Onderstaande tekst dient louter ter informatie en is juridisch niet bindend. De EU-instellingen zijn niet aansprakelijk voor de inhoud. Alleen de besluiten die zijn gepubliceerd in het Publicatieblad van de Europese Unie (te raadplegen in EUR-Lex) zijn authentiek. Deze officiële versies zijn rechtstreeks toegankelijk via de links in dit document

►**B**

UITVOERINGSVERORDENING (EU) 2022/1860 VAN DE COMMISSIE

van 10 juni 2022

tot vaststelling van technische uitvoeringsnormen voor de toepassing van Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad met betrekking tot de normen, formats, frequentie en methoden en regelingen voor rapportage

(Voor de EER relevante tekst)

(PB L 262 van 7.10.2022, blz. 68)

Gerectificeerd bij:

►**C1** Rectificatie PB L 304 van 24.11.2022, blz. 102 (2022/1860)

►**C2** Rectificatie PB L 125 van 11.5.2023, blz. 59 (2022/1860)

▼B

UITVOERINGSVERORDENING (EU) 2022/1860 VAN DE COMMISSIE

van 10 juni 2022

tot vaststelling van technische uitvoeringsnormen voor de toepassing van Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad met betrekking tot de normen, formats, frequentie en methoden en regelingen voor rapportage

(Voor de EER relevante tekst)

Artikel 1

Gegevensnormen en formats van derivatenrapporten

De nadere gegevens over een derivatencontract in een rapport krachtens artikel 9 van Verordening (EU) nr. 648/2012 worden verstrekt in overeenstemming met de normen en formats die in de tabellen 1, 2 en 3 van de bijlage bij die verordening zijn opgenomen en in een gebruikelijke elektronische en machineleesbare vorm en in een gemeenschappelijke XML-template overeenkomstig de ISO 20022-methodologie.

Artikel 2

Frequentie van de rapportage

1. Alle in artikel 1 van Gedelegeerde Verordening (EU) 2022/1855 van de Commissie ([1]) gespecificeerde rapportages van gegevens over een derivaat moeten worden verstrekt in de chronologische volgorde waarin de gebeurtenissen waarop de te rapporteren informatie betrekking heeft, zich hebben voorgedaan.

2. Een centrale tegenpartij, een financiële tegenpartij of een niet-financiële partij zoals bedoeld in artikel 10 van Verordening (EU) nr. 648/2012, die een tegenpartij bij een derivaat is, of de voor de rapportage verantwoordelijke entiteit, rapporteert elke wijziging van de nadere gegevens over zekerheden in de velden 1 tot en met 29 van tabel 3 van de bijlage bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2022/1855 met vermelding van het actietype “Actualisering margin”, zoals die gegevens aan het einde van elke dag gelden, voor dat derivaat wanneer:

a) het derivaat niet is vervallen en er voor het derivaat geen rapporten met actietype “Beëindigen”, “Fout” of “Positiebestanddeel” als bedoeld in veld 151 van tabel 2 van de bijlage zijn ontvangen; of

b) er voor het derivaat een rapport met actietype “Heropenen” is ontvangen dat niet werd gevolgd door een ander rapport met het actietype “Beëindigen” of “Fout” als bedoeld in veld 151 van tabel 2 van de bijlage.

([1]) Gedelegeerde Verordening (EU) 2022/1855 van de Commissie van 10 juni 2022 tot aanvulling van Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad met technische reguleringsnormen inzake de minimale mate van gedetailleerdheid van de aan transactieregisters te rapporteren gegevens en het te gebruiken rapportagetype (zie bladzijde 1 van dit Publicatieblad).

▼B

3. Een tegenpartij bij een derivaat als bedoeld in lid 2, punten a) en b), die een centrale tegenpartij, een financiële tegenpartij of een niet-financiële partij zoals bedoeld in artikel 10 van Verordening (EU) nr. 648/2012 of de voor de rapportage verantwoordelijke entiteit is, rapporteert de eindedagswaardering tegen marktwaarde of de eindedagswaardering op basis van een modellenbenadering van het contract in de velden 21 tot en met 25 in tabel 2 van de bijlage bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2022/1855 met vermelding van het actietype "actualisering van waardering" zoals die aan het einde van elke dag geldt.

Artikel 3

Identificatie van tegenpartijen en andere entiteiten

1. Een rapport gebruikt een identificatiecode voor juridische entiteiten (LEI) volgens ISO 17442 ter identificatie van:

a) een bemiddelingsentiteit;

b) een centrale tegenpartij;

c) een clearinglid;

d) een tegenpartij die een juridische entiteit is;

e) een rapporterende entiteit;

f) een voor de rapportage verantwoordelijke entiteit;

g) een aanbieder van posttransactionele risicoverlagende diensten.

2. Een tegenpartij 1 bij een derivaat als bedoeld in veld 4 van de bijlage bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2022/1855 en de voor de rapportage verantwoordelijke entiteit zorgen ervoor dat de referentiegegevens van haar LEI-code volgens ISO 17442 overeenkomstig de voorwaarden van een geaccrediteerde "local operating unit" van het mondiale LEI-systeem worden verlengd wanneer zij de sluiting of wijziging van een derivatencontract overeenkomstig artikel 9 van Verordening (EU) nr. 648/2012 rapporteren.

Artikel 4

Richting van het derivaat

1. De in de velden 17 tot en met 19 van tabel 1 van de bijlage bedoelde zijde van de tegenpartij van het derivatencontract wordt bij het sluiten van het derivaat bepaald ►C1 overeenkomstig de leden 2 tot en met 13 ◄.

2. In het geval van opties en swaptions wordt de tegenpartij die het recht heeft de optie uit te oefenen, geïdentificeerd als de koper, en de tegenpartij die de optie verkoopt en een premie ontvangt, als de verkoper.

3. In het geval van termijncontracten met betrekking tot valuta's wordt tegenpartij 1 geïdentificeerd als hetzij de betaler, hetzij de ontvanger voor deel 1 en als het tegengestelde voor deel 2. Tegenpartij 2 vult de velden 18 en 19 in tabel 1 met de tegengestelde waarden ten opzichte van tegenpartij 1.

▼B

4. In het geval van swaps met betrekking tot valuta's waarbij meerdere valuta's worden geruild, wordt elke tegenpartij voor beide delen van de transactie geïdentificeerd als hetzij de betaler, hetzij de ontvanger van het deel op basis van de valutaruil die het dichtst bij de vervaldatum plaatsvindt.

5. In het geval van andere termijncontracten dan termijncontracten met betrekking tot valuta's en in het geval van futures wordt de tegenpartij die het instrument koopt, geïdentificeerd als de koper, en de tegenpartij die het instrument verkoopt, als de verkoper.

6. In het geval van financieel contracten ter verrekening van verschillen ("contracts for difference") en spreadbets wordt de tegenpartij die short gaat met het contract geïdentificeerd als de verkoper, en wordt de tegenpartij die long gaat met het contract geïdentificeerd als de koper.

7. In het geval van swaps met betrekking tot dividenden wordt de tegenpartij die de gelijkwaardige dividenduitkeringen ontvangt, geïdentificeerd als de koper, en de tegenpartij die de gelijkwaardige dividenduitkeringen uitbetaalt als de verkoper.

8. In het geval van swaps met betrekking tot andere effecten dan swaps met betrekking tot dividenden wordt tegenpartij 1 geïdentificeerd als hetzij de betaler, hetzij de ontvanger voor deel 1, en het tegengestelde voor deel 2. Tegenpartij 2 vult de velden 18 en 19 in tabel 1 met de tegengestelde waarden ten opzichte van tegenpartij 1.

9. In het geval van swaps met betrekking tot rente of inflatie-indices, met inbegrip van cross-currency swaps, wordt tegenpartij 1 geïdentificeerd als hetzij de betaler, hetzij de ontvanger voor deel 1, en het tegengestelde voor deel 2. Tegenpartij 2 vult de velden 18 en 19 in tabel 1 met de tegengestelde waarden ten opzichte van tegenpartij 1.

10. In het geval van afgeleide instrumenten voor de overdracht van kredietrisico behalve opties en swaptions wordt de tegenpartij die de protectie koopt, geïdentificeerd als de koper, en de tegenpartij die de protectie verkoopt, als de verkoper.

11. In het geval swaps met betrekking tot grondstoffen wordt tegenpartij 1 geïdentificeerd als hetzij de betaler, hetzij de ontvanger voor deel 1 en als het tegengestelde voor deel 2. Tegenpartij 2 vult de velden 18 en 19 in tabel 1 met de tegengestelde waarden ten opzichte van tegenpartij 1.

12. In het geval rentetermijncontracten wordt tegenpartij 1 geïdentificeerd als hetzij de betaler, hetzij de ontvanger voor deel 1 en als het tegengestelde voor deel 2. Tegenpartij 2 vult de velden 18 en 19 in tabel 1 met de tegengestelde waarden ten opzichte van tegenpartij 1.

13. In het geval van derivaten die verband houden met variantie, volatiliteit en correlatie, wordt de tegenpartij die profiteert van een stijging van de prijs van de onderliggende waarde geïdentificeerd als koper en de tegenpartij die profiteert van een daling van de prijs van de onderliggende waarde als verkoper.

▼B

Artikel 5

Zekerheidsstelling

De rapporterende tegenpartij identificeert het type zekerheidsstelling van het derivatencontract of een portefeuille van derivaten als bedoeld in veld 11 van tabel 3 van de bijlage als volgt:

(a) als “zonder zekerheidsstelling” indien er tussen de tegenpartijen geen zekerheidsstellingscontract gesloten is of indien het zekerheidsstellingscontract tussen de tegenpartijen stipuleert dat de tegenpartijen met betrekking tot het derivatencontract noch een initial margin noch een variation margin storten;

(b) als “gedeeltelijk met zekerheidsstelling: alleen tegenpartij 1” indien het zekerheidsstellingscontract tussen de tegenpartijen stipuleert dat de rapporterende tegenpartij met betrekking tot het derivaat of een portefeuille van derivaten alleen op gezette tijden variation margin stort en de andere tegenpartij geen margin stort;

(c) als “gedeeltelijk met zekerheidsstelling: alleen tegenpartij 2” indien het zekerheidsstellingscontract tussen de tegenpartijen stipuleert dat de andere tegenpartij met betrekking tot het derivaat of een portefeuille van derivaten alleen op gezette tijden variation margin stort en de rapporterende tegenpartij geen margin stort;

(d) als “gedeeltelijk met zekerheidsstelling” indien het zekerheidsstellingscontract tussen de tegenpartijen stipuleert dat beide tegenpartijen met betrekking tot het derivaat of een portefeuille van derivaten alleen op gezette tijden variation margin storten;

(e) als “met eenzijdige zekerheidsstelling: alleen tegenpartij 1” indien het zekerheidsstellingscontract tussen de tegenpartijen stipuleert dat de rapporterende tegenpartij met betrekking tot het derivaat of een derivatenportefeuille de initial margin stort en op gezette tijden variation margin stort en de andere tegenpartij geen margin stort;

(f) als “met eenzijdige zekerheidsstelling: alleen tegenpartij 2” indien het zekerheidsstellingscontract tussen de tegenpartijen stipuleert dat de andere tegenpartij met betrekking tot het derivaat of een portefeuille van derivaten de initial margin stort en de rapporterende tegenpartij geen margin stort;

(g) als “met eenzijdige zekerheidsstelling/gedeeltelijk met zekerheidsstelling: tegenpartij 1” indien het zekerheidsstellingscontract tussen de tegenpartijen stipuleert dat de rapporterende tegenpartij met betrekking tot het derivaat of een derivatenportefeuille de initial margin stort en op gezette tijden variation margin stort en de andere tegenpartij alleen variation margin stort;

(h) als “met eenzijdige zekerheidsstelling/gedeeltelijk met zekerheidsstelling: tegenpartij 2” indien het zekerheidsstellingscontract tussen de tegenpartijen stipuleert dat de andere tegenpartij met betrekking tot het derivaat of een derivatenportefeuille de initial margin stort en op gezette tijden variation margin stort en de rapporterende tegenpartij alleen variation margin stort;

▼B

(i) als “met volledige zekerheidsstelling” indien het zekerheidsstellingscontract tussen de tegenpartijen stipuleert dat beide tegenpartijen met betrekking tot het derivaat of een portefeuille van derivaten de initial margin storten en op gezette tijden variation margin storten.

Artikel 6

Specificatie, identificatie en indeling van derivaten

1. In een rapport wordt een derivaat gespecificeerd op basis van het soort contract en activaklasse overeenkomstig de velden 10 en 11 in tabel 2 van de bijlage.

Indien een derivaat niet binnen een van de in veld 11 van tabel 2 van de bijlage bedoelde activaklassen valt, wordt in het rapport de activaklasse gespecificeerd die het derivaat het meest benadert. Beide tegenpartijen specificeren dezelfde activaklasse.

2. Een derivaat wordt in veld 7 in tabel 2 van de bijlage geïdentificeerd aan de hand van een internationaal effectenidentificatienummer (ISIN) volgens ISO 6166 in een van de volgende gevallen:

a) het is toegelaten tot de handel of wordt op een handelsplatform verhandeld;

b) het wordt verhandeld via een beleggingsonderneming met systematische interne afhandeling en de onderliggende waarde is toegelaten tot de handel of wordt op een handelsplatform verhandeld of is een index of korf bestaande uit instrumenten die op een handelsplatform worden verhandeld.

3. Andere dan de in lid 2 bedoelde derivaten worden in veld 8 van tabel 2 van de bijlage geïdentificeerd aan de hand van een unieke productidentificatiecode (UTI) volgens ISO 4914.

4. De rapporterende tegenpartij deelt het derivaat in veld 9 van tabel 2 van de bijlage in met behulp van een code voor classificatie van financiële instrumenten (CFI) volgens ISO 10962.

Artikel 7

Unieke transactie-identificatiecode

1. De tegenpartijen rapporteren derivaten met behulp van de overeenkomstig de leden 2, 3 en 5 gegenereerde UTI.

2. Een derivaat dat hetzij op transactieniveau, hetzij op positieniveau wordt gerapporteerd, wordt geïdentificeerd aan de hand van een unieke transactie-identificatiecode (UTI) volgens ISO 23897 in veld 1 van tabel 2 van de bijlage. De UTI bestaat uit de LEI van de entiteit die die UTI heeft gegenereerd, gevolgd door een code van maximaal 32 tekens die uniek is voor de genererende entiteit.

3. De tegenpartijen bepalen vooraf welke entiteit verantwoordelijk is voor het genereren van de UTI en gaat daarbij als volgt te werk:

▼B

(a) voor geclearde derivaten, met uitzondering van derivaten tussen twee centrale tegenpartijen, wordt de UTI bij clearing gegenereerd door de centrale tegenpartij voor het clearinglid. Het clearinglid genereert een andere UTI voor zijn tegenpartij voor een transactie waarbij de centrale tegenpartij geen tegenpartij is;

(b) voor centraal uitgevoerde maar niet centraal geclearde derivaten wordt de UTI gegenereerd door het platform van uitvoering voor zijn lid;

(c) voor andere dan de in de punten a) en b) bedoelde derivaten, wanneer een van de tegenpartijen onderworpen is aan rapportagevereisten in een derde land, wordt de UTI gegenereerd overeenkomstig de regels van het rechtsgebied van de tegenpartij die het eerst aan die rapportagevereisten moet voldoen.

Wanneer de tegenpartij die krachtens artikel 9 van Verordening (EU) nr. 648/2012 aan rapportage is onderworpen het eerst aan de rapportagevereisten moet voldoen, is de entiteit die verantwoordelijk is voor het genereren van de UTI de volgende:

i) voor derivaten die centraal werden bevestigd met elektronische middelen, het handelsplatform van bevestiging;

ii) voor alle andere derivaten komen de tegenpartijen overeen welke entiteit verantwoordelijk is voor het genereren van de UTI. Wanneer de tegenpartijen het niet eens worden, is de tegenpartij waarvan de LEI het eerst komt wanneer de identificatiecodes van de tegenpartijen worden gesorteerd met de tekens van de identificatiecode in omgekeerde volgorde verantwoordelijk voor het genereren van de UTI.

Wanneer de toepasselijke wetgeving van het betrokken derde land dezelfde rapportagetermijn voorschrijft als die waaraan de tegenpartij is onderworpen uit hoofde van artikel 9 van Verordening (EU) nr. 648/2012, overeenkomstig artikel 9, lid 1, eerste alinea van Verordening (EU) nr. 648/2012, komen de tegenpartijen overeen welke entiteit verantwoordelijk is voor het genereren van de UTI.

Wanneer de tegenpartijen het niet eens worden en het derivaat centraal werd bevestigd met elektronische middelen, wordt de UTI bij de bevestiging gegenereerd door het handelsplatform van bevestiging.

Als de UTI niet bij de bevestiging door het handelsplatform van bevestiging kan worden gegenereerd en de gegevens van het derivaat aan één enkel transactieregister moeten worden gerapporteerd, is dat transactieregister verantwoordelijk voor het genereren van de UTI.

Indien de UTI niet kan worden gegenereerd door het transactieregister waaraan de gegevens van het derivaat zijn gerapporteerd, is de tegenpartij waarvan de LEI het eerst komt wanneer de identificatiecodes van de tegenpartijen worden gesorteerd met de tekens in omgekeerde volgorde, verantwoordelijk voor het genereren van de UTI;

▼B

(d) voor andere dan de in de punten a), b) en c) vermelde derivaten, die centraal werden bevestigd met elektronische middelen, wordt de UTI bij de bevestiging gegenereerd door het handelsplatform van bevestiging;

(e) voor alle andere dan de in punten a) tot en met d) bedoelde derivaten geldt het volgende:

i) wanneer financiële tegenpartijen een derivaat sluiten met niet-financiële tegenpartijen, genereren de financiële tegenpartijen de UTI;

ii) wanneer niet-financiële tegenpartijen boven de clearingdrempel derivaten sluiten met niet-financiële tegenpartijen onder de clearingdrempel genereren de niet-financiële tegenpartijen boven de clearingdrempel de UTI;

iii) voor alle andere dan de in de punten i) en ii) bedoelde derivaten komen de tegenpartijen overeen welke entiteit verantwoordelijk is voor het genereren van de UTI. Wanneer de tegenpartijen het niet eens worden, is de tegenpartij waarvan de LEI het eerst komt wanneer de identificatiecodes van de tegenpartijen worden gesorteerd met de tekens van de identificatiecode in omgekeerde volgorde, verantwoordelijk voor het genereren van de UTI.

4. De tegenpartij die de UTI genereert deelt de UTI tijdig en uiterlijk om 10:00 uur gecoördineerde wereldtijd van de werkdag volgende op de datum van sluiting van het derivaat aan de andere tegenpartij mee.

5. Onverminderd lid 3 kan het genereren van de UTI worden gedelegeerd aan een andere entiteit dan die welke overeenkomstig lid 3 is bepaald. De entiteit die de UTI genereert, moet aan de vereisten van de leden 2 en 4 voldoen.

Artikel 8

Wijzigingen van LEI's en bijwerken van de identificatiecode naar LEI

1. Wanneer de overeenkomstig artikel 3 in een derivaatrapport geïdentificeerde tegenpartij een bedrijfsherstructurering ondergaat die tot een wijziging van haar LEI leidt, stelt die tegenpartij of de tegenpartij waarop de nieuwe LEI betrekking heeft, of de overeenkomstig artikel 9, lid 1 bis tot en met 1 quinquies, van Verordening (EU) nr. 648/2012 voor de rapportage namens een van die tegenpartijen verantwoordelijke entiteit of de entiteit waaraan een van de tegenpartijen de rapportage overeenkomstig artikel 9, lid 1 septies, van Verordening (EU) nr. 648/2012 heeft gedelegeerd, het transactieregister waaraan de tegenpartij die een bedrijfsherstructurering heeft ondergaan, haar derivaten rapporteerde, in kennis van de wijziging en verzoekt zij om de LEI in de betrokken derivaten als bedoeld in artikel 2, lid 2, punten a) en b), bij te werken op de datum van de bedrijfsherstructurering die tot een wijziging van de LEI heeft geleid of voor contracten die na die datum zijn gerapporteerd.

▼B

2. Indien mogelijk wordt het verzoek om actualisering van de identificatiecode in de derivaten als bedoeld artikel 2, lid 2, punten a) en b), gedaan ten minste dertig kalenderdagen vóór de bedrijfsherstructurering die tot een wijziging van LEI leidt. Indien de in lid 1 bedoelde entiteit niet in staat is om deze informatie 30 kalenderdagen vóór de bedrijfsherstructurering die tot een wijziging van de LEI leidt aan het transactieregister te verstrekken, stelt zij het transactieregister daarvan zo spoedig mogelijk in kennis.

3. Het in lid 1 bedoelde verzoek bevat ten minste:

a) de LEI van elk van de tegenpartijen die deelnemen aan de bedrijfsherstructurering;

b) de LEI van de nieuwe tegenpartij;

c) de datum waarop de wijziging van de LEI plaatsvindt of heeft plaatsgevonden;

d) de UTI's van de betrokken derivaten in het geval van een bedrijfsherstructurering die slechts gevolgen heeft voor een deel van de derivaten als bedoeld in artikel 2, lid 2, punten a) en b);

e) bewijs dat de bedrijfsherstructurering heeft plaatsgevonden of zal plaatsvinden, met inachtneming van de bepalingen inzake de openbaarmaking van voorwetenschap in artikel 17 van Verordening (EU) 596/2014.

4. Wanneer een tegenpartij een transactieregister per vergissing in kennis stelt van een wijziging van haar LEI, volgt zij de procedure om te verzoeken om actualisering van haar LEI overeenkomstig de leden 1, 2 en 3.

5. Wanneer een tegenpartij die eerder met een andere identificatiecode dan een LEI werd geïdentificeerd, een LEI verkrijgt, gelden de procedures in de leden 1, 2 en 3.

6. Wanneer een wijziging van een LEI betrekking heeft op een in een derde land gevestigde tegenpartij, leidt haar in de Unie gevestigde rapporterende tegenpartij of de overeenkomstig artikel 9, lid 1 bis tot en met 1 quinquies, van Verordening (EU) nr. 648/2012 voor de rapportage verantwoordelijke entiteit of de entiteit waaraan de in de Unie gevestigde rapporterende tegenpartij de rapportage heeft gedelegeerd, de procedure uit hoofde van de leden 1, 2 en 3 in.

7. Wanneer een in een derde land gevestigde tegenpartij die eerder met een andere identificatiecode dan een LEI werd geïdentificeerd, een LEI verkrijgt, verzoekt elke door deze wijziging getroffen in de Unie gevestigde rapporterende tegenpartij of de overeenkomstig artikel 9, lid 1 bis tot en met 1 quinquies, van Verordening (EU) nr. 648/2012 voor de rapportage verantwoordelijke entiteit of de entiteit waaraan de in de Unie gevestigde rapporterende tegenpartij de rapportage heeft gedelegeerd om actualisering van de identificatiecode van de in een derde land gevestigde tegenpartij bij haar respectieve transactieregister.

▼B

8. Wanneer de wijziging van de LEI betrekking heeft op een entiteit als bedoeld in artikel 3, lid 1, punten a), b), c), e) of g), die geen tegenpartij is bij het derivaat, bevestigt tegenpartij 1 of de voor de rapportage verantwoordelijke entiteit de UTI's van de betrokken derivaten als bedoeld in artikel 2, lid 2, punten a) en b), aan het transactieregister. Wanneer tegenpartij 1 en de voor de rapportage verantwoordelijke entiteit de UTI's van de betrokken derivaten als bedoeld in artikel 2, lid 2, punten a) en b), waarop de wijziging van de LEI betrekking heeft, niet aan het transactieregister bevestigen, werkt tegenpartij 1 of de voor de rapportage verantwoordelijke entiteit de LEI van de betrokken entiteit bij in alle rapporten met betrekking tot de betrokken derivaten als bedoeld in artikel 2, lid 2, punten a) en b), door een rapport met actietype "Wijzigen" te verzenden.

Artikel 9

Methoden en regelingen voor rapportage

1. De voor de rapportage verantwoordelijke entiteit stelt haar bevoegde autoriteit en, indien verschillend, de bevoegde autoriteit van de rapporterende tegenpartij in kennis van de volgende situaties:

a) een verkeerde rapportage wegens tekortkomingen in de rapportagesystemen die gevolgen zou hebben voor een significant aantal rapporten;

b) een belemmering voor de rapportage die de rapporterende entiteit belet rapporten naar een transactieregister te verzenden binnen de in artikel 9, lid 1, van Verordening (EU) nr. 648/2012 bedoelde termijn;

c) een significant probleem dat tot rapportagefouten leidt die geen aanleiding zouden geven tot afwijzing door een transactieregister overeenkomstig Gedelegeerde Verordening (EU) 2022/1858 van de Commissie ([2]).

De voor de rapportage verantwoordelijke entiteit meldt deze situaties onverwijld, zodra zij er kennis van krijgt.

In de kennisgeving wordt ten minste het soort fout of omissie vermeld, evenals de datum van het voorval, het bereik van de getroffen rapporten, de redenen voor de fouten of omissies, de stappen die zijn ondernomen om het probleem op te lossen en het tijdschema voor de oplossing van het probleem en voor correcties.

2. Wanneer een financiële tegenpartij uit hoofde van artikel 9, lid 1 bis, van Verordening (EU) nr. 648/2012 als enige verantwoordelijk en wettelijk aansprakelijk voor de rapportage van gegevens over otc-derivatencontracten namens een niet-financiële tegenpartij, treft zij de volgende regelingen:

([2]) Gedelegeerde Verordening (EU) 2022/1858 van de Commissie van 10 juni 2022 tot aanvulling van Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad betreffende technische reguleringsnormen tot nadere bepaling van de procedures voor de afstemming van gegevens tussen transactieregisters en de procedures die het transactieregister moet toepassen om te verifiëren of de rapporterende tegenpartij of de indienende entiteit de rapportagevereisten naleeft, en om de volledigheid en juistheid van de gerapporteerde gegevens te verifiëren (zie bladzijde 46 van dit Publicatieblad).

▼B

a) regelingen voor de tijdige verstrekking door de niet-financiële tegenpartij van de volgende gegevens over de otc-derivatencontracten waarvan redelijkerwijs niet kan worden verwacht dat de financiële tegenpartij erover beschikt en voor zover deze gegevens de financiële tegenpartij onbekend zijn:

   i) de identificatie van de makelaar, zoals vermeld in veld 15 in tabel 1 van de bijlage;

   ii) het clearinglid, zoals vermeld in veld 16 in tabel 1 van de bijlage;

   iii) rechtstreeks verband houdend met de handelsactiviteit of het beheer van kasmiddelen als bedoeld in veld 20 in tabel 1 van de bijlage;

b) regelingen voor tijdige informatieverstrekking door de niet-financiële tegenpartij aan de financiële tegenpartij over eventuele wijzigingen van haar wettelijke verplichtingen uit hoofde van artikel 10, lid 1, van Verordening (EU) nr. 648/2012;

c) regelingen voor een correcte verlenging door de niet-financiële tegenpartij van haar LEI in overeenstemming met de voorwaarden van een geaccrediteerde “local operating unit” van het mondiale LEI-systeem;

d) regelingen voor tijdige kennisgeving door de niet-financiële tegenpartij aan de financiële tegenpartij van haar besluit om de rapportage van de gegevens over met de financiële tegenpartij gesloten otc-derivatencontracten te starten of stop te zetten. Deze regelingen waarborgen ten minste dat de kennisgeving schriftelijk of op een andere gelijkwaardige elektronische wijze geschiedt, ten minste tien werkdagen vóór de datum waarop de niet-financiële partij de rapportage wil starten of stopzetten.

3. De tegenpartijen, de voor de rapportage verantwoordelijke entiteiten of de rapporterende entiteiten, naargelang van het geval, treffen de nodige regelingen om te verzekeren dat de overeenkomstig artikel 3 van Gedelegeerde Verordening (EU) 2022/1858 verstrekte feedback over de afstemmingsfouten in aanmerking wordt genomen.

▼C2

Artikel 10

Uiterste datum waarop derivatencontracten moeten worden gerapporteerd

Een tegenpartij bij een derivaat dat op 29 april 2024 aan de voorwaarden van artikel 2, lid 2, punten a) en b), voldoet of de voor de rapportage verantwoordelijke entiteit rapporteert alle overeenkomstig de bijlage vereiste gegevens van dat derivaat door binnen 180 kalenderdagen na 29 april 2024 een rapport met het gebeurtenistype “Actualisering” in te dienen, tenzij zij voor dat derivaat binnen deze periode een rapport met het actietype “Wijzigen” of “Correctie” heeft ingediend.

▼B

Artikel 11

Intrekking

Uitvoeringsverordening (EU) nr. 1247/2012 wordt ingetrokken.

Verwijzingen naar de ingetrokken verordening worden opgevat als verwijzingen naar deze verordening.

Artikel 12

Inwerkingtreding en toepassing

Deze verordening treedt in werking op de twintigste dag na die van de bekendmaking ervan in het *Publicatieblad van de Europese Unie*.

Zij is van toepassing met ingang van 29 april 2024.

Deze verordening is verbindend in al haar onderdelen en is rechtstreeks toepasselijk in elke lidstaat.

▼B

BIJLAGE

Tabel 1

	Afdeling	Veld	Format
1	Partijen bij het derivaat	Tijdstempel van de rapportage	Datum volgens ISO 8601 en UTC-tijdformaat (gecoördineerde wereldtijd) JJJJ-MM-DDTuu:mm:ssZ
2	Partijen bij het derivaat	Identificatie van de rapporterende entiteit	Identificatiecode voor juridische entiteiten (LEI) volgens ISO 17442 (20 alfanumerieke tekens) die is opgenomen in de LEI-gegevens zoals gepubliceerd door de Global LEI Foundation.
3	Partijen bij het derivaat	Voor de rapportage verantwoordelijke entiteit	Identificatiecode voor juridische entiteiten (LEI) volgens ISO 17442 (20 alfanumerieke tekens) die is opgenomen in de LEI-gegevens zoals gepubliceerd door de Global LEI Foundation. De LEI moet naar behoren zijn verlengd overeenkomstig de voorwaarden van een geaccrediteerde “local operating unit” van het mondiale LEI-systeem.
4	Partijen bij het derivaat	Tegenpartij 1 (rapporterende tegenpartij)	Identificatiecode voor juridische entiteiten (LEI) volgens ISO 17442 (20 alfanumerieke tekens) die is opgenomen in de LEI-gegevens zoals gepubliceerd door de Global LEI Foundation. De LEI moet naar behoren zijn verlengd overeenkomstig de voorwaarden van een geaccrediteerde “local operating unit” van het mondiale LEI-systeem.
5	Partijen bij het derivaat	Aard van tegenpartij 1	F = Financiële tegenpartij N = Niet-financiële tegenpartij C = Centrale tegenpartij O = Andere
6	Partijen bij het derivaat	Ondernemingssector van tegenpartij 1	Taxonomie voor financiële tegenpartijen: “INVF” — een beleggingsonderneming waaraan een vergunning is verleend overeenkomstig Richtlijn 2014/65/EU van het Europees Parlement en de Raad ([1]); “CDTI” — een kredietinstelling waaraan een vergunning is verleend overeenkomstig Richtlijn 2013/36/EU van het Europees Parlement en de Raad ([2]); “INUN” — een verzekeringsonderneming of herverzekeringsonderneming waaraan een vergunning is verleend overeenkomstig Richtlijn 2009/138/EG van het Europees Parlement en de Raad ([3]); “UCIT” — een icbe en, indien van toepassing, haar beheermaatschappij, waaraan een vergunning is verleend overeenkomstig Richtlijn 2009/65/EG van het Europees Parlement en de Raad ([4]), tenzij die icbe uitsluitend is opgericht voor het beheer van een of meer aandelenkooppregelingen voor werknemers; “ORPI” — een instelling voor bedrijfspensioenvoorziening (IBPV) in de zin van artikel 6, punt 1), van Richtlijn (EU) 2016/2341 van het Europees Parlement en de Raad ([5]);

▼B

	Afdeling	Veld	Format
			“AIFD” — een alternatieve beleggingsinstelling (abi) in de zin van artikel 4, lid 1, punt a), van Richtlijn 2011/61/EU van het Europees Parlement en de Raad ([6]) die hetzij in de Unie is gevestigd, hetzij wordt beheerd door een beheerder van een alternatieve beleggingsinstelling (abi-beheerder), waaraan een vergunning is verleend of die is geregistreerd overeenkomstig die richtlijn, tenzij die abi uitsluitend is opgericht voor het beheer van een of meer aandelenkoopregelingen voor werknemers of tenzij die abi een voor een bijzonder doel opgerichte securitisatie-entiteit is als bedoeld in artikel 2, lid 3, punt g), van Richtlijn 2011/61/EU, en, in voorkomend geval, haar in de Unie gevestigde abi-beheerder; “CSDS” — een centrale effectenbewaarinstelling waaraan een vergunning is verleend overeenkomstig Verordening (EU) nr. 909/2014 van het Europees Parlement en de Raad ([7]); Taxonomie voor niet-financiële tegenpartijen. De onderstaande categorieën komen overeen met de belangrijkste secties van de NACE-classificatie zoals omschreven in Verordening (EG) nr. 1893/2006 van het Europees Parlement en de Raad ([8]): “A” — Landbouw, bosbouw en visserij; “B” — Winning van delfstoffen; “C” — Industrie; “D” — Productie en distributie van elektriciteit, gas, stoom en gekoelde lucht; “E” — Distributie van water, afval- en afvalwaterbeheer en sanering; “F” — Bouwnijverheid; “G” — Groot- en detailhandel; reparatie van auto’s en motorfietsen; “H” — Vervoer en opslag; “I” — Verschaffen van accommodatie en maaltijden; “J” — Informatie en communicatie; “K” — Financiële en verzekeringsactiviteiten; “L” — Exploitatie van en handel in onroerend goed; “M” — Vrije beroepen en wetenschappelijke en technische activiteiten; “N” — Administratieve en ondersteunende diensten; “O” — Openbaar bestuur en defensie; verplichte sociale verzekeringen; “P” — Onderwijs; “Q” — Menselijke gezondheidszorg en maatschappelijke dienstverlening; “R” — Kunst, amusement en recreatie; “S” — Overige diensten;

▼B

	Afdeling	Veld	Format
			“T” — Huishoudens als werkgever; niet-gedifferentieerde productie van goederen en diensten door huishoudens voor eigen gebruik; “U” — Extraterritoriale organisaties en lichamen. Indien meer dan één activiteit wordt gerapporteerd, vermeld de codes in volgorde van het relatieve belang van de overeenkomstige activiteiten. Laat blanco in het geval van CTP’s en andere soorten tegenpartijen in de zin van artikel 1, lid 5, van Verordening (EU) nr. 648/2012 (9).
7	Partijen bij het derivaat	Clearingdrempel van tegenpartij 1	Booleaanse waarde: TRUE = Boven de drempel FALSE = Onder de drempel
8	Partijen bij het derivaat	Identificatietype tegenpartij 2	Booleaanse waarde: — TRUE — FALSE, voor natuurlijke personen die als particuliere individuen handelen die niet in aanmerking komen voor een LEI overeenkomstig de verklaring van het Comité voor regelgevend toezicht inzake individuen die bedrijfsmatig handelen van 20 september 2015 (de “ROC-verklaring”).
9	Partijen bij het derivaat	Tegenpartij 2	— Identificatiecode voor juridische entiteiten (LEI) volgens ISO 17442 (20 alfanumerieke tekens) die is opgenomen in de LEI-gegevens zoals gepubliceerd door de Global LEI Foundation of maximaal 72 alfanumerieke tekens voor natuurlijke personen die als particuliere individuen handelen die niet in aanmerking komen voor een LEI overeenkomstig de ROC-verklaring. De identificatiecode voor natuurlijke personen bestaat uit de LEI van tegenpartij 1, gevolgd door een unieke identificatiecode die door tegenpartij 1 voor rapportage voor toezichtdoeleinden aan die natuurlijke perso(o)n(en) wordt toegewezen en consequent wordt gehandhaafd.
10	Partijen bij het derivaat	Land van tegenpartij 2	Landcode volgens ISO 3166 — Tweeletterige landcode
11	Partijen bij het derivaat	Aard van tegenpartij 2	F = Financiële tegenpartij N = Niet-financiële tegenpartij C = Centrale tegenpartij O = Andere

▼B

	Afdeling	Veld	Format
12	Partijen bij het derivaat	Ondernemingssector van tegenpartij 2	Taxonomie voor financiële tegenpartijen: “INVF” — een beleggingsonderneming waaraan een vergunning is verleend overeenkomstig Richtlijn 2014/65/EU; “CDTI” — een kredietinstelling waaraan een vergunning is verleend overeenkomstig Richtlijn 2013/36/EU; “INUN” — een verzekeringsonderneming of herverzekeringsonderneming waaraan een vergunning is verleend overeenkomstig Richtlijn 2009/138/EG; “UCIT” — een icbe en, indien van toepassing, haar beheermaatschappij, waaraan een vergunning is verleend overeenkomstig Richtlijn 2009/65/EG, tenzij die icbe uitsluitend is opgericht voor het beheer van een of meer aandelenkoopregelingen voor werknemers; “ORPI” — een instelling voor bedrijfspensioenvoorziening (IBPV) in de zin van artikel 6, punt 1), van Richtlijn (EU) 2016/2341; “AIFD” — een alternatieve beleggingsinstelling (abi) in de zin van artikel 4, lid 1, punt a), van Richtlijn 2011/61/EU die hetzij in de Unie is gevestigd, hetzij wordt beheerd door een beheerder van een alternatieve beleggingsinstelling (abi-beheerder), waaraan een vergunning is verleend of die is geregistreerd overeenkomstig die richtlijn, tenzij die abi uitsluitend is opgericht voor het beheer van een of meer aandelenkoopregelingen voor werknemers of tenzij die abi een voor een bijzonder doel opgerichte securitisatie-entiteit is als bedoeld in artikel 2, lid 3, punt g), van Richtlijn 2011/61/EU, en, in voorkomend geval, haar in de Unie gevestigde abi-beheerder; “CSDS” — een centrale effectenbewaarinstelling waaraan een vergunning is verleend overeenkomstig Verordening (EU) nr. 909/2014; Taxonomie voor niet-financiële tegenpartijen. De onderstaande categorieën komen overeen met de belangrijkste secties van de NACE-classificatie zoals omschreven in Verordening (EG) nr. 1893/2006: “A” — Landbouw, bosbouw en visserij; “B” — Winning van delfstoffen; “C” — Industrie; “D” — Productie en distributie van elektriciteit, gas, stoom en gekoelde lucht; “E” — Distributie van water, afval- en afvalwaterbeheer en sanering; “F” — Bouwnijverheid; “G” — Groot- en detailhandel; reparatie van auto’s en motorfietsen; “H” — Vervoer en opslag; “I” — Verschaffen van accommodatie en maaltijden; “J” — Informatie en communicatie; “K” — Financiële en verzekeringsactiviteiten;

▼B

	Afdeling	Veld	Format
			“L” — Exploitatie van en handel in onroerend goed; “M” — Vrije beroepen en wetenschappelijke en technische activiteiten; “N” — Administratieve en ondersteunende diensten; “O” — Openbaar bestuur en defensie; verplichte sociale verzekeringen; “P” — Onderwijs; “Q” — Menselijke gezondheidszorg en maatschappelijke dienstverlening; “R” — Kunst, amusement en recreatie; “S” — Overige diensten; “T” — Huishoudens als werkgever; niet-gedifferentieerde productie van goederen en diensten door huishoudens voor eigen gebruik; “U” — Extraterritoriale organisaties en lichamen. Indien meer dan één activiteit wordt gerapporteerd, vermeld de codes in volgorde van het relatieve belang van de overeenkomstige activiteiten. Laat blanco in het geval van CTP’s en andere soorten tegenpartijen in de zin van artikel 1, lid 5, van Verordening (EU) nr. 648/2012.
13	Partijen bij het derivaat	Clearingdrempel van tegenpartij 2	Booleaanse waarde: TRUE = Boven de drempel FALSE = Onder de drempel
14	Partijen bij het derivaat	Rapportage-verplichting van tegenpartij 2	Booleaanse waarde: — TRUE, indien tegenpartij 2 de rapportageverplichting heeft — FALSE, indien tegenpartij 2 niet de rapportageverplichting heeft
15	Partijen bij het derivaat	Identificatie van de makelaar	Identificatiecode voor juridische entiteiten (LEI) volgens ISO 17442 (20 alfanumerieke tekens) die is opgenomen in de LEI-gegevens zoals gepubliceerd door de Global LEI Foundation.
16	Partijen bij het derivaat	Clearinglid	Identificatiecode voor juridische entiteiten (LEI) volgens ISO 17442 (20 alfanumerieke tekens) die is opgenomen in de LEI-gegevens zoals gepubliceerd door de Global LEI Foundation.
17	Partijen bij het derivaat	Richting	4 letters: BYER = koper SLLR = verkoper Ingevuld overeenkomstig artikel 4 van de onderhavige verordening

▼B

	Afdeling	Veld	Format
18	Partijen bij het derivaat	Richting van deel 1	4 letters: MAKE = betaler TAKE = ontvanger Ingevuld overeenkomstig artikel 4 van de onderhavige verordening
19	Partijen bij het derivaat	Richting van deel 2	4 letters: MAKE = betaler TAKE = ontvanger Ingevuld overeenkomstig artikel 4 van de onderhavige verordening
20	Partijen bij het derivaat	Rechtstreeks verband houdend met de handelsactiviteit of het beheer van kasmiddelen	Booleaanse waarde: TRUE = Ja FALSE = Nee

([1]) Richtlijn 2014/65/EU van het Europees Parlement en de Raad van 15 mei 2014 betreffende markten in financiële instrumenten en tot wijziging van Richtlijn 2002/92/EG en Richtlijn 2011/61/EU (PB L 173 van 12.6.2014, blz. 349).
([2]) Richtlijn 2013/36/EU van het Europees Parlement en de Raad van 26 juni 2013 betreffende toegang tot het bedrijf van kredietinstellingen en het prudentieel toezicht op kredietinstellingen en beleggingsondernemingen, tot wijziging van Richtlijn 2002/87/EG en tot intrekking van de Richtlijnen 2006/48/EG en 2006/49/EG (PB L 176 van 27.6.2013, blz. 338).
([3]) Richtlijn 2009/138/EG van het Europees Parlement en de Raad van 25 november 2009 betreffende de toegang tot en uitoefening van het verzekerings- en het herverzekeringsbedrijf (Solvabiliteit II) (PB L 335 van 17.12.2009, blz. 1).
([4]) Richtlijn 2009/65/EG van het Europees Parlement en de Raad van 13 juli 2009 tot coördinatie van de wettelijke en bestuursrechtelijke bepalingen betreffende bepaalde instellingen voor collectieve belegging in effecten (icbe's) (PB L 302 van 17.11.2009, blz. 32).
([5]) Richtlijn (EU) 2016/2341 van het Europees Parlement en de Raad van 14 december 2016 betreffende de werkzaamheden van en het toezicht op instellingen voor bedrijfspensioenvoorziening (IBPV's) (PB L 354 van 23.12.2016, blz. 37).
([6]) Richtlijn 2011/61/EU van het Europees Parlement en de Raad van 8 juni 2011 inzake beheerders van alternatieve beleggingsinstellingen en tot wijziging van de Richtlijnen 2003/41/EG en 2009/65/EG en van de Verordeningen (EG) nr. 1060/2009 en (EU) nr. 1095/2010 (PB L 174 van 1.7.2011, blz. 1).
([7]) Verordening (EU) nr. 909/2014 van het Europees Parlement en de Raad van 23 juli 2014 betreffende de verbetering van de effectenafwikkeling in de Europese Unie, betreffende centrale effectenbewaarinstellingen en tot wijziging van Richtlijnen 98/26/EG en 2014/65/EU en Verordening (EU) nr. 236/2012 (PB L 257 van 28.8.2014, blz. 1).
([8]) Verordening (EG) nr. 1893/2006 van het Europees Parlement en de Raad van 20 december 2006 tot vaststelling van de statistische classificatie van economische activiteiten NACE Rev. 2 en tot wijziging van Verordening (EEG) nr. 3037/90 en enkele EG-verordeningen op specifieke statistische gebieden (PB L 393 van 30.12.2006, blz. 1).
([9]) Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad van 4 juli 2012 betreffende otc-derivaten, centrale tegenpartijen en transactieregisters (PB L 201 van 27.7.2012, blz. 1).

Tabel 2

	Afdeling	Veld	Format
1	Afdeling 2a — Identificatiecodes en koppelingen	UTI	UTI volgens ISO 23897. Maximaal 52 alfanumerieke tekens, alleen de alfabetische hoofdletters A-Z en de cijfers 0-9 zijn toegestaan
2	Afdeling 2a — Identificatiecodes en koppelingen	Traceernummer rapport	Een alfanumeriek veld van maximaal 52 tekens
3	Afdeling 2a — Identificatiecodes en koppelingen	Eerdere UTI (voor één-op-één- en één-op-veel-relaties tussen transacties)	Maximaal 52 alfanumerieke tekens, alleen de alfabetische hoofdletters A-Z en de cijfers 0-9 zijn toegestaan

▼B

	Afdeling	Veld	Format
4	Afdeling 2a — Identificatiecodes en koppelingen	UTI van de latere positie	Maximaal 52 alfanumerieke tekens, alleen de alfabetische hoofdletters A-Z en de cijfers 0-9 zijn toegestaan
5	Afdeling 2a — Identificatiecodes en koppelingen	Identificatiecode van de posttransactionele risicobeperking (PTRB)	Maximaal 52 alfanumerieke tekens, alleen de alfabetische hoofdletters A-Z en de cijfers 0-9 zijn toegestaan. De eerste 20 tekens geven de LEI van de compressieaanbieder weer
6	Afdeling 2a — Identificatiecodes en koppelingen	Identificatiecode van het pakket	Maximaal 35 alfanumerieke tekens.
7	Afdeling 2b — Contractinformatie	Internationaal effectenidentificatienummer (ISIN)	ISIN volgens ISO 6166 (alfanumerieke code van 12 tekens)
8	Afdeling 2b — Contractinformatie	Unieke productidentificatiecode (UPI)	UPI volgens ISO 4914 (alfanumerieke code van 12 tekens)
9	Afdeling 2b — Contractinformatie	Productclassificatie	CFI volgens ISO 10962 (alfabetische code van 6 tekens)
10	Afdeling 2b — Contractinformatie	Soort contract	CFDS = Financiële contracten ter verrekening van verschillen (“contracts for differences”) FRAS = Rentetermijncontracten FUTR = Futures FORW = Termijncontracten OPTN = Optie SPDB = Spreadbet SWAP = Swap SWPT = Swaption OTHR = Overig
11	Afdeling 2b — Contractinformatie	Activaklasse	COMM = Grondstoffen en emissierechten CRDT = Krediet CURR = Deviezen EQUI = Aandelen INTR = Rente
12	Afdeling 2b — Contractinformatie	Derivaat op basis van cryptoactiva	Booleaanse waarde: — TRUE — voor derivaten op basis van cryptoactiva — FALSE — voor andere derivaten
13	Afdeling 2b — Contractinformatie	Soort identificatie van de onderliggende waarde	1 alfabetisch teken: I = ISIN B = Korf X = Index

▼B

	Afdeling	Veld	Format
14	Afdeling 2b — Contractinformatie	Identificatie van de onderliggende waarde	Voor soort identificatie van de onderliggende waarde I: ISIN volgens ISO 6166 (alfanumerieke code van 12 tekens) Voor soort identificatie van de onderliggende waarde X: ISIN volgens ISO 6166 indien beschikbaar (alfanumerieke code van 12 tekens)
15	Afdeling 2b — Contractinformatie	Indicator van de onderliggende index	De indicatie van de index van variabele rente. 4 letters: 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 SWAP = SWAP FUSW = Future SWAP EFFR = Effective Federal Funds Rate OBFR = Overnight Bank Funding Rate CZNA = CZEONIA
16	Afdeling 2b — Contractinformatie	Naam van de onderliggende index	Maximaal 50 alfanumerieke tekens. Speciale tekens zijn toegestaan als ze deel uitmaken van de volledige naam van de index.

▼B

	Afdeling	Veld	Format
17	Afdeling 2b — Contractinformatie	Code aangepaste korf	Maximaal 72 alfanumerieke tekens bestaande uit de LEI van de korfsamensteller, gevolgd door maximaal 52 alfanumerieke tekens.
18	Afdeling 2b — Contractinformatie	Identificatiecode van de onderdelen van de korf	Voor soort identificatie van de onderliggende waarde B: Alle individuele componenten geïdentificeerd aan de hand van de ISIN volgens ISO 6166
19	Afdeling 2b — Contractinformatie	Afwikkelingsvaluta 1	Valutacode volgens ISO 4217 (3 alfabetische tekens)
20	Afdeling 2b — Contractinformatie	Afwikkelingsvaluta 2	Valutacode volgens ISO 4217 (3 alfabetische tekens)
21	Afdeling 2c — Waardering	Waarderingsbedrag	Positieve en negatieve waarde, maximaal 25 numerieke tekens inclusief maximaal 5 decimalen. Indien de waarde meer dan vijf cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt. Als een minteken moet worden ingevuld, wordt het niet als numeriek teken meegeteld.
22	Afdeling 2c — Waardering	Valuta van de waardering	Valutacode volgens ISO 4217 (3 alfabetische tekens)
23	Afdeling 2c — Waardering	Tijdstempel van de waardering	Datum volgens ISO 8601 in het UTC-tijdformaat JJJJ-MM-DDTuu:mm:ssZ
24	Afdeling 2c — Waardering	Waarderingsmethode	4 letters: MTMA = Waardering tegen marktwaarde MTMO = Waardering op basis van een modellenbenadering CCPV = Waardering van de centrale tegenpartij
25	Afdeling 2c — Waardering	Delta	Maximaal 25 numerieke tekens, waarvan maximaal 5 decimalen. Indien de waarde meer dan vijf cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt. Elke waarde tussen –1 en 1 (inclusief –1 en 1) is toegestaan.
26	Afdeling 2d — Zekerheden	Indicator zekerhedenportefeuille	Booleaanse waarde: TRUE = met zekerheden op portefeuillebasis FALSE = geen deel van een portefeuille
27	Afdeling 2d — Zekerheden	Code van de zekerhedenportefeuille	Maximaal 52 alfanumerieke tekens Speciale tekens zijn niet toegestaan
28	Afdeling 2e — Risicolimitering/ rapportage	Tijdstempel van de bevestiging	Datum volgens ISO 8601 in het UTC-tijdformaat JJJJ-MM-DDTuu:mm:ssZ

▼B

	Afdeling	Veld	Format
29	Afdeling 2e — Risicolimitering/ rapportage	Bevestigd	4 letters: — NCNF = niet bevestigd — ECNF = elektronisch — YCNF = niet-elektronisch
30	Afdeling 2f — Clearing	Clearingverplichting	TRUE = het gerapporteerde contract behoort tot een klasse van otc-derivaten waarop de clearingverplichting van toepassing is verklaard en beide tegenpartijen bij het contract zijn op het moment van uitvoering van het contract aan de clearingverplichting onderworpen FLSE = het contract behoort tot een klasse van otc-derivaten waarop de clearingverplichting van toepassing is verklaard, maar één of beide tegenpartijen bij het contract is of zijn niet aan de clearingverplichting onderworpen of waarde “UKWN” — het contract behoort niet tot een klasse van otc-derivaten waarop de clearingverplichting van toepassing is verklaard
31	Afdeling 2f — Clearing	Gecleard	1 alfabetisch teken: Y= ja, centraal gecleard, voor bèta- en gammatransacties. N= nee, niet centraal gecleard.
32	Afdeling 2f — Clearing	Tijdstempel van de clearing	Datum volgens ISO 8601 in het UTC-tijdformaat JJJJ-MM-DDTuu:mm:ssZ
33	Afdeling 2f — Clearing	Centrale tegenpartij	Identificatiecode voor juridische entiteiten (LEI) volgens ISO 17442 (20 alfanumerieke tekens) die is opgenomen in de LEI-gegevens zoals gepubliceerd door de Global LEI Foundation.
34	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Soort raamovereenkomst	4 letters: “ISDA” — ISDA “CDEA”— FIA-ISDA Cleared Derivatives Execution Agreement “EUMA” — European Master Agreement “FPCA” — FOA Professional Client Agreement “FMAT” — FBF Master Agreement relating to transactions on forward financial instruments “DERV” — Deutscher Rahmenvertrag für Finanztermingeschäfte (DRV) “CMOP” — Contrato Marco de Operaciones Financieras “CHMA” — Swiss Master Agreement “IDMA” — Islamic Derivative Master Agreement “EFMA” — EFET Master Agreement

▼B

	Afdeling	Veld	Format
			“GMRA” — GMRA “GMSL” — GMSLA “BIAG” — bilaterale overeenkomst Of “OTHR” als het soort raamovereenkomst niet in bovenstaande lijst is opgenomen
35	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Ander soort raamovereenkomst	Maximaal 50 alfanumerieke tekens.
36	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Versie raamovereenkomst	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ
37	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Intragroep	Booleaanse waarde: TRUE = contract gesloten als intragroeptransactie FALSE = contract niet gesloten als intragroeptransactie
38	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	PTRB	Booleaanse waarde: TRUE = contract is het resultaat van een PTRB-gebeurtenis FALSE = contract is niet het resultaat van een PTRB-gebeurtenis
39	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Soort PTRB-techniek	4 letters: “PWOS” — Portefeuillecompressie zonder derde-aanbieder van diensten “PWAS” — Portefeuillecompressie met derde-aanbieder van diensten of centrale tegenpartij “PRBM” — Portefeuilleherschikking/marginbeheer “OTHR” — Overig
40	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Aanbieders van PTRB-diensten	Identificatiecode voor juridische entiteiten (LEI) volgens ISO 17442 (20 alfanumerieke tekens) die is opgenomen in de LEI-gegevens zoals gepubliceerd door de Global LEI Foundation.
41	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Plaats van uitvoering	Marktidentificatiecode (MIC) volgens ISO 10383 (4 alfanumerieke tekens)
42	Afdeling 2c — Gegevens over de transactie	Tijdstempel van de uitvoering	Datum volgens ISO 8601 in het UTC-tijdformaat JJJJ-MM-DDTuu:mm:ssZ
43	Afdeling 2c — Gegevens over de transactie	Ingangsdatum	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
44	Afdeling 2c — Gegevens over de transactie	Vervaldatum	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD

▼B

	Afdeling	Veld	Format
45	Afdeling 2c — Gegevens over de transactie	Datum van de vroegtijdige beëindiging	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
46	Afdeling 2c — Gegevens over de transactie	Uiterste contractuele afwikkelingsdatum	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
47	Afdeling 2c — Gegevens over de transactie	Soort levering	4 letters: CASH = Contanten PHYS = Fysiek OPTL = Facultatief voor tegenpartij of door bepaling door een derde
48	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Prijs	— Indien de prijs als monetaire waarde wordt uitgedrukt — elke waarde van maximaal 18 numerieke tekens inclusief maximaal 13 decimalen. Indien de waarde meer dan 13 cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. — Indien de prijs als percentage wordt uitgedrukt — elke waarde van maximaal 11 numerieke tekens inclusief maximaal 10 decimalen uitgedrukt als percentage (bv. 2,57 in plaats van 2,57 %). Indien de waarde meer dan 10 cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt. Als een minteken moet worden ingevuld, wordt het niet als numeriek teken meegeteld.
49	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Prijsvaluta	Valutacode volgens ISO 4217 (3 alfabetische tekens)
	De velden 50-52 zijn herhaalbaar en worden ingevuld in het geval van derivaten met prijsschema's		
50	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Niet-aangepaste ingangsdatum van de prijs	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
51	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Niet-aangepaste einddatum van de prijs	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
52	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Prijs die geldt tussen de niet-aangepaste ingangsdatum en de einddatum	— Indien de prijs als monetaire waarde wordt uitgedrukt — elke waarde van maximaal 18 numerieke tekens inclusief maximaal 13 decimalen. Indien de waarde meer dan 13 cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden.

▼B

	Afdeling	Veld	Format
			— Indien de prijs als percentage wordt uitgedrukt — elke waarde van maximaal 11 numerieke tekens inclusief maximaal 10 decimalen uitgedrukt als percentage (bv. 2,57 in plaats van 2,57 %). Indien de waarde meer dan 10 cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt. Als een minteken moet worden ingevuld, wordt het niet als numeriek teken meegeteld.
53	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Prijs van de pakkettransactie	— Indien de prijs van de pakkettransactie als monetaire waarde wordt uitgedrukt — elke waarde van maximaal 18 numerieke tekens inclusief maximaal 13 decimalen. Indien de waarde meer dan 13 cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. — Indien de prijs van de pakkettransactie als percentage wordt uitgedrukt — elke waarde van maximaal 11 numerieke tekens inclusief maximaal 10 decimalen uitgedrukt als percentage (bv. 2,57 in plaats van 2,57 %). Indien de waarde meer dan 10 cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt. Als een minteken moet worden ingevuld, wordt het niet als numeriek teken meegeteld.
54	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Valuta van de prijs van de pakkettransactie	Valutacode volgens ISO 4217 (3 alfabetische tekens)
55	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Nominaal bedrag van deel 1	Elke waarde groter dan of gelijk aan nul, tot 25 numerieke tekens, met inbegrip van maximaal 5 decimalen. Indien de waarde meer dan vijf cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt.
56	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Nominale valuta 1	Valutacode volgens ISO 4217 (3 alfabetische tekens)
	De velden 57-59 zijn herhaalbaar en worden ingevuld in het geval van derivaten met schema's voor nominale bedragen		

▼B

	Afdeling	Veld	Format
57	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Ingangsdatum van het nominale bedrag van deel 1	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
58	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Einddatum van het nominale bedrag van deel 1	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
59	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Nominaal bedrag dat gold op de bijbehorende ingangsdatum van deel 1	Elke waarde groter dan of gelijk aan nul, tot 25 numerieke tekens, met inbegrip van maximaal 5 decimalen. Indien de waarde meer dan vijf cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt.
60	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Totale nominale hoeveelheid van deel 1	Elke waarde groter dan of gelijk aan nul, tot 25 numerieke tekens, met inbegrip van maximaal 5 decimalen. Indien de waarde meer dan vijf cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt.
	De velden 61-63 zijn herhaalbaar en worden ingevuld in het geval van derivaten met schema's voor de nominale hoeveelheid		
61	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Ingangsdatum van de nominale hoeveelheid van deel 1	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
62	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Einddatum van de nominale hoeveelheid van deel 1	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
63	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Nominale hoeveelheid die gold op de bijbehorende ingangsdatum van deel 1	Elke waarde groter dan of gelijk aan nul, tot 25 numerieke tekens, met inbegrip van maximaal 5 decimalen. Indien de waarde meer dan vijf cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt.

▼B

	Afdeling	Veld	Format
64	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Nominaal bedrag van deel 2	Elke waarde groter dan of gelijk aan nul, tot 25 numerieke tekens, met inbegrip van maximaal 5 decimalen. Indien de waarde meer dan vijf cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt.
65	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Nominale valuta 2	Valutacode volgens ISO 4217 (3 alfabetische tekens)
	De velden 66-68 zijn herhaalbaar en worden ingevuld in het geval van derivaten met schema's voor nominale bedragen		
66	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Ingangsdatum van het nominale bedrag van deel 2	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
67	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Einddatum van het nominale bedrag van deel 2	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
68	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Nominaal bedrag dat gold op de bijbehorende ingangsdatum van deel 2	Elke waarde groter dan of gelijk aan nul, tot 25 numerieke tekens, met inbegrip van maximaal 5 decimalen. Indien de waarde meer dan vijf cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt.
69	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Totale nominale hoeveelheid van deel 2	Elke waarde groter dan of gelijk aan nul, tot 25 numerieke tekens, met inbegrip van maximaal 5 decimalen. Indien de waarde meer dan vijf cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt.
	De velden 70-72 zijn herhaalbaar en worden ingevuld in het geval van derivaten met schema's voor de nominale hoeveelheid		

▼B

	Afdeling	Veld	Format
70	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Ingangsdatum van de nominale hoeveelheid van deel 2	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
71	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Einddatum van de nominale hoeveelheid van deel 2	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
72	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Nominale hoeveelheid die gold op de bijbehorende ingangsdatum van deel 2	Elke waarde groter dan of gelijk aan nul, tot 25 numerieke tekens, met inbegrip van maximaal 5 decimalen. Indien de waarde meer dan vijf cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt.
	Afdeling van velden 73-78 is herhaalbaar		
73	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Type overige betaling	4 letters: UFRO = vooruitbetaling, d.w.z. de eerste betaling door een van de tegenpartijen om een transactie tot reële waarde te brengen of om enige andere reden die de oorzaak kan zijn van een transactie buiten de markt om UWIN = ontbinding of volledige beëindiging, d.w.z. de definitieve afwikkelingsbetaling wanneer een transactie vóór de einddatum ervan wordt afgewikkeld; betalingen die het gevolg kunnen zijn van de volledige beëindiging van derivatentransacties PEXH = ruil van hoofdsommen, d.w.z. ruil van nominale waarden voor cross-currency swaps
74	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Bedrag overige betaling	Maximaal 25 numerieke tekens, waarvan maximaal 5 decimalen. Indien de waarde meer dan vijf cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt. Elke waarde groter dan of gelijk aan nul is toegestaan.
75	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Valuta overige betaling	Valutacode volgens ISO 4217 (3 alfabetische tekens)
76	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Datum overige betaling	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD

▼B

	Afdeling	Veld	Format
77	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Betaler overige betaling	— Identificatiecode voor juridische entiteiten (LEI) volgens ISO 17442 (20 alfanumerieke tekens) die is opgenomen in de LEI-gegevens zoals gepubliceerd door de Global LEI Foundation of maximaal 72 alfanumerieke tekens voor natuurlijke personen die als particuliere individuen handelen die niet in aanmerking komen voor een LEI overeenkomstig de ROC-verklaring. De identificatiecode voor natuurlijke personen bestaat uit de LEI van tegenpartij 1, gevolgd door een unieke identificatiecode die door tegenpartij 1 voor rapportage voor toezichtdoeleinden aan die natuurlijke perso(o)n(en) wordt toegewezen en consequent wordt gehandhaafd.
78	Afdeling 2g — Nadere gegevens over de transactie	Ontvanger overige betaling	— Identificatiecode voor juridische entiteiten (LEI) volgens ISO 17442 (20 alfanumerieke tekens) die is opgenomen in de LEI-gegevens zoals gepubliceerd door de Global LEI Foundation of maximaal 72 alfanumerieke tekens voor natuurlijke personen die als particuliere individuen handelen die niet in aanmerking komen voor een LEI overeenkomstig de ROC-verklaring. De identificatiecode voor natuurlijke personen bestaat uit de LEI van tegenpartij 1, gevolgd door een unieke identificatiecode die door tegenpartij 1 voor rapportage voor toezichtdoeleinden aan die natuurlijke perso(o)n(en) wordt toegewezen en consequent wordt gehandhaafd.
79	Afdeling 2h — Rente	Vaste rente van deel 1 of coupon	Positieve en negatieve waarden, maximaal 11 numerieke tekens inclusief maximaal 10 decimalen uitgedrukt als percentage (bv. 2,57 in plaats van 2,57 %). Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt. Als een minteken moet worden ingevuld, wordt het niet als numeriek teken meegeteld.
80	Afdeling 2h — Rente	Dagtellingsconventie van de vaste rente of coupon van deel 1	4 alfanumerieke tekens: A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule

▼B

	Afdeling	Veld	Format
			A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364 A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = Narrative
81	Afdeling 2h — Rente	Betalingsfrequentie-periode van de vaste rente of coupon van deel 1	4 letters: DAIL = dagelijks WEEK = wekelijks MNTH = maandelijks YEAR = jaarlijks ADHO = ad hoc, hetgeen van toepassing is wanneer betalingen onregelmatig zijn EXPI = betaling aan het einde van de vervaltermijn
82	Afdeling 2h — Rente	Multiplicator van de betalingsfrequentie-periode van de vaste rente of coupon van deel 1	Elke gehele waarde groter dan of gelijk aan nul, tot 3 numerieke tekens.
83	Afdeling 2h — Rente	Identificatiecode van de variabele rente van deel 1	Indien de variabele rente een ISIN heeft, de ISIN-code voor die rente.
84	Afdeling 2h — Rente	Indicator van de variabele rente van deel 1	De indicatie van de index van variabele rente. 4 letters: 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

	Afdeling	Veld	Format
			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 SWAP = SWAP FUSW = Future SWAP EFFR = Effective Federal Funds Rate OBFR = Overnight Bank Funding Rate CZNA = CZEONIA
85	Afdeling 2h — Rente	Naam van de variabele rente van deel 1	Maximaal 50 alfanumerieke tekens. Speciale tekens zijn toegestaan als ze deel uitmaken van de volledige naam van de index.
86	Afdeling 2h — Rente	Dagtellingsconventie van de variabele rente van deel 1	4 alfanumerieke tekens: 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

	Afdeling	Veld	Format
			A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = Narrative
87	Afdeling 2h — Rente	Betalingsfrequentie-periode van de variabele rente van deel 1	4 letters: DAIL = dagelijks WEEK = wekelijks MNTH = maandelijks YEAR = jaarlijks ADHO = ad hoc, hetgeen van toepassing is wanneer betalingen onregelmatig zijn EXPI = betaling aan het einde van de vervaltermijn
88	Afdeling 2h — Rente	Multiplicator van de betalingsfrequentie-periode van de variabele rente van deel 1	Elke gehele waarde groter dan of gelijk aan nul, tot 3 numerieke tekens.
89	Afdeling 2h — Rente	Referentieperiode van de variabele rente van deel 1 — tijdsperiode	4 letters: DAIL = dagelijks WEEK = wekelijks MNTH = maandelijks YEAR = jaarlijks ADHO = ad hoc, hetgeen van toepassing is wanneer betalingen onregelmatig zijn EXPI = betaling aan het einde van de vervaltermijn
90	Afdeling 2h — Rente	Referentieperiode van de variabele rente van deel 1 — multiplicator	Elke gehele waarde groter dan of gelijk aan nul, tot 3 numerieke tekens.
91	Afdeling 2h — Rente	Herzieningsfrequentie-periode van de variabele rente van deel 1	4 letters: DAIL = dagelijks WEEK = wekelijks MNTH = maandelijks YEAR = jaarlijks ADHO = ad hoc, hetgeen van toepassing is wanneer betalingen onregelmatig zijn EXPI = betaling aan het einde van de vervaltermijn
92	Afdeling 2h — Rente	Multiplicator van de herzieningsfrequentie van de variabele rente van deel 1	Elke gehele waarde groter dan of gelijk aan nul, tot 3 numerieke tekens.

▼B

	Afdeling	Veld	Format
93	Afdeling 2h — Rente	Spread van deel 1	— Indien de spread als monetaire waarde wordt uitgedrukt — elke waarde van maximaal 18 numerieke tekens inclusief maximaal 13 decimalen. — Indien de spread als percentage wordt uitgedrukt — elke waarde van maximaal 11 numerieke tekens inclusief maximaal 10 decimalen uitgedrukt als percentage (bv. 2,57 in plaats van 2,57 %). — Indien de spread in basispunten wordt uitgedrukt — elke gehele waarde van maximaal 5 numerieke tekens uitgedrukt in basispunten (bv. 257 in plaats van 2,57 %).
94	Afdeling 2h — Rente	Valuta van de spread van deel 1	Valutacode volgens ISO 4217 (3 alfabetische tekens)
95	Afdeling 2h — Rente	Vaste rente van deel 2	Positieve en negatieve waarden, maximaal 11 numerieke tekens inclusief maximaal 10 decimalen uitgedrukt als percentage (bv. 2,57 in plaats van 2,57 %). Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt. Als een minteken moet worden ingevuld, wordt het niet als numeriek teken meegeteld.
96	Afdeling 2h — Rente	Dagtellingsconventie van de vaste rente van deel 2	4 alfanumerieke tekens: 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 = Narrative

▼B

	Afdeling	Veld	Format
97	Afdeling 2h — Rente	Betalingsfrequentie-periode van de vaste rente van deel 2	4 letters: DAIL = dagelijks WEEK = wekelijks MNTH = maandelijks YEAR = jaarlijks ADHO = ad hoc, hetgeen van toepassing is wanneer betalingen onregelmatig zijn EXPI = betaling aan het einde van de vervaltermijn
98	Afdeling 2h — Rente	Multiplicator van de betalingsfrequentie-periode van de vaste rente van deel 2	Elke gehele waarde groter dan of gelijk aan nul, tot 3 numerieke tekens.
99	Afdeling 2h — Rente	Identificatiecode van de variabele rente van deel 2	Indien de variabele rente een ISIN heeft, de ISIN-code voor die rente.
100	Afdeling 2h — Rente	Indicator van de variabele rente van deel 2	De indicatie van de index van variabele rente. 4 letters: 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

	Afdeling	Veld	Format
			WIBO = WIBOR TREA = Treasury SWAP = SWAP FUSW = Future SWAP EFFR = Effective Federal Funds Rate OBFR = Overnight Bank Funding Rate CZNA = CZEONIA
101	Afdeling 2h — Rente	Naam van de variabele rente van deel 2	Maximaal 50 alfanumerieke tekens. Speciale tekens zijn toegestaan als ze deel uitmaken van de volledige naam van de index.
102	Afdeling 2h — Rente	Dagtellingsconventie van de variabele rente van deel 2	4 alfanumerieke tekens: 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 = Narrative
103	Afdeling 2h — Rente	Betalingsfrequentie-periode van de variabele rente van deel 2	4 letters: DAIL = dagelijks WEEK = wekelijks MNTH = maandelijks YEAR = jaarlijks ADHO = ad hoc, hetgeen van toepassing is wanneer betalingen onregelmatig zijn EXPI = betaling aan het einde van de vervaltermijn

▼B

	Afdeling	Veld	Format
104	Afdeling 2h — Rente	Multiplicator van de betalingsfrequentie-periode van de variabele rente van deel 2	Elke gehele waarde groter dan of gelijk aan nul, tot 3 numerieke tekens.
105	Afdeling 2h — Rente	Referentieperiode van de variabele rente van deel 2 — tijdsperiode	4 letters: DAIL = dagelijks WEEK = wekelijks MNTH = maandelijks YEAR = jaarlijks ADHO = ad hoc, hetgeen van toepassing is wanneer betalingen onregelmatig zijn EXPI = betaling aan het einde van de vervaltermijn
106	Afdeling 2h — Rente	Referentieperiode van de variabele rente van deel 2 — multiplicator	Elke gehele waarde groter dan of gelijk aan nul, tot 3 numerieke tekens.
107	Afdeling 2h — Rente	Herzieningsfrequentie-periode van de variabele rente van deel 2	4 letters: DAIL = dagelijks WEEK = wekelijks MNTH = maandelijks YEAR = jaarlijks ADHO = ad hoc, hetgeen van toepassing is wanneer betalingen onregelmatig zijn EXPI = betaling aan het einde van de vervaltermijn
108	Afdeling 2h — Rente	Multiplicator van de herzieningsfrequentie van de variabele rente van deel 2	Elke gehele waarde groter dan of gelijk aan nul, tot 3 numerieke tekens.
109	Afdeling 2h — Rente	Spread van deel 2	— Indien de spread als monetaire waarde wordt uitgedrukt — elke waarde van maximaal 18 numerieke tekens inclusief maximaal 13 decimalen. — Indien de spread als percentage wordt uitgedrukt — elke waarde van maximaal 11 numerieke tekens inclusief maximaal 10 decimalen uitgedrukt als percentage (bv. 2,57 in plaats van 2,57 %). — Indien de spread in basispunten wordt uitgedrukt — elke gehele waarde van maximaal 5 numerieke tekens uitgedrukt in basispunten (bv. 257 in plaats van 2,57 %).
110	Afdeling 2h — Rente	Valuta van de spread van deel 2	Valutacode volgens ISO 4217 (3 alfabetische tekens)

▼B

	Afdeling	Veld	Format
111	Afdeling 2h — Rente	Spread van de pakkettransactie	— Indien de spread van de pakkettransactie als monetaire waarde wordt uitgedrukt — positieve en negatieve waarden van maximaal 18 numerieke tekens inclusief maximaal 13 decimalen. Indien de waarde meer dan 13 cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. — Indien de spread van de pakkettransactie als percentage wordt uitgedrukt — positieve en negatieve waarden van maximaal 11 numerieke tekens inclusief maximaal 10 decimalen uitgedrukt als percentage (bv. 2,57 in plaats van 2,57 %). Indien de waarde meer dan 10 cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. — Indien de spread van de pakkettransactie in basispunten wordt uitgedrukt — elke gehele waarde van maximaal 5 numerieke tekens uitgedrukt in basispunten (bv. 257 in plaats van 2,57 %). Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt. Als een minteken moet worden ingevuld, wordt het niet als numeriek teken meegeteld.
112	Afdeling 2h — Rente	Valuta van de spread van de pakkettransactie	Valutacode volgens ISO 4217 (3 alfabetische tekens)
113	Afdeling 2i — Deviezen	Wisselkoers 1	Elke waarde groter dan nul tot 18 numerieke tekens, met inbegrip van maximaal 13 decimalen. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt.
114	Afdeling 2i — Deviezen	Termijnkoers	Elke waarde groter dan nul tot 18 numerieke tekens, met inbegrip van maximaal 13 decimalen. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt.
115	Afdeling 2i — Deviezen	Wisselkoersbasis	7 tekens die twee valutacode volgens ISO 4217 vertegenwoordigen, gescheiden door “/” zonder beperking van de volgorde van het valutapaar. De eerste valutacode geeft de eenheidsvaluta aan, en de tweede geeft de valuta van notering aan.
116	Afdeling 2j — Grondstoffen en emissierechten (algemeen)	Basisproduct	Slechts de waarden in de kolom “Basisproduct” van de tabel met de indeling van grondstoffenderivaten zijn toegestaan.
117	Afdeling 2j — Grondstoffen en emissierechten (algemeen)	Subproduct	Slechts de waarden in de kolom “Subproduct” van de tabel met de indeling van grondstoffenderivaten zijn toegestaan.

▼B

	Afdeling	Veld	Format
118	Afdeling 2j — Grondstoffen en emissierechten (algemeen)	Verder subproduct	Slechts de waarden in de kolom “Verder subproduct” van de tabel met de indeling van grondstoffenderivaten zijn toegestaan.
119	Afdeling 2k — Grondstoffen en emissierechten (energie)	Leveringspunt of -zone	EIC-code (16 alfanumerieke tekens) Herhaalbaar veld.
120	Afdeling 2k — Grondstoffen en emissierechten (energie)	Interconnectiepunt	EIC-code (16 alfanumerieke tekens)
121	Afdeling 2k — Grondstoffen en emissierechten (energie)	Belastingsprofiel	BSLD = Basislast PKLD = Pieklast OFFP = Last buiten de piek HABH = Uur/Blokuren SHPD = Gevormd (shaped) GASD = Gasdag OTHR = Overig
	Afdeling van velden 122-131 is herhaalbaar		
122	Afdeling 2k — Grondstoffen en emissierechten (energie)	Starttijd van het leveringsinterval	uu:mm:ssZ
123	Afdeling 2k — Grondstoffen en emissierechten (energie)	Eindtijd van het leveringsinterval	uu:mm:ssZ
124	Afdeling 2k — Grondstoffen en emissierechten (energie)	Startdatum van de levering	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
125	Afdeling 2k — Grondstoffen en emissierechten (energie)	Einddatum van de levering	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
126	Afdeling 2k — Grondstoffen en emissierechten (energie)	Duur	MNUT = minuten HOUR = uur DASD = dag WEEK = week MNTH = maand QURT = kwartaal SEAS = seizoen YEAR = jaar OTHR = overig

▼B

	Afdeling	Veld	Format
127	Afdeling 2k — Grondstoffen en emissierechten (energie)	Dagen van de week	WDAY = weekdagen WEND = weekend MOND = maandag TUED = dinsdag WEDD = woensdag THUD = donderdag FRID = vrijdag SATD = zaterdag SUND = zondag XBHL - met uitzondering van feestdagen IBHL - met inbegrip van feestdagen Meerdere waarden zijn toegestaan
128	Afdeling 2k — Grondstoffen en emissierechten (energie)	Leveringscapaciteit	Maximaal 20 numerieke tekens inclusief decimalen Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt. Als een minteken moet worden ingevuld, wordt het niet als numeriek teken meegeteld.
129	Afdeling 2k — Grondstoffen en emissierechten (energie)	Eenheid van de hoeveelheid	KWAT = KW KWHH = KWh/h KWHD = KWh/d MWAT = MW MWHH = MWh/h MWHD = MWh/d GWAT = GW GWhh = GWh/h GWHD = GWh/d THMD = Therm/d KTMD = Ktherm/d MTMD = Mtherm/d CMPD = cm/d MCMD = mcm/d BTUD = Btu/d MBTD = MMBtu/d MJDD = MJ/d HMJD = 100MJ/d MMJD = MMJ/d GJDD = GJ/d
130	Afdeling 2k — Grondstoffen en emissierechten (energie)	Prijs per geleverde hoeveelheid in een tijdsinterval	Maximaal 20 numerieke tekens, inclusief decimalen. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt. Als een minteken moet worden ingevuld, wordt het niet als numeriek teken meegeteld.

▼B

	Afdeling	Veld	Format
131	Afdeling 2k — Grondstoffen en emissierechten (energie)	Valuta van de prijs per geleverde hoeveelheid in een tijdsinterval	Valutacode volgens ISO 4217 (3 alfabetische tekens)
132	Afdeling 2l — Opties	Soort optie	4 alfabetisch teken: PUTO = Put CALL = Call OTHR = Indien niet kan worden bepaald of het een call of een put betreft
133	Afdeling 2l — Opties	Aard van de optie	4 letters: AMER = Amerikaans BERM = Bermuda EURO = Europees
134	Afdeling 2l — Opties	Uitoefenprijs	— Indien de uitoefenprijs als geldbedrag wordt uitgedrukt: elke waarde van maximaal 18 numerieke tekens inclusief maximaal 13 decimalen (bv. 6,39 USD, uitgedrukt als 6,39) voor aandelenopties, grondstoffenopties, valutaopties en soortgelijke producten. Indien de waarde meer dan 13 cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. — Indien de uitoefenprijs als percentage wordt uitgedrukt: elke waarde van maximaal 11 numerieke tekens inclusief maximaal 10 decimalen uitgedrukt als percentage (bv. 2,1 in plaats van 2,1 %) voor renteopties, in spread genoteerde rente- en kredietswaptions en soortgelijke producten. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt. Als een minteken moet worden ingevuld, wordt het niet als numeriek teken meegeteld.
	De velden 135-137 zijn herhaalbaar en worden ingevuld in het geval van derivaten met uitoefenprijsschema's		
135	Afdeling 2l — Opties	Ingangsdatum van de uitoefenprijs	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
136	Afdeling 2l — Opties	Einddatum van de uitoefenprijs	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD

▼B

	Afdeling	Veld	Format
137	Afdeling 2l — Opties	Uitoefenprijs die gold op de bijbehorende ingangsdatum	— Indien de uitoefenprijs als geldbedrag wordt uitgedrukt: elke waarde van maximaal 18 numerieke tekens inclusief maximaal 13 decimalen (bv. 6,39 USD, uitgedrukt als 6,39) voor aandelenopties, grondstoffenopties, valutaopties en soortgelijke producten. Indien de waarde meer dan 13 cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. — Indien de uitoefenprijs als percentage wordt uitgedrukt: elke waarde van maximaal 11 numerieke tekens inclusief maximaal 10 decimalen uitgedrukt als percentage (bv. 2,1 in plaats van 2,1 %) voor renteopties, in spread genoteerde rente- en kredietswaptions en soortgelijke producten. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt. Als een minteken moet worden ingevuld, wordt het niet als numeriek teken meegeteld.
138	Afdeling 2l — Opties	Valuta/valutapaar van de uitoefenprijs	Valutacode volgens ISO 4217 (3 alfabetische tekens); of voor valutaopties: 7 tekens die twee valutacode volgens ISO 4217 vertegenwoordigen, gescheiden door “/” zonder beperking van de volgorde van het valutapaar. De eerste valutacode geeft de basisvaluta aan, en de tweede geeft de valuta van notering aan.
139	Afdeling 2l — Opties	Bedrag van de optiepremie	Elke waarde groter dan of gelijk aan nul, tot 25 numerieke tekens, met inbegrip van maximaal 5 decimalen. Indien de waarde meer dan vijf cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt.
140	Afdeling 2l — Opties	Valuta van de optiepremie	Valutacode volgens ISO 4217 (3 alfabetische tekens)
141	Afdeling 2l — Opties	Datum van de betaling van de optiepremie	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
142	Afdeling 2i — Opties	Vervaldatum van de onderliggende waarde	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD

▼B

	Afdeling	Veld	Format
143	Afdeling 2m — Kredietderivaten	Rangorde	4 letters: SNDB = Niet-achtergesteld, zoals niet-achtergestelde ongedekte schuld (ondernemingen/financieel), overheidsschuld in vreemde valuta (overheid) SBOD = Achtergesteld, zoals achtergestelde of lower tier 2-schuld (banken), junior achtergesteld of upper tier 2-schuld (banken) OTHR = Andere, zoals preferentiële aandelen of tier 1-kapitaal (banken) of andere kredietderivaten
144	Afdeling 2m — Kredietderivaten	Referentie-entiteit	Landcode volgens ISO 3166 — Tweeletterige landcode, of landcode volgens ISO 3166-2 — Tweeletterige landcode, gevolgd door een streepje “-” en code voor de onderverdeling van het land van maximaal 3 alfanumerieke karakters of Identificatiecode voor juridische entiteiten (LEI) volgens ISO 17442 (20 alfanumerieke tekens)
145	Afdeling 2m — Kredietderivaten	Serie	Veldnummer van maximaal 5 tekens
146	Afdeling 2m — Kredietderivaten	Versie	Veldnummer van maximaal 5 tekens
147	Afdeling 2m — Kredietderivaten	Indexfactor	Elke waarde van maximaal 11 numerieke tekens, inclusief maximaal 10 decimalen, uitgedrukt als decimale breuk (bv. 0,05 in plaats van 5 %) tussen 0 en 1 (met inbegrip van 0 en 1). Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt.
148	Afdeling 2m — Kredietderivaten	Tranche	Booleaanse waarde: TRUE = In tranches verdeeld FALSE = Niet in tranches verdeeld
149	Afdeling 2m — Kredietderivaten	Attachment point CDS (Credit Derivative Swap)-index	Elke waarde van maximaal 11 numerieke tekens, inclusief maximaal 10 decimalen, uitgedrukt als decimale breuk (bv. 0,05 in plaats van 5 %) tussen 0 en 1 (met inbegrip van 0 en 1). Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt.
150	Afdeling 2m — Kredietderivaten	Detachment point CDS-index	Elke waarde van maximaal 11 numerieke tekens, inclusief maximaal 10 decimalen, uitgedrukt als decimale breuk (bv. 0,05 in plaats van 5 %) tussen 0 en 1 (met inbegrip van 0 en 1). Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt.

▼B

	Afdeling	Veld	Format
151	Afdeling 2n — Wijzigingen in het derivaat	Actietype	4 letters: NEWT = Nieuw MODI = Wijzigen CORR = Corrigeren TERM = Beëindigen EROR = Fout REVI = Heropenen VALU = Waardering POSC = Positiebestanddeel
152	Afdeling 2n — Wijzigingen in het derivaat	Type gebeurtenis	4 letters: TRAD = Transactie NOVA = Instap COMP = PTRB ETRM = Vervroegde beëindiging CLRG = Clearing EXER = Uitoefening ALOC = Toewijzing CREV = Kredietgebeurtenis CORP=Corporate event INCP = Opname in positie UPDT = Actualisering
153	Afdeling 2n — Wijzigingen in het derivaat	Datum gebeurtenis	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
154	Afdeling 2n — Wijzigingen in het derivaat	Niveau	4 letters: TCTN = Transactie PSTN = Positie

Tabel 3

	Afdeling	Veld	Format
1	Partijen bij het derivaat	Tijdstempel van de rapportage	Datum volgens ISO 8601 en UTC-tijdformaat (gecoördineerde wereldtijd) JJJJ-MM-DDTuu:mm:ssZ
2	Partijen bij het derivaat	Identificatie van de rapporterende entiteit	Identificatiecode voor juridische entiteiten (LEI) volgens ISO 17442 (20 alfanumerieke tekens) die is opgenomen in de LEI-gegevens zoals gepubliceerd door de Global LEI Foundation.
3	Partijen bij het derivaat	Voor de rapportage verantwoordelijke entiteit	Identificatiecode voor juridische entiteiten (LEI) volgens ISO 17442 (20 alfanumerieke tekens) die is opgenomen in de LEI-gegevens zoals gepubliceerd door de Global LEI Foundation. De LEI moet naar behoren zijn verlengd overeenkomstig de voorwaarden van een geaccrediteerde “local operating unit” van het mondiale LEI-systeem.

▼B

	Afdeling	Veld	Format
4	Partijen bij het derivaat	Tegenpartij 1 (rapporterende tegenpartij)	Identificatiecode voor juridische entiteiten (LEI) volgens ISO 17442 (20 alfanumerieke tekens) die is opgenomen in de LEI-gegevens zoals gepubliceerd door de Global LEI Foundation. De LEI moet naar behoren zijn verlengd overeenkomstig de voorwaarden van een geaccrediteerde “local operating unit” van het mondiale LEI-systeem.
5	Partijen bij het derivaat	Identificatietype tegenpartij 2	Booleaanse waarde: — TRUE — FALSE, voor natuurlijke personen die als particuliere individuen handelen die niet in aanmerking komen voor een LEI overeenkomstig de ROC-verklaring.
6	Partijen bij het derivaat	Tegenpartij 2	— Identificatiecode voor juridische entiteiten (LEI) volgens ISO 17442 (20 alfanumerieke tekens) die is opgenomen in de LEI-gegevens zoals gepubliceerd door de Global LEI Foundation of maximaal 72 alfanumerieke tekens voor natuurlijke personen die als particuliere individuen handelen die niet in aanmerking komen voor een LEI overeenkomstig de ROC-verklaring. De identificatiecode voor natuurlijke personen bestaat uit de LEI van tegenpartij 1, gevolgd door een unieke identificatiecode die door tegenpartij 1 voor rapportage voor toezichtdoeleinden aan die natuurlijke perso(o)n(en) wordt toegewezen en consequent wordt gehandhaafd.
7	Zekerheden	Tijdstempel van de zekerheden	Datum volgens ISO 8601 in het UTC-tijdformaat JJJJ-MM-DDTuu:mm:ssZ
8	Zekerheden	Indicator zekerhedenportefeuille	Booleaanse waarde: TRUE = met zekerheden op portefeuillebasis FALSE = geen deel van een portefeuille
9	Zekerheden	Code van de zekerhedenportefeuille	Maximaal 52 alfanumerieke tekens Speciale tekens zijn niet toegestaan
10	Zekerheden	UTI	Maximaal 52 alfanumerieke tekens, alleen de alfabetische hoofdletters A-Z en de cijfers 0-9 zijn toegestaan
11	Zekerheden	Categorie zekerheidsstelling	4 letters: UNCL = niet door zekerheden gedekt PRC1 = gedeeltelijk met zekerheidsstelling: alleen tegenpartij 1 PRC2 = gedeeltelijk met zekerheidsstelling: alleen tegenpartij 2 PRCL = gedeeltelijk met zekerheidsstelling OWC1 = met eenzijdige zekerheidsstelling: alleen tegenpartij 1

▼B

	Afdeling	Veld	Format
			OWC2 = met eenzijdige zekerheidsstelling: alleen tegenpartij 2 OWP1 = met eenzijdige zekerheidsstelling/gedeeltelijk met zekerheidsstelling: tegenpartij 1 OWP2 = met eenzijdige zekerheidsstelling/gedeeltelijk met zekerheidsstelling: tegenpartij 2 FLCL = met volledige zekerheidsstelling Ingevuld overeenkomstig artikel 5 van de onderhavige verordening
12	Zekerheden	Door tegenpartij 1 gestorte initial margin (vóór de haircut)	Elke waarde groter dan of gelijk aan nul, tot 25 numerieke tekens, met inbegrip van maximaal 5 decimalen. Indien de waarde meer dan vijf cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt.
13	Zekerheden	Door tegenpartij 1 gestorte initial margin (na de haircut)	Elke waarde groter dan of gelijk aan nul, tot 25 numerieke tekens, met inbegrip van maximaal 5 decimalen. Indien de waarde meer dan vijf cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt.
14	Zekerheden	Valuta van de gestorte initial margin	Valutacode volgens ISO 4217 (3 alfabetische tekens)
15	Zekerheden	Door tegenpartij 1 gestorte variation margin (vóór de haircut)	Elke waarde groter dan of gelijk aan nul, tot 25 numerieke tekens, met inbegrip van maximaal 5 decimalen. Indien de waarde meer dan vijf cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt.
16	Zekerheden	Door tegenpartij 1 gestorte variation margin (na de haircut)	Elke waarde groter dan of gelijk aan nul, tot 25 numerieke tekens, met inbegrip van maximaal 5 decimalen. Indien de waarde meer dan vijf cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt.
17	Zekerheden	Valuta van de gestorte variation margin	Valutacode volgens ISO 4217 (3 alfabetische tekens)

▼B

	Afdeling	Veld	Format
18	Zekerheden	Door tegenpartij 1 te veel gestorte zekerheden	Elke waarde groter dan of gelijk aan nul, tot 25 numerieke tekens, met inbegrip van maximaal 5 decimalen. Indien de waarde meer dan vijf cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt.
19	Zekerheden	Valuta van de te veel gestorte zekerheden	Valutacode volgens ISO 4217 (3 alfabetische tekens)
20	Zekerheden	Door tegenpartij 1 geïnde initial margin (vóór de haircut)	Elke waarde groter dan of gelijk aan nul, tot 25 numerieke tekens, met inbegrip van maximaal 5 decimalen. Indien de waarde meer dan vijf cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt.
21	Zekerheden	Door tegenpartij 1 geïnde initial margin (na de haircut)	Elke waarde groter dan of gelijk aan nul, tot 25 numerieke tekens, met inbegrip van maximaal 5 decimalen. Indien de waarde meer dan vijf cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt.
22	Zekerheden	Valuta van de geïnde initia margin	Valutacode volgens ISO 4217 (3 alfabetische tekens)
23	Zekerheden	Door tegenpartij 1 geïnde variation margin (vóór de haircut)	Elke waarde groter dan of gelijk aan nul, tot 25 numerieke tekens, met inbegrip van maximaal 5 decimalen. Indien de waarde meer dan vijf cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt.
24	Zekerheden	Door tegenpartij 1 geïnde variation margin (na de haircut)	Elke waarde groter dan of gelijk aan nul, tot 25 numerieke tekens, met inbegrip van maximaal 5 decimalen. Indien de waarde meer dan vijf cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt.

▼B

	Afdeling	Veld	Format
25	Zekerheden	Valuta van de geïnde variation margin	Valutacode volgens ISO 4217 (3 alfabetische tekens)
26	Zekerheden	Door tegenpartij 1 te veel geïnde zekerheden	Elke waarde groter dan of gelijk aan nul, tot 25 numerieke tekens, met inbegrip van maximaal 5 decimalen. Indien de waarde meer dan vijf cijfers achter de komma telt, moeten de rapporterende tegenpartijen naar boven afronden. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld. Als een decimaalteken moet worden ingevuld, wordt een punt gebruikt.
27	Zekerheden	Valuta van de te veel geïnde zekerheden	Valutacode volgens ISO 4217 (3 alfabetische tekens)
28	Zekerheden	Actietype	“MARU” — Actualisering margin “CORR” — Correctie
29	Zekerheden	Datum gebeurtenis	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD

Tabel 4

Indeling van grondstoffen

Basisproduct	Subproduct	Verder subproduct
“AGRI” — Landbouw	“GROS” — Granen olie zaden	“FWHT” — Voedertarwe “SOYB” — Sojabonen “CORN” — Maïs “RPSD” — Raapzaad “RICE” — Rijst “OTHR” — Overig
	“SOFT” — Zachte landbouwproducten	“CCOA” — Cacao “ROBU” — Robustakoffie “WHSG” — Witte suiker “BRWN” — Ruwe suiker “OTHR” — Overig
	“POTA” — Aardappelen	
	“OOLI” — Olijfolie	“LAMP” — Olijfolie voor verlichting “OTHR” — Overig
	“DIRY” — Zuivel	
	“FRST” — Bosbouw	

▼B

Basisproduct	Subproduct	Verder subproduct
	“SEAF” — Visserijproducten	
	“LSTK” — Vee	
	“GRIN” — Granen	“MWHT” — Maaltarwe “OTHR” — Overig
	“OTHR” — Overig	
“NRGY” — Energie	“ELEC” — Elektriciteit	“BSLD” — Basislast “FITR” — Financiële transmissierechten “PKLD” — Pieklast “OFFP” — Dalbelasting “OTHR” — Overig
	“NGAS” — Aardgas	“GASP” — Gaspool “LNGG” — LNG “NBPG” — NBP “NCGG” — NCG “TTFG” — TTF “OTHR” — Overig
	“OILP” — Olie	“BAKK” — Bakken “BDSL” — Biodiesel “BRNX” — Brent NX “BRNX” — Brent NX “CNDA” — Canadese “COND” — Condensaat “DSEL” — Diesel “DUBA” — Dubai “ESPO” — ESPO “ETHA” — Ethanol “FUEL” — Brandstof “FOIL” — Brandstofolie “GOIL” — Gasolie “GSLN” — Benzine “HEAT” — Stookolie “JTFL” — Reactiemotorbrandstof “KERO” — Kerosine “LLSO” — Light Louisiana Sweet (LLS) “MARS” — Mars “NAPH” — Nafta “NGLO” — Aardgas “TAPI” — Tapis ‘URAL” — Oeral “WTIO” — West Texas Intermediate (WTI) “OTHR” — Overig

▼B

Basisproduct	Subproduct	Verder subproduct
	“COAL”— Kolen “INRG” — Interenergie “RNNG” — Hernieuwbare energie “LGHT” — Lichte eindfracties “DIST” — Distillaten “OTHR” — Overig	
“ENVR” — Milieu	“EMIS” — Emissies	“CERE” — CER “ERUE” — ERU “EUAE” — EUA “EUAA” — EUAA “OTHR” — Overige
	“WTHR” — Weer “CRBR” — Koolstofgerelateerd “OTHR” — Overig	
“FRGT” — Vracht	“WETF” — Nat	“TNKR” — Tankers “OTHR” — Overig
	“DRYF” — Droog	“DBCR” — Drogebulkcarriers “OTHR” — Overig
	“CSHP” — Containerschepen	
	“OTHR” — Overig	
“FRTL” — Meststoffen	“AMMO” — Ammoniak “DAPH” — DAP (diammoniumfosfaat) “PTSH” — Potas “SLPH” — Zwavel “UREA” — Ureum “UAAN” — UAN (ureum en ammoniumnitraat) “OTHR” — Overig	
“INDP” — Industriële producten	“CSTR” — Bouwnijverheid “MFTG” — Industrie	
“METL” — Metalen	“NPRM” — Onedel	“ALUM” — Aluminium “ALUA” — Aluminiumlegering “CBLT” — Kobalt “COPR” — Koper “IRON” — IJzererts

▼B

Basisproduct	Subproduct	Verder subproduct
		“LEAD” — Lood “MOLY” — Molybdeen “NASC” — NASAAC “NICK” — Nikkel “STEL” — Staal “TINN” — Tin “ZINC” — Zink “OTHR” — Overig
	“PRME” — Edel	“GOLD” — Goud “SLVR” — Zilver “PTNM” — Platina “PLDM” — Palladium “OTHR” — Overig
“MCEX” — Multi Commodity Exotic		
“PAPR” — Papier	“CBRD” — Golfkarton “NSPT” — Krantenpapier “PULP” — Pulp “RCVP” — Teruggewonnen papier “OTHR” — Overig	
“POLY” — Polypropeen	“PLST” — Plastic “OTHR” — Overig	
“INFL” — Inflatie		
“OEST” — Officiële economische statistieken		
“OTHC” — “Overige C10-derivaten” in de zin van tabel 10.1 van bijlage III bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/583 van de Commissie ([1])		
“OTHR” — Overig		

([1]) Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/583 van de Commissie van 14 juli 2016 tot aanvulling van Verordening (EU) nr. 600/2014 van het Europees Parlement en de Raad betreffende markten in financiële instrumenten wat betreft technische reguleringsnormen inzake transparantievereisten voor handelsplatforms en beleggingsondernemingen ten aanzien van obligaties, gestructureerde financiële producten, emissierechten en derivaten (PB L 87 van 31.3.2017, blz. 229).