizat, acesta este reprezentat printr-un punct.	
23	Plata în avans	Până la 20 de caractere numerice, inclusiv zecimalele. Pentru a semnala că plata a fost făcută, nu primită, se utilizează semnul negativ. Separatorul zecimal nu este considerat caracter numeric. Dacă este utilizat, acesta este reprezentat printr-un punct. Semnul negativ, dacă este utilizat, nu este considerat caracter numeric.	

	Câmp	Format	Tipuri de contracte derivate aplicabile
24	Tipul de livrare	C = numerar P = fizic O = la alegerea contrapărții sau atunci când este stabilită de către un terț	
25	Marca temporală a executării	Data și ora în conformitate cu standardul UTC, în formatul ISO 8601, după cum urmează: AAAA-LL-ZZThh:mm:ssZ	
26	Data intrării în vigoare	Data în formatul ISO 8601, după cum urmează: AAAA-LL-ZZ	
27	Data scadenței	Data în formatul ISO 8601, după cum urmează: AAAA-LL-ZZ	
28	Data încetării	Data în formatul ISO 8601, după cum urmează: AAAA-LL-ZZ	
29	Data decontării	Data în formatul ISO 8601, după cum urmează: AAAA-LL-ZZ	
30	Tipul de acord-cadru	Text liber, câmp cu până la 50 de caractere care identifică denumirea acordului-cadru utilizat, dacă există.	
31	Versiunea acordului-cadru	Data în formatul ISO 8601, după cum urmează: AAAA	
	Secțiunea 2d – Atenuarea riscurilor/Raportare		Toate contractele
32	Marca temporală a confirmării	Data și ora în conformitate cu standardul UTC, în formatul ISO 8601, după cum urmează: AAAA-LL-ZZThh:mm:ssZ	
33	Mijloace de confirmare	Y = confirmată prin mijloace neelectronice N = neconfirmată E = confirmată prin mijloace electronice	
	Secțiunea 2e – Compensarea		Toate contractele
34	Obligație de compensare	Y = Da N = Nu	
35	Compensat	Y = Da N = Nu	
36	Marca temporală a compensării	Data și ora în conformitate cu standardul UTC, în formatul ISO 8601, după cum urmează: AAAA-LL-ZZThh:mm:ssZ	
37	CPC	LEI, reprezentând identificatorul entității juridice în conformitate cu ISO 17442 Cod compus din 20 de caractere alfanumerice	

	Câmp	Format	Tipuri de contracte derivate aplicabile
38	În interiorul grupului	Y = Da N = Nu	
	Secțiunea 2f – Ratele dobânzii		Instrumente financiare derivate pe rata dobânzii
39	Rata fixă a segmentului 1	Până la 10 caractere numerice, inclusiv zecimalele, exprimate sub formă de procentaj, valoarea de 100 % fiind reprezentată sub forma „100”. Separatorul zecimal nu este considerat caracter numeric. Dacă este utilizat, acesta este reprezentat printr-un punct. Semnul negativ, dacă este utilizat, nu este considerat caracter numeric.	
40	Rata fixă a segmentului 2	Până la 10 caractere numerice, inclusiv zecimalele, exprimate sub formă de procentaj, valoarea de 100 % fiind reprezentată sub forma „100”. Separatorul zecimal nu este considerat caracter numeric. Dacă este utilizat, acesta este reprezentat printr-un punct. Semnul negativ, dacă este utilizat, nu este considerat caracter numeric.	
41	Numărul de zile al ratei fixe, segmentul 1	Numărător/numitor, unde atât numărătorul, cât și numitorul sunt caractere numerice sau expresia alfabetică „Actual”, de exemplu 30/360 sau Actual/365	
42	Numărul de zile al ratei fixe, segmentul 2	Numărător/numitor, unde atât numărătorul, cât și numitorul sunt caractere numerice sau expresia alfabetică „Actual”, de exemplu 30/360 sau Actual/365	
43	Frecvența de plată a ratei fixe din segmentul 1 – perioada de timp	Perioada de timp care descrie frecvența cu care contrapărțile își fac plăți reciproce; se aplică următoarele prescurtări: Y = an M = lună W = săptămână D = zi	

	Câmp	Format	Tipuri de contracte derivate aplicabile
44	Frecvența de plată a ratei fixe din segmentul 1 – multiplicator	Un multiplicator întreg al unei perioade de timp care descrie frecvența cu care contrapărțile își fac plăți reciproce. Până la trei caractere numerice.	
45	Frecvența de plată a ratei fixe din segmentul 2 – perioada de timp	Perioada de timp care descrie frecvența cu care contrapărțile își fac plăți reciproce; se aplică următoarele prescurtări: Y = an M = lună W = săptămână D = zi	
46	Frecvența de plată a ratei fixe din segmentul 2 – multiplicator	Un multiplicator întreg al unei perioade de timp care descrie frecvența cu care contrapărțile își fac plăți reciproce. Până la trei caractere numerice.	
47	Frecvența de plată a ratei variabile din segmentul 1 – perioada de timp	Perioada de timp care descrie frecvența cu care contrapărțile își fac plăți reciproce; se aplică următoarele prescurtări: Y = an M = lună W = săptămână D = zi	
48	Frecvența de plată a ratei variabile din segmentul 1 – multiplicator	Un multiplicator întreg al unei perioade de timp care descrie frecvența cu care contrapărțile își fac plăți reciproce. Până la trei caractere numerice.	
49	Frecvența de plată a ratei variabile din segmentul 2 – perioada de timp	Perioada de timp care descrie frecvența cu care contrapărțile își fac plăți reciproce; se aplică următoarele prescurtări: Y = an M = lună W = săptămână D = zi	
50	Frecvența de plată a ratei variabile din segmentul 2 – multiplicator	Un multiplicator întreg al unei perioade de timp care descrie frecvența cu care contrapărțile își fac plăți reciproce. Până la trei caractere numerice.	

	Câmp	Format	Tipuri de contracte derivate aplicabile
51	Frecvența de revizuire a ratei variabile din segmentul 1 – perioada de timp	Perioada de timp care descrie frecvența cu care contrapărțile revizuiesc rata variabilă; se aplică următoarele prescurtări: Y = an M = lună W = săptămână D = zi	
52	Frecvența de revizuire a ratei variabile din segmentul 1 – multiplicator	Un multiplicator întreg al unei perioade de timp care descrie frecvența cu care contrapărțile revizuiesc rata variabilă. Până la trei caractere numerice.	
53	Frecvența de revizuire a ratei variabile din segmentul 2 – perioada de timp	Perioada de timp care descrie frecvența cu care contrapărțile revizuiesc rata variabilă; se aplică următoarele prescurtări: Y = an M = lună W = săptămână D = zi	
54	Frecvența de revizuire a ratei variabile din segmentul 2 – multiplicator	Un multiplicator întreg al unei perioade de timp care descrie frecvența cu care contrapărțile revizuiesc rata variabilă. Până la trei caractere numerice.	
55	Rata variabilă a segmentului 1	Denumirea indicelui pentru rata variabilă „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	

	Câmp	Format	Tipuri de contracte derivate aplicabile
		<p>„CDOR” – CDOR „CIBO” – CIBOR „MOSP” – MOSPRIM „NIBO” – NIBOR „PRBO” – PRIBOR „TLBO” – TELBOR „WIBO” – WIBOR „TREA” – Trezorerie „SWAP” – SWAP „FUSW” – SWAP pe futures Sau până la 25 de caractere alfanumerice dacă rata de referință nu este inclusă în lista de mai sus</p>	
56	Perioada de referință pentru rata variabilă din segmentul 1 – perioada de timp	<p>Perioada de timp care corespunde perioadei de referință; se aplică următoarele prescurtări: Y = an M = lună W = săptămână D = zi</p>	
57	Perioada de referință pentru rata variabilă din segmentul 1 – multiplicator	<p>Un multiplicator întreg al unei perioade de timp care corespunde perioadei de referință. Până la trei caractere numerice.</p>	
58	Rata variabilă a segmentului 2	<p>Denumirea indicelui pentru rata variabilă „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</p>	

	Câmp	Format	Tipuri de contracte derivate aplicabile
		<p>„NIBO” – NIBOR „PRBO” – PRIBOR „TLBO” – TELBOR „WIBO” – WIBOR „TREA” – Trezorerie „SWAP” – SWAP „FUSW” – SWAP pe futures</p> <p>Sau până la 25 de caractere alfanumerice dacă rata de referință nu este inclusă în lista de mai sus</p>	
59	Perioada de referință pentru rata variabilă din segmentul 2 – perioada de timp	<p>Perioada de timp care corespunde perioadei de referință; se aplică următoarele prescurtări:</p> <p>Y = an M = lună W = săptămână D = zi</p>	
60	Perioada de referință pentru rata variabilă din segmentul 2 – multiplicator	<p>Un multiplicator întreg al unei perioade de timp care corespunde perioadei de referință.</p> <p>Până la trei caractere numerice.</p>	
	Secțiunea 2g – Schimb valutar		Instrumente financiare derivate pe valute
61	Moneda de livrat 2	Codul monedei în format ISO 4217, trei caractere alfabetice.	
62	Cursul de schimb 1	<p>Până la 10 de caractere numerice, inclusiv zecimalele.</p> <p>Separatorul zecimal nu este considerat caracter numeric. Dacă este utilizat, acesta este reprezentat printr-un punct.</p> <p>Semnul negativ, dacă este utilizat, nu este considerat caracter numeric.</p>	
63	Cursul de schimb la termen	<p>Până la 10 de caractere numerice, inclusiv zecimalele.</p> <p>Separatorul zecimal nu este considerat caracter numeric. Dacă este utilizat, acesta este reprezentat printr-un punct.</p> <p>Semnul negativ, dacă este utilizat, nu este considerat caracter numeric.</p>	

	Câmp	Format	Tipuri de contracte derivate aplicabile
64	Baza cursului de schimb	Două coduri de monedă ISO 4217, separate prin caracterul „/”. Primul cod de monedă indică moneda de bază, iar al doilea indică moneda cotației.	
	Secțiunea 2h – Mărfuri și certificate de emisii		Instrumente financiare derivate pe mărfuri și certificate de emisii
	Considerații generale		
65	Mărfuri – categoria principală	AG = agricole EN = energie FR = transport ME = metale IN = indice EV = mediu EX = exotice OT = altele	
66	Mărfuri – detalii	Agricole GO = cereale și oleaginoase DA = produse lactate LI = șeptel FO = produse silvice SO = produse perisabile SF = pește și fructe de mare OT = altele Energie OI = petrol NG = gaze naturale CO = cărbune EL = energie electrică IE = inter-energetice OT = altele Transport DR = uscat WT = umed OT = altele Metale PR = prețioase NP = neprețioase Mediu WE = climatice EM = emisii OT = altele	

	Câmp	Format	Tipuri de contracte derivate aplicabile
	Energie		
67	Punctul sau zona de livrare	Codul EIC, 16 caractere alfanumerice. Câmp repetabil.	
68	Punctul de interconectare	Codul EIC, 16 caractere alfanumerice.	
69	Tipul de sarcină	BL = încărcare de bază PL = încărcare maximă OP = în afara orelor de vârf BH = ora/blocurile orare SH = profilat („shaped”) GD = zi gazieră OT = altele	
	Secțiune repetabilă a câmpurilor 70-77		
70	Intervale de livrare a sarcinii	hh:mmZ	
71	Data și ora de începere a livrării	Data și ora în conformitate cu standardul UTC, în formatul ISO 8601, după cum urmează: AAAA-LL-ZZThh:mm:ssZ	
72	Data și ora de încheiere a livrării	Data și ora în conformitate cu standardul UTC, în formatul ISO 8601, după cum urmează: AAAA-LL-ZZThh:mm:ssZ	
73	Durată	N = minute H = oră D = zi W = săptămână M = lună Q = trimestru S = anotimp Y = an O = altele	
74	Zilele săptămânii	WD = zile lucrătoare WN = weekend MO = luni TU = marți WE = miercuri TH = joi FR = vineri SA = sâmbătă SU = duminică Sunt permise mai multe valori, separate prin caracterul „/”	

	Câmp	Format	Tipuri de contracte derivate aplicabile
75	Capacitatea de livrare	Până la 20 de caractere numerice, inclusiv zecimalele. Separatorul zecimal nu este considerat caracter numeric. Dacă este utilizat, acesta este reprezentat printr-un punct. Semnul negativ, dacă este utilizat, nu este considerat caracter numeric.	
76	Unitatea de măsură a cantității	KW KWh/h KWh/zi MW MWh/h MWh/zi GW GWh/h GWh/zi Thm/zi KThm/zi MThm/zi cm/zi mcm/zi	
77	Prețul/cantitatea livrată în intervalul de timp	Până la 20 de caractere numerice, inclusiv zecimalele. Separatorul zecimal nu este considerat caracter numeric. Dacă este utilizat, acesta este reprezentat printr-un punct. Semnul negativ, dacă este utilizat, nu este considerat caracter numeric.	
	Secțiunea 2i – Opțiuni		Contracte care conțin o opțiune
78	Tipul de opțiune	P = vânzare C = cumpărare O = nu se poate stabili dacă este vorba de o opțiune de cumpărare sau de vânzare	
79	Stil de exercitare a opțiunii	A = american B = Bermuda E = european S = asiatic Sunt permise mai multe valori	

	Câmp	Format	Tipuri de contracte derivate aplicabile
80	Prețul de exercitare (rată maximă/minimă)	Până la 20 de caractere numerice, inclusiv zecimalele. Separatorul zecimal nu este considerat caracter numeric. Dacă este utilizat, acesta este reprezentat printr-un punct. Semnul negativ, dacă este utilizat, nu este considerat caracter numeric. Dacă prețul este raportat sub formă de valori procentuale, acesta trebuie exprimat ca procentaj, valoarea de 100 % fiind reprezentată sub forma „100”	
81	Modul în care este exprimat prețul de exercitare	U = unități P = procentaj Y = randament	
82	Data scadenței activului-suport	Data în formatul ISO 8601, după cum urmează: AAAA-LL-ZZ	
	Secțiunea 2j – Derivate de credit		
83	Grad de prioritate	SNDB = „cu rang superior”, cum ar fi datoriile negarantate cu rang superior (întreprinderi/instituții financiare), datoria suverană în valută (guverne), SBOD = subordonate, cum ar fi datoriile subordonate sau datoriile de rang inferior 2, datoriile secundare subordonate sau datoriile de rang superior 2 (bănci), OTHR = altele, cum ar fi acțiunile preferențiale, capitalul de rangul 1 (bănci) sau alte derivate de credit	
84	Entitatea de referință	ISO 3166 – codul de țară compus din două caractere sau ISO 3166 – codul de țară compus din două caractere urmat de caracterul „-” și până la trei caractere alfanumerice reprezentând codul subdiviziunii naționale sau Identificatorul entității juridice în conformitate cu ISO 17442 (LEI; 20 de caractere alfanumerice).	
85	Frecvența plăților	MNTH = lunar QURT = trimestrial MIAN = semestrial YEAR = anual	
86	Baza de calcul	Numărător/numitor, unde atât numărătorul, cât și numitorul sunt caractere numerice sau expresia alfabetică „Actual”, de exemplu 30/360 sau Actual/365	

	Câmp	Format	Tipuri de contracte derivate aplicabile
87	Seria	Un câmp cu până la cinci caractere reprezentând numere întregi	
88	Versiunea	Un câmp cu până la cinci caractere reprezentând numere întregi	
89	Factorul-indice	Până la 10 de caractere numerice, inclusiv zecimalele. Separatorul zecimal nu este considerat caracter numeric. Dacă este utilizat, acesta este reprezentat printr-un punct.	
90	Tranșa	T = în tranșe U = fără tranșe	
91	Plafonul de afectare	Până la 10 caractere numerice, inclusiv zecimalele, exprimate sub formă de fracție zecimală mai mare ca 0 și mai mică decât 1. Separatorul zecimal nu este considerat caracter numeric. Dacă este utilizat, acesta este reprezentat printr-un punct.	
92	Plafonul de neafectare	Până la 10 caractere numerice, inclusiv zecimalele, exprimate sub formă de fracție zecimală mai mare ca 0 și mai mică decât 1. Separatorul zecimal nu este considerat caracter numeric. Dacă este utilizat, acesta este reprezentat printr-un punct.	
	Secțiunea 2k – Modificări ale contractului		
93	Tipul de acțiune	N = nouă M = modificare E = eroare C = încetare anticipată R = corecție Z = comprimare V = actualizare a evaluării P = componentă a poziției	
94	Nivelul	T = tranzacție P = poziție”	