KOMISSION TÄYTÄNTÖÖNPANOASETUS (EU) 2017/105,

annettu 19 päivänä lokakuuta 2016,

kauppatietorekistereihin OTC-johdannaisista, keskusvastapuolista ja kauppatietorekistereistä annetun Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 648/2012 mukaisesti annettavien kauppailmoitusten muotoa ja antamistiheyttä koskevista teknisistä täytäntöönpanostandardeista annetun täytäntöönpanoasetuksen (EU) N:o 1247/2012 muuttamisesta

(ETA:n kannalta merkityksellinen teksti)

EUROOPAN KOMISSIO, joka

ottaa huomioon Euroopan unionin toiminnasta tehdyn sopimuksen,

ottaa huomioon OTC-johdannaisista, keskusvastapuolista ja kauppatietorekistereistä 4 päivänä heinäkuuta 2012 annetun Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 648/2012 ([1]) ja erityisesti sen 9 artiklan 6 kohdan,

sekä katsoo seuraavaa:

(1) Komission täytäntöönpanoasetuksessa (EU) N:o 1247/2012 ([2]) säädetään väliaikaisten yhteisötunnusten käytöstä, jos oikeushenkilötunnus ei ole käytettävissä. Viime aikoina on tullut saataville infrastruktuuria, jonka avulla yhteisöille voidaan myöntää oikeushenkilötunnukset, ja markkinatoimijat ovat tutustuneet tällaisten oikeushenkilötunnusten käyttöön. Näin ollen oikeushenkilötunnusten pitäisi nyt olla ainoa tapa, jolla oikeushenkilöiden yksilöiminen sallitaan.

(2) Sen määrittäminen, onko raportoiva vastapuoli sopimuksessa ostaja vai myyjä, on erityisen monimutkaista swap-johdannaissopimusten tapauksessa, sillä kyseisiin sopimuksiin liittyy rahoitusvälineiden vaihtoa osapuolten välillä. Sen vuoksi olisi vahvistettava erityissäännöt sen varmistamiseksi, että swap-johdannaissopimusten osalta voidaan tarkasti ja johdonmukaisesti määrittää, ketkä ovat ostajia ja ketkä myyjiä.

(3) Vastapuolten todellisten vastuiden määrittämiseksi toimivaltaiset viranomaiset tarvitsevat täydelliset ja tarkat tiedot kyseisten vastapuolten välillä vaihdetuista vakuuksista. Tämän vuoksi olisi määritettävä erityiset säännöt, joilla varmistetaan yhdenmukainen lähestymistapa tietyn johdannaissopimuksen tai salkun osalta annetun vakuuden asettamista koskevassa raportoinnissa.

(4) Johdannaisten tarkka luokitus ja täsmällinen yksilöinti on olennaisen tärkeää tietojen tehokkaan käytön kannalta ja tietojen yhdistämiseksi mielekkäästi eri kauppatietorekistereihin, ja sen avulla voidaan näin ollen osaltaan edistää finanssimarkkinoiden vakauden valvontaryhmän tavoitteita, jotka on esitetty 19 päivänä syyskuuta 2014 julkaistussa OTC-johdannaisia koskevien tietojen yhdistämistä kauppatietorekistereihin koskevassa toteutettavuustutkimuksessa (Feasibility Study on Aggregation of OTC Derivatives Trade Repository Data) ([3]). Johdannaisten luokittelua ja yksilöintiä koskevia raportointivaatimuksia olisi tämän vuoksi muutettava siten, että tiedot ovat kokonaisuudessaan toimivaltaisten viranomaisten saatavilla.

(5) Jotta voidaan ilmoittaa sellaiset uudet johdannaissopimustyypit, joita on tullut saataville ja joilla käydään finanssialan innovoinnin ansiosta säännöllisesti kauppaa, swaptiot ja spread bet -sopimukset olisi lisättävä johdannaissopimusten lajien luetteloon. Yleisesti ottaen, kun otetaan huomioon, että finanssialan innovointi synnyttää jatkuvasti uudentyyppisiä johdannaissopimuksia, on tärkeää varmistaa, että kaikki uudentyyppiset johdannaissopimukset, jotka eivät kuulu olemassa oleviin luokkiin, voidaan kuitenkin ilmoittaa. Sen vuoksi on aiheellista säilyttää luokka ”muu” johdannaissopimusten tyyppien luokittelussa.

(6) Jos kaksi vastapuolta ei pysty sopimaan, kumman niistä pitäisi antaa yksilöllinen kauppatunnus raportoinnille säädetyn määräajan kuluessa, saattaa olla mahdotonta tunnistaa asianmukaisesti ja yhdistää toisiinsa samaan transaktioon liittyvät kaksi ilmoitusta. Sen vuoksi on tarpeen vahvistaa perusteet yksilöllisten kauppatunnusten antamista varten, jotta vältettäisiin laskemasta sama liiketoimi kahteen kertaan.

([1]) EUVL L 201, 27.7.2012, s. 1.

([2]) Komission täytäntöönpanoasetus (EU) N:o 1247/2012, annettu 19 päivänä joulukuuta 2012, kauppatietorekistereihin OTC-johdannaisista, keskusvastapuolista ja kauppatietorekistereistä annetun Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 648/2012 mukaisesti annettavien kauppailmoitusten muotoa ja antamistiheyttä koskevista teknisistä täytäntöönpanostandardeista (EUVL L 352, 21.12.2012, s. 20).

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

(7) Vastapuolilla voi olla merkittäviä vaikeuksia saada kaikki merkitykselliset tiedot kaupoista, jotka päättyivät ennen raportoinnin alkamispäivää. Koska päättyneiden kauppojen ilmoittaminen on näin ollen monimutkaista ja koska tällaiset kaupat eivät lisää järjestelmäriskiä, päättyneiden kauppojen raportoinnin määräaikaa olisi pidennettävä kolmesta vuodesta viiteen vuoteen raportoinnin alkamispäivästä.

(8) Jotta varmistetaan kauppatietorekistereihin ilmoitettujen tietojen täydellinen yhdenmukaistaminen ja mahdollistetaan siten näiden tietojen yhdenmukainen tulkinta ja yhdistäminen, olisi selkeytettävä kauppailmoituksia koskevia standardeja ja niiden muotoa. Lisäksi on aiheellista muuttaa tiedon muotoa koskevia raportointivaatimuksia. Vastapuolille ja kauppatietorekistereille olisi siksi annettava riittävästi aikaa toteuttaa kaikki tarvittavat toimet muutettujen vaatimusten noudattamiseksi.

(9) Sen vuoksi täytäntöönpanoasetusta (EU) N:o 1247/2012 olisi muutettava.

(10) Tämä asetus perustuu teknisten täytäntöönpanostandardien luonnoksiin, jotka Euroopan arvopaperimarkkinaviranomainen (EAMV) on toimittanut komissiolle.

(11) EAMV järjesti Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 1095/2010 ([1]) 15 artiklan mukaisesti avoimia julkisia kuulemisia tällaisista teknisten täytäntöönpanostandardien luonnoksista, analysoi mahdollisia asiaan liittyviä kustannuksia ja hyötyjä sekä pyysi lausunnon mainitun asetuksen 37 artiklalla perustetulta EAMV:n arvopaperimarkkina-alan osallisryhmältä,

ON HYVÄKSYNYT TÄMÄN ASETUKSEN:

1 artikla

Muutetaan täytäntöönpanoasetus (EU) N:o 1247/2012 seuraavasti:

1) Korvataan 3 artikla seuraavasti:

”3 artikla

Vastapuolten ja muiden yhteisöjen tunnistetiedot

Ilmoituksessa on käytettävä oikeushenkilötunnusta (Legal Entity Identifier, LEI), jolla voidaan yksilöidä seuraavat:

a) edunsaaja, joka on oikeushenkilö;

b) välittäjänä toimiva yhteisö;

c) keskusvastapuoli;

d) määritysosapuoli;

e) vastapuoli, joka on oikeushenkilö;

f) ilmoituksen tekevä yhteisö.”

2) Lisätään 3 a ja 3 b artikla seuraavasti:

”3 a artikla

Vastapuolen rooli

1. Liitteessä olevan taulukon 1 kentässä 14 tarkoitettu johdannaissopimuksen vastapuoli määritetään 2–10 kohdan mukaisesti.

2. Jos on kyse optioista ja swaptioista, vastapuoli, jolla on oikeus toteuttaa optio, katsotaan ostajaksi ja vastapuoli, joka myy option ja saa preemion, katsotaan myyjäksi.

([1]) Euroopan parlamentin ja neuvoston asetus (EU) N:o 1095/2010, annettu 24 päivänä marraskuuta 2010, Euroopan valvontaviranomaisen (Euroopan arvopaperimarkkinaviranomainen) perustamisesta sekä päätöksen N:o 716/2009/EY muuttamisesta ja komission päätöksen 2009/77/EY kumoamisesta (EUVL L 331, 15.12.2010, s. 84).

3. Jos on kyse futuureista ja termiineistä, jotka eivät liity valuuttoihin, rahoitusvälineen ostava vastapuoli katsotaan ostajaksi ja rahoitusvälineen myyvä vastapuoli katsotaan myyjäksi.

4. Jos on kyse arvopapereihin liittyvistä swapeista, vastapuoli, joka kantaa kohde-etuutena olevan arvopaperin hinnanmuutokseen liittyvän riskin ja saa arvopaperiin sisältyvän määrän, katsotaan ostajaksi ja vastapuoli, joka maksaa arvopaperiin sisältyvän määrän, katsotaan myyjäksi.

5. Jos on kyse korkoihin tai inflaatioindekseihin liittyvistä swapeista, vastapuoli, joka maksaa kiinteän koron, katsotaan ostajaksi ja vastapuoli, joka saa kiinteän koron, katsotaan myyjäksi. Jos on kyse vaihtuvasta vaihtuvaksi koroksi -swapeista, vastapuoli, joka maksaa spreadin, katsotaan ostajaksi ja vastapuoli, joka saa spreadin, katsotaan myyjäksi.

6. Jos on kyse koron- ja valuutanvaihtosopimuksista sekä valuuttoihin liittyvistä swapeista ja termiineistä, vastapuoli, joka saa valuutan, jonka Kansainvälisen standardisoimisjärjestön ISO 4217 -koodi on ensimmäisenä aakkosjärjestyksessä, katsotaan ostajaksi ja vastapuoli, joka toimittaa kyseisen valuutan, katsotaan myyjäksi.

7. Jos on kyse osinkoihin liittyvistä swapeista, vastapuoli, joka saa vastaavat tosiasialliset osingonjaot, katsotaan ostajaksi ja vastapuoli, joka maksaa osingon ja saa kiinteän koron, katsotaan myyjäksi.

8. Jos on kyse luottoriskin siirtoon tarkoitetuista johdannaissopimuksista, optioita ja swaptioita lukuun ottamatta, suojan ostava vastapuoli katsotaan ostajaksi ja suojan myyvä vastapuoli katsotaan myyjäksi.

9. Jos on kyse hyödykkeisiin liittyvästä johdannaissopimuksesta, vastapuoli, joka saa ilmoitetun hyödykkeen, katsotaan ostajaksi ja vastapuoli, joka toimittaa kyseisen hyödykkeen, katsotaan myyjäksi.

10. Jos on kyse korkotermiinisopimuksista, vastapuoli, joka maksaa kiinteän koron, katsotaan ostajaksi ja vastapuoli, joka saa kiinteän koron, katsotaan myyjäksi.

3 b artikla

Vakuuden asettaminen

1. Raportoiva vastapuoli yksilöi liitteessä olevan taulukon 1 kentässä 21 tarkoitetun johdannaissopimuksen vakuuden asettamisen tyypin 2–5 kohdan mukaisesti.

2. Jos vastapuolten välillä ei ole tehty vakuussopimusta tai jos vastapuolten välillä tehdyssä vakuussopimuksessa määrätään, että raportoiva vastapuoli ei aseta alkuvakuutta eikä myöskään vaihtuvaa vakuutta johdannaissopimukselle, johdannaissopimuksen vakuuden asettamisen tyypiksi katsotaan vakuudeton.

3. Jos vastapuolten välillä tehdyssä vakuussopimuksessa määrätään, että raportoiva vastapuoli asettaa säännöllisesti ainoastaan vaihtuvat vakuudet johdannaissopimukselle, johdannaissopimuksen vakuuden asettamisen tyypiksi katsotaan osittaiset vakuudet.

4. Jos vastapuolten välillä tehdyssä vakuussopimuksessa määrätään, että raportoiva vastapuoli asettaa alkuvakuuden ja säännöllisesti vaihtuvat vakuudet ja että toinen vastapuoli asettaa joko ainoastaan vaihtuvat vakuudet tai ei aseta mitään vakuuksia johdannaissopimukselle, johdannaissopimuksen vakuuden asettamisen tyypiksi katsotaan yksisuuntaiset vakuudet.

5. Jos vastapuolten välillä tehdyssä vakuussopimuksessa määrätään, että kumpikin vastapuoli asettaa alkuvakuuden ja säännöllisesti vaihtuvat vakuudet johdannaissopimukselle, johdannaissopimuksen vakuuden asettamisen tyypiksi katsotaan täydet vakuudet.”

3) Korvataan 4 artikla seuraavasti:

"4 artikla

Johdannaisten erittely, tunnistetiedot ja luokittelu

1. Johdannainen on ilmoituksessa eriteltävä sopimustyypin ja omaisuuslajin pohjalta 2 ja 3 kohdan mukaisesti.

2. Johdannainen on eriteltävä liitteen taulukon 2 kentässä 1 johonkin seuraavista sopimustyypeistä:

a) hinnanerosopimus;

b) korkotermiini;

c) termiini;

d) futuuri;

e) optio;

f) spread bet -sopimus;

g) swap;

h) swaptio;

i) muu.

3. Johdannainen on eriteltävä liitteen taulukon 2 kentässä 2 johonkin seuraavista omaisuuslajeista:

a) hyödykkeet ja päästöoikeudet;

b) luotto;

c) valuutta;

d) oma pääoma;

e) korko.

4. Jos johdannaiset eivät kuulu mihinkään 3 kohdassa eriteltyihin omaisuuslajeihin, vastapuolten on mainittava ilmoituksessa johdannaista läheisimmin muistuttava omaisuuslaji. Kummankin vastapuolen on ilmoitettava sama omaisuuslaji.

5. Johdannainen on yksilöitävä liitteen taulukon 2 kentässä 6 käyttäen seuraavaa koodia, jos sellainen on saatavilla:

a) ISO 6166 -standardiin perustuva ISIN-koodi tai tapauksen mukaan vaihtoehtoinen tunnus (Alternative Instrument Identifier, AII) Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 600/2014 (*) 27 artiklan 3 kohdan mukaisesti annetun komission delegoidun säädöksen soveltamispäivään asti.

b) ISIN-koodi asetuksen (EU) N:o 600/2014 27 artiklan 3 kohdan mukaisesti annetun komission delegoidun säädöksen soveltamispäivästä alkaen.

Jos käytetään AII-koodia, on ilmoitettava täydellinen AII-koodi.

6. Edellä 5 kohdassa tarkoitettu täydellinen AII-koodi saadaan, kun liitetään yhteen seuraavat kuusi osatekijää:

a) ISO 10383 -standardin mukainen sen kauppapaikan, jossa johdannaisella käydään kauppaa, koodi (Market Identifier Code, MIC), joka muodostuu 4 aakkosnumeerisesta merkistä;

b) koodi, jonka kauppapaikka on antanut ja joka liittyy yksiselitteisesti tiettyyn kohde-etuutena olevaan rahoitusvälineeseen ja toimitustyyppiin ja muihin sopimuksen ominaispiirteisiin ja muodostuu enintään 12 aakkosnumeerisesta merkistä;

c) yksi merkki, jolla yksilöidään, onko väline optio vai futuuri: ”O”, jos on kyseessä optio, ja ”F”, jos on kyseessä futuuri;

d) yksi merkki, jolla yksilöidään, onko optio osto-optio vai myyntioptio: ”P”, jos on kyseessä osto-optio, ja ”C”, jos on kyseessä myyntioptio; jos väline on yksilöity futuuriksi c alakohdan mukaisesti, merkitään ”F”;

e) johdannaissopimuksen toteutuspäivä tai erääntymispäivä ISO 8601 -standardin mukaisessa muodossa VVVV-KK-PP;

f) option toteutushinta käyttäen enintään 19:ää numeroa: enintään viisi desimaalia ja ilman etu- ja loppunollia. Desimaalipistettä on käytettävä desimaalierottimena. Negatiiviset arvot eivät ole sallittuja. Jos rahoitusväline on futuuri, toteutushinta täydennetään nollalla.

7. Johdannainen on luokiteltava liitteen taulukon 2 kentässä 4 käyttäen ISO 10692 -standardin mukaista CFI-koodia (Classification of Financial Instruments) tuotteista, jotka on yksilöity ISO 6166 -standardin mukaisella ISIN-koodilla tai AII-koodilla.

8. Johdannaiset, joista ei ole saatavilla ISO 6166 -standardin mukaista ISIN-koodia tai AII-koodia, on luokiteltava nimetyn koodin avulla. Kyseisen koodin on oltava:

a) yksilöllinen;

b) neutraali;

c) luotettava;

d) peräisin avoimesta lähdekoodista;

e) skaalautuva;

f) helposti saatavilla;

g) saatavilla kohtuulliseen hintaan;

h) asianmukaisen hallinnointikehyksen alainen.

9. Siihen asti, kunnes EAMV on hyväksynyt 8 kohdassa tarkoitetun koodin, johdannaiset, joiden osalta ei ole saatavilla ISO 6166 -standardin mukaista ISIN-koodia tai AII-koodia, luokitellaan käyttäen ISO 10692 -standardin mukaista CFI-koodia.

(*) Euroopan parlamentin ja neuvoston asetus (EU) N:o 600/2014, annettu 15 päivänä toukokuuta 2014, rahoitusvälineiden markkinoista sekä asetuksen (EU) N:o 648/2012 muuttamisesta (EUVL L 173, 12.6.2014, s. 84).”

4) Lisätään 4 a ja 4 b artikla seuraavasti:

”4 a artikla

Yksilöllinen kauppatunnus

1. Ilmoitus on yksilöitävä joko EAMV:n hyväksymällä maailmanlaajuisella yksilöllisellä kauppatunnuksella tai, jos sellaista ei ole, vastapuolten sopimalla yksilöllisellä kauppatunnuksella.

2. Jos vastapuolet eivät pääse sopimukseen yhteisöstä, jonka olisi vastattava ilmoitukselle osoitettavan yksilöllisen kauppatunnuksen antamisesta, vastapuolten on määritettävä yksilöllisen kauppatunnuksen antamisesta vastaava yksikkö seuraavasti:

a) jos on kyse keskitetysti toteutetuista ja määritetyistä kaupoista, keskusvastapuolen on annettava määritysosapuolelle yksilöllinen kauppatunnus määrityshetkellä. Määritysosapuoli antaa toisen yksilöllisen kauppatunnuksen vastapuolelleen;

b) jos on kyse keskitetysti toteutetuista kaupoista, joita ei ole määritetty keskitetysti, kauppapaikka, jossa toteutus tapahtuu, antaa yksilöllisen kauppatunnuksen jäsenelleen;

c) jos on kyse keskitetysti vahvistetuista ja määritetyistä kaupoista, keskusvastapuolen on annettava määritysosapuolelle yksilöllinen kauppatunnus määrityshetkellä. Määritysosapuoli antaa toisen yksilöllisen kauppatunnuksen vastapuolelleen;

d) jos on kyse keskitetysti sähköisesti vahvistetuista kaupoista, joita ei ole määritetty keskitetysti, kaupanvahvistusjärjestelmä antaa yksilöllisen kauppatunnuksen vahvistamishetkellä;

e) kaikkiin muihin kuin a–d alakohdassa tarkoitettuihin kauppoihin sovelletaan seuraavaa:

i) jos finanssialalla toimivat vastapuolet käyvät kauppaa finanssialan ulkopuolisten vastapuolten kanssa, finanssialalla toimivien vastapuolten on annettava yksilöllinen kauppatunnus;

ii) jos finanssialan ulkopuoliset vastapuolet, jotka ylittävät määrityskynnysarvon, käyvät kauppaa sellaisten finanssialan ulkopuolisten vastapuolten kanssa, jotka alittavat määrityskynnysarvon, finanssialan ulkopuolisten vastapuolten, jotka ylittävät määrityskynnysarvon, on annettava yksilöllinen kauppatunnus;

iii) kaikissa muissa kuin i ja ii alakohdassa tarkoitetuissa kaupoissa myyjän on annettava yksilöllinen kauppatunnus.

3. Yksilöllisen kauppatunnuksen antavan vastapuolen on ilmoitettava kyseinen yksilöllinen kauppatunnus toiselle vastapuolelle ajoissa, jotta jälkimmäinen kykenee täyttämään raportointivelvollisuutensa.

4 b artikla

Toteuttamispaikka

Johdannaissopimuksen toteuttamispaikka on yksilöitävä liitteen taulukon 2 kentässä 15 seuraavasti:

a) asetuksen (EU) N:o 600/2014 27 artiklan 3 kohdan mukaisesti annetun komission delegoidun säädöksen soveltamispäivään asti:

i) unionin sisällä sijaitsevan toteuttamispaikan ollessa kyseessä käytetään ISO 10383 -standardin mukaista kauppapaikan koodia (Market Identifier Code, MIC), joka on julkaistu EAMV:n verkkosivustolla rekisterissä, joka on perustettu toimivaltaisten viranomaisten komission asetuksen (EY) N:o 1287/2006 (*) 13 artiklan 2 kohdan mukaisesti toimittamien tietojen pohjalta;

ii) unionin ulkopuolella sijaitsevan toteuttamispaikan ollessa kyseessä käytetään ISO 10383 -standardin mukaista MIC-koodia, joka sisältyy ISO:n ylläpitämään ja päivittämään MIC-koodien luetteloon ja joka on julkaistu ISO:n verkkosivustolla;

b) asetuksen (EU) N:o 600/2014 27 artiklan 3 kohdan mukaisesti annetun komission delegoidun säädöksen soveltamispäivästä alkaen ISO 10383 -standardin mukaista MIC-koodia.

(*) Komission asetus (EY) N:o 1287/2006, annettu 10 päivänä elokuuta 2006, Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivin 2004/39/EY täytäntöönpanosta tietojen kirjaamista koskevien sijoituspalveluyritysten velvoitteiden, liiketoimista ilmoittamisen, markkinoiden avoimuuden, rahoitusvälineiden kaupankäynnin kohteeksi ottamisen sekä direktiivissä määriteltyjen käsitteiden osalta (EUVL L 241, 2.9.2006, s. 1).”

5) Korvataan 5 artiklan 4 kohta seuraavasti:

”4. Seuraavat johdannaissopimukset, jotka eivät ole voimassa kyseisen johdannaislajin raportoinnin alkamispäivänä, on ilmoitettava kauppatietorekisteriin viiden vuoden kuluessa kyseisestä päivästä:

a) johdannaissopimukset, jotka tehtiin ennen 16 päivää elokuuta 2012 ja jotka ovat yhä voimassa 16 päivänä elokuuta 2012, tai

b) johdannaissopimukset, jotka tehtiin 16 päivänä elokuuta 2012 tai sen jälkeen.”

2) Korvataan liite tämän asetuksen liitteellä.

2 artikla

Tämä asetus tulee voimaan kahdentenakymmenentenä päivänä sen jälkeen, kun se on julkaistu *Euroopan unionin virallisessa lehdessä*.

Sitä sovelletaan 1 päivästä marraskuuta 2017 alkaen, paitsi 1 artiklan 5 kohtaa, jota sovelletaan voimaantulopäivästä.

Tämä asetus on kaikilta osiltaan velvoittava, ja sitä sovelletaan sellaisenaan kaikissa jäsenvaltioissa.

Tehty Brysselissä 19 päivänä lokakuuta 2016.

Komission puolesta

Puheenjohtaja

Jean-Claude JUNCKER

LIITE

"LIITE

Taulukko 1

Vastapuolen tiedot

	Kenttä	Muoto
	Sopimuspuolet	
1	Raportoinnin aikaleima	Päivämäärä ISO 8601 -muodossa ja koordinoituna yleisaikana (UTC) muodossa VVVV-KK-PPThh:mm:ssZ
2	Raportoivan vastapuolen tunnistetiedot	ISO 17442 -standardin mukainen oikeushenkilötunnus (Legal Entity Identifier, LEI), 20 aakkosnumeerisesta merkistä muodostuva koodi.
3	Toisen vastapuolen tunnistetietojen tyyppi	"LEI" ISO 17442 -standardin mukainen oikeushenkilötunnus (LEI). "CLC" asiakaskoodi.
4	Toisen vastapuolen tunnistetiedot	ISO 17442 -standardin mukainen oikeushenkilötunnus (LEI), 20 aakkosnumeerisesta merkistä muodostuva koodi. Asiakaskoodi (enintään 50 aakkosnumeerista merkkiä).
5	Toisen vastapuolen maa	ISO 3166 -standardin mukainen kaksimerkkinen maakoodi.
6	Raportoivan vastapuolen yrityssektori	Finanssialalla toimivien vastapuolten luokittelu: A = Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivin 2009/138/EY ([1]) mukaisesti toimiluvan saanut henkivakuutusyritys C = Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivin 2013/36/EU ([2]) mukaisesti toimiluvan saanut luottolaitos F = Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivin 2004/39/EY ([3]) mukaisesti toimiluvan saanut sijoituspalveluyritys I = Direktiivin 2009/138/EY mukaisesti toimiluvan saanut vakuutusyritys L = Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivin 2011/61/EU ([4]) mukaisesti toimiluvan saaneiden tai rekisteröityjen vaihtoehtoisten sijoitusrahastojen hoitajien hoitama vaihtoehtoinen sijoitusrahasto O = Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivin 2003/41/EY ([5]) 6 artiklan a alakohdassa tarkoitettu ammatillisia lisäeläkkeitä tarjoava laitos R = Direktiivin 2009/138/EY mukaisesti toimiluvan saanut jälleenvakuutusyritys U = Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivin 2009/65/EY ([6]) mukaisesti toimiluvan saanut yhteissijoitusyritys ja sen rahastoyhtiö Finanssialan ulkopuolisten vastapuolten luokittelu: Seuraavat luokat vastaavat Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksessa (EY) N:o 1893/2006 ([7]) esitetyn tilastollisen toimialaluokituksen (NACE) pääluokkia 1 = Maatalous, metsätalous ja kalatalous 2 = Kaivostoiminta ja louhinta 3 = Teollisuus 4 = Sähkö-, kaasu-, lämpö- ja ilmastointihuolto

	Kenttä	Muoto
		5 = Vesihuolto, viemäri- ja jätevesihuolto, jätehuolto ja muu ympäristön puhtaanapito 6 = Rakentaminen 7 = Tukku- ja vähittäiskauppa; moottoriajoneuvojen ja moottoripyörien korjaus 8 = Kuljetus ja varastointi 9 = Majoitus- ja ravitsemistoiminta 10 = Informaatio ja viestintä 11 = Rahoitus- ja vakuutustoiminta 12 = Kiinteistöalan toiminta 13 = Ammatillinen, tieteellinen ja tekninen toiminta 14 = Hallinto- ja tukipalvelutoiminta 15 = Julkinen hallinto ja maanpuolustus; pakollinen sosiaalivakuutus 16 = Koulutus 17 = Terveys- ja sosiaalipalvelut 18 = Taiteet, viihde ja virkistys 19 = Muu palvelutoiminta 20 = Kotitalouksien toiminta työnantajina; kotitalouksien eriyttämätön toiminta tavaroiden ja palvelujen tuottamiseksi omaan käyttöön 21 = Kansainvälisten organisaatioiden ja toimielinten toiminta Jos ilmoitetaan useampi kuin yksi toiminta, koodit luetellaan vastaavan toiminnan suhteellisen merkittävyyden mukaan ja erotetaan toisistaan merkillä ”-”. Kohta jätetään tyhjäksi, kun on kyse keskusvastapuolista ja muista asetuksen (EU) N:o 648/2012 1 artiklan 5 kohdassa tarkoitetuista vastapuolista.
7	Raportoivan vastapuolen luonne	F = finanssialalla toimiva vastapuoli N = finanssialan ulkopuolinen vastapuoli C = keskusvastapuoli O = muu
8	Välittäjän tunnistetiedot	ISO 17442 -standardin mukainen oikeushenkilötunnus (LEI), 20 aakkosnumeerisesta merkistä muodostuva koodi.
9	Raportoivan yhteisön tunnistetiedot	ISO 17442 -standardin mukainen oikeushenkilötunnus (LEI), 20 aakkosnumeerisesta merkistä muodostuva koodi.
10	Määritysosapuolen tunnistetiedot	ISO 17442 -standardin mukainen oikeushenkilötunnus (LEI), 20 aakkosnumeerisesta merkistä muodostuva koodi.
11	Edunsaajan tunnistetietojen tyyppi	”LEI” ISO 17442 -standardin mukainen oikeushenkilötunnus (LEI). ”CLC” asiakaskoodi.
12	Edunsaajan tunnistetiedot	ISO 17442 -standardin mukainen oikeushenkilötunnus (LEI), 20 aakkosnumeerisesta merkistä muodostuva koodi tai enintään 50 aakkosnumeerisesta merkistä muodostuva asiakaskoodi, jos asiakas ei ole kelpoinen saamaan oikeushenkilötunnusta.

	Kenttä	Muoto
13	Asema kaupankäynnissä	P = päämies A = edustaja
14	Vastapuolen rooli	B = ostaja S = myyjä Täytetään 3 a artiklan mukaisesti.
15	Liittyy liiketoimintaan tai rahoitustoimintaan suoraan	Y = kyllä N = ei
16	Määrityskynnysarvo	Y = ylittää kynnysarvon N = alittaa kynnysarvon
17	Sopimuksen arvo	Enintään 20 numeerista merkkiä, desimaalit mukaan lukien. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeroksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä. Jos on käytettävä miinusmerkkiä, sitä ei lasketa numeroksi.
18	Valuutta, jossa arvo ilmoitetaan	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.
19	Arvostuksen aikaleima	Päivämäärä ISO 8601 -muodossa yleisaikana (UTC) muodossa VVVV-KK-PPThh:mm:ssZ
20	Arvostuksen tyyppi	M = markkina-arvoon O = arvostusmallilla C = keskusvastapuolen arvostus.
21	Vakuuden asettaminen	U = ei vakuuksia PC = osittaiset vakuudet OC = yksisuuntaiset vakuudet FC = täydet vakuudet Täytetään 3 b artiklan mukaisesti.
22	Vakuussalkku	Y = kyllä N = ei
23	Vakuussalkun koodi	Enintään 52 aakkosnumeerista merkkiä, joista neljä erikoismerkkiä: ”. – _.” Erikoismerkkejä ei sallita koodin alussa eikä lopussa. Välilyönnit eivät ole sallittuja.
24	Asetettu alkuvakuus	Enintään 20 numeerista merkkiä, desimaalit mukaan lukien. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeroksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.
25	Asetetun alkuvakuuden valuutta	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.

	Kenttä	Muoto
26	Asetettu vaihtuva vakuus	Enintään 20 numeerista merkkiä, desimaalit mukaan lukien. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeroksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.
27	Asetetun vaihtuvan vakuuden valuutta	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.
28	Saatu alkuvakuus	Enintään 20 numeerista merkkiä, desimaalit mukaan lukien. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeroksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.
29	Saadun alkuvakuuden valuutta	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.
30	Saatu vaihtuva vakuus	Enintään 20 numeerista merkkiä, desimaalit mukaan lukien. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeroksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.
31	Saadun vaihtuvan vakuuden valuutta	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.
32	Asetetut ylimääräiset vakuudet	Enintään 20 numeerista merkkiä, desimaalit mukaan lukien. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeroksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.
33	Asetettujen ylimääräisten vakuuksien valuutta	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.
34	Saadut ylimääräiset vakuudet	Enintään 20 numeerista merkkiä, desimaalit mukaan lukien. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeroksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.
35	Saatujen ylimääräisten vakuuksien valuutta	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.

(1) Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivi 2009/138/EY, annettu 25 päivänä marraskuuta 2009, vakuutus- ja jälleenvakuutustoiminnan aloittamisesta ja harjoittamisesta (Solvenssi II) (EUVL L 335, 17.12.2009, s. 1).

(2) Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivi 2013/36/EU, annettu 26 päivänä kesäkuuta 2013, oikeudesta harjoittaa luottolaitostoimintaa ja luottolaitosten ja sijoituspalveluyritysten vakavaraisuusvalvonnasta, direktiivin 2002/87/EY muuttamisesta sekä direktiivien 2006/48/EY ja 2006/49/EY kumoamisesta (EUVL L 176, 27.6.2013, s. 338).

(3) Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivi 2004/39/EY, annettu 21 päivänä huhtikuuta 2004, rahoitusvälineiden markkinoista sekä neuvoston direktiivien 85/611/ETY ja 93/6/ETY ja Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivin 2000/12/EY muuttamisesta ja neuvoston direktiivin 93/22/ETY kumoamisesta (EUVL L 145, 30.4.2004, s. 1).

(4) Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivi 2011/61/EU, annettu 8 päivänä kesäkuuta 2011, vaihtoehtoisten sijoitusrahastojen hoitajista ja direktiivin 2003/41/EY ja 2009/65/EY sekä asetuksen (EY) N:o 1060/2009 ja (EU) N:o 1095/2010 muuttamisesta (EUVL L 174, 1.7.2011, s. 1).

(5) Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivi 2003/41/EY, annettu 3 päivänä kesäkuuta 2003, ammatillisia lisäeläkkeitä tarjoavien laitosten toiminnasta ja valvonnasta (EUVL L 235, 23.9.2003, s. 10).

(6) Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivi 2009/65/EY, annettu 13 päivänä heinäkuuta 2009, siirtokelpoisiin arvopapereihin kohdistuvaa yhteistä sijoitustoimintaa harjoittavia yrityksiä (yhteissijoitusyritykset) koskevien lakien, asetusten ja hallinnollisten määräysten yhteensovittamisesta (EUVL L 302, 17.11.2009, s. 32).

(7) Euroopan parlamentin ja neuvoston asetus (EY) N:o 1893/2006, annettu 20 päivänä joulukuuta 2006, tilastollisen toimialaluokituksen NACE Rev. 2 vahvistamisesta sekä neuvoston asetuksen (ETY) N:o 3037/90 ja tiettyjen eri tilastoaloja koskevien yhteisön asetusten muuttamisesta (EUVL L 393, 30.12.2006, s. 1).

Taulukko 2

Yhteiset tiedot

	Kenttä	Muoto	Sovellettavat johdannaissopimukset
	Jakso 2a – Sopimustyyppi		**Kaikki sopimukset**
1	Sopimustyyppi	CD = hinnanerosopimukset FR = korkotermiinit FU = futuurit FW = termiinit OP = optiot Sb = spread bet -sopimukset SW = swapit ST = swaptiot OT = muu	
2	Omaisuuslaji	CO = hyödykkeet ja päästöoikeudet CR = luotto CU = valuutta EQ = oma pääoma IR = korko	
	Jakso 2b – Sopimuksen tiedot		**Kaikki sopimukset**
3	Tuotteen luokituksen tyyppi	C = CFI U = UPI	
4	Tuotteen luokitus	ISO 10692 -standardin mukainen kuusikirjaiminen CFI-koodi. Hyväksytty UPI.	
5	Tuotteen tunnistetietojen tyyppi	Täsmennetään käytettävä tunniste: I = ISIN A = AII.	
6	Tuotteen tunnistetiedot	Tyyppiä I olevat tuotteen tunnisteet: ISO 6166 -standardin mukainen 12 merkkiä käsittävä aakkosnumeerinen koodi. Tyyppiä A olevat tuotteen tunnisteet: Täydellinen AII-koodi 4 artiklan 8 kohdan mukaisesti.	

	Kenttä	Muoto	Sovellettavat johdannaissopimukset
7	Kohde-etuuden tunnistetietojen tyyppi	I = ISIN A = AII U = UPI B = kori X = indeksi	
8	Kohde-etuuden tunnistetiedot	Tyyppiä I olevat kohde-etuuden tunnisteet: ISO 6166 -standardin mukainen 12 merkkiä käsittävä aakkosnumeerinen koodi. Tyyppiä A olevat kohde-etuuden tunnisteet: täydellinen AII-koodi 4 artiklan 8 kohdan mukaisesti. Tyyppiä U olevat kohde-etuuden tunnisteet: UPI. Tyyppiä B olevat kohde-etuuden tunnisteet: kaikkien yksittäisten osien osalta ISO 6166 -standardin mukainen ISIN-koodi tai AII-koodi 4 artiklan 8 kohdan mukaisesti. Yksittäisten osien tunnisteet erotetaan toisistaan merkillä ”-”. Tyyppiä X olevat kohde-etuuden tunnisteet: ISO 6166 -standardin mukainen ISIN-koodi, jos saatavilla, muussa tapauksessa indeksin tarjoajan osoittama indeksin koko nimi.	
9	Nimellisvaluutta 1	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.	
10	Nimellisvaluutta 2	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.	
11	Toteutusvaluutta	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.	
	Jakso 2c – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta		**Kaikki sopimukset**
12	Kaupan tunnistetiedot	Kunnes maailmanlaajuinen yksilöllinen kauppatunnus UTI on käytettävissä, enintään 52 aakkosnumeerista merkkiä, joista neljä erikoismerkkiä: ”. – _.” Erikoismerkkejä ei sallita koodin alussa eikä lopussa. Välilyönnit eivät ole sallittuja.	
13	Ilmoituksen seurantanumero	Aakkosnumeerinen kenttä, jossa enintään 52 merkkiä.	
14	Monimutkaisen kaupan osatekijöiden tunniste	Aakkosnumeerinen kenttä, jossa enintään 35 merkkiä.	
15	Toteuttamispaikka	ISO 10383 -standardin mukainen kauppapaikan koodi (Market Identifier Code, MIC), 4 aakkosnumeerista merkkiä, 4 b artiklan mukaisesti.	

	Kenttä	Muoto	Sovellettavat johdannaissopimukset
16	Tiivistäminen	Y = sopimus on tiivistämisen tulosta N = sopimus ei ole tiivistämisen tulosta.	
17	Hinta/kurssi	Enintään 20 numeerista merkkiä, desimaalit mukaan lukien. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeroksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä. Jos on käytettävä miinusmerkkiä, sitä ei lasketa numeroksi. Jos hinta ilmoitetaan prosenttiarvoina, se olisi ilmaistava siten, että 100 % on ”100”.	
18	Hinnan merkintätapa	U = yksikköä P = prosenttia Y = tuotto	
19	Hinnan valuutta	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.	
20	Nimellismäärä	Enintään 20 numeerista merkkiä, desimaalit mukaan lukien. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeroksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä. Jos on käytettävä miinusmerkkiä, sitä ei lasketa numeroksi.	
21	Hintakerroin	Enintään 20 numeerista merkkiä, desimaalit mukaan lukien. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeroksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.	
22	Määrä	Enintään 20 numeerista merkkiä, desimaalit mukaan lukien. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeroksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.	
23	Ennakkomaksu	Enintään 20 numeerista merkkiä, desimaalit mukaan lukien. Miinusmerkkiä käytetään osoittamaan, että maksu on suoritettu, ei saatu. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeroksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä. Jos on käytettävä miinusmerkkiä, sitä ei lasketa numeroksi.	

	Kenttä	Muoto	Sovellettavat johdannaissopimukset
24	Toimitustapa	C = käteinen P = fyysinen O = vastapuolen valittavissa tai kolmannen osapuolen päättämä.	
25	Toteutuksen aikaleima	Päivämäärä ISO 8601 -muodossa yleisaikana (UTC) muodossa VVVV-KK-PPThh:mm:ssZ	
26	Voimaantulopäivä	Päivämäärä ISO 8601 -muodossa (VVVV-KK-PP).	
27	Erääntymispäivä	Päivämäärä ISO 8601 -muodossa (VVVV-KK-PP).	
28	Päättymispäivä	Päivämäärä ISO 8601 -muodossa (VVVV-KK-PP).	
29	Toimituspäivä	Päivämäärä ISO 8601 -muodossa (VVVV-KK-PP).	
30	Vakiosopimuksen tyyppi	Vapaa tekstikenttä (enintään 50 merkkiä), jossa mainitaan mahdollisen vakiosopimuksen (Master Agreement) nimi.	
31	Vakiosopimuksen versio	Päivämäärä ISO 8601 -muodossa (VVVV).	
	Jakso 2d – Riskin vähentäminen / raportointi		**Kaikki sopimukset**
32	Vahvistamisen aikaleima	Päivämäärä ISO 8601 -muodossa yleisaikana (UTC) muodossa VVVV-KK-PPThh:mm:ssZ	
33	Vahvistamiskeino	Y = vahvistettu muuten kuin sähköisesti N = ei vahvistettu E = vahvistettu sähköisesti.	
	Jakso 2e – Määritys		**Kaikki sopimukset**
34	Määritys-velvollisuus	Y = kyllä N = ei	
35	Määritetty	Y = kyllä N = ei	
36	Määrityksen aikaleima	Päivämäärä ISO 8601 -muodossa yleisaikana (UTC) muodossa VVVV-KK-PPThh:mm:ssZ	
37	Keskusvastapuoli	ISO 17442 -standardin mukainen oikeushenkilötunnus (LEI), 20 aakkosnumeerisesta merkistä muodostuva koodi.	

	Kenttä	Muoto	Sovellettavat johdannaissopimukset
38	Konsernin sisäinen	Y = kyllä N = ei	
	Jakso 2f – Korot		**Korkojohdannaiset**
39	Ensimmäisen korkovirran kiinteä kurssi	Enintään 10 numeerista merkkiä, mukaan lukien desimaalit, ilmaistuna prosenttiosuutena siten, että 100 % on ”100”. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeroksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä. Jos on käytettävä miinusmerkkiä, sitä ei lasketa numeroksi.	
40	Toisen korkovirran kiinteä kurssi	Enintään 10 numeerista merkkiä, mukaan lukien desimaalit, ilmaistuna prosenttiosuutena siten, että 100 % on ”100”. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeroksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä. Jos on käytettävä miinusmerkkiä, sitä ei lasketa numeroksi.	
41	Ensimmäisen korkovirran kiinteän kurssin laskukäytäntö	Osoittaja/nimittäjä: niin osoittajana kuin nimittäjänä on numeroita tai ilmaisu ”todelliset päivät”, esim. 30/360 tai todelliset päivät/365.	
42	Toisen korkovirran kiinteän kurssin laskukäytäntö	Osoittaja/nimittäjä: niin osoittajana kuin nimittäjänä on numeroita tai ilmaisu ”todelliset päivät”, esim. 30/360 tai todelliset päivät/365.	
43	Ensimmäisen korkovirran kiinteän koron maksutiheys – aikajakso	Aikajakso kuvaa, kuinka usein vastapuolet suorittavat toisilleen maksuja. Käytössä on seuraavat lyhenteet: Y = vuosi M = kuukausi W = viikko D = päivä	

	Kenttä	Muoto	Sovellettavat johdannaissopimukset
44	Ensimmäisen korkovirran kiinteän koron maksutiheys – kerroin	Aikajakson kokonaislukukerroin, joka kuvaa, kuinka usein vastapuolet suorittavat toisilleen maksuja. Enintään 3 numeerista merkkiä.	
45	Toisen korkovirran kiinteän koron maksutiheys – aikajakso	Aikajakso kuvaa, kuinka usein vastapuolet suorittavat toisilleen maksuja. Käytössä on seuraavat lyhenteet: Y = vuosi M = kuukausi W = viikko D = päivä	
46	Toisen korkovirran kiinteän koron maksutiheys – kerroin	Aikajakson kokonaislukukerroin, joka kuvaa, kuinka usein vastapuolet suorittavat toisilleen maksuja. Enintään 3 numeerista merkkiä.	
47	Ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron maksutiheys – aikajakso	Aikajakso kuvaa, kuinka usein vastapuolet suorittavat toisilleen maksuja. Käytössä on seuraavat lyhenteet: Y = vuosi M = kuukausi W = viikko D = päivä	
48	Ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron maksutiheys – kerroin	Aikajakson kokonaislukukerroin, joka kuvaa, kuinka usein vastapuolet suorittavat toisilleen maksuja. Enintään 3 numeerista merkkiä.	
49	Toisen korkovirran vaihtuvan koron maksutiheys – aikajakso	Aikajakso kuvaa, kuinka usein vastapuolet suorittavat toisilleen maksuja. Käytössä on seuraavat lyhenteet: Y = vuosi M = kuukausi W = viikko D = päivä	
50	Toisen korkovirran vaihtuvan koron maksutiheys – kerroin	Aikajakson kokonaislukukerroin, joka kuvaa, kuinka usein vastapuolet suorittavat toisilleen maksuja. Enintään 3 numeerista merkkiä.	

	Kenttä	Muoto	Sovellettavat johdannaissopimukset
51	Ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron korkojakson muuttaminen – aikajakso	Aikajakso kuvaa, kuinka usein vastapuolet muuttavat vaihtuvaa korkoa. Käytössä on seuraavat lyhenteet: Y = vuosi M = kuukausi W = viikko D = päivä	
52	Ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron korkojakson muuttaminen – kerroin	Aikajakson kokonaislukukerroin, joka kuvaa, kuinka usein vastapuolet muuttavat vaihtuvaa korkoa. Enintään 3 numeerista merkkiä.	
53	Toisen korkovirran vaihtuvan koron korkojakson muuttaminen – aikajakso	Aikajakso kuvaa, kuinka usein vastapuolet muuttavat vaihtuvaa korkoa. Käytössä on seuraavat lyhenteet: Y = vuosi M = kuukausi W = viikko D = päivä	
54	Toisen korkovirran vaihtuvan koron korkojakson muuttaminen – kerroin	Aikajakson kokonaislukukerroin, joka kuvaa, kuinka usein vastapuolet muuttavat vaihtuvaa korkoa. Enintään 3 numeerista merkkiä.	
55	Ensimmäisen korkovirran vaihtuva kurssi	Vaihtuvan koron indeksin nimi ”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	

	Kenttä	Muoto	Sovellettavat johdannaissopimukset
		”CDOR” – CDOR ”CIBO” – CIBOR ”MOSP” – MOSPRIM ”NIBO” – NIBOR ”PRBO” – PRIBOR ”TLBO” – TELBOR ”WIBO” – WIBOR ”TREA” – Treasury ”SWAP” – SWAP ”FUSW” – Future SWAP tai enintään 25 aakkosnumeerista merkkiä, jos viitekorko ei sisälly edellä olevaan luetteloon.	
56	Ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron viitekausi – aikajakso	Viitekautta kuvaava aikajakso käyttäen seuraavia lyhenteitä: Y = vuosi M = kuukausi W = viikko D = päivä	
57	Ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron viitekausi – kerroin	Aikajakson kokonaislukukerroin, joka kuvaa viitekautta. Enintään 3 numeerista merkkiä.	
58	Toisen korkovirran vaihtuva kurssi	Vaihtuvan koron indeksin nimi ”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	

	Kenttä	Muoto	Sovellettavat johdannaissopimukset
		”NIBO” – NIBOR ”PRBO” – PRIBOR ”TLBO” – TELBOR ”WIBO” – WIBOR ”TREA” – Treasury ”SWAP” – SWAP ”FUSW” – Future SWAP tai enintään 25 aakkosnumeerista merkkiä, jos viitekorko ei sisälly edellä olevaan luetteloon.	
59	Toisen korkovirran vaihtuvan koron viitekausi – aikajakso	Viitekautta kuvaava aikajakso käyttäen seuraavia lyhenteitä: Y = vuosi M = kuukausi W = viikko D = päivä	
60	Toisen korkovirran vaihtuvan koron viitekausi – kerroin	Aikajakson kokonaislukukerroin, joka kuvaa viitekautta. Enintään 3 numeerista merkkiä.	
	Jakso 2 g – Valuutat		**Valuuttajohdannaiset**
61	Toimitusvaluutta 2	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.	
62	Valuuttakurssi 1	Enintään 10 numeerista merkkiä, desimaalit mukaan lukien. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeroksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä. Jos on käytettävä miinusmerkkiä, sitä ei lasketa numeroksi.	
63	Valuutan termiinikurssi	Enintään 10 numeerista merkkiä, desimaalit mukaan lukien. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeroksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä. Jos on käytettävä miinusmerkkiä, sitä ei lasketa numeroksi.	

	Kenttä	Muoto	Sovellettavat johdannaissopimukset
64	Valuuttapari	Kaksi ISO 4217 -standardin mukaista valuuttakoodia erotettuina toisistaan merkillä "/". Ensimmäisellä valuuttakodilla ilmoitetaan perusvaluutta ja toisella valuuttakoodilla hintavaluutta.	
	Jakso 2h – Hyödykkeet ja päästöoikeudet		**Hyödyke- ja päästöoikeusjohdannaiset**
	Yleistä		
65	Hyödykeperusta	AG = maatalous EN = energia FR = rahti ME = metallit IN = indeksi EV = ympäristö EX = eksoottinen OT = muu	
66	Hyödykkeen yksityiskohtaiset tiedot	Maatalous GO = viljat ja öljykasvit DA = maitotuotteet LI = kotieläimet FO = metsätalous SO = viljellyt tuotteet, muut kuin viljat ja öljykasvit (softs) SF = kalat ja äyriäiset OT = muu Energia OI = öljy NG = maakaasu CO = hiili EL = sähkö IE = energialajien välinen OT = muu Rahti DR = kuiva WT = nestemäinen OT = muu Metallit PR = jalometallit NP = muut kuin jalometallit Ympäristö WE = sää EM = päästöt OT = muu	

	Kenttä	Muoto	Sovellettavat johdannaissopimukset
	Energia		
67	Jakelupaikka tai -alue	EIC-koodi, 16 aakkosnumeerista merkkiä. Toistuva kenttä.	
68	Yhteenliitäntäpiste	EIC-koodi, 16 aakkosnumeerista merkkiä.	
69	Kuormitustyyppi	BL = peruskuormitus PL = huippukuormitus OP = huippukuormitusajan ulkopuolinen BH = tuntiperiodi SH = shaped (mukautettu) GD = kaasutoimituspäivä OT = muu	
	Kenttien 70–77 toistuva jakso		
70	Kuormituksen aikavälit	hh:mmZ	
71	Toimituksen alkamispäivä ja -aika	Päivämäärä ISO 8601 -muodossa yleisaikana (UTC) muodossa VVVV-KK-PPThh:mm:ssZ	
72	Toimituksen päättymispäivä ja -aika	Päivämäärä ISO 8601 -muodossa yleisaikana (UTC) muodossa VVVV-KK-PPThh:mm:ssZ	
73	Kesto	N = minuutti H = tunti D = päivä W = viikko M = kuukausi Q = neljännesvuosi S = kausi Y = vuotuinen O = muu	
74	Viikonpäivät	WD = arkipäivät WN = viikonloppu MO = maanantai TU = tiistai WE = keskiviikko TH = torstai FR = perjantai SA = lauantai SU = sunnuntai Useat toisistaan merkillä ”/” erotetut arvot ovat sallittuja	

	Kenttä	Muoto	Sovellettavat johdannaissopimukset
75	Toimitus-kapasiteetti	Enintään 20 numeerista merkkiä, desimaalit mukaan lukien. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeroksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä. Jos on käytettävä miinusmerkkiä, sitä ei lasketa numeroksi.	
76	Määräyksikkö	KW KWh/h KWh/d MW MWh/h MWh/d GW GWh/h GWh/d Therm/d KTherm/d MTherm/d cm/d mcm/d	
77	Hinta määräyksikköä kohden per aikaväli	Enintään 20 numeerista merkkiä, desimaalit mukaan lukien. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeroksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä. Jos on käytettävä miinusmerkkiä, sitä ei lasketa numeroksi.	
	Jakso 2i – Optiot		**Sopimukset, jotka sisältävät option**
78	Option tyyppi	P = osto-optio C = myyntioptio O = jollei voida määrittää, onko kyseessä osto- vai myyntioptio.	
79	Option toteutustapa	A = amerikkalainen B = bermudalainen E = eurooppalainen S = aasialainen Useampi kuin yksi arvo on sallittu.	

	Kenttä	Muoto	Sovellettavat johdannaissopimukset
80	Toteutushinta (korkokatto/ korko-pohja)	Enintään 20 numeerista merkkiä, desimaalit mukaan lukien. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeroksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä. Jos on käytettävä miinusmerkkiä, sitä ei lasketa numeroksi. Jos toteutushinta ilmoitetaan prosenttiarvoina, se olisi ilmaistava siten, että 100 % on ”100”.	
81	Toteutushinnan merkintätapa	U = yksikköä P = prosenttia Y = tuotto	
82	Kohde-etuuden erääntymispäivä	Päivämäärä ISO 8601 -muodossa (VVVV-KK-PP).	
	Jakso 2j – Luotto-johdannaiset		
83	Etuoikeusasema	SNDB = Parhaassa etuoikeusasemassa olevat velat, kuten etuoikeutettuihin saamisiin kuuluva vakuudeton velka (yritykset/rahoituslaitokset), ulkomaanvaluutassa oleva valtion velka (julkishallinto), SBOD = Etuoikeudeltaan huonompi velka, kuten huonommassa etuoikeusasemassa oleva velka tai Lower Tier 2 -velka (pankit) tai huonoimmassa etuoikeusasemassa oleva velka tai Upper Tier 2 -velka (pankit), OTHR = muu, kuten etuosakkeet tai ensisijainen pääoma (pankit) tai muut luottojohdannaiset.	
84	Riskikohde	ISO 3166 -standardin mukainen kaksimerkkinen maakoodi. tai ISO 3166–2 -standardin mukainen kaksimerkkinen maakoodi ja sen jälkeen merkki (”-”) ja enintään kolmesta aakkosnumeerisesta merkistä muodostuva maaryhmittelykoodi tai ISO 17442 -standardin mukainen oikeushenkilötunnus (LEI), 20 aakkosnumeerisesta merkistä muodostuva koodi.	
85	Maksutiheys	MNTH = kuukausittain QURT = neljännesvuosittain MIAN = puolivuosittain YEAR = vuosittain	
86	Laskentaperuste	Osoittaja/nimittäjä: niin osoittajana kuin nimittäjänä on numeroita tai ilmaisu ”todelliset päivät”, esim. 30/360 tai todelliset päivät/365.	

	Kenttä	Muoto	Sovellettavat johdannaissopimukset
87	Sarja	Kokonaislukukenttä, jossa enintään 5 merkkiä.	
88	Versio	Kokonaislukukenttä, jossa enintään 5 merkkiä.	
89	Indeksikerroin	Enintään 10 numeerista merkkiä, desimaalit mukaan lukien. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeroksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.	
90	Etuoikeusluokka	T = etuoikeusluokkiin jaettu U = etuoikeusluokkiin jakamaton	
91	Kiinnitystaso	Enintään 10 numeerista merkkiä, mukaan lukien desimaalit, ilmaistuna desimaalilukuna välillä 0–1. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeroksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.	
92	Irrottautumistaso	Enintään 10 numeerista merkkiä, mukaan lukien desimaalit, ilmaistuna desimaalilukuna välillä 0–1. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeroksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.	
	Jakso 2k – Sopimukseen tehdyt muutokset		
93	Toimen tyyppi	N = uusi M = muutos E = virhe C = ennenaikainen päättyminen R = korjaus Z = tiivistäminen V = arvostuksen saattaminen ajan tasalle P = position komponentti	
94	Taso	T = kauppa P = positio”	