

DURCHFÜHRUNGSVERORDNUNG (EU) Nr. 1247/2012 DER KOMMISSION**vom 19. Dezember 2012**

zur Festlegung technischer Durchführungsstandards im Hinblick auf das Format und die Häufigkeit von Transaktionsmeldungen an Transaktionsregister gemäß der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister

(Text von Bedeutung für den EWR)

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

nach Stellungnahme der Europäischen Zentralbank ⁽¹⁾,

gestützt auf die Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 4. Juli 2012 über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister ⁽²⁾, insbesondere auf Artikel 9 Absatz 6,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) Um Inkohärenzen zu vermeiden, sollten alle Daten, die Transaktionsregistern nach Artikel 9 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 übermittelt werden, unabhängig vom Transaktionsregister, von der Gegenpartei und von der Derivateart den gleichen Regeln, Standards und Formaten folgen. Für die Beschreibung eines Derivatgeschäfts sollte deshalb ein einheitlicher Datensatz verwendet werden.
- (2) Da OTC-Derivate in der Regel weder über die bestehenden, an den Finanzmärkten weit verbreiteten Kennziffern, wie die internationalen Wertpapierkennnummern (ISIN), eindeutig identifiziert noch mit Hilfe der ISO-Kennziffer zur Klassifizierung von Finanzinstrumenten (CFI) beschrieben werden können, muss eine neue universelle Identifikationsmethode entwickelt werden. Liegt eine einheitliche Produktkennziffer vor, die den Grundsätzen der Unverwechselbarkeit, Neutralität, Verlässlichkeit, Quell-offenheit, Skalierbarkeit und Zugänglichkeit entspricht, zu vertretbaren Kosten verfügbar ist, einem angemessenen Entscheidungsrahmen unterliegt und für den Gebrauch in der Union angenommen wird, so sollte diese verwendet werden. Liegt eine einheitliche Produktkennziffer, die diese Anforderungen erfüllt, nicht vor, sollte auf eine vorläufige Taxonomie zurückgegriffen werden.
- (3) Auch wenn es zurzeit keine marktweit standardisierte Kennziffer zur Identifizierung der Basiswerte in einem Korb gibt, sollte der Basiswert durch eine einheitliche Kennziffer identifiziert werden. Die Gegenparteien sollten deshalb zumindest angeben müssen, dass es sich bei dem Basiswert um einen Korb handelt, und so weit wie möglich die ISIN für standardisierte Indizes verwenden.
- (4) Um Kohärenz zu gewährleisten, sollten alle Parteien eines Derivatekontrakts durch eine einheitliche Kennziffer identifiziert werden. Um insbesondere für Kohärenz mit dem Bericht des Ausschusses für Zahlungs- und Abrechnungssysteme (Committee on Payment and Settlement Systems, CPSS) und der Internationalen Organisation der Wertpapieraufsichtsbehörden (International Organisation of Securities Commissions, IOSCO) über die Meldung und Aggregation von Daten über OTC-Derivate zu sorgen, in dem Kennziffern für juristische Personen als Instrument für die Datenaggregation beschrieben werden, sollte zur Identifikation aller finanziellen und nichtfinanziellen Gegenparteien, Makler, zentralen Gegenparteien und Begünstigten eine für den Gebrauch in der EU angenommene globale oder vorläufige Kennziffer für juristische Personen verwendet werden, sobald sie vorliegt, die innerhalb eines Entscheidungsrahmens festzulegen ist, der mit den FSB-Empfehlungen zu Datenanforderungen vereinbar ist. Bei Kommissionsgeschäften sollten die Begünstigten als die natürlichen oder juristischen Personen ausgewiesen werden, auf deren Namen der Kontrakt geschlossen wurde.
- (5) Die von Drittländern und auch von den Transaktionsregistern selbst bei der Aufnahme ihrer Tätigkeit praktizierten Verfahrensweisen sollten berücksichtigt werden. Um für die Gegenparteien eine kostengünstige Lösung zu gewährleisten und für Transaktionsregister das operationelle Risiko zu mindern, sollte das Datum des Meldebegins nach verschiedenen Derivatekategorien gestaffelt werden, d. h. die Meldung sollte mit den am stärksten standardisierten Kategorien beginnen und dann allmählich auf die anderen Kategorien ausgeweitet werden. Die vor, zu oder nach dem Datum des Inkrafttretens der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 geschlossenen Derivatekontrakte, die zu oder nach dem Datum des Meldebegins nicht mehr ausstehen, sind für Regulierungszwecke von eher untergeordneter Bedeutung. Dennoch müssen sie nach Artikel 9 Absatz 1 Buchstabe a der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 gemeldet werden. Um für solche Fälle eine effiziente und verhältnismäßige Melde-regelung zu gewährleisten und der Schwierigkeit der Rekonstruktion von Daten beendeter Kontrakte Rechnung zu tragen, sollte für solche Meldungen eine längere Frist vorgesehen werden.
- (6) Diese Verordnung stützt sich auf den Entwurf technischer Durchführungsstandards, der der Kommission von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) vorgelegt wurde.
- (7) Gemäß Artikel 15 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen

⁽¹⁾ Noch nicht im Amtsblatt veröffentlicht.

⁽²⁾ ABl. L 201 vom 27.7.2012.

Aufsichtsbehörde (Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde) ⁽¹⁾ hat die ESMA zu dem Entwurf technischer Durchführungsstandards offene öffentliche Anhörungen durchgeführt, potenzielle Kosten und potenziellen Nutzen analysiert und die Stellungnahme der nach Artikel 37 der genannten Verordnung eingesetzten ESMA-Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte eingeholt —

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

Artikel 1

Format der Derivatekontrakt-Meldungen

Die in einer Meldung nach Artikel 9 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 enthaltenen Angaben werden in dem im Anhang der vorliegenden Verordnung angegebenen Format übermittelt.

Artikel 2

Häufigkeit der Derivatekontrakt-Meldungen

Soweit in Artikel 11 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 vorgesehen, werden die an ein Transaktionsregister gemeldeten Kontrakte täglich einer Marktpreis- oder Modellpreisbewertung unterzogen. Alle anderen etwaigen Bestandteile der Meldung, die im Anhang dieser Verordnung und im Anhang des delegierten Rechtsakts zur Festlegung technischer Regulierungsstandards für die Mindestangaben, die den Transaktionsregistern gemäß Artikel 9 Absatz 5 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 zu melden sind, aufgeführt sind, werden bei Eintreten des betreffenden Ereignisses und unter Beachtung der in Artikel 9 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 insbesondere für den Abschluss, die Änderung oder die Kündigung eines Kontrakts vorgesehenen Fristen gemeldet.

Artikel 3

Identifikation von Gegenparteien und anderen juristischen Personen

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

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

2. Ist für eine juristische Person keine Kennziffer vorhanden, wird in der Meldung eine auf Unionsebene festgelegte vorläufige Kennziffer verwendet, die

- (a) unverwechselbar,
- (b) neutral
- (c) verlässlich,
- (d) quelloffen,
- (e) skalierbar,

- (f) zugänglich und
- (g) zu vertretbaren Kosten verfügbar ist und
- (h) einem angemessenen Entscheidungsrahmen unterliegt.

3. Liegen für eine juristische Person weder eine endgültige noch eine vorläufige Kennziffer vor, so wird in einer Meldung – soweit vorhanden – auf ein Geschäftskennzeichen nach ISO 9362 zurückgegriffen.

Artikel 4

Identifizierung von Derivaten

1. In einer Meldung wird ein Derivatekontrakt über eine einheitliche Produktkennziffer identifiziert, die

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

2. Ist keine einheitliche Produktkennziffer vorhanden, wird ein Derivatekontrakt in einer Meldung über eine Kombination aus der ihm zugewiesenen ISIN-Kennziffer nach ISO 6166 oder einer alternativen Instrumentenkennziffer mit der dazugehörigen Kennziffer nach ISO 10962 (Klassifizierung von Finanzinstrumenten) identifiziert.

3. Steht die in Absatz 2 genannte Kombination nicht zur Verfügung, wird der Derivatetyp wie folgt identifiziert:

- (a) als Derivatekategorie wird eine der Folgenden angegeben:
 - (i) Warenderivat,
 - (ii) Kreditderivat,
 - (iii) Devisenderivat,
 - (iv) Aktienderivat,
 - (v) Zinsderivat,
 - (vi) Sonstiges.
- (b) als Derivatetyp wird einer der Folgenden angegeben:
 - (i) Differenzkontrakt,
 - (ii) Zinstermingeschäft,
 - (iii) außerbörslicher Finanzterminkontrakt (Forward),
 - (iv) börsengehandelter Finanzterminkontrakt (Future),
 - (v) Option,
 - (vi) Swap,
 - (vii) Sonstiges.

(c) bei Derivaten, die keiner bestimmten Kategorie oder keinem bestimmten Typ zuzuordnen sind, erfolgt die Meldung aufgrund der Derivatekategorie oder des Derivatetyps, der/dem der Derivatekontrakt nach übereinstimmender Auffassung der Gegenparteien am stärksten ähnelt.

⁽¹⁾ ABL L 331 vom 15.12.2010, S. 84.

*Artikel 5***Meldebeginn**

1. Kredit- und Zinsderivatkontrakte werden wie folgt gemeldet:

- (a) wenn ein Transaktionsregister vor dem 1. April 2013 nach Artikel 55 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 für diese Derivatekategorie registriert wurde, bis zum 1. Juli 2013;
- (b) wenn vor dem oder am 1. April 2013 kein Transaktionsregister für diese Derivatekategorie registriert wurde, 90 Tage nach Registrierung eines Transaktionsregisters für diese Derivatekategorie gemäß Artikel 55 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012;
- (c) wenn für diese Derivatekategorie bis zum 1. Juli 2015 kein Transaktionsregister nach Artikel 55 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 registriert wurde, bis zum 1. Juli 2015; die Meldepflicht beginnt an diesem Tag und solange für diese Derivatekategorie kein Transaktionsregister registriert ist, werden die Kontrakte gemäß Artikel 9 Absatz 3 der genannten Verordnung an die ESMA gemeldet.

2. Nicht in Absatz 1 genannte Derivatkontrakte werden wie folgt gemeldet:

- (a) wenn ein Transaktionsregister vor dem 1. Oktober 2013 nach Artikel 55 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 für diese Derivatekategorie registriert wurde, bis zum 1. Januar 2014;
- (b) wenn vor dem oder am 1. Oktober 2013 kein Transaktionsregister für diese Derivatekategorie registriert wurde, 90 Tage nach Registrierung eines Transaktionsregisters für diese Derivatekategorie gemäß Artikel 55 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012;

(c) wenn für diese Derivatekategorie bis zum 1. Juli 2015 kein Transaktionsregister nach Artikel 55 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 registriert wurde, bis zum 1. Juli 2015; Die Meldepflicht beginnt an diesem Tag und solange für diese Derivatekategorie kein Transaktionsregister registriert ist, werden die Kontrakte gemäß Artikel 9 Absatz 3 der genannten Verordnung an die ESMA gemeldet.

3. Derivatkontrakte, die am 16. August 2012 ausstanden und bei Meldebeginn nach wie vor ausstehen, werden einem Transaktionsregister innerhalb von 90 Tagen nach Meldebeginn für die betreffende Derivatekategorie gemeldet.

4. Derivatkontrakte, die

(a) vor dem 16. August 2012 geschlossen wurden und am 16. August 2012 nach wie vor ausstehen, oder die

(b) am oder nach dem 16. August 2012 geschlossen wurden

und bei oder nach Meldebeginn nicht ausstehen, werden einem Transaktionsregister innerhalb von drei Jahren nach Meldebeginn für die betreffende Derivatkategorie gemeldet.

5. Für die Meldung der Angaben, die in Artikel 3 des delegierten Rechtsakts zur Festlegung technischer Regulierungsstandards für die Mindestangaben, die den Transaktionsregistern gemäß Artikel 9 Absatz 5 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 zu melden sind, genannt sind, wird der Meldebeginn um 180 Tage verlängert.

*Artikel 6***Inkrafttreten**

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

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

Brüssel, den 19. Dezember 2012

Für die Kommission
Der Präsident
José Manuel BARROSO

ANHANG

Tabelle 1

Angaben zu den Gegenparteien

	Feld	Format
	Parteien	
1	Meldezeitstempel	Datumsangabe nach ISO 8601/UTC-Zeit.
2	ID der Gegenpartei	Kennziffer der juristischen Person (LEI) (20 alphanumerische Zeichen), vorläufige Unternehmenskennziffer (20 alphanumerische Zeichen), BIC (11 alphanumerische Zeichen) oder eine Kundenkennziffer (50 alphanumerische Zeichen).
3	ID der anderen Gegenpartei	Kennziffer der juristischen Person (LEI) (20 alphanumerische Zeichen), Vorläufige Unternehmenskennziffer (20 alphanumerische Zeichen), BIC (11 alphanumerische Zeichen) oder eine Kundenkennziffer (50 alphanumerische Zeichen).
4	Name der Gegenpartei	100 alphanumerische Zeichen oder freilassen, falls für Gegenpartei Kennziffer für die juristische Person (LEI) angegeben wird.
5	Sitz der Gegenpartei	500 alphanumerische Zeichen oder freilassen, falls für Gegenpartei Kennziffer für die juristische Person (LEI) angegeben wird.
6	Sparte, in der die Gegenpartei tätig ist	<p>Taxonomie:</p> <p>A = ein gemäß der Richtlinie 2002/83/EG zugelassenes Versicherungsunternehmen</p> <p>C = ein gemäß der Richtlinie 2006/48/EG zugelassenes Kreditinstitut</p> <p>F = eine Wertpapierfirma gemäß der Richtlinie 2004/39/EG</p> <p>I = ein gemäß der Richtlinie 73/239/EG zugelassenes Versicherungsunternehmen</p> <p>L = ein alternativer Investmentfonds, der von einem gemäß der Richtlinie 2011/61/EU zugelassenen oder registrierten AIFM verwaltet wird</p> <p>O = eine Einrichtung der betrieblichen Altersversorgung im Sinne von Artikel 6 Buchstabe a der Richtlinie 2003/41/EG</p> <p>R = ein gemäß der Richtlinie 2005/68/EG zugelassenes Rückversicherungsunternehmen</p> <p>U = ein OGAW und seine Verwaltungsgesellschaft mit Zulassung gemäß der Richtlinie 2009/65/EG oder</p> <p>freilassen, falls Kennziffer für die juristische Person (LEI) angegeben wird oder es sich um eine nichtfinanzielle Gegenpartei handelt.</p>
7	Art der Gegenpartei	F=finanzielle Gegenpartei, N=nichtfinanzielle Gegenpartei.
8	Makler-ID	Kennziffer der juristischen Person (LEI) (20 alphanumerische Zeichen), Vorläufige Unternehmenskennziffer (20 alphanumerische Zeichen), BIC (11 alphanumerische Zeichen) oder eine Kundenkennziffer (50 alphanumerische Zeichen).

	Feld	Format
	Parteien	
9	ID der meldenden Stelle	Kennziffer der juristischen Person (LEI) (20 alphanumerische Zeichen), Vorläufige Unternehmenskennziffer (20 alphanumerische Zeichen), BIC (11 alphanumerische Zeichen) oder eine Kundenkennziffer (50 alphanumerische Zeichen).
10	ID des Clearingmitglieds	Kennziffer der juristischen Person (LEI) (20 alphanumerische Zeichen), Vorläufige Unternehmenskennziffer (20 alphanumerische Zeichen), BIC (11 alphanumerische Zeichen) oder eine Kundenkennziffer (50 alphanumerische Zeichen).
11	ID des Begünstigten	Kennziffer der juristischen Person (LEI) (20 alphanumerische Zeichen), Vorläufige Unternehmenskennziffer (20 alphanumerische Zeichen), BIC (11 alphanumerische Zeichen) oder eine Kundenkennziffer (50 alphanumerische Zeichen).
12	Eigenschaft, in der die Transaktion vollzogen wird	P=Eigenhändler, A=Beauftragter.
13	Seite der Gegenpartei	B=Käufer, S=Verkäufer.
14	Transaktion mit einer Nicht-EWR-Gegenpartei	Y=ja, N=Nein.
15	Direkte Verbindung zur Geschäftstätigkeit oder zum Liquiditäts- und Finanzmanagement	Y=ja, N=Nein.
16	Clearingschwelle	Y=darüber, N=darunter.
17	Aktueller Marktwert des Kontrakts	Maximal 20 numerische Zeichen im Format xxxx,yyyyy.
18	Währung, in der der aktuelle Marktwert des Kontrakts angegeben ist	Währungskürzel nach ISO 4217, 3 alphabetische Zeichen.
19	Datum der Bewertung	Datumsangabe nach ISO 8601.
20	Uhrzeit der Bewertung	UTC-Zeit.
21	Art der Bewertung	M=Marktpreisbewertung / O=Modellpreisbewertung.
22	Besicherung	U=unbesichert, PC=teilbesichert, OC=einseitig besichert oder FC=vollständig besichert.
23	Besicherung auf Portfolioebene	Y=ja, N=Nein.
24	Kennziffer des besicherten Portfolios	Maximal 10 numerische Zeichen.
25	Wert der Sicherheiten	Gesamtwert der hinterlegten Sicherheiten angeben; maximal 20 numerische Zeichen im Format xxxx,yyyyy.

	Feld	Format
	Parteien	
26	Währung, in der der Wert der Sicherheit angegeben ist	Geben Sie die Währung an, in der in Feld 25 der Gesamtwert ausgewiesen ist; Währungskürzel nach ISO 4217, 3 alphabetische Zeichen.

Tabelle 2

Allgemeine Angaben

	Feld	Format	Derivat-kontrakt-typen
	Abschnitt 2a – Art des Kontrakts		Alle Kontrakte
1	Verwendete Taxonomie	Geben Sie an, welche Taxonomie Sie verwendet haben: U = [in Europa angenommene] Produktkennziffer I = ISIN/AII + CFI E = vorläufige Taxonomie	
2	Produkt-ID 1	Wenn Taxonomie = U: Produktkennziffer (UPI), noch festzulegen Wenn Systematik = I: ISIN oder AII, zwölfstelliger alphanumerischer Code Wenn Systematik = E: Derivatkategorie CO = Warenderivat CR = Kreditderivat CU = Währungsderivat EQ = Aktienderivat IR = Zinsderivat OT = Sonstige	
3	Produkt-ID 2	Wenn Taxonomie = U: Freilassen Wenn Taxonomie = I: CFI, sechsstelliger alphabetischer Code Wenn Taxonomie = E: Derivatetyp: CD = Differenzkontrakt FR = Zinstermingeschäft FU = Börsengehandelter Finanzterminkontrakt (Future) FW = Außerbörslicher Finanzterminkontrakt (Forward) OP = Option SW = Swap OT = Sonstige	

	Feld	Format	Derivat-kontrakt-typen
4	Basiswert	ISIN (12 alphanumerische Zeichen); LEI (20 alphanumerische Zeichen); Vorläufige Kennziffer (20 alphanumerische Zeichen); UPI (noch festzulegen); B = Korb; I = Index.	
5	Nennwährung 1	Währungskürzel nach ISO 4217, 3 alphabetische Zeichen.	
6	Nennwährung 2	Währungskürzel nach ISO 4217, 3 alphabetische Zeichen.	
7	Zu liefernde Währung	Währungskürzel nach ISO 4217, 3 alphabetische Zeichen.	
	Abschnitt 2b – Transaktionsdetails		Alle Kontrakte
8	Transaktions-ID	Bis zu 52 numerische Zeichen	
9	Transaktionsreferenznummer	Alphanumerisches Feld mit bis zu 40 Zeichen	
10	Ausführungsplatz	Handelsplatz-Identifikationsnummer (MIC) nach ISO 10383, 4 alphabetische Zeichen. Soweit relevant, XOFF für börsennotierte, außerbörslich gehandelte Derivate oder XXXX für OTC-Derivate.	
11	Zahlenmäßige Reduktion der ausstehenden Kontrakte („Compression“)	Y = wenn der Vertrag aus einer solchen Reduktion hervorgegangen ist; N = wenn der Vertrag nicht aus einer solchen Reduktion hervorgegangen ist.	
12	Preis / Satz	Bis zu 20 numerische Zeichen im Format xxxx,yyyyy.	
13	Preisnotierung	Z.B. Währungskürzel nach ISO 4217, 3 alphabetische Zeichen, Prozentangabe.	
14	Nennbetrag	Bis zu 20 numerische Zeichen im Format xxxx,yyyyy.	
15	Preismultiplikator	Bis zu 10 numerische Zeichen.	
16	Menge	Bis zu 10 numerische Zeichen.	
17	Zahlung bei Abschluss	Bis zu 10 numerische Zeichen im Format xxxx,yyyyy bei Zahlungen, die die meldende Gegenpartei leistet, und im Format xxx,yyyyy bei Zahlungen, die die meldende Gegenpartei entgegennimmt.	
18	Art der Lieferung	C=Bar, P=Physisch, O=Optional.	
19	Ausführungszeitstempel	Datumsangabe nach ISO 8601/UTC-Zeit.	
20	Geltungsbeginn	Datumsangabe nach ISO 8601.	
21	Fälligkeitstermin	Datumsangabe nach ISO 8601.	

	Feld	Format	Derivat-kontrakt-typen
22	Kontraktende	Datumsangabe nach ISO 8601.	
23	Abrechnungstermin	Datumsangabe nach ISO 8601.	
24	Art des Rahmenvertrags	Textfeld mit bis zu 50 Zeichen, geben Sie bitte gegebenenfalls den Namen des Rahmenvertrags an.	
25	Fassung des Rahmenvertrags	Jahr, xxxx.	
	Abschnitt 2c – Risikominderung / Meldung		Alle Kontrakte
26	Bestätigungszeitstempel	Datumsangabe nach ISO 8601, UTC-Zeit.	
27	Art der Bestätigung	Y=nichtelektronisch, N=unbestätigt, E=elektronisch.	
	Abschnitt 2d – Clearing		Alle Kontrakte
28	Clearingpflicht	Y=ja, N=Nein.	
29	Gecleart	Y=ja, N=Nein.	
30	Clearing-Zeitstempel	Datumsangabe nach ISO 8601/UTC-Zeit.	
31	CCP-ID	Kennziffer der juristischen Person (LEI) (20 alphanumerische Zeichen) oder, falls nicht vorhanden, vorläufige Unternehmenskennziffer (20 alphanumerische Zeichen) oder, falls nicht vorhanden, BIC (11 alphanumerische Zeichen).	
32	Gruppenintern	Y=ja, N=Nein.	
	Abschnitt 2e – Zinssätze		Zinsderivate
33	Fester Satz „Leg 1“	Numerische Zeichen im Format xxxx,yyyyy.	
34	Fester Satz „Leg 2“	Numerische Zeichen im Format xxxx,yyyyy.	
35	Festsatzberechnungsmethode	Actual/365, 30B/360 oder sonstige Zählung.	
36	Zahlungsfrequenz Festzinsseite	Ganzzahliger Multiplikator eines Zeitraums, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien einander Zahlungen leisten, wie 10D, 3M, 5Y.	
37	Zahlungsfrequenz variable Seite	Ganzzahliger Multiplikator eines Zeitraums, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien einander Zahlungen leisten, wie 10D, 3M, 5Y.	
38	Frequenz der Neufestsetzung bei variabler Seite	D = Ganzzahliger Multiplikator eines Zeitraums, der beschreibt, wie oft die Gegenparteien einander Zahlungen leisten, wie 10D, 3M, 5Y.	
39	Variabler Satz „Leg 1“	Bezeichnung des Indexes, an dem sich der variable Satz orientiert, wie 3M Euribor.	

	Feld	Format	Derivat-kontrakt-typen
40	Variabler Satz „Leg 2“	Bezeichnung des Indexes, an dem sich der variable Satz orientiert, wie 3M Euribor.	
	Abschnitt 2f - Devisen		Währungsderivate
41	Währung 2	Währungskürzel nach ISO 4217, 3 alphabetische Zeichen.	
42	Wechselkurs 1	Bis zu 10 numerische Zeichen im Format xxxx,yyyyy.	
43	Devisenterminkurs	Bis zu 10 numerische Zeichen im Format xxxx,yyyyy.	
44	Umrechnungsbasis	Z. B. EUR/USD oder USD/EUR.	
	Abschnitt 2g – Rohstoffe	Wird eine einheitliche Produktkennziffer (UPI) gemeldet, die alle nachstehend genannten Informationen umfasst, sind keine Angaben erforderlich, es sei denn, sie sind nach der Verordnung (EU) Nr. 1227/2011 vorzulegen.	Rohstoffderivate
	Allgemeines		
45	Basiswert	AG = Agrarprodukt EN = Energie FR = Fracht ME = Metalle IN = Index EV = Umwelt EX = Exotisch	
46	Nähere Beschreibung des Basiswerts	<i>Agrarprodukt</i> GO = Getreide, Ölsaaten DA = Molkereiprodukte LI = Vieh FO = Forstwirtschaftliche Produkte SO = Weichwaren <i>Energie</i> OI = Öl NG = Erdgas CO = Kohle EL = Strom IE = Arbitragegeschäft <i>Metalle</i> PR = Edelmetalle NP = Nichtedelmetalle <i>Umwelt</i> WE = Wetter EM = Emissionen	

	Feld	Format	Derivat-kontrakt-typen
	Energie		
47	Lieferpunkt oder -zone	EIC-Code, 16-stelliger alphanumerischer Code.	
48	Kuppelstelle/Kopplungspunkt	Textfeld mit bis zu 50 Zeichen.	
49	Art der Last	Wiederholbarer Abschnitt der Felder 50-54 zur Identifizierung des Produktlieferprofils entsprechend den Lieferperioden pro Tag); BL = Grundlast PL = Spitzenlast OP = Schwachlast BH = Blockstunden OT = Sonstiges	
50	Lieferstarttermin und -zeit	Datumsangabe nach ISO 8601/UTC-Zeit.	
51	Lieferendtermin und -zeit	Datumsangabe nach ISO 8601/UTC-Zeit.	
52	Kontrahierte Kapazität	Textfeld mit bis zu 50 Zeichen.	
53	Mengeneinheit	10 numerische Zeichen im Format xxxx,yyyyy.	
54	Preis-/Zeitintervallmengen	10 numerische Zeichen im Format xxxx,yyyyy.	
	Abschnitt 2h – Optionen		Kontrakte mit Option
55	Art der Option	P=Put, C=Call.	
56	Art der Option (mögliche Ausübung)	A=Amerikanische Option, B=Bermuda-Option, E=Europäische Option, S=Asiatische Option.	
57	Ausübungspreis (Zinsober-/untergrenze)	Bis zu 10 numerische Zeichen im Format xxxx,yyyyy.	
	Abschnitt 2i - Änderung des Kontrakts		Alle Kontrakte
58	Art der Maßnahme	N = New (neu) M = Modify (Änderung) E = Error (Fehler) C = Cancel (Beendigung) Z = Compression (Reduktion) V = Valuation update (Bewertungsaktualisierung) O = Other (Sonstiges)	
59	Nähere Angaben zur Art der Maßnahme	Textfeld mit bis zu 50 Zeichen.	