Käesolev tekst on üksnes dokumenteerimisvahend ning sel ei ole mingit õiguslikku mõju. Liidu institutsioonid ei vastuta selle teksti sisu eest. Asjakohaste õigusaktide autentsed versioonid, sealhulgas nende preambulid, on avaldatud Euroopa Liidu Teatajas ning on kättesaadavad EUR-Lexi veebisaidil. Need ametlikud tekstid on vahetult kättesaadavad käesolevasse dokumenti lisatud linkide kaudu

►B

KOMISJONI RAKENDUSMÄÄRUS (EL) 2022/1860,

10. juuni 2022,

millega kehtestatakse rakenduslikud tehnilised standardid Euroopa Parlamendi ja nõukogu määruse (EL) nr 648/2012 kohaldamiseks seoses aruandluse standardite, vormingute, sageduse, meetodite ja korraga

(EMPs kohaldatav tekst)

(ELT L 262, 7.10.2022, lk 68)

Parandatud:

►C1 Parandus, ELT L 304, 24.11.2022, lk 102 (2022/1860)

►C2 Parandus, ELT L 125, 11.5.2023, lk 59 (2022/1860)

▼B

KOMISJONI RAKENDUSMÄÄRUS (EL) 2022/1860,

10. juuni 2022,

millega kehtestatakse rakenduslikud tehnilised standardid Euroopa Parlamendi ja nõukogu määruse (EL) nr 648/2012 kohaldamiseks seoses aruandluse standardite, vormingute, sageduse, meetodite ja korraga

(EMPs kohaldatav tekst)

Artikkel 1

Tuletisinstrumente käsitlevate teadete andmestandardid ja vormingud

Määruse (EL) nr 648/2012 artikli 9 kohaselt tuletislepingu üksikasjade kohta esitatav teade esitatakse kooskõlas käesoleva määruse lisa tabelites 1, 2 ja 3 sätestatud standardite ja vormingutega ning ühtsel elektroonilisel ja masinloetaval kujul ja kasutades ühtset XML-vormi kooskõlas standardi ISO 20022 metoodikaga.

Artikkel 2

Teadete esitamise sagedus

1. Kõik teated tuletisinstrumendi üksikasjade kohta, millele on osutatud komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2022/1855 ([1]) artiklis 1, esitatakse esitatava teabega seotud sündmuste toimumise kronoloogilises järjekorras.

2. Määruse (EL) nr 648/2012 artiklis 10 osutatud keskne vastaspool, finantssektori vastaspool või finantssektoriväline vastaspool, kes on tuletisinstrumendi vastaspool, või aruandluse eest vastutav üksus teatab tagatise andmete üksikasjade muutustestdelegeeritud määruse (EL) 2022/1855 tabeli 3 väljadel 1–29, märkides toimingu liigiks „Margin update“ („võimendustagatise ajakohastamine“), asjaomase tuletisinstrumendi üksikasjade iga päeva lõpu seisuga, kui

a) tuletisinstrumendi tähtpäev ei ole saabunud ja tuletisinstrumendi kohta ei ole esitatud lisa tabeli 2 väljal 151 teadet toimingu liigiga „Terminate“ („lõpetamine“), „Error“ („viga“) või „Position component“ („positsiooni komponent“) või

b) tuletisinstrumendi kohta on esitatud teade toimingu liigiga „taastamine“, millele ei ole järgnenud muud teadet toimingu liigiga „Terminate“ („lõpetamine“) või „Error“ („viga“), nagu on osutatud lisa tabeli 2 väljal 151.

([1]) Komisjoni 10. juuni 2022. aasta delegeeritud määrus (EL) 2022/1855, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 648/2012 seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, millega määratakse kindlaks kauplemisteabehoidlale esitatav miinimumteave ja kasutatavate teadete liik (vt käesoleva *Euroopa Liidu Teataja* lk 1).

▼B

3. Lõike 2 punktides a ja b osutatud tuletisinstrumendi vastaspool, kes on määruse (EL) nr 648/2012 artiklis 10 osutatud keskne vastaspool, finantssektori vastaspool või finantssektoriväline vastaspool, või aruandluse eest vastutav üksus teatab lepingu päevalõpu turuhinnas hinnatud või mudelipõhise hindamise väärtuse delegeeritud määruse (EL) 2022/1855 lisa tabeli 2 väljadel 21–25, märkides toimingu liigiks „Valuation update“ („väärtuse hindamise ajakohastamine“), iga päeva lõpu seisuga.

Artikkel 3

Vastaspoolte ja teiste üksuste identifitseerimine

1. Teates kasutatakse standardi ISO 17442 kohast juriidilise isiku tunnuskoodi (LEI), et identifitseerida

a) vahendav üksus,

b) keskne vastaspool,

c) kliiriv liige,

d) juriidilisest isikust vastaspool,

e) teadet esitav üksus,

f) aruandluse eest vastutav üksus,

g) kauplemisjärgse riskivähendusteenuse osutaja.

2. Tuletisinstrumendi vastaspool 1, kellele on osutatud delegeeritud määruse (EL) 2022/1855 lisa tabeli 1 väljal 4, ja aruandluse eest vastutav üksus tagavad, et vastaspoole standardi ISO 17442 kohase LEI-koodiga seotud viiteandmeid ajakohastatakse tuletislepingu sõlmimisest või muutmisest teatamisel vastavalt määruse (EL) nr 648/2012 artiklile 9 kooskõlas ülemaailmse LEI-süsteemi akrediteeritud kohaliku tegevusüksuse tingimustega.

Artikkel 4

Tuletisinstrumendi suund

1. Lisa tabeli 1 väljadel 17–19 osutatud tuletislepingu vastaspoole roll määratakse tuletislepingu sõlmimise ajal kindlaks ►C1 kooskõlas lõigetega 2–13 ◄.

2. Optsioonide ja vahetusoptsioonide korral märgitakse ostjaks vastaspool, kellel on õigus optsioon realiseerida, ja müüjaks vastaspool, kes müüb optsiooni ja saab optsioonipreemia.

3. Valuutadega seotud forvardtehingute korral märgitakse vastaspool 1 esimese poole puhul kas maksjaks või saajaks ning teise poole puhul vastupidiselt. Vastaspool 2 täidab tabeli 1 väljad 18 ja 19 vastaspoole 1 väärtustele vastupidiste väärtustega.

▼B

4. Valuutaga seotud vahetustehingute korral, kus toimub mitu valuutavahetust, märgitakse kumbki vastaspool tehingu mõlema poole puhul kas asjaomase poole maksjaks või saajaks, lähtudes aegumistähtajale kõige lähemal kuupäeval aset leidnud valuutavahetusest.

5. Muude forvardite (v.a valuutaforvardtehingud) ja futuuride korral märgitakse ostjaks instrumenti ostev vastaspool ja müüjaks instrumenti müüv vastaspool.

6. Hinnavahelepingute ja hinnavahekihlvedude korral märgitakse müüjaks hinnalanguse peale lepingu sõlminud vastaspool ja ostjaks hinnatõusu peale lepingu sõlminud vastaspool.

7. Dividendi vahetustehingute korral märgitakse ostjaks samaväärseid dividendisummade makseid saav vastaspool ja müüjaks samaväärseid dividendisummade makseid tegev vastaspool.

8. Muude väärtpaberitega seotud vahetustehingute (v.a dividendidega seotud vahetustehingud) korral märgitakse vastaspool 1 esimese poole puhul kas maksjaks või saajaks ning teise poole puhul vastupidiselt. Vastaspool 2 täidab tabeli 1 väljad 18 ja 19 vastaspoole 1 väärtustele vastupidiste väärtustega.

9. Intressimäärade või inflatsiooniindeksitega seotud vahetustehingute, sealhulgas erinevate valuutade intressimäära vahetuslepingute korral märgitakse vastaspool 1 esimese poole puhul kas maksjaks või saajaks ning teise poole puhul vastupidiselt. Vastaspool 2 täidab tabeli 1 väljad 18 ja 19 vastaspoole 1 väärtustele vastupidiste väärtustega.

10. Krediidiriski ülekandmise tuletisinstrumentide (v.a optsioonid ja vahetusoptsioonid) korral märgitakse ostjaks kaitset ostev vastaspool ja müüjaks kaitset müüv vastaspool.

11. Kaubavahetustehingute korral märgitakse vastaspool 1 esimese poole puhul kas maksjaks või saajaks ning teise poole puhul vastupidiselt. Vastaspool 2 täidab tabeli 1 väljad 18 ja 19 vastaspoole 1 väärtustele vastupidiste väärtustega.

12. Valuutaforvardlepingute korral märgitakse vastaspool 1 esimese poole puhul kas maksjaks või saajaks ning teise poole puhul vastupidiselt. Vastaspool 2 täidab tabeli 1 väljad 18 ja 19 vastaspoole 1 väärtustele vastupidiste väärtustega.

13. Variatsiooni, volatiilsuse ja korrelatsiooniga seotud tuletisinstrumentide korral märgitakse ostjaks alusvara hinna tõusust kasu saav vastaspool ja müüjaks alusvara hinna langusest kasu saav vastaspool.

▼B

Artikkel 5

Tagatis

Andmeid esitav vastaspool märgib lisa tabeli 3 väljal 11 nimetatud tuletislepingu või tuletisinstrumentide portfelli tagatise liigi järgmiselt:

a) „tagatiseta“, kui vastaspoolte vahel puudub tagatisleping või kui vastaspooltevahelises tagatislepingus on sätestatud, et vastaspooled ei anna seoses tuletisinstrumendiga või tuletisinstrumentide portfelliga alustamise tagatist ega ka muutuvtagatist;

b) „osalise tagatisega: ainult vastaspool 1“, kui vastaspooltevahelises tagatislepingus on sätestatud, et andmeid esitav vastaspool annab korrapäraselt ainult muutuvtagatisi ja et teine vastaspool ei anna seoses tuletisinstrumendi või tuletisinstrumentide portfelliga mingit tagatist;

c) „osalise tagatisega: ainult vastaspool 2“, kui vastaspooltevahelises tagatislepingus on sätestatud, et teine vastaspool annab korrapäraselt ainult muutuvtagatise ja et andmeid esitav vastaspool ei anna seoses tuletisinstrumendi või tuletisinstrumentide portfelliga mingit tagatist;

d) „osalise tagatisega“, kui vastaspooltevahelises tagatislepingus on sätestatud, et mõlemad vastaspooled annavad seoses tuletisinstrumendi või tuletisinstrumentide portfelliga korrapäraselt ainult muutuvtagatise;

e) „ühesuunalise tagatisega: ainult vastaspool 1“, kui vastaspooltevahelises tagatislepingus on sätestatud, et andmeid esitav vastaspool annab alustamise tagatise ja annab korrapäraselt muutuvtagatisi ning et teine vastaspool ei anna seoses tuletisinstrumendi või tuletisinstrumentide portfelliga mingeid tagatisi;

f) „ühesuunalise tagatisega: ainult vastaspool 2“, kui vastaspooltevahelises tagatislepingus on sätestatud, et teine vastaspool annab alustamise tagatise ja annab korrapäraselt muutuvtagatisi ning et andmeid esitav vastaspool ei anna seoses tuletisinstrumendi või tuletisinstrumentide portfelliga mingeid tagatisi;

g) „ühesuunalise/osalise tagatisega: vastaspool 1“, kui vastaspooltevahelises tagatislepingus on sätestatud, et andmeid esitav vastaspool annab alustamise tagatise ja annab korrapäraselt muutuvtagatise ning et teine vastaspool annab seoses tuletisinstrumendi või tuletisinstrumentide portfelliga korrapäraselt ainult muutuvtagatise;

h) „ühesuunalise/osalise tagatisega: vastaspool 2“, kui vastaspooltevahelises tagatislepingus on sätestatud, et teine vastaspool annab alustamise tagatise ja annab korrapäraselt muutuvtagatise ning et andmeid esitav vastaspool annab seoses tuletisinstrumendi või tuletisinstrumentide portfelliga korrapäraselt ainult muutuvtagatise;

▼B

i) „täieliku tagatisega“, kui vastaspooltevahelises tagatislepingus on sätestatud, et mõlemad vastaspooled annavad seoses tuletisinstrumendi või tuletisinstrumentide portfelliga alustamise tagatise ja annavad korrapäraselt muutuvtagatisi.

Artikkel 6

Tuletislepingute määratlemine, identifitseerimine ja klassifitseerimine

1. Teates määratletakse tuletisleping lepingu liigi ja varaklassi alusel kooskõlas lisa tabeli 2 väljadega 10 ja 11.

Kui tuletisinstrumendid ei kuulu ühte lisa tabeli 2 väljal 11 nimetatud tuletisinstrumentide liiki, märgitakse teates tuletisinstrumendiga kõige enam sarnanev varaklass. Mõlemad vastaspooled kasutavad teates sama varaklassi.

2. Tuletisinstrument identifitseeritakse lisa tabeli 2 väljal 7, kasutades standardi ISO 6166 kohast rahvusvahelist väärtpaberite identifitseerimisnumbrit (ISIN kood) ühel järgmistest juhtudest:

a) tuletisinstrument on lubatud kauplemisele või sellega kaubeldakse kauplemiskohas;

b) tuletisinstrumendiga kaubeldakse kliendi korralduste süsteemse täitja juures ja selle alusvara on lubatud kauplemisele või sellega kaubeldakse kauplemiskohas või see on indeks või korv, mis koosneb kauplemiskohas kaubeldavatest instrumentidest.

3. Muu kui lõikes 2 nimetatud tuletisinstrument identifitseeritakse lisa tabeli 2 väljal 8, kasutades standardi ISO 4914 kohast toote kordumatut tunnuskoodi (UPI).

4. Andmeid esitav vastaspool klassifitseerib tuletisinstrumendi lisa tabeli 2 väljal 9, kasutades standardi ISO 10962 kohast finantsinstrumentide klassifikatsiooni (CFI) koodi.

Artikkel 7

Tehingu kordumatu tunnuskood

1. Vastaspooled esitavad tuletisinstrumentide kohta andmeid, kasutades lõigete 2, 3 ja 5 kohaselt genereeritud tehingu kordumatut tunnuskoodi (UTI).

2. Kas tehingu või positsiooni tasandil teatatud tuletisinstrument identifitseeritakse standardi ISO 23897 kohase UTI abil lisa tabeli 2 väljal 1. UTI koosneb selle genereerinud üksuse LEI-koodist, millele järgneb kuni 32 märgist koosnev kood, mis on genereeriva üksuse tasandil kordumatu.

3. Vastaspooled määravad UTI genereerimise eest vastutava üksuse kindlaks järgmiselt:

▼B

a) muude kliiritud tuletisinstrumentide puhul kui kahe keskse vastaspoole vahelised tuletisinstrumendid genereerib keskne vastaspool kliirimise hetkel UTI kliiriva liikme jaoks. Kui tehingu vastaspool ei ole keskne vastaspool, genereerib kliiriv liige oma vastaspoole jaoks erineva UTI;

b) kui tuletisinstrumendid on keskselt täidetud, kuid ei ole keskselt kliiritud, genereerib täitmiskoht UTI oma liikme jaoks;

c) muude kui punktides a ja b nimetatud tuletisinstrumentide puhul, kui kummalegi vastaspoolele kehtivad teatamisnõuded kolmandas riigis, genereeritakse UTI selle vastaspoole jurisdiktsiooni eeskirjade kohaselt, kes peab neid teatamisnõudeid esimesena täitma.

Kui vastaspool, kes peab määruse (EL) nr 648/2012 artikli 9 kohaselt andmeid esitama, täidab teatamisnõuded esimesena, on UTI genereerimise eest vastutav üksus järgmine:

i) tuletisinstrumentide puhul, mis on elektrooniliste vahenditega keskselt kinnitatud, tehingu kinnitamise platvorm tehingu kinnitamise hetkel;

ii) kõigi muude tuletisinstrumentide puhul lepivad vastaspooled UTI genereerimise eest vastutava üksuse omavahel kokku. Kui vastaspooled ei jõua kokkuleppele, vastutab genereerimise eest see vastaspool, kelle LEI on vastaspoolte tunnuskoodide ümberpööratud märkide alusel sorteerimise põhjal esimene.

Kui asjaomase kolmanda riigi kohaldatavates õigusaktides on sätestatud sama teadete esitamise tähtaeg, mida kohaldatakse vastaspoole suhtes, kes peab määruse (EL) nr 648/2012 artikli 9 kohaselt andmeid esitama vastavalt määruse (EL) nr 648/2012 artikli 9 lõike 1 esimesele lõigule, lepivad vastaspooled UTI genereerimise eest vastutava üksuse omavahel kokku.

Kui vastaspooled ei jõua kokkuleppele ja tuletisinstrument kinnitati keskselt elektrooniliste vahenditega, genereerib UTI tehingu kinnitamise platvorm tehingu kinnitamise hetkel.

Kui tehingu kinnitamise platvorm ei saa tehingu hetkel UTI-koodi genereerida ja tuletisinstrumendi üksikasjad tuleb esitada ühele kauplemisteabehoidlale, vastutab UTI genereerimise eest see kauplemisteabehoidla.

Kui kauplemisteabehoidla, millele tuletisinstrumendi üksikasjad on teatatud, ei saa UTI-koodi genereerida, vastutab genereerimise eest vastaspool, kelle LEI on vastaspoolte tunnuskoodide ümberpööratud märkide alusel sorteerimise põhjal esimene;

▼B

d) muude kui punktides a, b ja c osutatud tuletisinstrumentide puhul, mis kinnitati kesksel elektrooniliste vahenditega, genereerib UTI tehingu kinnitamise platvorm tehingu kinnitamise hetkel;

e) kõigi muude kui punktides a–d osutatud tuletisinstrumentide puhul kohaldatakse järgmist:

i) kui tuletislepingu sõlmivad finantssektori vastaspool ja finantssektoriväline vastaspool, genereerib UTI finantssektori vastaspool;

ii) kui tuletislepingu sõlmivad kliirimiskünnist ületav finantssektoriväline vastaspool ja kliirimiskünnisest allapoole jääv finantssektoriväline vastaspool, genereerib UTI kliirimiskünnist ületav finantssektoriväline vastaspool;

iii) kõigi muude kui punktides i ja ii osutatud tuletisinstrumentide puhul lepivad vastaspooled UTI genereerimise eest vastutava üksuse omavahel kokku. Kui vastaspooled ei jõua kokkuleppele, vastutab genereerimise eest see vastaspool, kelle LEI on vastaspoolte tunnuskoodide ümberpööratud märkide alusel sorteerimise põhjal esimene.

4. Vastaspool, kes genereerib UTI, edastab selle teisele vastaspoolele õigel ajal ja hiljemalt tuletislepingu sõlmimise kuupäevale järgneval tööpäeval kell 10.00 koordineeritud maailmaaja järgi.

5. Olenemata lõikest 3 võib UTI genereerimise delegeerida lõike 3 kohaselt kindlaksmääratud üksusest erinevale üksusele. Üksus, kes genereerib UTI, täidab lõigetes 2 ja 4 sätestatud nõudeid.

Artikkel 8

LEI muutustest teatamine ja tunnuskoodi ajakohastamine LEI-koodiks

1. Kui tuletisinstrumenti käsitlevas teates artikli 3 kohaselt identifitseeritud vastaspoolele saab osaks korporatiivne restruktureerimine, mille tulemusena muutub tema LEI, siis see vastaspool või vastaspool, kellega uus LEI on seotud, või üksus, kes vastutab aruandluse eest emma-kumma vastaspoole nimel vastavalt määruse (EL) nr 648/2012 artikli 9 lõike 1 punktidele a–d, või üksus, kellele emb-kumb vastaspool delegeeris andmete esitamise vastavalt määruse (EL) nr 648/2012 artikli 9 lõike 1 punktile f, teatab muutusest kauplemisteabehoidlale, kellele korporatiivse restruktureerimise läbinud vastaspool teatas oma tuletisinstrumentidest, ja taotleb LEI ajakohastamist artikli 2 lõike 2 punktides a ja b osutatud asjaomaste tuletisinstrumentide puhul LEI muutuse põhjustanud korporatiivse restruktureerimissündmuse kuupäeval või pärast seda kuupäeva teatatud lepingute puhul.

▼B

2. Võimaluse korral esitatakse artikli 2 lõike 2 punktides a ja b osutatud tuletisinstrumentide tunnuskoodi ajakohastamise taotlus vähemalt 30 kalendripäeva enne seda korporatiivset restruktureerimissündmust, mis põhjustab LEI muutuse. Kui lõikes 1 osutatud üksus ei saa seda teavet kauplemisteabehoidlale esitada 30 kalendripäeva enne seda korporatiivset restruktureerimissündmust, mis põhjustab LEI muutuse, teavitab ta kauplemisteabehoidlat sellest esimesel võimalusel.

3. Lõikes 1 osutatud taotlus peab sisaldama vähemalt järgmist:

a) iga korporatiivses restruktureerimissündmuses osaleva vastaspoole LEI;

b) uue vastaspoole LEI;

c) kuupäev, millal LEI muutus toimub või on toimunud;

d) asjaomaste tuletisinstrumentide UTI, juhul kui korporatiivne restruktureerimissündmus mõjutab ainult teatavat artikli 2 lõike 2 punktides a ja b osutatud tuletisinstrumentide kogumit;

e) tõendid selle kohta, et korporatiivne restruktureerimissündmus on toimunud või toimub, järgides (EL) nr 596/2014 artikli 17 sätteid, mis käsitlevad siseteabe avalikustamist.

4. Kui vastaspool teatab eksituse tõttu kauplemisteabehoidlale oma LEI muutusest, järgib ta oma LEI ajakohastamise taotluse esitamiseks lõigetes 1, 2 ja 3 sätestatud menetlust.

5. Kui vastaspool, kes on varem identifitseeritud muu tunnusega kui LEI, saab LEI, kohaldatakse lõigetes 1, 2 ja 3 sätestatud menetlust.

6. Kui LEI muutus puudutab kolmandas riigis asutatud vastaspoolt, algatab lõigete 1, 2 ja 3 kohase menetluse tema liidus asutatud andmeid esitav vastaspool või määruse (EL) nr 648/2012 artikli 9 lõigete 1a–1d kohaselt aruandluse eest vastutav üksus või üksus, kellele liidus asutatud andmeid esitav vastaspool on andmete esitamise delegeerinud.

7. Kui kolmandas riigis asutatud vastaspool, keda on varem identifitseeritud muu tunnusega kui LEI, saab LEI, taotleb iga liidus asutatud andmeid esitav vastaspool, keda see muutus mõjutab, või määruse (EL) nr 648/2012 artikli 9 lõigete 1a–1d kohaselt aruandluse eest vastutav üksus või üksus, kellele liidus asutatud andmeid esitav vastaspool on andmete esitamise delegeerinud, oma asjakohaselt kauplemisteabehoidlalt kolmandas riigis asutatud vastaspoole tunnuse ajakohastamist.

▼B

8. Kui LEI muutus puudutab artikli 3 lõike 1 punktis a, b, c, e või g osutatud üksust, mis ei ole tuletisinstrumendi vastaspool, kinnitab vastaspool 1 või aruandluse eest vastutav üksus kauplemisteabehoidlale artikli 2 lõike 2 punktides a ja b osutatud asjaomaste tuletisinstrumentide UTI-koodid. Kui vastaspool 1 ja aruandluse eest vastutav üksus ei kinnita kauplemisteabehoidlale nende artikli 2 lõike 2 punktides a ja b osutatud tuletisinstrumentide UTI-koode, mida LEI muutus puudutab, ajakohastab vastaspool 1 või aruandluse eest vastutav üksus asjaomase üksuse LEI-koodi kõigis teadetes, mis käsitlevad artikli 2 lõike 2 punktides a ja b osutatud asjaomaseid tuletisinstrumente, saates teate toimingu liigiga „Modify“ („muudatus“).

Artikkel 9

Aruandluse meetodid ja kord

1. Aruandluse eest vastutav üksus teavitab oma pädevat asutust, ja kui see on erinev, siis andmeid esitava vastaspoole pädevat asutust, järgmistest juhtudest:

a) valeandmete esitamine, mille põhjustasid aruandlussüsteemide vead, mis võivad mõjutada märkimisväärset hulka teateid;

b) takistus andmete esitamisel, mis ei lase teadet esitaval üksusel saata teateid kauplemisteabehoidlale määruse (EL) nr 648/2012 artikli 9 lõikes 1 osutatud tähtaja jooksul;

c) mis tahes oluline probleem, mis põhjustab esitatud andmetes vigu, mille korral kauplemisteabehoidla ei lükkaks teadet tagasi kooskõlas komisjoni delegeeritud määrusega (EL) 2022/1858 ([2]).

Aruandluse eest vastutav üksus teavitab kõigist sellistest juhtudest kohe, kui ta neist teada saab.

Teates esitatakse vähemalt vea või väljajätmise liik, juhtumi kuupäev, mõjutatud teadete ulatus, vigade või väljajätmiste põhjused, probleemi lahendamiseks võetud meetmed ning probleemi lahendamise ja parandamise tegemise tähtaeg.

2. Kui finantssektori vastaspoolel lasub määruse (EL) nr 648/2012 artikli 9 lõike 1a kohaselt ainukohustus ja õiguslik vastutus finantssektorivälise vastaspoole nimel börsiväliste tuletislepingute üksikasjade esitamise eest, kehtestab ta järgmise korra:

([2]) Komisjoni 10. juuni 2022. aasta delegeeritud määrus (EL) 2022/1858, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 648/2012 seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, millega määratakse kindlaks menetlused eri kauplemisteabehoidlate andmete kooskõlastavaks võrdlemiseks ning menetlused, mida kauplemisteabehoidla rakendab, et kontrollida andmeid esitava vastaspoole või teadet esitava üksuse vastavust teatamisnõuetele ning teatatud andmete täielikkust ja õigsust (vt käesoleva *Euroopa Liidu Teataja* lk 46).

▼B

a) kord, mille kohaselt finantssektoriväline vastaspool esitab õigel ajal järgmised börsiväliste tuletislepingute üksikasjad, mille puhul on mõistlik eeldada, et finantssektori vastaspoolel neid ei ole, ja kui need on finantssektori vastaspoolele teadmata:

i) maakleri tunnuskood, nagu on osutatud lisa tabeli 1 väljal 15;

ii) kliiriv liige, nagu on osutatud lisa tabeli 1 väljal 16;

iii) otsene seotus äritegevuse või finantseerimistegevusega, nagu on osutatud lisa tabeli 1 väljal 20;

b) kord, mille kohaselt finantssektoriväline vastaspool teavitab õigel ajal finantssektori vastaspoolt mis tahes muudatustest tema määruse (EL) nr 648/2012 artikli 10 lõike 1 kohastes juriidilistes kohustustes;

c) kord, mille kohaselt finantssektoriväline vastaspool uuendab nõuetekohaselt oma LEI-koodi vastavalt ülemaailmse LEI-süsteemi akrediteeritud kohalike tegevusüksuste tingimustele;

d) kord, mille kohaselt finantssektoriväline vastaspool teatab finantssektori vastaspoolele õigel ajal oma otsusest alustada andmete esitamist finantssektori vastaspoolega sõlmitud börsiväliste tuletislepingute kohta või see lõpetada. Selline kord tagab vähemalt selle, et teatamine toimub kirjalikult või muul samaväärsel elektroonilisel viisil vähemalt kümme tööpäeva enne kuupäeva, mil finantssektoriväline vastaspool soovib andmete esitamist alustada või selle lõpetada.

3. Vastaspooltel, aruandluse eest vastutavatel üksustel ja teateid esitavatel üksustel peab olema kehtestatud kord, mis tagab, et delegeeritud määruse (EL) 2022/1858 artikli 3 kohaselt kooskõlastava võrdlemise tõrgete kohta antud tagasisidet võetakse arvesse.

▼C2

Artikkel 10

Tuletislepingutest teatamise kuupäev

Tuletisinstrumendi vastaspool, kes vastab 29. aprillil 2024 artikli 2 lõike 2 punktides a või b sätestatud tingimustele, või aruandluse eest vastutav üksus esitab kõik selle tuletisinstrumendi üksikasjad, mis on lisa kohaselt nõutavad, esitades teate sündmuse liigiga „Update“ („ajakohastamine“) 180 kalendripäeva jooksul alates 29. aprillist 2024, välja arvatud juhul, kui ta on esitanud sellel perioodil kõnealuse tuletisinstrumendi kohta teate toimingu liigiga „Modify“ („muudatus“) või „Correct“ („parandus“).

▼B

Artikkel 11

Kehtetuks tunnistamine

Rakendusmäärus (EL) nr 1247/2012 tunnistatakse kehtetuks.

Viiteid kehtetuks tunnistatud määrusele käsitatakse viidetena käesolevale määrusele.

Artikkel 12

Jõustumine ja kohaldamine

Käesolev määrus jõustub kahekümnendal päeval pärast selle avaldamist *Euroopa Liidu Teatajas*.

Seda kohaldatakse alates 29.aprill 2024.

Käesolev määrus on tervikuna siduv ja vahetult kohaldatav kõikides liikmesriikides.

▼B

LISA

Tabel 1

	Jagu	Väli	Vorming
1	Tuletisinstrumendi pooled	Teabe ajatempel	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev ja kellaaeg koordineeritud maailmaaja (UTC) järgi vormingus AAAA-KK-PPThh:mm:ssZ
2	Tuletisinstrumendi pooled	Teadet esitava üksuse tunnuskood	Standardi ISO 17442 kohane 20-kohaline tähtnumbriline juriidilise isiku tunnus (LEI), mis sisaldub sihtasutuse Global LEI Foundation avaldatud LEI andmetes.
3	Tuletisinstrumendi pooled	Aruandluse eest vastutav üksus	Standardi ISO 17442 kohane 20-kohaline tähtnumbriline juriidilise isiku tunnus (LEI), mis sisaldub sihtasutuse Global LEI Foundation avaldatud LEI andmetes. LEI-koodi tuleb nõuetekohaselt ajakohastada kooskõlas juriidilise isiku ülemaailmse tunnuse süsteemi akrediteeritud kohaliku tegevusüksuse tingimustega.
4	Tuletisinstrumendi pooled	Vastaspool 1 (andmeid esitav vastaspool)	Standardi ISO 17442 kohane 20-kohaline tähtnumbriline juriidilise isiku tunnus (LEI), mis sisaldub sihtasutuse Global LEI Foundation avaldatud LEI andmetes. LEI-koodi tuleb nõuetekohaselt ajakohastada kooskõlas juriidilise isiku ülemaailmse tunnuse süsteemi akrediteeritud kohaliku tegevusüksuse tingimustega.
5	Tuletisinstrumendi pooled	Vastaspoole 1 liik	F = finantssektori vastaspool N = finantssektoriväline vastaspool C = keskne vastaspool O = muu
6	Tuletisinstrumendi pooled	Vastaspoole 1 tegevusvaldkond	Finantssektori vastaspoolte taksonoomia: „INVF“ – kooskõlas Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiiviga 2014/65/EL ([1]) tegevusloa saanud investeerimisühing; „CDTI“ – Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2013/36/EL ([2]) kohaselt tegevusloa saanud krediidiasutus; „INUN“ – kooskõlas Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiiviga 2009/138/EÜ ([3]) tegevusloa saanud kindlustusandja või edasikindlustusandja; „UCIT“ – kooskõlas Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiiviga 2009/65/EÜ ([4]) tegevusloa saanud vabalt võõrandatavatesse väärtpaberitesse ühiseks investeerimiseks loodud ettevõtja (eurofond) ja kui see on asjakohane, selle valitseja, välja arvatud juhul, kui kõnealune eurofond on asutatud üksnes toimima ühe või mitme töötajate kapitaliosaluse skeemina; „ORPI“ – Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi (EL) 2016/2341 ([5]) artikli 6 punktis 1 määratletud tööandja kogumispensioni asutus;

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
			„AIFD“ – Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2011/61/EL ([6]) artikli 4 punkti 1 alapunktis a määratletud alternatiivne investeerimisfond, mis on asutatud liidus või mida valitseb alternatiivse investeerimisfondi valitseja, kes on tegevusloa saanud või registreeritud kooskõlas kõnealuse direktiiviga, välja arvatud juhul, kui kõnealune alternatiivne investeerimisfond on asutatud üksnes toimima ühe või mitme töötajate kapitaliosaluse skeemina või kui alternatiivne investeerimisfond on direktiivi 2011/61/EL artikli 2 lõike 3 punktis g osutatud eriotstarbeline väärtpaberistamisüksus, ja asjakohasel juhul selle liidus asutatud alternatiivse investeerimisfondi valitseja; „CSDS“ – kooskõlas Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrusega (EL) nr 909/2014 ([7]) tegevusloa saanud väärtpaberite keskdepositoorium. Finantssektoriväliste vastaspoolte taksonoomia. Allpool esitatud kategooriad vastavad NACE klassifikaatori põhilistele jagudele, nagu on kindlaks määratud Euroopa Parlamendi ja nõukogu määruses (EÜ) nr 1893/2006 ([8]): A – põllumajandus, metsamajandus ja kalapüük; B – mäetööstus; C – töötlev tööstus; D – elektrienergia, gaasi, auru ja konditsioneeritud õhuga varustamine; E – veevarustus; kanalisatsioon, jäätme- ja saastekäitlus; F – ehitus; G – hulgi- ja jaekaubandus; mootorsõidukite ja mootorrataste remont; H – veondus ja laondus; I – majutus ja toitlustus; J – info ja side; K – finants- ja kindlustustegevus; L – kinnisvaraalane tegevus; M – kutse-, teadus- ja tehnikaalane tegevus; N – haldus- ja abitegevused; O – avalik haldus ja riigikaitse; kohustuslik sotsiaalkindlustus; P – haridus; Q – tervishoid ja sotsiaalhoolekanne; R – kunst, meelelahutus ja vaba aeg; S – muud teenindavad tegevused;

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
			T – kodumajapidamiste kui tööandjate tegevus; kodumajapidamiste oma tarbeks mõeldud eristamata kaupade tootmine ja teenuste osutamine; U – eksterritoriaalsete organisatsioonide ja üksuste tegevus. Kui teatatakse rohkem kui ühest tegevusalast, tuleb koodid reastada neile vastava tegevuse suhtelise tähtsuse järjekorras. Väli jäetakse tühjaks, kui tegemist on kesksete vastaspooltega ja määruse (EL) nr 648/2012 ([9]) artikli 1 lõike 5 kohaste muud liiki vastaspooltega.
7	Tuletisinstrumendi pooled	Vastaspoole 1 kliirimiskünnis	Kahendmuutuja väärtus: TRUE = ületab künnist FALSE = ei ületa künnist
8	Tuletisinstrumendi pooled	Vastaspoole 2 tuvastamisviis	Kahendmuutuja väärtus: — TRUE — FALSE, kui tegemist on füüsilise isikuga, kes tegutseb eraisikuna ja kellel ei ole majandustegevusega üksikisikuid käsitleva regulatiivse järelevalvekomitee 20. septembri 2015. aasta avalduse (edaspidi „ROCi avaldus“) kohaselt õigust saada LEI-koodi.
9	Tuletisinstrumendi pooled	Vastaspool 2	— Standardi ISO 17442 kohane 20-kohaline tähtnumbriline juriidilise isiku tunnus (LEI), mis sisaldub sihtasutuse Global LEI Foundation avaldatud LEI andmetes, või kuni 72-kohaline tähtnumbriline kood füüsiliste isikute puhul, kes tegutsevad eraisikuna ja kellel ei ole ROCi avalduse kohaselt õigust saada LEI-koodi. Füüsilise isiku tunnuskood koosneb vastaspoole 1 LEI-koodist, millele järgneb kordumatu tunnus, mille vastaspool 1 on määranud ja mida ta säilitab järjepidevalt asjaomas(t)e füüsilis(t)e isiku(te) jaoks regulatiivse aruandluse eesmärgil.
10	Tuletisinstrumendi pooled	Vastaspoole 2 riik	Standardi ISO 3166 kohane riigikood – kahetäheline riigikood
11	Tuletisinstrumendi pooled	Vastaspoole 2 liik	F = finantssektori vastaspool N = finantssektoriväline vastaspool C = keskne vastaspool O = muu

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
12	Tuletisinstrumendi pooled	Vastaspoole 2 tegevusvaldkond	Finantssektori vastaspoolte taksonoomia: „INVF“ – direktiivi 2014/65/EL kohaselt tegevusloa saanud investeerimisühing; „CDTI“ – direktiivi 2013/36/EL kohaselt tegevusloa saanud krediidiasutuses; „INUN“ – direktiivi 2009/138/EÜ kohaselt tegevusloa saanud kindlustusandja või edasikindlustusandja; „UCIT“ – direktiivi 2009/65/EÜ kohaselt tegevusloa saanud vabalt võõrandatavatesse väärtpaberitesse ühiseks investeerimiseks loodud ettevõtja (eurofond) ja kui see on asjakohane, selle valitseja, välja arvatud juhul, kui kõnealune eurofond on asutatud üksnes toimima ühe või mitme töötajate kapitaliosaluse skeemina; „ORPI“ – direktiivi (EL) 2016/2341 artikli 6 punktis 1 määratletud tööandja kogumispensioni asutus; „AIFD“ – direktiivi 2011/61/EL artikli 4 punkti 1 alapunktis a määratletud alternatiivne investeerimisfond, mis on asutatud liidus või mida valitseb alternatiivse investeerimisfondi valitseja, kes on tegevusloa saanud või registreeritud kooskõlas kõnealuse direktiiviga, välja arvatud juhul, kui kõnealune alternatiivne investeerimisfond on asutatud üksnes toimima ühe või mitme töötajate kapitaliosaluse skeemina või kui alternatiivne investeerimisfond on direktiivi 2011/61/EL artikli 2 lõike 3 punktis g osutatud eriotstarbeline väärtpaberistamisüksus, ja asjakohasel juhul selle liidus asutatud alternatiivse investeerimisfondi valitseja; „CSDS“ – määruse (EL) nr 909/2014 kohaselt tegevusloa saanud väärtpaberite keskdepositoorium. Finantssektoriväliste vastaspoolte taksonoomia. Allpool esitatud kategooriad vastavad NACE klassifikaatori põhilistele jagudele, nagu on kindlaks määratud määruses (EÜ) nr 1893/2006: A – põllumajandus, metsamajandus ja kalapüük; B – mäetööstus; C – töötlev tööstus; D – elektrienergia, gaasi, auru ja konditsioneeritud õhuga varustamine; E – veevarustus; kanalisatsioon, jäätme- ja saastekäitlus; F – ehitus; G – hulgi- ja jaekaubandus; mootorsõidukite ja mootorrataste remont; H – veondus ja laondus; I – majutus ja toitlustus; J – info ja side; K – finants- ja kindlustustegevus;

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
			L – kinnisvaraalane tegevus; M – kutse-, teadus- ja tehnikaalane tegevus; N – haldus- ja abitegevused; O – avalik haldus ja riigikaitse; kohustuslik sotsiaalkindlustus; P – haridus; Q – tervishoid ja sotsiaalhoolekanne; R – kunst, meelelahutus ja vaba aeg; S – muud teenindavad tegevused; T – kodumajapidamiste kui tööandjate tegevus; kodumajapidamiste oma tarbeks mõeldud eristamata kaupade tootmine ja teenuste osutamine; U – eksterritoriaalsete organisatsioonide ja üksuste tegevus. Kui teatatakse rohkem kui ühest tegevusalast, tuleb koodid reastada neile vastava tegevuse suhtelise tähtsuse järjekorras. Väli jäetakse tühjaks, kui tegemist on kesksete vastaspooltega ja määruse (EL) nr 648/2012 artikli 1 lõike 5 kohaste muud liiki vastaspooltega.
13	Tuletisinstrumendi pooled	Vastaspoole 2 kliirimiskünnis	Kahendmuutuja väärtus: TRUE = ületab künnist FALSE = ei ületa künnist
14	Tuletisinstrumendi pooled	Vastaspoole 2 teatamiskohustus	Kahendmuutuja väärtus: — TRUE, kui vastaspoolel 2 on teatamiskohustus — FALSE, kui vastaspoolel 2 ei ole teatamiskohustust
15	Tuletisinstrumendi pooled	Maakleri tunnuskood	Standardi ISO 17442 kohane 20-kohaline tähtnumbriline juriidilise isiku tunnus (LEI), mis sisaldub sihtasutuse Global LEI Foundation avaldatud LEI andmetes.
16	Tuletisinstrumendi pooled	Kliiriv liige	Standardi ISO 17442 kohane 20-kohaline tähtnumbriline juriidilise isiku tunnus (LEI), mis sisaldub sihtasutuse Global LEI Foundation avaldatud LEI andmetes.
17	Tuletisinstrumendi pooled	Suund	4 tähte: BYER = ostja SLLR = müüja Täidetakse käesoleva määruse artikli 4 kohaselt.

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
18	Tuletisinstrumendi pooled	Esimese poole suund	4 tähte: MAKE = maksja TAKE = saaja Täidetakse käesoleva määruse artikli 4 kohaselt.
19	Tuletisinstrumendi pooled	Teise poole suund	4 tähte: MAKE = maksja TAKE = saaja Täidetakse käesoleva määruse artikli 4 kohaselt.
20	Tuletisinstrumendi pooled	Otsene seotus äritegevuse või finantseerimistegevusega	Kahendmuutuja väärtus: TRUE = jah FALSE = ei

([1]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 15. mai 2014. aasta direktiiv 2014/65/EL finantsinstrumentide turgude kohta ning millega muudetakse direktiive 2002/92/EÜ ja 2011/61/EL (ELT L 173, 12.6.2014, lk 349).
([2]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 26. juuni 2013. aasta direktiiv 2013/36/EL, mis käsitleb krediidiasutuste tegevuse alustamise tingimusi ning krediidiasutuste ja investeerimisühingute usaldatavusnõuete täitmise järelevalvet, millega muudetakse direktiivi 2002/87/EÜ ning millega tunnistatakse kehtetuks direktiivid 2006/48/EÜ ja 2006/49/EÜ (ELT L 176, 27.6.2013, lk 338).
([3]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 25. novembri 2009. aasta direktiiv 2009/138/EÜ kindlustus- ja edasikindlustustegevuse alustamise ja jätkamise kohta (Solventsus II) (ELT L 335, 17.12.2009, lk 1).
([4]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 13. juuli 2009. aasta direktiiv 2009/65/EÜ vabalt võõrandatavatesse väärtpaberitesse ühiseks investeeringuks loodud ettevõtjaid (eurofondid) käsitlevate õigus- ja haldusnormide kooskõlastamise kohta (ELT L 302, 17.11.2009, lk 32).
([5]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 14. detsembri 2016. aasta direktiiv (EL) 2016/2341 tööandja kogumispensioni asutuste tegevuse ja järelevalve kohta (ELT L 354, 23.12.2016, lk 37).
([6]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 8. juuni 2011. aasta direktiiv 2011/61/EL alternatiivsete investeerimisfondide valitsejate kohta, millega muudetakse direktiive 2003/41/EÜ ja 2009/65/EÜ ning määruseid (EÜ) nr 1060/2009 ja (EL) nr 1095/2010 (ELT L 174, 1.7.2011, lk 1).
([7]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 23. juuli 2014. aasta määrus (EL) nr 909/2014, mis käsitleb väärtpaberiarvelduse parandamist Euroopa Liidus ja väärtpaberite keskdepositooriume ning millega muudetakse direktiive 98/26/EÜ ja 2014/65/EL ning määrust (EL) nr 236/2012 (ELT L 257, 28.8.2014, lk 1).
([8]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 20. detsembri 2006. aasta määrus (EÜ) nr 1893/2006, millega kehtestatakse majanduse tegevusalade statistiline klassifikaator NACE Revision 2 ning muudetakse nõukogu määrust (EMÜ) nr 3037/90 ja teatavaid EÜ määrusi, mis käsitlevad konkreetseid statistikavaldkondi (ELT L 393, 30.12.2006, lk 1).
([9]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 4. juuli 2012. aasta määrus (EL) nr 648/2012 börsiväliste tuletisinstrumentide, kesksete vastaspoolte ja kauplemisteabehoidlate kohta (ELT L 201, 27.7.2012, lk 1).

Tabel 2

	Jagu	Väli	Vorming
1	Jagu 2a – tunnused ja seosed	UTI	Standardi ISO 23897 kohane tehingu kordumatu tunnuskood (UTI). Kuni 52 tähtnumbrilist märki, lubatud on ainult suurtähed A–Z ja numbrid 0–9
2	Jagu 2a – tunnused ja seosed	Teate kontrollnumber	Kuni 52 tähtnumbrilist märki
3	Jagu 2a – tunnused ja seosed	Algne UTI (tehingutevaheliste üks-ühele ja üks-mitmele seoste puhul)	Kuni 52 tähtnumbrilist märki, lubatud on ainult suurtähed A–Z ja numbrid 0–9

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
4	Jagu 2a – tunnused ja seosed	Järgneva positsiooni UTI	Kuni 52 tähtnumbrilist märki, lubatud on ainult suurtähed A–Z ja numbrid 0–9
5	Jagu 2a – tunnused ja seosed	Kauplemisjärgse riskivähenduse tunnuskood	Kuni 52 tähtnumbrilist märki, lubatud on ainult suurtähed A–Z ja numbrid 0–9. Esimesed 20 tähemärki tähistavad tihendusteenuse osutaja LEI-koodi
6	Jagu 2a – tunnused ja seosed	Kombineeritud tehingu tunnuskood	Kuni 35 tähtnumbrilist märki
7	Jagu 2b – lepinguandmed	Rahvusvaheline väärtpaberite identifitseerimisnumber (ISIN kood)	Standardi ISO 6166 kohane ISIN kood (12-kohaline tähtnumbriline kood)
8	Jagu 2b – lepinguandmed	Toote kordumatu tunnuskood (UPI)	Standardi ISO 4914 kohane UPI kood (12-kohaline tähtnumbriline kood)
9	Jagu 2b – lepinguandmed	Toote klassifikatsioon	Standardi ISO 10962 kohane CFI (6-kohaline tähtkood)
10	Jagu 2b – lepinguandmed	Lepingu liik	CFDS = hinnavaheleping FRAS = valuutaforvardleping FUTR = futuurleping FORW = forvardleping OPTN = optsioon SPDB = hinnavahekihlvedu SWAP = vahetusleping SWPT = vahetusoptsioon OTHR = muu
11	Jagu 2b – lepinguandmed	Varaklass	COMM = kaup ja lubatud heitkoguste väärtpaberid CRDT = krediit CURR = valuuta EQUI = aktsia INIR = intressimäär
12	Jagu 2b – lepinguandmed	Krüptovaral põhinev tuletisinstrument	Kahendmuutuja väärtus: — TRUE – krüptovaral põhinevate tuletisinstrumentide puhul — FALSE – muude tuletisinstrumentide puhul
13	Jagu 2b – lepinguandmed	Alusvara identifitseerimise viis	1 täht: I = ISIN B = korv X = indeks

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
14	Jagu 2b – lepinguandmed	Alusvara identifitseerimisandmed	Kui kasutatakse identifitseerimisviisi „I“: standardi ISO 6166 kohane ISIN kood (12-kohaline tähtnumbriline kood) Kui kasutatakse identifitseerimisviisi „X“: standardi ISO 6166 kohane ISIN kood selle olemasolu korral (12-kohaline tähtnumbriline kood)
15	Jagu 2b – lepinguandmed	Aluseks oleva indeksi tähis	Ujuva intressimäära indeksi tähis. 4 tähte: ESTR = €STR SONA = SONIA SOFR = SOFR 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 NIBO = NIBOR PRBO = PRIBOR TLBO = TELBOR WIBO = WIBOR TREA = Treasury (riigikassa võlakiri) SWAP = SWAP FUSW = Future SWAP EFFR = Effective Federal Funds Rate (tegelik föderaalfondide intressimäär) OBFR = Overnight Bank Funding Rate (panga üleöö rahastamismäär) CZNA = CZEONIA
16	Jagu 2b – lepinguandmed	Aluseks oleva indeksi nimi	Kuni 50 tähtnumbrilist märki. Erimärgid on lubatud, kui need on osa indeksi täisnimest.

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
17	Jagu 2b – lepinguandmed	Kohandatud korvi tunnuskood	Kuni 72-kohaline tähtnumbriline kood, mis koosneb korvi koostaja LEI-koodist, millele järgneb kuni 52 tähtnumbrilist märki.
18	Jagu 2b – lepinguandmed	Korvi koostisosade tunnuskood	Kui kasutatakse identifitseerimisviisi „B“: kõik üksikkomponendid identifitseeritakse standardi ISO 6166 kohase ISIN koodiga
19	Jagu 2b – lepinguandmed	Arveldusvaluuta 1	Standardi ISO 4217 kohane valuutakood (3 tähte)
20	Jagu 2b – lepinguandmed	Arveldusvaluuta 2	Standardi ISO 4217 kohane valuutakood (3 tähte)
21	Jagu 2c – väärtuse hindamine	Väärtuse hindamise summa	Positiivne ja negatiivne väärtus, kuni 25 numbrit, sealhulgas kuni 5 kümnendkohta. Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui viis numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt. Juhul kui kasutatakse miinusmärki, ei loeta seda numbriks.
22	Jagu 2c – väärtuse hindamine	Väärtuse hindamise valuuta	Standardi ISO 4217 kohane valuutakood (3 tähte)
23	Jagu 2c – väärtuse hindamine	Väärtuse hindamise ajatempel	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev ja kellaaeg UTC järgi vormingus AAAA-KK-PPThh:mm:ssZ
24	Jagu 2c – väärtuse hindamine	Hindamismeetod	4 tähte: MTMA = turuhinnas hindamine MTMO = mudelipõhine hindamine CCPV = keskse vastaspoole väärtuse hindamine
25	Jagu 2c – väärtuse hindamine	Delta	Kuni 25 numbrit, sealhulgas kuni 5 kümnendkohta. Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui viis numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt. Lubatud on kõik väärtused vahemikus –1 kuni 1 (–1 ja 1 kaasa arvatud).
26	Jagu 2d – tagatis	Tagatisportfelli tunnus	Kahendmuutuja väärtus: TRUE = tagatud portfellipõhiselt FALSE = ei ole portfelli osa
27	Jagu 2d – tagatis	Tagatisportfelli tunnuskood	Kuni 52 tähtnumbrilist märki Erimärgid ei ole lubatud
28	Jagu 2e – riskide maandamine / teatamine	Kinnituse ajatempel	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev ja kellaaeg UTC järgi vormingus AAAA-KK-PPThh:mm:ssZ

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
29	Jagu 2e – riskide maandamine / teatamine	Kinnitatud	4 tähte: — NCNF = kinnitamata — ECNF = elektrooniline — YCNF = mitteelektrooniline
30	Jagu 2f – kliirimine	Kliiringukohustus	TRUE – leping kuulub sellisesse börsiväliste tuletisinstrumentide klassi, mille suhtes kehtib kliirimiskohustus, ning lepingu mõlema vastaspoole suhtes kehtib kliirimiskohustus FALSE – leping kuulub sellisesse börsiväliste tuletisinstrumentide klassi, mille suhtes kehtib kliirimiskohustus, kuid lepingu ühe või mõlema vastaspoole suhtes ei kehti kliirimiskohustus või väärtus „UKWN“ – leping ei kuulu börsiväliste tuletisinstrumentide klassi, mille suhtes kehtib kliirimiskohustus
31	Jagu 2f – kliirimine	Kliiritud	1 täht: Y = jah, on keskselt kliiritav beeta- ja gamma-tehingute puhul N = ei, ei ole keskselt kliiritav
32	Jagu 2f – kliirimine	Kliirimise ajatempel	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev ja kellaaeg UTC järgi vormingus AAAA-KK-PPThh:mm:ssZ
33	Jagu 2f – kliirimine	Keskne vastaspool	Standardi ISO 17442 kohane 20-kohaline tähtnumbriline juriidilise isiku tunnus (LEI), mis sisaldub sihtasutuse Global LEI Foundation avaldatud LEI andmetes.
34	Jagu 2g – tehinguandmed	Raamlepingu liik	4 tähte: ISDA – ISDA CDEA – FIA-ISDA kliiritud tuletisinstrumentide täitmise leping EUMA – Euroopa raamleping FPCA – FOA kutselise kliendi leping FMAT – FBFi forvardfinantsinstrumentidega tehtavate tehingute raamleping DERV – Deutscher Rahmenvertrag für Finanztermingeschäfte (DRV) CMOP – Contrato Marco de Operaciones Financieras CHMA – Šveitsi raamleping IDMA – islami tuletisinstrumentide raamleping EFMA – EFETi raamleping

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
			GMRA – GMRA GMSL – GMSLA BIAG – kahepoolne leping või „MUU“, kui raamlepingu liiki ei ole eespool olevas loetelus
35	Jagu 2g – tehinguandmed	Muu raamlepingu liik	Kuni 50 tähtnumbrilist märki.
36	Jagu 2g – tehinguandmed	Raamlepingu versioon	Standardi ISO 8601 kohane aasta vormingus AAAA
37	Jagu 2g – tehinguandmed	Grupisisene tehing	Kahendmuutuja väärtus: TRUE = leping on sõlmitud grupisisese tehinguna FALSE = leping ei ole sõlmitud grupisisese tehinguna
38	Jagu 2g – tehinguandmed	Kauplemisjärgne riskivähendus	Kahendmuutuja väärtus: TRUE = leping tuleneb kauplemisjärgse riskivähenduse sündmusest FALSE = leping ei tulene kauplemisjärgse riskivähenduse sündmusest
39	Jagu 2g – tehinguandmed	Kauplemisjärgse riskivähenduse meetodi liik	4 tähte: PWOS – portfelli tihendamine ilma kolmandast isikust teenuseosutajata PWAS – portfelli tihendamine kolmandast isikust teenuseosutajaga või keskse vastaspoolega PRBM – portfelli tasakaalustamine / võimendustagatise haldamine OTHR – muu
40	Jagu 2g – tehinguandmed	Kauplemisjärgse riskivähendusteenuse osutaja	Standardi ISO 17442 kohane 20-kohaline tähtnumbriline juriidilise isiku tunnus (LEI), mis sisaldub sihtasutuse Global LEI Foundation avaldatud LEI andmetes.
41	Jagu 2g – tehinguandmed	Täitmiskoht	Standardi ISO 10383 kohane turu tunnuskood (MIC) (neli tähtnumbrilist märki)
42	Jagu 2c – tehinguandmed	Täitmise ajatempel	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev ja kellaaeg UTC järgi vormingus AAAA-KK-PPThh:mm:ssZ
43	Jagu 2c – tehinguandmed	Jõustumiskuupäev	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev UTC järgi vormingus AAAA-KK-PP
44	Jagu 2c – tehinguandmed	Aegumiskuupäev	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev UTC järgi vormingus AAAA-KK-PP

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
45	Jagu 2c – tehinguandmed	Ennetähtaegse lõpetamise kuupäev	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev UTC järgi vormingus AAAA-KK-PP
46	Jagu 2c – tehinguandmed	Lõplik lepinguline arvelduspäev	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev UTC järgi vormingus AAAA-KK-PP
47	Jagu 2c – tehinguandmed	Ülekande liik	4 tähte: CASH = sularaha PHYS = füüsiline OPTN = vastaspoole vabal valikul või kui ülekande liigi määrab kolmas isik
48	Jagu 2g – tehinguandmed	Hind	— Kui hind esitatakse rahalises väärtuses – mis tahes väärtus, kuni 18 numbrit, sealhulgas kuni 13 kümnendkohta. Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui 13 numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. — Kui hind esitatakse protsendina – mis tahes väärtus, kuni 11 numbrit, sealhulgas kuni 10 kümnendkohta, väljendatuna protsendina (nt 2.57 % asemel 2.57). Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui 10 numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt. Juhul kui kasutatakse miinusmärki, ei loeta seda numbriks.
49	Jagu 2g – tehinguandmed	Hinna valuuta	Standardi ISO 4217 kohane valuutakood (3 tähte)
	Väljade 50–52 andmed on korratavad ja need väljad täidetakse hinnagraafikuid hõlmavate tuletisinstrumentide puhul		
50	Jagu 2g – tehinguandmed	Hinna korrigeerimata jõustumiskuupäev	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev UTC järgi vormingus AAAA-KK-PP
51	Jagu 2g – tehinguandmed	Hinna korrigeerimata lõppkuupäev	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev UTC järgi vormingus AAAA-KK-PP
52	Jagu 2g – tehinguandmed	Hind, mis kehtib korrigeerimata jõustumiskuupäeva ja lõppkuupäeva vahel	— Kui hind esitatakse rahalises väärtuses – mis tahes väärtus, kuni 18 numbrit, sealhulgas kuni 13 kümnendkohta. Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui 13 numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole.

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
			— Kui hind esitatakse protsendina – mis tahes väärtus, kuni 11 numbrit, sealhulgas kuni 10 kümnendkohta, väljendatuna protsendina (nt 2.57 % asemel 2.57). Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui 10 numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt. Juhul kui kasutatakse miinusmärki, ei loeta seda numbriks.
53	Jagu 2g – tehinguandmed	Kombineeritud tehingu hind	— Kui kombineeritud tehingu hind esitatakse rahalises väärtuses – mis tahes väärtus, kuni 18 numbrit, sealhulgas kuni 13 kümnendkohta. Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui 13 numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. — Kui kombineeritud tehingu hind esitatakse protsendina – mis tahes väärtus, kuni 11 numbrit, sealhulgas kuni 10 kümnendkohta, väljendatuna protsendina (nt 2.57 % asemel 2.57). Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui 10 numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt. Juhul kui kasutatakse miinusmärki, ei loeta seda numbriks.
54	Jagu 2g – tehinguandmed	Kombineeritud tehingu hinna valuuta	Standardi ISO 4217 kohane valuutakood (3 tähte)
55	Jagu 2g – tehinguandmed	Esimese poole tinglik väärtus	Väärtus, mis on nullist suurem või sellega võrdne ja sisaldab kuni 25 numbrit, sealhulgas kuni 5 kümnendkohta. Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui viis numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt.
56	Jagu 2g – tehinguandmed	Tinglik valuuta 1	Standardi ISO 4217 kohane valuutakood (3 tähte)
	Väljade 57–59 andmed on korratavad ja need väljad täidetakse tingliku väärtuse graafikuid hõlmavate tuletisinstrumentide puhul.		

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
57	Jagu 2g – tehinguandmed	Esimese poole tingliku väärtuse jõustumiskuupäev	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev UTC järgi vormingus AAAA-KK-PP
58	Jagu 2g – tehinguandmed	Esimese poole tingliku väärtuse lõppkuupäev	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev UTC järgi vormingus AAAA-KK-PP
59	Jagu 2g – tehinguandmed	Tinglik väärtus, mis kehtib esimese poole seotud jõustumiskuupäeval	Väärtus, mis on nullist suurem või sellega võrdne ja sisaldab kuni 25 numbrit, sealhulgas kuni 5 kümnendkohta. Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui viis numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt.
60	Jagu 2g – tehinguandmed	Esimese poole tinglik üldkogus	Väärtus, mis on nullist suurem või sellega võrdne ja sisaldab kuni 25 numbrit, sealhulgas kuni 5 kümnendkohta. Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui viis numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt.
	Väljade 61–63 andmed on korratavad ja need väljad täidetakse tingliku koguse graafikuid hõlmavate tuletisinstrumentide puhul.		
61	Jagu 2g – tehinguandmed	Esimese poole tingliku koguse jõustumiskuupäev	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev UTC järgi vormingus AAAA-KK-PP
62	Jagu 2g – tehinguandmed	Esimese poole tingliku koguse lõppkuupäev	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev UTC järgi vormingus AAAA-KK-PP
63	Jagu 2g – tehinguandmed	Tinglik kogus, mis kehtib esimese poole seotud jõustumiskuupäeval	Väärtus, mis on nullist suurem või sellega võrdne ja sisaldab kuni 25 numbrit, sealhulgas kuni 5 kümnendkohta. Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui viis numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt.

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
64	Jagu 2g – tehinguandmed	Teise poole tinglik väärtus	Väärtus, mis on nullist suurem või sellega võrdne ja sisaldab kuni 25 numbrit, sealhulgas kuni 5 kümnendkohta. Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui viis numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt.
65	Jagu 2g – tehinguandmed	Tinglik valuuta 2	Standardi ISO 4217 kohane valuutakood (3 tähte)
	Väljade 66–68 andmed on korratavad ja need väljad täidetakse tingliku väärtuse graafikuid hõlmavate tuletisinstrumentide puhul.		
66	Jagu 2g – tehinguandmed	Teise poole tingliku väärtuse jõustumiskuupäev	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev UTC järgi vormingus AAAA-KK-PP
67	Jagu 2g – tehinguandmed	Teise poole tingliku väärtuse lõppkuupäev	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev UTC järgi vormingus AAAA-KK-PP
68	Jagu 2g – tehinguandmed	Tinglik väärtus, mis kehtib teise poole seotud jõustumiskuupäeval	Väärtus, mis on nullist suurem või sellega võrdne ja sisaldab kuni 25 numbrit, sealhulgas kuni 5 kümnendkohta. Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui viis numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt.
69	Jagu 2g – tehinguandmed	Teise poole tinglik üldkogus	Väärtus, mis on nullist suurem või sellega võrdne ja sisaldab kuni 25 numbrit, sealhulgas kuni 5 kümnendkohta. Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui viis numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt.
	Väljade 70–72 andmed on korratavad ja need väljad täidetakse tingliku koguse graafikuid hõlmavate tuletisinstrumentide puhul.		

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
70	Jagu 2g – tehinguandmed	Teise poole tingliku koguse jõustumiskuupäev	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev UTC järgi vormingus AAAA-KK-PP
71	Jagu 2g – tehinguandmed	Teise poole tingliku koguse lõppkuupäev	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev UTC järgi vormingus AAAA-KK-PP
72	Jagu 2g – tehinguandmed	Tinglik kogus, mis kehtib teise poole seotud jõustumiskuupäeval	Väärtus, mis on nullist suurem või sellega võrdne ja sisaldab kuni 25 numbrit, sealhulgas kuni 5 kümnendkohta. Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui viis numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt.
	Väljade 73–78 andmed on korratavad.		
73	Jagu 2g – tehinguandmed	Muu makse liik	4 tähte: UFRO = ettemakse, st algne makse, mille üks vastaspool teeb tehingu õiglase väärtuse saavutamiseks või muul põhjusel, mis võib olla turuvälise tehingu põhjuseks UWIN = tagasipööramine või täielik lõpetamine, st lõppmakse, mis tehakse, kui tehing pööratakse tagasi enne selle lõppkuupäeva; maksed, mis võivad tuleneda tuletistehingu(te) täielikust lõpetamisest PEXH = põhisumma vahetus, st tinglike väärtuste vahetus erinevate valuutade intressimäära vahetuslepingute puhul
74	Jagu 2g – tehinguandmed	Muu makse summa	Kuni 25 numbrit, sealhulgas kuni 5 kümnendkohta. Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui viis numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt. Lubatud on mis tahes väärtus, mis on suurem kui null või sellega võrdne.
75	Jagu 2g – tehinguandmed	Muu makse vääring	Standardi ISO 4217 kohane valuutakood (3 tähte)
76	Jagu 2g – tehinguandmed	Muu makse kuupäev	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev UTC järgi vormingus AAAA-KK-PP

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
77	Jagu 2g – tehinguandmed	Muu makse maksja	— Standardi ISO 17442 kohane 20-kohaline tähtnumbriline juriidilise isiku tunnus (LEI), mis sisaldub sihtasutuse Global LEI Foundation avaldatud LEI andmetes, või kuni 72-kohaline tähtnumbriline kood füüsiliste isikute puhul, kes tegutsevad eraisikuna ja kellel ei ole ROCi avalduse kohaselt õigust saada LEI-koodi. Füüsilise isiku tunnuskood koosneb vastaspoole 1 LEI-koodist, millele järgneb kordumatu tunnus, mille vastaspool 1 on määranud ja mida ta säilitab järjepidevalt asjaomas(t)e füüsilis(t)e isiku(te) jaoks regulatiivse aruandluse eesmärgil.
78	Jagu 2g – tehinguandmed	Muu makse saaja	— Standardi ISO 17442 kohane 20-kohaline tähtnumbriline juriidilise isiku tunnus (LEI), mis sisaldub sihtasutuse Global LEI Foundation avaldatud LEI andmetes, või kuni 72-kohaline tähtnumbriline kood füüsiliste isikute puhul, kes tegutsevad eraisikuna ja kellel ei ole ROCi avalduse kohaselt õigust saada LEI-koodi. Füüsilise isiku tunnuskood koosneb vastaspoole 1 LEI-koodist, millele järgneb kordumatu tunnus, mille vastaspool 1 on määranud ja mida ta säilitab järjepidevalt asjaomas(t)e füüsilis(t)e isiku(te) jaoks regulatiivse aruandluse eesmärgil.
79	Jagu 2h – intressimäärad	Esimese poole fikseeritud intress või kupongiintress	• Positiivsed ja negatiivsed väärtused, kuni 11 numbrit, sealhulgas kuni 10 kümnendkohta, väljendatuna protsendina (nt 2.57 % asemel 2.57). Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt. Juhul kui kasutatakse miinusmärki, ei loeta seda numbriks.
80	Jagu 2h – intressimäärad	Esimese poole fikseeritud intressi või kupongiintressi arvestusmeetod	4 tähtnumbrilist märki: A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
			A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364 A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = sõnaline kirjeldus
81	Jagu 2h – intressimäärad	Esimese poole fikseeritud intressi või kupongiintressi maksesageduse ajaperiood	4 tähte: DAIL = kord päevas WEEK = kord nädalas MNTH = kord kuus YEAR = kord aastas ADHO = *ad hoc*, mida kasutatakse, kui maksed on ebakorrapärased EXPI = tähtajaline makse
82	Jagu 2h – intressimäärad	Esimese poole fikseeritud intressi või kupongiintressi maksesageduse ajaperioodi kordaja	Täisarvuline väärtus, mis on nullist suurem või sellega võrdne ja sisaldab kuni 3 numbrit.
83	Jagu 2h – intressimäärad	Esimese poole ujuva intressi tunnus	Kui ujuval intressimääral on ISIN kood, selle määra ISIN kood.
84	Jagu 2h – intressimäärad	Esimese poole ujuva intressi näitaja	Ujuva intressimäära indeksi tähis. 4 tähte: ESTR = €STR SONA = SONIA SOFR = SOFR 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

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
			TIBO = TIBOR STBO = STIBOR BBSW = BBSW JIBA = JIBAR BUBO = BUBOR CDOR = CDOR CIBO = CIBOR MOSP = MOSPRIM NIBO = NIBOR PRBO = PRIBOR TLBO = TELBOR WIBO = WIBOR TREA = Treasury (riigikassa võlakiri) SWAP = SWAP FUSW = Future SWAP EFFR = Effective Federal Funds Rate (tegelik föderaalfondide intressimäär) OBFR = Overnight Bank Funding Rate (panga üleöö rahastamismäär) CZNA = CZEONIA
85	Jagu 2h – intressimäärad	Esimese poole ujuva intressi nimi	Kuni 50 tähtnumbrilist märki. Erimärgid on lubatud, kui need on osa indeksi täisnimest.
86	Jagu 2h – intressimäärad	Esimese poole ujuva intressi arvestusmeetod	4 tähtnumbrilist märki: A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
			A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = sõnaline kirjeldus
87	Jagu 2h – intressimäärad	Esimese poole ujuva intressi maksesageduse ajaperiood	4 tähte: DAIL = kord päevas WEEK = kord nädalas MNTH = kord kuus YEAR = kord aastas ADHO = *ad hoc*, mida kasutatakse, kui maksed on ebakorrapärased EXPI = tähtajaline makse
88	Jagu 2h – intressimäärad	Esimese poole ujuva intressi maksesageduse ajaperioodi kordaja	Täisarvuline väärtus, mis on nullist suurem või sellega võrdne ja sisaldab kuni 3 numbrit.
89	Jagu 2h – intressimäärad	Esimese poole ujuva intressi baasperiood – ajaperiood	4 tähte: DAIL = kord päevas WEEK = kord nädalas MNTH = kord kuus YEAR = kord aastas ADHO = *ad hoc*, mida kasutatakse, kui maksed on ebakorrapärased EXPI = tähtajaline makse
90	Jagu 2h – intressimäärad	Esimese poole ujuva intressi baasperiood – kordaja	Täisarvuline väärtus, mis on nullist suurem või sellega võrdne ja sisaldab kuni 3 numbrit.
91	Jagu 2h – intressimäärad	Esimese poole ujuva intressi muutmise sageduse ajaperiood	4 tähte: DAIL = kord päevas WEEK = kord nädalas MNTH = kord kuus YEAR = kord aastas ADHO = *ad hoc*, mida kasutatakse, kui maksed on ebakorrapärased EXPI = tähtajaline makse
92	Jagu 2h – intressimäärad	Esimese poole ujuva intressi muutmise sageduse kordaja	Täisarvuline väärtus, mis on nullist suurem või sellega võrdne ja sisaldab kuni 3 numbrit.

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
93	Jagu 2h – intressimäärad	Esimese poole intressivahe	— Kui intressivahe esitatakse rahasummana – mis tahes väärtus, kuni 18 numbrit, sealhulgas kuni 13 kümnendkohta. — Kui intressivahe esitatakse protsendina – mis tahes väärtus, kuni 11 numbrit, sealhulgas kuni 10 kümnendkohta, väljendatuna protsendina (nt 2.57 % asemel 2.57). — Kui intressivahe esitatakse baaspunktidena – mis tahes täisarvuline väärtus, kuni 5 numbrit, väljendatuna baaspunktidena (nt 2.57 % asemel 257).
94	Jagu 2h – intressimäärad	Esimese poole intressivahe valuuta	Standardi ISO 4217 kohane valuutakood (3 tähte)
95	Jagu 2h – intressimäärad	Teise poole fikseeritud intress	• Positiivsed ja negatiivsed väärtused, kuni 11 numbrit, sealhulgas kuni 10 kümnendkohta, väljendatuna protsendina (nt 2.57 % asemel 2.57). Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt. Juhul kui kasutatakse miinusmärki, ei loeta seda numbriks.
96	Jagu 2h – intressimäärad	Teise poole fikseeritud intressi arvestusmeetod	4 tähtnumbrilist märki: A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364 A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = sõnaline kirjeldus

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
97	Jagu 2h – intressimäärad	Teise poole fikseeritud intressi maksesageduse ajaperiood	4 tähte: DAIL = kord päevas WEEK = kord nädalas MNTH = kord kuus YEAR = kord aastas ADHO = *ad hoc*, mida kasutatakse, kui maksed on ebakorrapärased EXPI = tähtajaline makse
98	Jagu 2h – intressimäärad	Teise poole fikseeritud intressi maksesageduse ajaperioodi kordaja	Täisarvuline väärtus, mis on nullist suurem või sellega võrdne ja sisaldab kuni 3 numbrit.
99	Jagu 2h – intressimäärad	Teise poole ujuva intressi tunnus	Kui ujuval intressimääral on ISIN kood, selle määra ISIN kood.
100	Jagu 2h – intressimäärad	Teise poole ujuva intressi näitaja	Ujuva intressimäära indeksi tähis. 4 tähte: ESTR = €STR SONA = SONIA SOFR = SOFR 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 NIBO = NIBOR PRBO = PRIBOR TLBO = TELBOR

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
			WIBO = WIBOR TREA = Treasury (riigikassa võlakiri) SWAP = SWAP FUSW = Future SWAP EFFR = Effective Federal Funds Rate (tegelik föderaalfondide intressimäär) OBFR = Overnight Bank Funding Rate (panga üleöö rahastamismäär) CZNA = CZEONIA
101	Jagu 2h – intressimäärad	Teise poole ujuva intressi nimi	Kuni 50 tähtnumbrilist märki. Erimärgid on lubatud, kui need on osa indeksi täisnimest.
102	Jagu 2h – intressimäärad	Teise poole ujuva intressi arvestusmeetod	4 tähtnumbrilist märki: A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364 A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = sõnaline kirjeldus
103	Jagu 2h – intressimäärad	Teise poole ujuva intressi maksesageduse ajaperiood	4 tähte: DAIL = kord päevas WEEK = kord nädalas MNTH = kord kuus YEAR = kord aastas ADHO = *ad hoc*, mida kasutatakse, kui maksed on ebakorrapärased EXPI = tähtajaline makse

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
104	Jagu 2h – intressimäärad	Teise poole ujuva intressi maksesageduse ajaperioodi kordaja	Täisarvuline väärtus, mis on nullist suurem või sellega võrdne ja sisaldab kuni 3 numbrit.
105	Jagu 2h – intressimäärad	Teise poole ujuva intressi baasperiood – ajaperiood	4 tähte: DAIL = kord päevas WEEK = kord nädalas MNTH = kord kuus YEAR = kord aastas ADHO = *ad hoc*, mida kasutatakse, kui maksed on ebakorrapärased EXPI = tähtajaline makse
106	Jagu 2h – intressimäärad	Teise poole ujuva intressi baasperiood – kordaja	Täisarvuline väärtus, mis on nullist suurem või sellega võrdne ja sisaldab kuni 3 numbrit.
107	Jagu 2h – intressimäärad	Teise poole ujuva intressi muutmise sageduse ajaperiood	4 tähte: DAIL = kord päevas WEEK = kord nädalas MNTH = kord kuus YEAR = kord aastas ADHO = *ad hoc*, mida kasutatakse, kui maksed on ebakorrapärased EXPI = tähtajaline makse
108	Jagu 2h – intressimäärad	Teise poole ujuva intressi muutmise sageduse kordaja	Täisarvuline väärtus, mis on nullist suurem või sellega võrdne ja sisaldab kuni 3 numbrit.
109	Jagu 2h – intressimäärad	Teise poole intressivahe	— Kui intressivahe esitatakse rahasummana – mis tahes väärtus, kuni 18 numbrit, sealhulgas kuni 13 kümnendkohta. — Kui intressivahe esitatakse protsendina – mis tahes väärtus, kuni 11 numbrit, sealhulgas kuni 10 kümnendkohta, väljendatuna protsendina (nt 2.57 % asemel 2.57). — Kui intressivahe esitatakse baaspunktidena – mis tahes täisarvuline väärtus, kuni 5 numbrit, väljendatuna baaspunktidena (nt 2.57 % asemel 257).
110	Jagu 2h – intressimäärad	Teise poole intressivahe valuuta	Standardi ISO 4217 kohane valuutakood (3 tähte)

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
111	Jagu 2h – intressimäärad	Kombineeritud tehingu hinnavahe	— Kui kombineeritud tehingu hinnavahe esitatakse rahasummana – positiivne ja negatiivne väärtus, kuni 18 numbrit, sealhulgas kuni 13 kümnendkohta. Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui 13 numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. — Kui kombineeritud tehingu hinnavahe esitatakse protsendina – positiivne ja negatiivne väärtus, kuni 11 numbrit, sealhulgas kuni 10 kümnendkohta, väljendatuna protsendina (nt 2.57 % asemel 2.57). Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui 10 numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. — Kui kombineeritud tehingu hinnavahe esitatakse baaspunktidena – mis tahes täisarvuline väärtus, kuni 5 numbrit, väljendatuna baaspunktidena (nt 2.57 % asemel 257). Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt. Juhul kui kasutatakse miinusmärki, ei loeta seda numbriks.
112	Jagu 2h – intressimäärad	Kombineeritud tehingu hinnavahe valuuta	Standardi ISO 4217 kohane valuutakood (3 tähte)
113	Jagu 2i – välisvaluuta	Vahetuskurss 1	Väärtus, mis on nullist suurem, kuni 18 numbrit, sealhulgas kuni 13 kümnendkohta. Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt.
114	Jagu 2i – välisvaluuta	Valuuta forvardkurss	Väärtus, mis on nullist suurem, kuni 18 numbrit, sealhulgas kuni 13 kümnendkohta. Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt.
115	Jagu 2i – välisvaluuta	Vahetuskursi alus	7 tähemärki, mis tähistavad kaht standardi ISO 4217 kohast valuutakoodi, mis on teineteisest eraldatud märgiga „/“, kusjuures valuutapaaride järjestusel piiranguid ei ole. Esimene valuutakood tähistab alusvaluutat ja teine valuutakood tähistab hinnavaluutat.
116	Jagu 2j – kaubad ja lubatud heitkoguste väärtpaberid (üldine)	Põhitoode	Lubatud on ainult kaubatuletisinstrumentide klassifikatsiooni tabeli veeru „Põhitoode“ väärtused.
117	Jagu 2j – kaubad ja lubatud heitkoguste väärtpaberid (üldine)	Alamtoode	Lubatud on ainult kaubatuletisinstrumentide klassifikatsiooni tabeli veeru „Alamtoode“ väärtused.

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
118	Jagu 2j – kaubad ja lubatud heitkoguste väärtpaberid (üldine)	Muu alamtoode	Lubatud on ainult kaubatuletisinstrumentide klassifikatsiooni tabeli veeru „Muu alamtoode“ väärtused.
119	Jagu 2k – kaubad ja lubatud heitkoguste väärtpaberid (energia)	Tarnekoht või -tsoon	EIC-kood, 16-kohaline tähtnumbriline kood Korratavad andmed
120	Jagu 2k – kaubad ja lubatud heitkoguste väärtpaberid (energia)	Ühenduspunkt	EIC-kood, 16-kohaline tähtnumbriline kood
121	Jagu 2k – kaubad ja lubatud heitkoguste väärtpaberid (energia)	Koormuse liik	BSLD = baaskoormus PKLD = tippkoormus OFFP = tipuväline koormus HABH = tund/blokktunnid SHPD = profileeritud GASD = gaasipäev OTHR = muu
	Väljade 122–131 andmed on korratavad.		
122	Jagu 2k – kaubad ja lubatud heitkoguste väärtpaberid (energia)	Tarneajavahemiku algusaeg	hh:mm:ssZ
123	Jagu 2k – kaubad ja lubatud heitkoguste väärtpaberid (energia)	Tarneajavahemiku lõpuaeg	hh:mm:ssZ
124	Jagu 2k – kaubad ja lubatud heitkoguste väärtpaberid (energia)	Tarne alguskuupäev	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev vormingus AAAA-KK-PP
125	Jagu 2k – kaubad ja lubatud heitkoguste väärtpaberid (energia)	Tarne lõppkuupäev	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev vormingus AAAA-KK-PP
126	Jagu 2k – kaubad ja lubatud heitkoguste väärtpaberid (energia)	Kestus	MNUT = minutid HOUR = tund DASD = päev WEEK = nädal MNTH = kuu QURT = kvartal SEAS = hooaeg YEAR = aasta OTHR = muu

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
127	Jagu 2k – kaubad ja lubatud heitkoguste väärtpaberid (energia)	Nädalapäevad	WDAY = tööpäev WEND = nädalavahetus MOND = esmaspäev TUED = teisipäev WEDD = kolmapäev THUD = neljapäev FRID = reede SATD = laupäev SUND = pühapäev XBHL – välja arvatud riigipühad IBHL – kaasa arvatud riigipühad Lubatud on mitu väärtust
128	Jagu 2k – kaubad ja lubatud heitkoguste väärtpaberid (energia)	Tarnevõimsus	Kuni 20 numbrit (koos kümnendkohtadega). Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt. Juhul kui kasutatakse miinusmärki, ei loeta seda numbriks.
129	Jagu 2k – kaubad ja lubatud heitkoguste väärtpaberid (energia)	Koguse ühik	KWAT = kW KWHH = kWh/h KWHD = kWh/päev MWAT = MW MWHH = MWh/h MWHD = MWh/päev GWAT = GW GWHH = GWh/h GWHD = GWh/päev THMD = term/päev KTMD = kterm/päev MTMD = Mterm/päev CMPD = kuupmeetrit/päev MCMD = miljon kuupmeetrit/päev BTUD = Btu/päev MBTD = MMBtu/päev MJDD = MJ/päev HMJD = 100MJ/päev MMJD = MMJ/päev GJDD = GJ/päev
130	Jagu 2k – kaubad ja lubatud heitkoguste väärtpaberid (energia)	Koguse hind tarneajavahemikul	Kuni 20 numbrit (kümnendkohtadega). Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt. Juhul kui kasutatakse miinusmärki, ei loeta seda numbriks.

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
131	Jagu 2k – kaubad ja lubatud heitkoguste väärtpaberid (energia)	Valuuta, milles väljendatakse koguse hinda tarneajavahemikul	Standardi ISO 4217 kohane valuutakood (3 tähte)
132	Jagu 2l – optsioonid	Optsiooni liik	4 tähte: PUTO = müügioptsioon CALL = ostuoptsioon OTHR = kui ei ole võimalik kindlaks määrata, kas tegemist on ostu- või müügioptsiooniga
133	Jagu 2l – optsioonid	Optsiooni tüüp	4 tähte: AMER = Ameerika BERM = Bermuda EURO = Euroopa
134	Jagu 2l – optsioonid	Täitmishind	— Kui täitmishind on väljendatud rahasummana: aktsiaoptsioonide, kaubaoptsioonide, valuutaoptsioonide ja sarnaste toodete puhul mis tahes väärtus, kuni 18 numbrit, sealhulgas kuni 13 kümnendkohta (nt 6.39 USD väljendatuna kujul 6.39). Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui 13 numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. — Kui täitmishind on väljendatud protsendina: intressimääraoptsioonide, hinnavahena esitatud intressimäärade ja krediidiriski vahetusoptsioonide ning sarnaste toodete puhul mis tahes väärtused, kuni 11 numbrit, sealhulgas kuni 10 kümnendkohta, väljendatuna protsentides (nt 2.1 % asemel 2.1). Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt. Juhul kui kasutatakse miinusmärki, ei loeta seda numbriks.
	Väljade 135–137 andmed on korratavad ja need väljad täidetakse täitmishinna graafikuid hõlmavate tuletisinstrumentide puhul.		
135	Jagu 2l – optsioonid	Täitmishinna jõustumiskuupäev	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev UTC järgi vormingus AAAA-KK-PP.
136	Jagu 2l – optsioonid	Täitmishinna lõppkuupäev	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev UTC järgi vormingus AAAA-KK-PP.

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
137	Jagu 2l – optsioonid	Täitmishind, mis kehtib seotud jõustumiskuupäeval	— Kui täitmishind on väljendatud rahasummana: aktsiaoptsioonide, kaubaoptsioonide, valuutaoptsioonide ja sarnaste toodete puhul mis tahes väärtus, kuni 18 numbrit, sealhulgas kuni 13 kümnendkohta (nt 6.39 USD väljendatuna kujul 6.39). Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui 13 numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. — Kui täitmishind on väljendatud protsendina: intressimääraoptsioonide, hinnavahena esitatud intressimäärade ja krediidiriski vahetusoptsioonide ning sarnaste toodete puhul mis tahes väärtused, kuni 11 numbrit, sealhulgas kuni 10 kümnendkohta, väljendatuna protsentides (nt 2.1 % asemel 2.1). Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt. Juhul kui kasutatakse miinusmärki, ei loeta seda numbriks.
138	Jagu 2l – optsioonid	Täitmishinna valuuta/ valuutapaar	Standardi ISO 4217 kohane valuutakood (3 tähte) või välisvaluuta optsioonide puhul: 7 märki, mis tähistavad kaht standardi ISO 4217 kohast valuutakoodi, mis on teineteisest eraldatud märgiga „/“, kusjuures valuutapaaride järjestusel piiranguid ei ole. Esimene valuutakood tähistab alusvaluutat ja teine valuutakood tähistab hinnavaluutat.
139	Jagu 2l – optsioonid	Optsioonipreemia summa	Väärtus, mis on nullist suurem või sellega võrdne ja sisaldab kuni 25 numbrit, sealhulgas kuni 5 kümnendkohta. Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui viis numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt.
140	Jagu 2l – optsioonid	Optsioonipreemia valuuta	Standardi ISO 4217 kohane valuutakood (3 tähte)
141	Jagu 2l – optsioonid	Optsioonipreemia maksekuupäev	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev UTC järgi vormingus AAAA-KK-PP.
142	Jagu 2i – optsioonid	Alusvara tähtpäev	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev UTC järgi vormingus AAAA-KK-PP.

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
143	Jagu 2m – krediidituletisinstrumendid	Nõudeõiguse järk	4 tähte: SNDB = kõrgema nõudeõiguse järguga võlg, nagu tagatiseta kõrgema nõudeõiguses järguga võlg (ettevõtlussektor/finantssektor), riigi välisvaluutavõlg (valitsus), SBOD = madalama nõudeõiguse järguga võlg, nagu allutatud või madalama teise taseme võlg (pangad), madalama nõudeõiguse järguga või kõrgema teise taseme võlg (pangad), OTHR = muu, nagu eelisaktsiad või esimese taseme omavahendid (pangad) või muud krediidituletisinstrumendid
144	Jagu 2m – krediidituletisinstrumendid	Aluseks olev üksus	Standardi ISO 3166 kohane riigikood – kahetäheline riigikood või standardi ISO 3166-2 kohane riigikood – kahetäheline riigikood, millele järgneb kriips („-“) ja kuni kolmekohaline tähtnumbriline riigi alljaotuse kood või standardi ISO 17442 kohane 20-kohaline tähtnumbriline juriidilise isiku tunnus (LEI)
145	Jagu 2m – krediidituletisinstrumendid	Seeria	Täisarv (kuni 5 märki)
146	Jagu 2m – krediidituletisinstrumendid	Versioon	Täisarv (kuni 5 märki)
147	Jagu 2m – krediidituletisinstrumendid	Indeks-tegur	Mis tahes väärtus, kuni 11 numbrit, sealhulgas kuni 10 kümnendkohta, väljendatuna kümnendmurruna (nt 5 % asemel 0.05) vahemikus 0 kuni 1 (sealhulgas 0 ja 1). Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt.
148	Jagu 2m – krediidituletisinstrumendid	Väärtpaberistamise seeria	Kahendmuutuja väärtus: TRUE = seeriatesse jagatud FALSE = seeriatesse jagamata
149	Jagu 2m – krediidituletisinstrumendid	Krediidituletisinstrumendi vahetustehingu indeksi alumine eraldamispunkt	Mis tahes väärtus, kuni 11 numbrit, sealhulgas kuni 10 kümnendkohta, väljendatuna kümnendmurruna (nt 5 % asemel 0.05) vahemikus 0 kuni 1 (sealhulgas 0 ja 1). Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt.
150	Jagu 2m – krediidituletisinstrumendid	Krediidituletisinstrumendi vahetustehingu indeksi ülemine eraldamispunkt	Mis tahes väärtus, kuni 11 numbrit, sealhulgas kuni 10 kümnendkohta, väljendatuna kümnendmurruna (nt 5 % asemel 0.05) vahemikus 0 kuni 1 (sealhulgas 0 ja 1). Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt.

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
151	Jagu 2n – tuletisinstrumendi muudatused	Toimingu liik	4 tähte: NEWT = uus MODI = muudatus CORR = parandus TERM = lõpetamine EROR = viga REVI = taastamine VALU = väärtuse hindamine POSC = positsiooni komponent
152	Jagu 2n – tuletisinstrumendi muudatused	Sündmuse liik	4 tähte: TRAD = tehing NOVA = üleandmine COMP = kauplemisjärgne riskivähendus ETRM = ennetähtaegne lõpetamine CLRG = kliirimine EXER = täitmine ALOC = jaotamine CREV = krediidisündmus CORP = korporatiivne sündmus INCP = positsioonile lisamine UPDT = ajakohastamine
153	Jagu 2n – tuletisinstrumendi muudatused	Sündmuse kuupäev	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev UTC järgi vormingus AAAA-KK-PP.
154	Jagu 2n – tuletisinstrumendi muudatused	Tasand	4 tähte: TCTN = tehing PSTN = positsioon

Tabel 3

	Jagu	Väli	Vorming
1	Tuletisinstrumendi pooled	Teabe ajatempel	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev ja kellaaeg koordineeritud maailmaaja (UTC) järgi vormingus AAAA-KK-PPThh:mm:ssZ
2	Tuletisinstrumendi pooled	Teadet esitava üksuse tunnuskood	Standardi ISO 17442 kohane 20-kohaline tähtnumbriline juriidilise isiku tunnus (LEI), mis sisaldub sihtasutuse Global LEI Foundation avaldatud LEI andmetes.
3	Tuletisinstrumendi pooled	Aruandluse eest vastutav üksus	Standardi ISO 17442 kohane 20-kohaline tähtnumbriline juriidilise isiku tunnus (LEI), mis sisaldub sihtasutuse Global LEI Foundation avaldatud LEI andmetes. LEI-koodi tuleb nõuetekohaselt ajakohastada kooskõlas juriidilise isiku ülemaailmse tunnuse süsteemi akrediteeritud kohaliku tegevusüksuse tingimustega.

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
4	Tuletisinstrumendi pooled	Vastaspool 1 (andmeid esitav vastaspool)	Standardi ISO 17442 kohane 20-kohaline tähtnumbriline juriidilise isiku tunnus (LEI), mis sisaldub sihtasutuse Global LEI Foundation avaldatud LEI andmetes. LEI-koodi tuleb nõuetekohaselt ajakohastada kooskõlas juriidilise isiku ülemaailmse tunnuse süsteemi akrediteeritud kohaliku tegevusüksuse tingimustega.
5	Tuletisinstrumendi pooled	Vastaspoole 2 tuvastamisviis	Kahendmuutuja väärtus: — TRUE — FALSE füüsiliste isikute puhul, kes tegutsevad eraisikuna ja kellel ei ole ROCi avalduse kohaselt õigust saada LEI-koodi
6	Tuletisinstrumendi pooled	Vastaspool 2	— Standardi ISO 17442 kohane 20-kohaline tähtnumbriline juriidilise isiku tunnus (LEI), mis sisaldub sihtasutuse Global LEI Foundation avaldatud LEI andmetes, või kuni 72-kohaline tähtnumbriline kood füüsiliste isikute puhul, kes tegutsevad eraisikuna ja kellel ei ole ROCi avalduse kohaselt õigust saada LEI-koodi. Füüsilise isiku tunnuskood koosneb vastaspoole 1 LEI-koodist, millele järgneb kordumatu tunnus, mille vastaspool 1 on määranud ja mida ta säilitab järjepidevalt asjaomas(t)e füüsilis(t)e isiku(te) jaoks regulatiivse aruandluse eesmärgil.
7	Tagatis	Tagatise ajatempel	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev ja kellaaeg UTC järgi vormingus AAAA-KK-PPThh:mm:ssZ
8	Tagatis	Tagatisportfelli tunnus	Kahendmuutuja väärtus: TRUE = tagatud portfellipõhiselt FALSE = ei ole portfelli osa
9	Tagatis	Tagatisportfelli tunnuskood	Kuni 52 tähtnumbrilist märki Erimärgid ei ole lubatud
10	Tagatis	UTI	Kuni 52 tähtnumbrilist märki, lubatud on ainult suurtähed A–Z ja numbrid 0–9
11	Tagatis	Tagatuse kategooria	4 tähte: UNCL = tagatiseta PRC1 = osalise tagatisega: ainult vastaspool 1 PRC2 = osalise tagatisega: ainult vastaspool 2 PRCL = osalise tagatisega OWC1 = ühesuunalise tagatisega: ainult vastaspool 1

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
			OWC2 = ühesuunalise tagatisega: ainult vastaspool 2 OWP1 = ühesuunalise/osalise tagatisega: vastaspool 1 OWP2 = ühesuunalise/osalise tagatisega: vastaspool 2 FLCL = täieliku tagatisega Täidetakse käesoleva määruse artikli 5 kohaselt.
12	Tagatis	Vastaspoole 1 antud alustamise tagatis (enne väärtuskärbet)	Väärtus, mis on nullist suurem või sellega võrdne ja sisaldab kuni 25 numbrit, sealhulgas kuni 5 kümnendkohta. Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui viis numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt.
13	Tagatis	Vastaspoole 1 antud alustamise tagatis (pärast väärtuskärbet)	Väärtus, mis on nullist suurem või sellega võrdne ja sisaldab kuni 25 numbrit, sealhulgas kuni 5 kümnendkohta. Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui viis numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt.
14	Tagatis	Antud alustamise tagatise valuuta	Standardi ISO 4217 kohane valuutakood (3 tähte)
15	Tagatis	Vastaspoole 1 antud muutuvtagatis (enne väärtuskärbet)	Väärtus, mis on nullist suurem või sellega võrdne ja sisaldab kuni 25 numbrit, sealhulgas kuni 5 kümnendkohta. Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui viis numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt.
16	Tagatis	Vastaspoole 1 antud muutuvtagatis (enne väärtuskärbet)	Väärtus, mis on nullist suurem või sellega võrdne ja sisaldab kuni 25 numbrit, sealhulgas kuni 5 kümnendkohta. Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui viis numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt.
17	Tagatis	Antud muutuvtagatise valuuta	Standardi ISO 4217 kohane valuutakood (3 tähte)

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
18	Tagatis	Vastaspoole 1 antud ülemäärane tagatis	Väärtus, mis on nullist suurem või sellega võrdne ja sisaldab kuni 25 numbrit, sealhulgas kuni 5 kümnendkohta. Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui viis numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt.
19	Tagatis	Antud ülemäärase tagatise valuuta	Standardi ISO 4217 kohane valuutakood (3 tähte)
20	Tagatis	Vastaspoole 1 võetud alustamise tagatis (enne väärtuskärbet)	Väärtus, mis on nullist suurem või sellega võrdne ja sisaldab kuni 25 numbrit, sealhulgas kuni 5 kümnendkohta. Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui viis numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt.
21	Tagatis	Vastaspoole 1 võetud alustamise tagatis (pärast väärtuskärbet)	Väärtus, mis on nullist suurem või sellega võrdne ja sisaldab kuni 25 numbrit, sealhulgas kuni 5 kümnendkohta. Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui viis numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt.
22	Tagatis	Võetud alustamise tagatise valuuta	Standardi ISO 4217 kohane valuutakood (3 tähte)
23	Tagatis	Vastaspoole 1 võetud muutuvtagatis (enne väärtuskärbet)	Väärtus, mis on nullist suurem või sellega võrdne ja sisaldab kuni 25 numbrit, sealhulgas kuni 5 kümnendkohta. Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui viis numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt.
24	Tagatis	Vastaspoole 1 võetud muutuvtagatis (pärast väärtuskärbet)	Väärtus, mis on nullist suurem või sellega võrdne ja sisaldab kuni 25 numbrit, sealhulgas kuni 5 kümnendkohta. Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui viis numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt.

▼B

	Jagu	Väli	Vorming
25	Tagatis	Võetud muutuvtagatise valuuta	Standardi ISO 4217 kohane valuutakood (3 tähte)
26	Tagatis	Vastaspoole 1 võetud ülemäärane tagatis	Väärtus, mis on nullist suurem või sellega võrdne ja sisaldab kuni 25 numbrit, sealhulgas kuni 5 kümnendkohta. Kui väärtuses on pärast koma rohkem kui viis numbrit, ümardavad andmeid esitavad vastaspooled need ülespoole. Kümnendkoha eraldajat ei loeta numbriks. Kui kümnendkoha eraldajat kasutatakse, peab selleks olema punkt.
27	Tagatis	Võetud ülemäärase tagatise valuuta	Standardi ISO 4217 kohane valuutakood (3 tähte)
28	Tagatis	Toimingu liik	„MARU“ – võimendustagatise ajakohastamine „CORR“ – parandus
29	Tagatis	Sündmuse kuupäev	Standardi ISO 8601 kohane kuupäev UTC järgi vormingus AAAA-KK-PP.

Tabel 4

Kaupade klassifikatsioon

Põhitoode	Alamtoode	Muu alamtoode
„AGRI“ – põllumajandustooted	„GROS“ – teraviljad, õliseemned	„FWHT“ – söödanisu „SOYB“ – sojaoad „CORN“ – mais „RPSD“ – rapsiseemned „RICE“ – riis „OTHR“ – muu
	„SOFT“ – kulukaubad	„CCOA“ – kakao „ROBU“ – robusta kohv „WHSG“ – valge suhkur „BRWN“ – toorsuhkur „OTHR“ – muu
	„POTA“ – kartulid	
	„OOLI“ – oliiviõli	„LAMP“ – lambiõli „OTHR“ – muu
	„DIRY“ – piimatooted	
	„FRST“ – metsamajandustooted	

▼B

Põhitoode	Alamtoode	Muu alamtoode
	„SEAF“ – mereannid	
	„LSTK“ – põllumajandusloomad	
	„GRIN“ – teravili	„MWHT“ – toidunisu „OTHR“ – muu
	„OTHR“ – muu	
„NRGY“ – energia	„ELEC“ – elektrienergia	„BSLD“ – baaskoormus „FITR“ – rahaline ülekandeõigus „PKLD“ – tippkoormus „OFFP“ – tipuväline koormus „OTHR“ – muu
	„NGAS“ – maagaas	„GASP“ – GASPOOL „LNGG“ – veeldatud maagaas „NBPG“ – Natural Balancing Point (NBP) „NCGG“ – Net Connect Germany (NCG) „TTFG“ – Title Tranfer Facility (TTF) „OTHR“ – muu
	„OILP“ – nafta	„BAKK“ – Bakken „BDSL“ – biodiisel „BRNT“ – Brent „BRNX“ – Brent NX „CNDA“ – Kanada „COND“ – kondensaadid „DSEL“ – diislikütus „DUBA“ – Dubai „ESPO“ – ESPO „ETHA“ – etanool „FUEL“ – kütus „FOIL“ – diisliõli „GOIL“ – gaasiõli „GSLN“ – bensiin „HEAT“ – kütteõli „JTFL“ – reaktiivkütus „KERO“ – petrooleum „LLSO“ – Light Louisiana Sweet (LLS) „MARS“ – Mars „NAPH“ – toorbensiin „NGLO“ – maagaasi kondensaat „TAPI“ – Tapis „URAL“ – Uural „WTIO“ – West Texas Intermediate (WTI) „OTHR“ – muu

▼B

Põhitoode	Alamtoode	Muu alamtoode
	„COAL“ – süsi „INRG“ – Inter Energy „RNNG“ – taastuvenergia „LGHT“ – kerged fraktsioonid „DIST“ – destillaadid „OTHR“ – muu	
„ENVR“ – keskkond	„EMIS“ – heited	„CERE“ – THV „ERUE“ – HVÜ „EUAE“ – üldine LHÜ „EUAA“ – lennunduse LHÜ „OTHR“ – muu
	„WTHR“ – ilm „CRBR“ – süsinikdioksiid „OTHR“ – muu	
„FRGT“ – prahtimine	„WETF“ – vedellast	„TNKR“ – tankerid „OTHR“ – muu
	„DRYF“ – kuivlast	„DBCR“ – puistlastilaevad „OTHR“ – muu
	„CSHP“ – konteinerilaevad	
	„OTHR“ – muu	
„FRTL“ – väetis	„AMMO“ – ammoniaak „DAPH“ – DAP (diammooniumfosfaat) „PTSH“ – kaaliumkarbonaat „SLPH“ – väävel „UREA“ – uurea „UAAN“ – UAN (uurea ja ammooniumnitraat) „OTHR“ – muu	
„INDP“ – tööstustooted	„CSTR“ – ehitustööstus „MFTG“ – tootmine	
„METL“ – metallid	„NPRM“ – värvilised metallid	„ALUM“ – alumiinium „ALUA“ – alumiiniumisulam „CBLT“ – koobalt „COPR“ – vask „IRON“ – rauamaak

▼B

Põhitoode	Alamtoode	Muu alamtoode
		„LEAD“ – plii „MOLY“ – molübdeen „NASC“ – NASAAC „NICK“ – nikkel „STEL“ – teras „TINN“ – tina „ZINC“ – tsink „OTHR“ – muu
	„PRME“ – väärismetallid	„GOLD“ – kuld „SLVR“ – hõbe „PTNM“ – plaatina „PLDM“ – pallaadium „OTHR“ – muu
„MCEX“ – Multi Commodity Exotic		
„PAPR“ – paber	„CBRD“ – lainepapp „NSPT“ – ajalehepaber „PULP“ – paberimass „RCVP“ – paberijäätmed „OTHR“ – muu	
„POLY“ – polüpropüleen	„PLST“ – plast „OTHR“ – muu	
„INFL“ – inflatsioon		
„OEST“ – ametlik majandusstatistika		
„OTHC“ – „muud C10 tuletisinstrumendid“ komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/583 ([1]) III lisa tabeli 10.1 tähenduses.		
„OTHR“ – muu		

([1]) Komisjoni 14. juuli 2016. aasta delegeeritud määrus (EL) 2017/583, millega täiendatakse finantsinstrumentide turge käsitlevat Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 600/2014 seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, mis käsitlevad kauplemiskohtade ja investeerimisühingute suhtes kohaldatavaid läbipaistvuse nõudeid võlakirjade, struktureeritud finantstoodete, lubatud heitkoguste väärtpaberite ning tuletisinstrumentide puhul (ELT L 87, 31.3.2017, lk 229).