KOMISSION TÄYTÄNTÖÖNPANOASETUS (EU) 2022/1860,

annettu 10 päivänä kesäkuuta 2022,

teknisistä täytäntöönpanostandardeista Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 648/2012 soveltamiseksi ilmoitettavia tietoja koskevien vaatimusten ja muotojen, ilmoitusten antamistiheyden sekä ilmoittamista koskevien menetelmien ja järjestelyjen osalta

(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 neljännen alakohdan,

sekä katsoo seuraavaa:

(1) 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 19 päivänä joulukuuta 2012 annettua komission täytäntöönpanoasetusta (EU) N:o 1247/2012 ([2]) on muutettu merkittävästi. Koska lisämuutoksia tarvitaan oikeudellisen kehyksen selkeyden ja johdonmukaisuuden parantamiseksi, mukaan lukien raportointivaatimukset muilla lainkäyttöalueilla, täytäntöönpanoasetus (EU) N:o 1247/2012 olisi kumottava ja korvattava tällä asetuksella.

(2) Johdannaisten vastapuolten kauppatietorekistereihin ilmoittamat tiedot olisi toimitettava yhdenmukaisessa muodossa, jotta helpotetaan tietojen keräämistä, yhdistämistä ja vertailua kauppatietorekisterien välillä. Sen vuoksi olisi säädettävä kunkin ilmoitettavan kentän muodosta, ja ilmoitukset olisi standardoitava viittaamalla laajalti rahoitusalalla käytettävään ISO-standardiin.

(3) Yhdestä ja samasta johdannaisesta voidaan antaa useita ilmoituksia, esimerkiksi jos kyseiseen johdannaiseen tehdään useita peräkkäisiä muutoksia. Sen varmistamiseksi, että kaikki johdannaiseen liittyvät ilmoitukset ja johdannainen kokonaisuutena ymmärretään oikein, ilmoitukset olisi tehtävä siinä kronologisessa järjestyksessä, jossa ilmoitetut tapahtumat ovat toteutuneet.

(4) Tiettyjen arvojen ja erityisesti sopimuksen arvostukseen sekä asetettuun tai vastaanotettuun marginaaliin liittyvien tietojen muutoksista ilmoittamisesta aiheutuvan rasitteen keventämiseksi nämä tiedot olisi ilmoitettava sellaisina kuin ne ovat kunkin päivän lopussa.

(5) Koska maailmanlaajuisten oikeushenkilötunnusten (LEI), järjestelmä on nyt kokonaisuudessaan pantu täytäntöön, johdannaisten vastapuolten tai raportoinnista vastaavan yhteisön olisi käytettävät ilmoituksessa mainitun oikeushenkilön yksilöimisessä ainoastaan sitä. Jotta LEI-järjestelmän käyttö olisi tehokasta, kyseisen vastapuolen tai raportoinnista vastaavan yhteisön olisi varmistettava, että sen LEI-tunnukseen liittyvät viitetiedot uusitaan hyväksytyn LEI-tunnuksen antajan (paikallisen toimintayksikön) ehtojen mukaisesti.

(6) Johdannaisen vastapuolen määrittäminen on monimutkaista tiettyjen tuotteiden osalta. Tämän vuoksi olisi vahvistettava johdannaisen suunnan määrittämistä koskevat erityiset säännöt sen varmistamiseksi, että nämä tiedot ilmoitetaan johdonmukaisesti ja täsmällisesti.

(7) 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 johdannaisen tai salkun osalta annetun vakuuden asettamista koskevassa raportoinnissa.

([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).

(8) Johdannaisten tarkka erittely ja luokitus sekä 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. Lisäksi maailmanlaajuisesti sovitun yksilöllisen tuotetunnuksen (UPI) käyttöönotto on olennaisen tärkeää, jotta johdannaisia koskevia tietoja voidaan yhdistää maailmanlaajuisella tasolla. Sen vuoksi olisi vahvistettava johdannaisten luokittelua ja tunnistamista koskevat raportointivaatimukset, jotta nämä tiedot olisivat kokonaisuudessaan toimivaltaisten viranomaisten saatavilla.

(9) Yksilöllisen kauppatunnuksen (UTI) ([3]) oikea-aikainen luominen ja antaminen on välttämätöntä, jotta molemmat vastapuolet voivat käyttää samaa UTI-tunnusta, jolloin varmistetaan, että samaa johdannaista koskevat kaksi ilmoitusta yksilöidään ja yhdistetään oikein. Sen vuoksi on tarpeen vahvistaa perusteet UTI-tunnuksen antamisesta vastaavan yhteisön määrittämiseksi, jotta vältettäisiin saman johdannaisen laskeminen kahteen kertaan. Tämän tavoitteen varmistamiseksi unionin ulkopuolisten vastapuolten kanssa tehtyjen johdannaisten osalta on lisäksi tärkeää yhdenmukaistaa nämä säännöt UTI-tunnusta koskevien maailmanlaajuisesti sovittujen ohjeiden kanssa.

(10) Se, että tietyn yhteisön LEI-tunnus muuttuu yritystapahtuman vuoksi, tai se, että oikeushenkilö saa LEI-tunnuksen, voi johtaa siihen, että on tarpeen päivittää huomattava määrä ilmoituksia ja erityisesti kaikki ilmoitukset, joissa tällainen yhteisö yksilöidään johdannaisen osapuoleksi. Tästä syystä olisi otettava käyttöön menettely, jolla varmistetaan, että kauppatietorekisterit voivat päivittää yhteisön tunnusta keskitetysti siten, että varmistetaan tehokas, vakaa ja oikea-aikainen prosessi.

(11) Viranomaiset eivät välttämättä ole tietoisia tietyistä valvottavien raportoivien yhteisöjen merkittävistä raportointiin liittyvistä ongelmista esimerkiksi silloin, kun tällaiset ongelmat eivät johda ilmoitusten hylkäämiseen tai täsmäytyksen epäonnistumiseen. Jotta voidaan varmistaa, että viranomaiset saavat tietää merkittävistä raportointiongelmista, raportoinnista vastaavien yhteisöjen olisi ilmoitettava toimivaltaisille viranomaisille asiaankuuluvista raportoinnin virheistä ja puutteista.

(12) Jos finanssialalla toimivalla vastapuolella on yksinomainen vastuu, myös oikeudellinen vastuu, OTC-johdannaissopimuksia koskevien tietojen ilmoittamisesta finanssialan ulkopuolisen vastapuolen puolesta asetuksen (EU) N:o 648/2012 9 artiklan 1 a kohdan mukaisesti, kyseisen finanssialalla toimivan vastapuolen olisi otettava käyttöön tarvittavat järjestelyt sen varmistamiseksi, että se voi täyttää tämän velvollisuuden asianmukaisesti ilman päällekkäisyyksiä johdannaisia koskevien tietojen ilmoittamisessa.

(13) Täsmäytyskatkot ovat selkeä osoitus ilmoitettavien tietojen laatuun liittyvistä mahdollisista ongelmista. Sen vuoksi vastapuolilla, raportoinnista vastaavilla yhteisöillä ja raportoivilla yhteisöillä olisi tapauksen mukaan oltava käytössään järjestelyt, joilla varmistetaan täsmäytysvirheiden korjaaminen.

(14) Sen varmistamiseksi, että viranomaiset voivat tehokkaasti täyttää erityisesti rahoitusvakauteen liittyvät tehtävänsä, niillä on oltava selkeä ja kattava kuva kaikista johdannaisista, joihin liittyy olemassa oleva riski. Ainoastaan yhdenmukaistetulla vaatimuksella, jonka mukaan kaikki voimassa olevat johdannaiset on saatettava ajan tasalle asianmukaisesti, voidaan estää erot voimassa oleviin johdannaisiin sovellettavien raportointivaatimusten täytäntöönpanossa ja siten vähentää riskiä siitä, että valvontakäytäntöjen lähentyminen vaarantuu. Lisäksi sen varmistaminen, että voimassa olevia johdannaisia koskevat ilmoitukset yhdenmukaistetaan tietojen sisällön ja laadun osalta, mahdollistaa raportoinnin yksinkertaistamisen, mikä vähentää pitkällä aikavälillä kaikille asiaankuuluville sidosryhmille, kuten kauppatietorekistereille, raportoiville yhteisöille ja viranomaisille, aiheutuvia kustannuksia. Jotta voidaan varmistaa ilmoittamisen toimivuuden parantaminen ja ilmoittamisesta johtuvan rasituksen keventäminen Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksella (EU) 2019/834 ([4]) asetukseen (EU) N:o 648/2012 tehtyjen muutosten tavoitteiden mukaisesti, on olennaisen tärkeää, että vastapuolet ilmoittavat täydelliset ja tarkat tiedot kaikista voimassa olevista johdannaisista tällä hetkellä sovellettavien vaatimusten

([3]) Asetuksen (EU) N:o 648/2012 9 artiklan 6 kohdassa käytetty käsite ”yksilöllinen kauppatunnus (UTI)” vastaa merkitykseltään ISO 23897 -standardissa käytettyä yksilöllisen tapahtumatunnuksen (UTI) käsitettä.

([4]) Euroopan parlamentin ja neuvoston asetus (EU) 2019/834, annettu 20 päivänä toukokuuta 2019, asetuksen (EU) N:o 648/2012 muuttamisesta määritysvelvollisuuden, määritysvelvollisuuden keskeyttämisen, raportointivaatimusten, sellaisten OTC-johdannaissopimusten riskienpienentämistekniikoiden, joille ei ole tehty keskusvastapuolimääritystä, kauppatietorekisterien rekisteröinnin ja valvonnan sekä kauppatietorekistereitä koskevien vaatimusten osalta (EUVL L 141, 28.5.2019, s. 42).

mukaisesti. Voimassa olevien johdannaisten päivittämiseen liittyvän alkuperäisen rasitteen keventämiseksi vastapuolille olisi myönnettävä lisäaikaa, jotta ne voivat päivittää voimassa olevia johdannaisia koskevat tiedot. Lisäksi vastapuolia olisi vaadittava toimittamaan tällainen päivitys ainoastaan, jos kyseisen ajan kuluessa ei tapahdu muutoksia, jotka edellyttäisivät vastapuolen ilmoittavan kyseistä muutosta koskevassa ilmoituksessa täydelliset ja tarkat tiedot johdannaisesta.

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

(16) ESMA on kuullut Euroopan keskuspankkijärjestelmän jäseniä ennen tämän asetuksen perustana olevien teknisten täytäntöönpanostandardien luonnosten toimittamista. ESMA on järjestänyt avoimia julkisia kuulemisia tämän asetuksen perustana olevista teknisten täytäntöönpanostandardien luonnoksista, analysoinut niihin mahdollisesti liittyviä kustannuksia ja hyötyjä sekä pyytänyt lausunnon Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 1095/2010 ([5]) 37 artiklan mukaisesti perustetulta arvopaperimarkkina-alan osallisryhmältä.

(17) Jotta vastapuolet ja kauppatietorekisterit voivat toteuttaa kaikki tarvittavat toimet mukautuakseen uusiin vaatimuksiin, tämän asetuksen soveltamispäivää olisi lykättävä 18 kuukaudella,

ON HYVÄKSYNYT TÄMÄN ASETUKSEN:

1 artikla

Johdannaisilmoitusten tietoja koskevat vaatimukset ja muodot

Asetuksen (EU) N:o 648/2012 9 artiklan mukaisesti ilmoitettavat johdannaissopimusta koskevat tiedot on toimitettava tämän asetuksen liitteessä olevissa taulukoissa 1, 2 ja 3 vahvistettuja vaatimuksia ja muotoja noudattaen sekä yhteisessä sähköisessä ja koneellisesti luettavassa muodossa ja yhteisessä XML-mallissa ISO 20022 -standardin menetelmien mukaisesti.

2 artikla

Ilmoitustiheys

1. Kaikki komission delegoidun asetuksen (EU) 2022/1855 ([6]) 1 artiklassa täsmennetyt johdannaistietoja koskevat ilmoitukset on toimitettava siinä aikajärjestyksessä, jossa ilmoitettaviin tietoihin liittyvät tapahtumat ovat toteutuneet.

2. Keskusvastapuolen, finanssialalla toimivan vastapuolen tai asetuksen (EU) N:o 648/2012 10 artiklassa tarkoitetun finanssialan ulkopuolisen vastapuolen, joka on johdannaisen vastapuoli, tai raportoinnista vastaavan yhteisön on ilmoitettava kaikki delegoidun asetuksen (EU) 2022/1855 liitteessä olevan taulukon 3 kenttien 1–29 vakuustietoihin liittyvien tietojen muutokset toimen tyypillä ”Marginaalin saattaminen ajan tasalle”, sellaisina kuin nämä tiedot ovat kunkin päivän lopussa kyseisen johdannaisen osalta, kun

a) johdannainen ei ole erääntynyt eikä siitä ole tehty ilmoitusta, jossa toimen tyyppinä on ”Päättyminen”, ”Virhe” tai ”Position komponentti” liitteessä olevan taulukon 2 kentän 151 mukaisesti; tai

b) johdannaisesta on tehty ilmoitus, jossa toimen tyyppi on ”Uudelleenavaaminen”, mutta sen jälkeen ei ole toimitettu toista ilmoitusta, jossa toimen tyyppi on ”Päättyminen” tai ”Virhe” liitteessä olevan taulukon 2 kentän 151 mukaisesti.

([5]) 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).

([6]) Komission delegoitu asetus (EU) 2022/1855, annettu 10 päivänä kesäkuuta 2022, Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 648/2012 täydentämisestä kauppatietorekistereihin ilmoitettavien tietojen vähimmäisyksityiskohtia ja käytettävien ilmoitusten tyyppiä koskevilla teknisillä sääntelystandardeilla (katso tämän virallisen lehden sivu 1).

3. Edellä 2 kohdan a ja b alakohdassa tarkoitetun johdannaisen sellaisen vastapuolen, joka on keskusvastapuoli, finanssialalla toimivan vastapuolen, asetuksen (EU) N:o 648/2012 10 artiklassa tarkoitetun finanssialan ulkopuolisen vastapuolen tai raportoinnista vastaavan yhteisön on ilmoitettava delegoidun asetuksen (EU) 2022/1855 liitteessä olevan taulukon 2 kentissä 21–25 sopimuksen päivän lopun markkinahintaan arvostus tai malliin perustuva arvostus toimen tyypillä ”Arvostuksen saattaminen ajan tasalle”, sellaisena kuin se on kunkin päivän lopussa.

3 artikla

Vastapuolten ja muiden yhteisöjen tunnistetiedot

1. Ilmoituksessa on käytettävä ISO 17442 -standardin mukaista oikeushenkilötunnusta (LEI), jolla yksilöidään

a) välittäjänä toimiva yhteisö;

b) keskusvastapuoli;

c) määritysosapuoli;

d) vastapuoli, joka on oikeushenkilö;

e) raportoiva yhteisö;

f) raportoinnista vastaava yhteisö;

g) kaupan jälkeisten riskinvähennyspalvelujen tarjoaja.

2. Delegoidun asetuksen (EU) 2022/1855 liitteessä olevan taulukon 1 kentässä 4 tarkoitetun johdannaisen vastapuolen 1 ja raportoinnista vastaavan yhteisön on varmistettava, että sen ISO 17442 -standardin mukaiseen LEI-tunnukseen liittyvät viitetiedot uusitaan maailmanlaajuisen LEI-järjestelmän jonkin hyväksytyn paikallisen toimintayksikön ehtojen mukaisesti, kun ilmoitetaan johdannaissopimuksen tekemisestä tai muuttamisesta asetuksen (EU) N:o 648/2012 9 artiklan mukaisesti.

4 artikla

Johdannaisen suunta

1. Liitteessä olevan taulukon 1 kentissä 17–19 tarkoitettu johdannaissopimuksen vastapuoli määritetään johdannaisen tekohetkellä 2–14 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.

3. Jos on kyse valuuttoihin liittyvistä termiineistä, vastapuoli 1 katsotaan joko maksajaksi tai vastaanottajaksi ensimmäisen korkovirran osalta ja päinvastaiseksi toisen korkovirran osalta. Vastapuoli 2 täyttää taulukon 1 kenttiin 18 ja 19 vastapuoleen 1 nähden vastakkaiset arvot.

4. Jos on kyse valuuttoihin liittyvistä swapeista, joissa tehdään useita valuutanvaihtoja, kukin vastapuoli katsotaan kaupan molempien korkovirtojen osalta joko korkovirran maksajaksi tai vastaanottajaksi lähimpänä voimassaolon päättymispäivää tapahtuvan valuutanvaihdon perusteella.

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

6. Jos on kyse hinnanerosopimuksista ja spread bet -sopimuksista, vastapuoli, joka myy sopimuksen lyhyeksi, katsotaan myyjäksi ja vastapuoli, joka myy sopimuksen pitkäksi, katsotaan ostajaksi.

7. Jos on kyse osinkoihin liittyvistä swapeista, vastapuoli, joka saa vastaavan osingonjaon määrän, katsotaan ostajaksi ja vastapuoli, joka maksaa vastaavan osingonjaon määrän, katsotaan myyjäksi.

8. Jos on kyse vakuuksiin liittyvistä swapeista, jotka eivät ole osinkoihin liittyviä swapeja, vastapuoli 1 katsotaan joko maksajaksi tai vastaanottajaksi ensimmäisen korkovirran osalta ja päinvastaiseksi toisen korkovirran osalta. Vastapuoli 2 täyttää taulukon 1 kenttiin 18 ja 19 vastapuoleen 1 nähden vastakkaiset arvot.

9. Jos on kyse korkoihin tai inflaatioindekseihin liittyvistä swapeista, mukaan lukien koron- ja valuutanvaihtosopimukset, vastapuoli 1 katsotaan joko maksajaksi tai vastaanottajaksi ensimmäisen korkovirran osalta ja päinvastaiseksi toisen korkovirran osalta. Vastapuoli 2 täyttää taulukon 1 kenttiin 18 ja 19 vastapuoleen 1 nähden vastakkaiset arvot.

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

11. Jos on kyse hyödykkeisiin liittyvistä swapeista, vastapuoli 1 katsotaan joko maksajaksi tai vastaanottajaksi ensimmäisen korkovirran osalta ja päinvastaiseksi toisen korkovirran osalta. Vastapuoli 2 täyttää taulukon 1 kenttiin 18 ja 19 vastapuoleen 1 nähden vastakkaiset arvot.

12. Jos on kyse korkotermiinisopimuksista, vastapuoli 1 katsotaan joko maksajaksi tai vastaanottajaksi ensimmäisen korkovirran osalta ja päinvastaiseksi toisen korkovirran osalta. Vastapuoli 2 täyttää taulukon 1 kenttiin 18 ja 19 vastapuoleen 1 nähden vastakkaiset arvot.

13. Jos on kyse varianssiin, volatiliteettiin ja korrelaatioon liittyvistä johdannaisista, kohde-etuuden hinnan noususta hyötyvä vastapuoli katsotaan ostajaksi ja kohde-etuuden hinnan laskusta hyötyvä vastapuoli katsotaan myyjäksi.

5 artikla

Vakuuden asettaminen

Raportoivan vastapuolen on yksilöitävä liitteessä olevan taulukon 3 kentässä 11 tarkoitettu johdannaissopimuksen tai -salkun vakuuden asettamisen tyyppi seuraavasti:

a) ”vakuudeton”, jos vastapuolten välillä ei ole tehty vakuussopimusta tai jos vastapuolten välillä tehdyssä vakuussopimuksessa määrätään, että vastapuolet eivät aseta alkumarginaalia eikä vaihtelumarginaalia johdannaiselle tai johdannaissalkulle;

b) ”osittaiset vakuudet: ainoastaan vastapuoli 1”, jos vastapuolten välillä tehdyssä vakuussopimuksessa määrätään, että raportoiva vastapuoli asettaa säännöllisesti ainoastaan vaihtelumarginaalit ja että toinen vastapuoli ei aseta mitään marginaaleja johdannaiselle tai johdannaissalkulle;

c) ”osittaiset vakuudet: ainoastaan vastapuoli 2”, jos vastapuolten välillä tehdyssä vakuussopimuksessa määrätään, että toinen vastapuoli asettaa säännöllisesti ainoastaan vaihtelumarginaalin ja että raportoiva vastapuoli ei aseta mitään marginaaleja johdannaiselle tai johdannaissalkulle;

d) ”osittaiset vakuudet”, jos vastapuolten välillä tehdyssä vakuussopimuksessa määrätään, että molemmat vastapuolet asettavat säännöllisesti ainoastaan vaihtelumarginaalin johdannaiselle tai johdannaissalkulle;

e) ”yksisuuntaiset vakuudet: ainoastaan vastapuoli 1”, jos vastapuolten välillä tehdyssä vakuussopimuksessa määrätään, että raportoiva vastapuoli asettaa alkumarginaalin ja säännöllisesti vaihtelumarginaalit ja että toinen vastapuoli ei aseta mitään marginaaleja johdannaiselle tai johdannaissalkulle;

f) ”yksisuuntaiset vakuudet: ainoastaan vastapuoli 2”, jos vastapuolten välillä tehdyssä vakuussopimuksessa määrätään, että toinen vastapuoli asettaa alkumarginaalin ja säännöllisesti vaihtelumarginaalit ja että raportoiva vastapuoli ei aseta mitään marginaaleja johdannaiselle tai johdannaissalkulle;

g) ”yksisuuntaiset tai osittaiset vakuudet: ainoastaan vastapuoli 1”, jos vastapuolten välillä tehdyssä vakuussopimuksessa määrätään, että raportoiva vastapuoli asettaa alkumarginaalin ja säännöllisesti vaihtelumarginaalin ja että toinen vastapuoli asettaa säännöllisesti ainoastaan vaihtelumarginaalin johdannaiselle tai johdannaissalkulle;

h) ”yksisuuntaiset tai osittaiset vakuudet: ainoastaan vastapuoli 2”, jos vastapuolten välillä tehdyssä vakuussopimuksessa määrätään, että toinen vastapuoli asettaa alkumarginaalin ja säännöllisesti vaihtelumarginaalin ja että raportoiva vastapuoli asettaa säännöllisesti ainoastaan vaihtelumarginaalin johdannaiselle tai johdannaissalkulle;

i) ”täydet vakuudet”, jos vastapuolten välillä tehdyssä vakuussopimuksessa määrätään, että molemmat vastapuolet asettavat alkumarginaalin ja säännöllisesti vaihtelumarginaalit johdannaiselle tai johdannaissalkulle.

6 artikla

Johdannaisten erittely, tunnistetiedot ja luokittelu

1. Ilmoituksessa on eriteltävä johdannaissopimus sopimustyypin ja omaisuuslajin perusteella liitteessä olevan taulukon 2 kenttien 10 ja 11 mukaisesti.

Ilmoituksessa on ilmoitettava johdannaista läheisimmin muistuttava omaisuuslaji, jos johdannaiset eivät kuulu mihinkään liitteessä olevan taulukon 2 kentässä 11 tarkoitetuista johdannaislajeista. Kummankin vastapuolen on ilmoitettava sama omaisuuslaji.

2. Johdannainen on yksilöitävä liitteessä olevan taulukon 2 kentässä 7 käyttäen ISO 6166 -standardin mukaista kansainvälistä arvopaperien tunnusnumeroa (ISIN) jommassakummassa seuraavista tapauksista:

a) johdannainen on otettu kaupankäynnin kohteeksi tai sillä käydään kauppaa markkinapaikassa;

b) johdannaisella käydään kauppaa kauppojen sisäisessä toteuttajassa ja sen kohde-etuus on otettu kaupankäynnin kohteeksi tai sillä käydään kauppaa markkinapaikassa tai se on indeksi tai kori, joka koostuu rahoitusvälineistä, joilla käydään kauppaa markkinapaikassa.

3. Muu kuin 2 kohdassa tarkoitettu johdannainen on yksilöitävä liitteessä olevan taulukon 2 kentässä 8 käyttäen ISO 4914 -standardin mukaista yksilöllistä tuotetunnistetta (UPI).

4. Raportoivan vastapuolen on luokiteltava johdannainen liitteessä olevan taulukon 2 kentässä 9 käyttäen ISO 10962 -standardin mukaista CFI-koodia (Classification of Financial Instruments).

7 artikla

Yksilöllinen kauppatunnus

1. Vastapuolten on ilmoitettava johdannaisista käyttäen 2, 3 ja 5 kohdan mukaisesti annettua UTI-tunnusta.

2. Johdannainen, josta ilmoitetaan joko transaktion tai position tasolla, on yksilöitävä käyttäen liitteessä olevan taulukon 2 kentässä 1 olevaa ISO 23897 -standardin mukaista yksilöllistä tapahtumatunnusta (UTI). UTI-tunnus koostuu sen yhteisön LEI-tunnuksesta, joka on antanut kyseisen UTI-tunnuksen, jota seuraa enintään 32 merkkiä sisältävä koodi, joka on tunnuksen antavan yhteisön tasolla yksilöllinen.

3. Vastapuolten on määritettävä UTI-tunnuksen antamisesta vastaava yhteisö seuraavasti:

a) jos on kyse muista määritetyistä johdannaisista kuin kahden keskusvastapuolen välisistä johdannaisista, keskusvastapuolen on annettava UTI-tunnus määritysosapuolelle määrityshetkellä. Määritysosapuolen on annettava vastapuolelleen toinen UTI-tunnus sellaista kauppaa varten, jossa keskusvastapuoli ei ole vastapuoli;

b) jos on kyse keskitetysti toteutetuista johdannaisista, joita ei ole määritetty keskitetysti, paikan, jossa toteutus tapahtuu, on annettava UTI-tunnus jäsenelleen;

c) jos on kyse muista kuin a ja b alakohdassa tarkoitetuista johdannaisista, ja jompaankumpaan vastapuoleen sovelletaan raportointivaatimuksia kolmannessa maassa, UTI-tunnus on annettava sen vastapuolen lainkäyttöalueen sääntöjen mukaisesti, jonka on ensin noudatettava kyseisiä raportointivaatimuksia.

Jos vastapuolen, johon sovelletaan asetuksen (EU) N:o 648/2012 9 artiklan mukaista raportointia, on ensin noudatettava raportointivaatimuksia, UTI-tunnuksen antamisesta vastaavan yhteisön on oltava seuraava:

i) kaupanvahvistusjärjestelmä vahvistamishetkellä, jos on kyse sellaisista johdannaisista, jotka on vahvistettu keskitetysti sähköisellä menetelmällä;

ii) vastapuolten on sovittava UTI-tunnuksen antamisesta vastaavasta yhteisöstä, jos on kyse mistä tahansa muista johdannaisista. Jos vastapuolet eivät pääse sopimukseen, vastapuoli, jonka LEI-tunnus on ensimmäisenä, kun vastapuolten tunnukset asetetaan peräkkäin siten, että tunnusten merkit ovat päinvastaisessa järjestyksessä, on vastuussa tunnuksen antamisesta.

Jos asianomaisen kolmannen maan sovellettavassa lainsäädännössä säädetään samasta raportoinnin määräajasta, jota sovelletaan vastapuoleen, johon sovelletaan asetuksen (EU) N:o 648/2012 9 artiklan mukaista raportointia, vastapuolten on asetuksen (EU) N:o 648/2012 9 artiklan 1 kohdan ensimmäisen alakohdan nojalla sovittava UTI-tunnuksen antamisesta vastaavasta yhteisöstä.

Jos vastapuolet eivät pääse sopimukseen ja johdannainen on vahvistettu keskitetysti sähköisesti menetelmällä, kaupanvahvistusjärjestelmän on annettava UTI-tunnus vahvistamishetkellä.

Jos kaupanvahvistusjärjestelmä ei voi antaa UTI-tunnusta vahvistamishetkellä ja johdannaista koskevat tiedot on ilmoitettava yhteen kauppatietorekisteriin, kyseinen kauppatietorekisteri vastaa UTI-tunnuksen antamisesta.

Jos kauppatietorekisteri, johon johdannaista koskevat tiedot on ilmoitettu, ei voi antaa UTI-tunnusta, se vastapuoli, jonka LEI-tunnus on ensimmäisenä, kun vastapuolten tunnukset asetetaan peräkkäin siten, että tunnusten merkit ovat päinvastaisessa järjestyksessä, on vastuussa tunnuksen antamisesta;

d) jos kyse on muista kuin a, b ja c alakohdassa tarkoitetuista johdannaisista, jotka on vahvistettu keskitetysti sähköisellä menetelmällä, kaupanvahvistusjärjestelmän on annettava UTI-tunnus vahvistamishetkellä;

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

i) jos finanssialalla toimivat vastapuolet tekevät sopimuksen johdannaisesta finanssialan ulkopuolisten vastapuolten kanssa, finanssialalla toimivien vastapuolten on annettava UTI-tunnus;

ii) jos finanssialan ulkopuoliset vastapuolet, jotka ylittävät määrityskynnysarvon, tekevät johdannaissopimuksen sellaisten finanssialan ulkopuolisten vastapuolten kanssa, jotka alittavat määrityskynnysarvon, finanssialan ulkopuolisten vastapuolten, jotka ylittävät määrityskynnysarvon, on annettava UTI-tunnus;

iii) jos on kyse muista kuin i ja ii alakohdassa tarkoitetuista johdannaisista, vastapuolten on sovittava UTI-tunnuksen antamisesta vastaavasta yhteisöstä. Jos vastapuolet eivät pääse sopimukseen, vastapuoli, jonka LEI-tunnus on ensimmäisenä, kun vastapuolten tunnukset asetetaan peräkkäin siten, että tunnusten merkit ovat päinvastaisessa järjestyksessä, on vastuussa tunnuksen antamisesta.

4. UTI-tunnuksen antavan vastapuolen on ilmoitettava UTI-tunnus toiselle vastapuolelle hyvissä ajoin ja viimeistään johdannaisen tekopäivää seuraavana työpäivänä kello 10.00 aamupäivällä koordinoitua yleisaikaa.

5. Sen estämättä, mitä 3 kohdassa säädetään, UTI-tunnuksen antaminen voidaan siirtää muulle kuin 3 kohdan mukaisesti määritetylle yhteisölle. UTI-tunnuksen antavan yhteisön on täytettävä 2 ja 4 kohdassa säädetyt vaatimukset.

8 artikla

LEI-tunnuksen muutoksista ilmoittaminen ja yksilöintitunnuksen päivittäminen LEI-tunnukseksi

1. Jos johdannaisilmoituksessa 3 artiklan mukaisesti yksilöity vastapuoli joutuu yrityksen uudelleenjärjestelyn kohteeksi, minkä seurauksena sen LEI-tunnus muuttuu, kyseisen vastapuolen, sen vastapuolen, jota uusi LEI-tunnus koskee, yhteisön, joka vastaa raportoinnista jommankumman vastapuolen puolesta asetuksen (EU) N:o 648/2012 9 artiklan 1 a–d kohdan mukaisesti, tai yhteisön, jolle jompikumpi vastapuoli on siirtänyt raportoinnin asetuksen (EU) N:o 648/2012 9 artiklan 1 f kohdan mukaisesti, on ilmoitettava muutoksesta sille kauppatietorekisterille, jolle yrityksen uudelleenjärjestelyn kohteena ollut vastapuoli on ilmoittanut johdannaisensa, ja pyydettävä asianomaisissa

2 artiklan 2 kohdan a ja b alakohdassa tarkoitetuissa johdannaisissa olevan LEI-tunnuksen päivittämistä LEI-tunnuksen muuttumiseen johtavan yrityksen uudelleenjärjestelyn päivämääränä tai kyseisen päivämäärän jälkeen ilmoitettavissa sopimuksissa olevan LEI-tunnuksen päivittämistä.

2. Edellä 2 artiklan 2 kohdan a ja b alakohdassa tarkoitetuissa johdannaisissa olevan tunnuksen päivittämistä koskeva pyyntö on mahdollisuuksien mukaan tehtävä vähintään 30 kalenteripäivää ennen LEI-tunnuksen muutokseen johtavaa yrityksen uudelleenjärjestelyä. Jos 1 kohdassa tarkoitettu yhteisö ei voi toimittaa näitä tietoja kauppatietorekisterille 30 kalenteripäivää ennen LEI-tunnuksen muutokseen johtavaa yrityksen uudelleenjärjestelyä, sen on ilmoitettava asiasta kauppatietorekisterille mahdollisimman pian.

3. Edellä 1 kohdassa tarkoitetussa pyynnössä on oltava vähintään seuraavat tiedot:

a) kunkin yrityksen uudelleenjärjestelyyn osallistuvan vastapuolen LEI-tunnus;

b) uuden vastapuolen LEI-tunnus;

c) päivä, jona LEI-tunnus muuttuu tai on muuttunut;

d) asianomaisten johdannaisten UTI-tunnukset, jos yrityksen uudelleenjärjestely vaikuttaa ainoastaan 2 artiklan 2 kohdan a ja b alakohdassa tarkoitettujen johdannaisten alajoukkoon;

e) näyttö siitä, että yrityksen uudelleenjärjestely on toteutettu tai toteutetaan, jollei asetuksen (EU) N:o 596/2014 17 artiklan sisäpiiritiedon julkistamista koskevista säännöksistä muuta johdu.

4. Jos vastapuoli ilmoittaa vahingossa kauppatietorekisterille LEI-tunnuksensa muutoksesta, sen on noudatettava 1, 2 ja 3 kohdan mukaista LEI-tunnuksen päivittämisen pyytämistä koskevaa menettelyä.

5. Jos vastapuoli, joka on aiemmin yksilöity muulla tunnuksella kuin LEI-tunnuksella, saa LEI-tunnuksen, sovelletaan 1, 2 ja 3 kohdan mukaisia menettelyjä.

6. Jos LEI-tunnuksen muutos koskee kolmanteen maahan sijoittautunutta vastapuolta, sen unioniin sijoittautuneen raportoivan vastapuolen, asetuksen (EU) N:o 648/2012 9 artiklan 1 a–d kohdan mukaisesta raportoinnista vastaavan yhteisön tai yhteisön, jolle unioniin sijoittautunut raportoiva vastapuoli on siirtänyt raportoinnin, on aloitettava 1, 2 ja 3 kohdan mukainen menettely.

7. Jos kolmanteen maahan sijoittautunut vastapuoli, joka on aiemmin yksilöity muulla tunnisteella kuin LEI-tunnuksella, saa LEI-tunnuksen, kunkin sellaisen unioniin sijoittautuneen raportoivan vastapuolen, johon tämä muutos vaikuttaa, asetuksen (EU) N:o 648/2012 9 artiklan 1 a–d kohdan mukaisesta raportoinnista vastaavan yhteisön tai yhteisön, jolle raportoiva vastapuoli on siirtänyt raportoinnin, on pyydettävä kolmanteen maahan sijoittautuneen vastapuolen tunnuksen päivittämistä asianomaiseen kauppatietorekisteriinsä.

8. Jos LEI-tunnuksen muutos koskee 3 artiklan 1 kohdan a, b, c, e tai g alakohdassa tarkoitettua yhteisöä, joka ei ole johdannaisen vastapuoli, vastapuolen 1 tai raportoinnista vastaavan yhteisön on vahvistettava kauppatietorekisterille asianomaisten 2 artiklan 2 kohdan a ja b alakohdassa tarkoitettujen johdannaisten UTI-tunnukset. Jos vastapuoli 1 ja raportoinnista vastaava yhteisö eivät vahvista kauppatietorekisterille niiden 2 artiklan 2 kohdan a ja b alakohdassa tarkoitettujen johdannaisten UTI-tunnuksia, joita LEI-tunnuksen muutos koskee, vastapuolen 1 tai raportoinnista vastaavan yhteisön on päivitettävä asianomaisen yhteisön LEI-tunnus kaikkiin asianomaisia 2 artiklan 2 kohdan a ja b alakohdassa tarkoitettuja johdannaisia koskeviin ilmoituksiin lähettämällä ilmoitus, jossa on toimen tyyppi ”Muutos”.

9 artikla

Ilmoittamista koskevat menetelmät ja järjestelyt

1. Raportoinnista vastaavan yhteisön on ilmoitettava toimivaltaiselle viranomaiselleen ja raportoivan vastapuolen toimivaltaiselle viranomaiselle, jos se on eri viranomainen, seuraavista tapauksista:

a) kaikki raportointijärjestelmien puutteista johtuva virheellinen raportointi, joka vaikuttaa merkittävään määrään ilmoituksia,

b) kaikki raportoinnin esteet, jotka estävät raportoivaa yhteisöä lähettämästä ilmoituksia kauppatietorekisteriin asetuksen (EU) N:o 648/2012 9 artiklan 1 kohdassa tarkoitetussa määräajassa,

c) kaikki merkittävät ongelmat, jotka aiheuttavat raportointivirheitä, mutta eivät johtaisi ilmoitusten hylkäämiseen kauppatietorekisterissä komission delegoidun asetuksen (EU) 2022/1858 ([7]) mukaisesti.

Raportoinnista vastaavan yhteisön on viipymättä ilmoitettava näistä tapauksista heti, kun se saa niistä tiedon.

Ilmoituksessa on ilmoitettava ainakin virheen tai puutteen tyyppi, tapahtumapäivä, asianomaisten ilmoitusten laajuus, virheiden tai puutteiden syyt, ongelman ratkaisemiseksi toteutetut toimet sekä ongelman ratkaisemisen aikataulu ja korjaukset.

2. Jos finanssialalla toimivalla vastapuolella on asetuksen (EU) N:o 648/2012 9 artiklan 1 a kohdan mukainen yksinomainen vastuu, myös oikeudellinen vastuu, OTC-johdannaissopimuksia koskevien tietojen ilmoittamisesta finanssialan ulkopuolisen vastapuolen puolesta, sen on otettava käyttöön seuraavat järjestelyt:

a) järjestelyt, joiden avulla finanssialan ulkopuolinen vastapuoli toimittaa oikea-aikaisesti seuraavat tiedot OTC-johdannaissopimuksista, joita finanssialalla toimivalla vastapuolella ei voida kohtuudella olettaa olevan ja jotka eivät ole kyseinen finanssialalla toimivan vastapuolen tiedossa:

   i) liitteessä olevan taulukon 1 kentässä 15 tarkoitetut välittäjän tunnistetiedot;

   ii) liitteessä olevan taulukon 1 kentässä 16 tarkoitettu määritysosapuoli;

   iii) liitteessä olevan taulukon 1 kentässä 20 tarkoitettu liiketoimintaan tai rahoitustoimintaan suoraan liittyminen;

b) järjestelyt, joiden avulla finanssialan ulkopuolinen vastapuoli ilmoittaa finanssialalla toimivalle vastapuolelle oikea-aikaisesti kaikista muutoksista asetuksen (EU) N:o 648/2012 10 artiklan 1 kohdan mukaisiin oikeudellisiin velvollisuuksiinsa;

c) järjestelyt, joiden avulla finanssialan ulkopuolinen vastapuoli uusii asianmukaisesti LEI-tunnuksensa maailmanlaajuisen LEI-järjestelmän jonkin hyväksytyn paikallisen toimintayksikön ehtojen mukaisesti;

d) järjestelyt, joiden avulla finanssialan ulkopuolinen vastapuoli ilmoittaa finanssialalla toimivalle vastapuolelle oikea-aikaisesti päätöksestään aloittaa tai lopettaa finanssialalla toimivan vastapuolen kanssa tehtyjä OTC-johdannaissopimuksia koskevien tietojen ilmoittaminen. Tällaisilla järjestelyillä on vähintään varmistettava, että ilmoitus tehdään kirjallisesti tai muulla vastaavalla sähköisellä menetelmällä vähintään 10 työpäivää ennen sitä päivää, jona finanssialan ulkopuolinen vastapuoli tahtoo aloittaa tai lopettaa ilmoittamisen.

3. Vastapuolilla, raportoinnista vastaavilla yhteisöillä ja tapauksen mukaan raportoivilla yhteisöillä on oltava käytössään järjestelyt, joilla varmistetaan, että delegoidun asetuksen (EU) 2022/1858 3 artiklan mukaisesti annettu täsmäytysvirheitä koskeva palaute otetaan huomioon.

10 artikla

Päivämäärä, johon mennessä johdannaissopimukset on ilmoitettava

Johdannaisen vastapuolen, joka täyttää 2 artiklan 2 kohdan a tai b alakohdassa säädetyt edellytykset [julkaisutoimisto lisää tämän täytäntöönpanoasetuksen soveltamispäivän], tai raportoinnista vastaavan yhteisön on ilmoitettava kaikki liitteen mukaisesti vaaditut tiedot kyseisestä johdannaisesta toimittamalla ilmoitus, jossa tapahtuman tyyppi on ”Päivitys”, 180 kalenteripäivän kuluessa XX.XX.20XX, elleivät ne ole kyseisen ajanjakson aikana toimittaneet tämän johdannaisen osalta ilmoitusta, jossa toimen tyyppi on ”Muutos” tai ”Oikaisu”.

([7]) Komission delegoitu asetus (EU) 2022/1858, annettu 10 päivänä kesäkuuta 2022, Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 648/2012 täydentämisestä teknisillä sääntelystandardeilla, joissa täsmennetään menettelyt, joita noudattaen tiedot täsmäytetään kauppatietorekisterien välillä, ja menettelyt, joita kauppatietorekisterin on noudatettava sen todentamiseksi, että raportoiva vastapuoli tai tiedot ilmoittava yhteisö täyttää ilmoitusvaatimukset, ja sen todentamiseksi, että ilmoitetut tiedot ovat täydellisiä ja oikeellisia (katso tämän virallisen lehden sivu 46).

11 artikla

Kumoaminen

Kumotaan täytäntöönpanoasetus (EU) N:o 1247/2012.

Viittauksia kumottuun asetukseen pidetään viittauksina tähän asetukseen.

12 artikla

Voimaantulo ja soveltaminen

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

Sitä sovelletaan 24. travnja 2024.

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

Tehty Brysselissä 10 päivänä kesäkuuta 2022.

Komission puolesta
Puheenjohtaja
Ursula VON DER LEYEN

LIITE

Taulukko 1

	Jakso	Kenttä	Muoto
1	Johdannaissopimuksen osapuolet	Raportoinnin aikaleima	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä koordinoituna yleisaikana (UTC) muodossa VVVV-KK-PPThh:mm:ssZ.
2	Johdannaissopimuksen osapuolet	Raportoivan yhteisön tunnistetiedot	ISO 17442 -standardin mukainen oikeushenkilötunnus (LEI), 20 aakkosnumeerista merkkiä pitkä koodi, joka sisältyy maailmanlaajuisen LEI-säätiön julkaisemiin LEI-tietoihin.
3	Johdannaissopimuksen osapuolet	Raportoinnista vastaava yhteisö	ISO 17442 -standardin mukainen oikeushenkilötunnus (LEI), 20 aakkosnumeerista merkkiä pitkä koodi, joka sisältyy maailmanlaajuisen LEI-säätiön julkaisemiin LEI-tietoihin. LEI-tunnus on uusittava asianmukaisesti maailmanlaajuisen LEI-järjestelmän jonkin hyväksytyn paikallisen toimintayksikön ehtojen mukaisesti.
4	Johdannaissopimuksen osapuolet	Vastapuoli 1 (raportoiva vastapuoli)	ISO 17442 -standardin mukainen oikeushenkilötunnus (LEI), 20 aakkosnumeerista merkkiä pitkä koodi, joka sisältyy maailmanlaajuisen LEI-säätiön julkaisemiin LEI-tietoihin. LEI-tunnus on uusittava asianmukaisesti maailmanlaajuisen LEI-järjestelmän jonkin hyväksytyn paikallisen toimintayksikön ehtojen mukaisesti.
5	Johdannaissopimuksen osapuolet	Vastapuolen 1 luonne	F = finanssialalla toimiva vastapuoli N = finanssialan ulkopuolinen vastapuoli C = keskusvastapuoli O = muu.
6	Johdannaissopimuksen osapuolet	Vastapuolen 1 yrityssektori	Finanssialalla toimivien vastapuolten luokittelu: ”INVF” – Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivin 2014/65/EU ([1]) mukaisesti toimiluvan saanut sijoituspalveluyritys; ”CDTI” – Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivin 2013/36/EU ([2]) mukaisesti toimiluvan saanut luottolaitos; ”INUN” – Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivin 2009/138/EY ([3]) mukaisesti toimiluvan saanut vakuutus- tai jälleenvakuutusyritys; ”UCIT” – Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivin 2009/65/EY ([4]) mukaisesti toimiluvan saanut yhteissijoitusyritys ja tilanteen mukaan sen rahastoyhtiö, ellei kyseistä yhteissijoitusyritystä ole perustettu yksinomaan yhtä tai useampaa henkilöstön osakkeenostojärjestelyä varten; ”ORPI” – Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivin (EU) 2016/2341 ([5]) 6 artiklan 1 alakohdassa määritelty ammatillisia lisäeläkkeitä tarjoava laitos (lisäeläkelaitos);

	Jakso	Kenttä	Muoto
			”AIFD” – Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivin 2011/61/EU ([6]) 4 artiklan 1 kohdan a alakohdassa määritelty vaihtoehtoinen sijoitusrahasto, joka on joko sijoittautunut unioniin tai jota hallinnoi vaihtoehtoisen sijoitusrahaston hoitaja, jolle on myönnetty toimilupa tai joka on rekisteröity kyseisen direktiivin mukaisesti, ellei kyseistä vaihtoehtoista sijoitusrahastoa ole perustettu yksinomaan yhtä tai useampaa henkilöstön osakkeenostojärjestelyä varten, tai ellei kyseinen vaihtoehtoinen sijoitusrahasto ole direktiivin 2011/61/EU 2 artiklan 3 kohdan g alakohdassa tarkoitettu arvopaperistamista varten perustettu erillisyhtiö, ja tarvittaessa sen unioniin sijoittautunutta vaihtoehtoisen sijoitusrahaston hoitajaa; ”CSDS” – Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 909/2014 ([7]) mukaisesti toimiluvan saanut arvopaperikeskus. Finanssialan ulkopuolisten vastapuolten luokittelu – seuraavat luokat vastaavat Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksessa (EY) N:o 1893/2006 ([8]) määritellyn NACE-luokituksen pääluokkia: ”A” – maatalous, metsätalous ja kalatalous; ”B” – kaivostoiminta ja louhinta; ”C” – teollisuus; ”D” – sähkö-, kaasu-, lämpö- ja ilmastointihuolto; ”E” – vesihuolto, viemäri- ja jätevesihuolto, jätehuolto ja muu ympäristön puhtaanapito; ”F” – rakentaminen; ”G” – tukku- ja vähittäiskauppa; moottoriajoneuvojen ja moottoripyörien korjaus; ”H” – kuljetus ja varastointi; ”I” – majoitus- ja ravitsemistoiminta; ”J” – informaatio ja viestintä; ”K” – rahoitus- ja vakuutustoiminta; ”L” – kiinteistöalan toiminta; ”M” – ammatillinen, tieteellinen ja tekninen toiminta; ”N” – hallinto- ja tukipalvelutoiminta; ”O” – julkinen hallinto ja maanpuolustus; pakollinen sosiaalivakuutus; ”P” – koulutus; ”Q” – terveys- ja sosiaalipalvelut; ”R” – taiteet, viihde ja virkistys; ”S” – muu palvelutoiminta;

	Jakso	Kenttä	Muoto
			”T” – kotitalouksien toiminta työnantajina; kotitalouksien eriyttämätön toiminta tavaroiden ja palvelujen tuottamiseksi omaan käyttöön; ”U” – kansainvälisten organisaatioiden ja toimielinten toiminta. Jos ilmoitetaan useampi kuin yksi toiminta, koodit luetellaan vastaavan toiminnan suhteellisen merkittävyyden mukaan. Kohta jätetään tyhjäksi, kun on kyse keskusvastapuolista ja muista asetuksen (EU) N:o 648/2012 ([9]) 1 artiklan 5 kohdassa tarkoitetuista vastapuolista.
7	Johdannaissopimuksen osapuolet	Vastapuolen 1 määrityskynnysarvo	Boolen arvo: TRUE = ylittää kynnysarvon FALSE = alittaa kynnysarvon.
8	Johdannaissopimuksen osapuolet	Vastapuolen 2 tunnuksen tyyppi	Boolen arvo: — TRUE — FALSE, kun kyse on luonnollisista henkilöistä, jotka toimivat yksityishenkilöinä ja jotka eivät voi LEI-järjestelmän valvontaelimen (Regulatory Oversight Committee) yrityksen ominaisuudessa toimivista yksityishenkilöistä 20. syyskuuta 2015 antaman lausunnon, jäljempänä ’valvontaelimen lausunto’, mukaisesti saada LEI-tunnusta.
9	Johdannaissopimuksen osapuolet	Vastapuoli 2	— ISO 17442 -standardin mukainen oikeushenkilötunnus (LEI), jossa on 20 aakkosnumeerista merkkiä ja joka sisältyy maailmanlaajuisen LEI-säätiön julkaisemiin LEI-tietoihin, tai enintään 72 aakkosnumeerisen merkin pituinen koodi yksityishenkilöinä toimiville luonnollisille henkilöille, jotka eivät voi valvontaelimen lausunnon mukaisesti saada LEI-tunnusta. Luonnollisen henkilön yksilöivä koodi muodostuu vastapuolen 1 LEI-tunnuksesta, jota seuraa vastapuolen 1 kyseiselle luonnolliselle henkilölle (kyseisille luonnollisille henkilöille) lakisääteistä raportointia varten antama ja johdonmukaisesti ylläpitämä yksilöllinen tunnus.
10	Johdannaissopimuksen osapuolet	Vastapuolen 2 maa	ISO 3166 -standardin mukainen maakoodi – kaksimerkkinen maakoodi.
11	Johdannaissopimuksen osapuolet	Vastapuolen 2 luonne	F = finanssialalla toimiva vastapuoli N = finanssialan ulkopuolinen vastapuoli C = keskusvastapuoli O = muu.

	Jakso	Kenttä	Muoto
12	Johdannaissopimuksen osapuolet	Vastapuolen 2 yrityssektori	Finanssialalla toimivien vastapuolten luokittelu: ”INVF” – direktiivin 2014/65/EU mukaisesti toimiluvan saanut sijoituspalveluyritys; ”CDTI” – direktiivin 2013/36/EU mukaisesti toimiluvan saanut luottolaitos; ”INUN” – direktiivin 2009/138/EY mukaisesti toimiluvan saanut vakuutus- tai jälleenvakuutusyritys; ”UCIT” – direktiivin 2009/65/EY mukaisesti toimiluvan saanut yhteissijoitusyritys ja tilanteen mukaan sen rahastoyhtiö, ellei kyseistä yhteissijoitusyritystä ole perustettu yksinomaan yhtä tai useampaa henkilöstön osakkeenostojärjestelyä varten; ”ORPI” – direktiivin (EU) 2016/2341 6 artiklan 1 kohdassa määritelty ammatillisia lisäeläkkeitä tarjoava laitos (lisäeläkelaitos); ”AIFD” – direktiivin 2011/61/EU 4 artiklan 1 kohdan a alakohdassa määritelty vaihtoehtoinen sijoitusrahasto, joka on joko sijoittautunut unioniin tai jota hallinnoi vaihtoehtoisen sijoitusrahaston hoitaja, jolle on myönnetty toimilupa tai joka on rekisteröity kyseisen direktiivin mukaisesti, ellei kyseistä vaihtoehtoista sijoitusrahastoa ole perustettu yksinomaan yhtä tai useampaa henkilöstön osakkeenostojärjestelyä varten, tai ellei kyseinen vaihtoehtoinen sijoitusrahasto ole direktiivin 2011/61/EU 2 artiklan 3 kohdan g alakohdassa tarkoitettu arvopaperistamista varten perustettu erillisyhtiö, ja tarvittaessa sen unioniin sijoittautunutta vaihtoehtoisen sijoitusrahaston hoitajaa; ”CSDS” – asetuksen (EU) N:o 909/2014 mukaisesti toimiluvan saanut arvopaperikeskus. Finanssialan ulkopuolisten vastapuolten luokittelu – seuraavat luokat vastaavat asetuksessa (EY) N:o 1893/2006 määritellyn NACE-luokituksen pääluokkia: ”A” – maatalous, metsätalous ja kalatalous; ”B” – kaivostoiminta ja louhinta; ”C” – teollisuus; ”D” – sähkö-, kaasu-, lämpö- ja ilmastointihuolto; ”E” – vesihuolto, viemäri- ja jätevesihuolto, jätehuolto ja muu ympäristön puhtaanapito; ”F” – rakentaminen; ”G” – tukku- ja vähittäiskauppa; moottoriajoneuvojen ja moottoripyörien korjaus; ”H” – kuljetus ja varastointi; ”I” – majoitus- ja ravitsemistoiminta; ”J” – informaatio ja viestintä; ”K” – rahoitus- ja vakuutustoiminta;

	Jakso	Kenttä	Muoto
			”L” – kiinteistöalan toiminta; ”M” – ammatillinen, tieteellinen ja tekninen toiminta; ”N” – hallinto- ja tukipalvelutoiminta; ”O” – julkinen hallinto ja maanpuolustus; pakollinen sosiaalivakuutus; ”P” – koulutus; ”Q” – terveys- ja sosiaalipalvelut; ”R” – taiteet, viihde ja virkistys; ”S” – muu palvelutoiminta; ”T” – kotitalouksien toiminta työnantajina; kotitalouksien eriyttämätön toiminta tavaroiden ja palvelujen tuottamiseksi omaan käyttöön; ”U” – kansainvälisten organisaatioiden ja toimielinten toiminta. Jos ilmoitetaan useampi kuin yksi toiminta, koodit luetellaan vastaavan toiminnan suhteellisen merkittävyyden mukaan. Kohta jätetään tyhjäksi, kun on kyse keskusvastapuolista ja muista asetuksen (EU) N:o 648/2012 1 artiklan 5 kohdassa tarkoitetuista vastapuolista.
13	Johdannaissopimuksen osapuolet	Vastapuolen 2 määrityskynnysarvo	Boolen arvo: TRUE = ylittää kynnysarvon FALSE = alittaa kynnysarvon.
14	Johdannaissopimuksen osapuolet	Vastapuolen 2 ilmoitusvelvollisuus	Boolen arvo: — TRUE, jos vastapuolella 2 on ilmoitusvelvollisuus — FALSE, jos vastapuolella 2 ei ole ilmoitusvelvollisuutta.
15	Johdannaissopimuksen osapuolet	Välittäjän tunnistetiedot	ISO 17442 -standardin mukainen oikeushenkilötunnus (LEI), 20 aakkosnumeerista merkkiä pitkä koodi, joka sisältyy maailmanlaajuisen LEI-säätiön julkaisemiin LEI-tietoihin.
16	Johdannaissopimuksen osapuolet	Määritysosapuoli	ISO 17442 -standardin mukainen oikeushenkilötunnus (LEI), 20 aakkosnumeerista merkkiä pitkä koodi, joka sisältyy maailmanlaajuisen LEI-säätiön julkaisemiin LEI-tietoihin.
17	Johdannaissopimuksen osapuolet	Suunta	4 aakkosellista merkkiä: BYER = ostaja SLLR = myyjä. Täytetään tämän asetuksen 4 artiklan mukaisesti.

	Jakso	Kenttä	Muoto
18	Johdannaissopimuksen osapuolet	Ensimmäisen korkovirran suunta	4 aakkosellista merkkiä: MAKE = maksaja TAKE = vastaanottaja. Täytetään tämän asetuksen 4 artiklan mukaisesti.
19	Johdannaissopimuksen osapuolet	Toisen korkovirran suunta	4 aakkosellista merkkiä: MAKE = maksaja TAKE = vastaanottaja. Täytetään tämän asetuksen 4 artiklan mukaisesti.
20	Johdannaissopimuksen osapuolet	Liittyy liiketoimintaan tai rahoitustoimintaan suoraan	Boolen arvo: TRUE = kyllä FALSE = ei.

([1]) Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivi 2014/65/EU, annettu 15 päivänä toukokuuta 2014, rahoitusvälineiden markkinoista sekä direktiivin 2002/92/EY ja direktiivin 2011/61/EU muuttamisesta (EUVL L 173, 12.6.2014, s. 349).

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

([4]) 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).

([5]) Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivi (EU) 2016/2341, annettu 14 päivänä joulukuuta 2016, ammatillisia lisäeläkkeitä tarjoavien laitosten toiminnasta ja valvonnasta (EUVL L 354, 23.12.2016, s. 37).

([6]) 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).

([7]) Euroopan parlamentin ja neuvoston asetus (EU) N:o 909/2014, annettu 23 päivänä heinäkuuta 2014, arvopaperitoimituksen parantamisesta Euroopan unionissa sekä arvopaperikeskuksista ja direktiivien 98/26/EY ja 2014/65/EU sekä asetuksen (EU) N:o 236/2012 muuttamisesta (EUVL L 257, 28.8.2014, s. 1).

([8]) 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).

([9]) Euroopan parlamentin ja neuvoston asetus (EU) N:o 648/2012, annettu 4 päivänä heinäkuuta 2012, OTC-johdannaisista, keskusvastapuolista ja kauppatietorekistereistä (EUVL L 201, 27.7.2012, s. 1).

Taulukko 2

	Jakso	Kenttä	Muoto
1	Jakso 2a – Tunnukset ja linkit	UTI	ISO 23897 -standardin mukainen UTI-tunnus. Enintään 52 aakkosnumeerista merkkiä, ainoastaan isot kirjaimet A–Z ja numerot 0–9 ovat sallittuja.
2	Jakso 2a – Tunnukset ja linkit	Ilmoituksen seurantanumero	Aakkosnumeerinen kenttä, jossa enintään 52 merkkiä.

	Jakso	Kenttä	Muoto
3	Jakso 2a – Tunnukset ja linkit	Aiempi UTI-tunnus (yksi yhteen- ja yhdestä moneen -suhteet transaktioiden välillä).	Enintään 52 aakkosnumeerista merkkiä, ainoastaan isot kirjaimet A–Z ja numerot 0–9 ovat sallittuja.
4	Jakso 2a – Tunnukset ja linkit	Myöhemmän position UTI-tunnus	Enintään 52 aakkosnumeerista merkkiä, ainoastaan isot kirjaimet A–Z ja numerot 0–9 ovat sallittuja.
5	Jakso 2a – Tunnukset ja linkit	Kaupan jälkeisen riskinvähennyksen tunnistetiedot	Enintään 52 aakkosnumeerista merkkiä, ainoastaan isot kirjaimet A–Z ja numerot 0–9 ovat sallittuja. Ensimmäiset 20 merkkiä edustavat tiivistämisen tarjoajan LEI-tunnusta.
6	Jakso 2a – Tunnukset ja linkit	Liiketoimikokonaisuuden tunnus	Enintään 35 aakkosnumeerista merkkiä.
7	Jakso 2b – Sopimuk-sen tiedot	Kansainvälinen arvopaperien tunnusnumero (ISIN)	ISO 6166 -standardin mukainen ISIN-tunnus, jossa on 12 aakkosnumeerista merkkiä.
8	Jakso 2b – Sopimuk-sen tiedot	Yksilöllinen tuotetunnus (UPI)	ISO 4914 -standardin mukainen UPI-tunnus, jossa on 12 aakkosnumeerista merkkiä.
9	Jakso 2b – Sopimuk-sen tiedot	Tuotteen luokitus	ISO 10962 -standardin mukainen kuusikirjaiminen CFI-koodi.
10	Jakso 2b – Sopimuk-sen tiedot	Sopimustyyppi	CFDS = hinnanerosopimukset FRAS = korkotermiinit FUTR = futuurit FORW = termiinit OPTN = optiot SPDB = spread bet -sopimukset SWAP = swapit SWPT = swaptiot OTHR = muu.
11	Jakso 2b – Sopimuk-sen tiedot	Omaisuuslaji	COMM = hyödykkeet ja päästöoikeudet CRDT = luotto CURR = valuutta EQUI = oma pääoma INTR = korko.
12	Jakso 2b – Sopimuk-sen tiedot	Kryptovaroihin perustuva johdannainen	Boolen arvo: — TRUE – kryptovaroihin perustuvien johdannaisten osalta — FALSE – muiden johdannaisten osalta.

	Jakso	Kenttä	Muoto
13	Jakso 2b – Sopimuk-sen tiedot	Kohde-etuuden tunnistetietojen tyyppi	1 aakkosellinen merkki: I = ISIN B = kori X = indeksi.
14	Jakso 2b – Sopimuk-sen tiedot	Kohde-etuuden tunnistetiedot	Tyyppiä I olevat kohde-etuuden tunnisteet: ISO 6166 -standardin mukainen ISIN-tunnus, jossa on 12 aakkosnumeerista merkkiä Tyyppiä X olevat kohde-etuuden tunnisteet: ISO 6166 -standardin mukainen ISIN-tunnus, jossa on 12 aakkosnumeerista merkkiä, jos saatavilla.
15	Jakso 2b – Sopimuk-sen tiedot	Kohde-etuutena olevan indeksin indikaattori	Vaihtuvan koron indeksin merkintä. 4 aakkosellista merkkiä: 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.

	Jakso	Kenttä	Muoto
16	Jakso 2b – Sopimuk-sen tiedot	Kohde-etuutena olevan indeksin nimi	Enintään 50 aakkosnumeerista merkkiä. Erikoismerkit ovat sallittuja, jos ne muodostavat osan indeksin koko nimestä.
17	Jakso 2b – Sopimuk-sen tiedot	Mukautetun korin koodi	Enintään 72 aakkosnumeerista merkkiä, jotka koostuvat korin järjestäjän LEI-tunnuksesta, jota seuraa enintään 52 aakkosnumeerista merkkiä.
18	Jakso 2b – Sopimuk-sen tiedot	Korin osien tunnus	Tyyppiä B olevat kohde-etuuden tunnisteet: kaikki yksittäiset komponentit tunnistettu ISO 6166 -standardin mukaisesti.
19	Jakso 2b – Sopimuk-sen tiedot	Toimitusvaluutta 1	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.
20	Jakso 2b – Sopimuk-sen tiedot	Toimitusvaluutta 2	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.
21	Jakso 2c – Arvostus	Arvostuksen määrä	Positiivinen ja negatiivinen arvo, enintään 25 numeerista merkkiä, joista enintään 5 desimaaleja. Jos arvossa on enemmän kuin 5 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä puolivälistä ylöspäin. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä. Jos on käytettävä miinusmerkkiä, sitä ei lasketa numeeriseksi merkiksi.
22	Jakso 2c – Arvostus	Arvostusvaluutta	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.
23	Jakso 2c – Arvostus	Arvostuksen aikaleima	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä UTC-muodossa VVVV-KK-PPThh:mm:ssZ.
24	Jakso 2c – Arvostus	Arvostus-menetelmä	4 aakkosellista merkkiä: MTMA = arvostus markkinahintaan MTMO = malliin perustuva arvostus CCPV = keskusvastapuolen arvostus.
25	Jakso 2c – Arvostus	Delta	Enintään 25 numeerista merkkiä, joista enintään 5 desimaaleja. Jos arvossa on enemmän kuin 5 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä puolivälistä ylöspäin. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä. Mikä tahansa –1:n ja 1:n välinen arvo (mukaan lukien –1 ja 1) on sallittu.
26	Jakso 2d – Vakuus	Vakuussalkun indikaattori	Boolen arvo: TRUE = vakuus asetettu salkkuperusteisesti FALSE = ei osa salkkua.
27	Jakso 2d – Vakuus	Vakuussalkun koodi	Enintään 52 aakkosnumeerista merkkiä. Erikoismerkkejä ei sallita.

	Jakso	Kenttä	Muoto
28	Jakso 2e – Riskin vähentäminen / raportointi	Vahvistamisen aikaleima	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä UTC-muodossa VVVV-KK-PPThh:mm:ssZ.
29	Jakso 2e – Riskin vähentäminen / raportointi	Vahvistettu	4 aakkosellista merkkiä: — NCNF = vahvistamaton — ECNF = sähköinen — YCNF = muu kuin sähköinen.
30	Jakso 2f – Määritys	Määritys-velvollisuus	TRUE = sopimus kuuluu OTC-johdannaislajiin, jonka on ilmoitettu kuuluvan määritysvelvollisuuden piiriin, ja molempiin sopimuspuolina oleviin vastapuoliin sovelletaan määritysvelvollisuutta FLSE = sopimus kuuluu OTC-johdannaislajiin, jonka on ilmoitettu kuuluvan määritysvelvollisuuden piiriin, mutta toiseen tai kumpaankaan vastapuoleen ei sovelleta määritysvelvollisuutta tai arvo ”UKWN”, jos sopimus ei kuulu OTC-johdannaislajiin, jonka on ilmoitettu kuuluvan määritysvelvollisuuden piiriin.
31	Jakso 2f – Määritys	Määritetty	1 aakkosellinen merkki: Y = määritetty keskitetysti beeta- ja gammatransaktioiden osalta. N = ei määritetty keskitetysti.
32	Jakso 2f – Määritys	Määrityksen aikaleima	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä UTC-muodossa VVVV-KK-PPThh:mm:ssZ.
33	Jakso 2f – Määritys	Keskusvastapuoli	ISO 17442 -standardin mukainen oikeushenkilötunnus (LEI), 20 aakkosnumeerista merkkiä pitkä koodi, joka sisältyy maailmanlaajuisen LEI-säätiön julkaisemiin LEI-tietoihin.
34	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Vakiosopimuksen tyyppi	4 aakkosellista merkkiä: ”ISDA” – ISDA ”CDEA” – FIA-ISDA Cleared Derivatives Execution Agreement ”EUMA” – European Master Agreement ”FPCA” – FOA Professional Client Agreement ”FMAT” – FBF:n vakiosopimus termiinirahoitusinstrumentteihin liittyvistä liiketoimista ”DERV” – Deutscher Rahmenvertrag für Finanztermingeschäfte (DRV) ”CMOP” – Contrato Marco de Operaciones Financieras ”CHMA” – Swiss Master Agreement

	Jakso	Kenttä	Muoto
			”IDMA” – Islamic Derivative Master Agreement ”EFMA” – EFET Master Agreement ”GMRA” – GMRA ”GMSL” – GMSLA ”BIAG” – kahdenvälinen sopimus tai ”OTHR”, jos vakiosopimustyyppi ei sisälly edellä olevaan luetteloon.
35	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Muun vakiosopimuksen tyyppi	Enintään 50 aakkosnumeerista merkkiä.
36	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Vakiosopimuksen versio	Päivämäärä ISO 8601 -muodossa (VVVV).
37	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Konsernin sisäinen	Boolen arvo: TRUE = sopimus on tehty konsernin sisäisenä transaktiona FALSE = sopimusta ei ole tehty konsernin sisäisenä transaktiona.
38	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Kaupan jälkeinen riskinvähennys	Boolen arvo: TRUE = sopimus johtuu kaupan jälkeisestä riskinvähennystapahtumasta FALSE = sopimus ei johdu kaupan jälkeisestä riskinvähennystapahtumasta.
39	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Kaupan jälkeisen riskinvähennyk-sen tekniikan tyyppi	4 aakkosellista merkkiä: ”PWOS” – salkun tiivistäminen ilman kolmannen osapuolen palveluntarjoajaa ”PWAS” – salkun tiivistäminen kolmannen osapuolen palveluntarjoajan tai keskusvastapuolen kanssa ”PRBM” – salkun sijoituspainotusten muutos / marginaalin hallinta ”OTHR” – muu.
40	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Kaupan jälkeisten riskinvähennys-palvelujen tarjoaja	ISO 17442 -standardin mukainen oikeushenkilötunnus (LEI), 20 aakkosnumeerista merkkiä pitkä koodi, joka sisältyy maailmanlaajuisen LEI-säätiön julkaisemiin LEI-tietoihin.
41	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Toteuttamis-paikka	ISO 10383 -standardin mukainen kaupankäyntipaikan koodi (Market Identifier Code, MIC), jossa on 4 aakkosnumeerista merkkiä.
42	Jakso 2c – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Toteutuksen aikaleima	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä UTC-muodossa VVVV-KK-PPThh:mm:ssZ.
43	Jakso 2c – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Voimaantulo-päivä	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä UTC-muodossa VVVV-KK-PP.
44	Jakso 2c – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Voimassaolon päättymispäivä	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä UTC-muodossa VVVV-KK-PP.
45	Jakso 2c – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Ennenaikaisen päättymisen päivämäärä	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä UTC-muodossa VVVV-KK-PP.

	Jakso	Kenttä	Muoto
46	Jakso 2c – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Sopimuksen lopullinen toimituspäivä	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä UTC-muodossa VVVV-KK-PP.
47	Jakso 2c – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Toimitustapa	4 aakkosellista merkkiä: CASH = käteinen PHYS = fyysinen OPTL = vastapuolen valittavissa tai kolmannen osapuolen päättämä.
48	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Hinta	— Jos hinta ilmaistaan rahallisena arvona, mikä tahansa arvo, jossa voi olla enintään 18 numeerista merkkiä ja enintään 13 desimaalia. Jos arvossa on enemmän kuin 13 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä arvo ylöspäin. — Jos hinta ilmaistaan prosentteina, mikä tahansa arvo, jossa voi olla enintään 11 numeerista merkkiä ja enintään 10 desimaalia prosentteina ilmaistuna (esimerkiksi 2,57 eikä 2,57 %). Jos arvossa on enemmän kuin 10 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä arvo ylöspäin. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä. Jos on käytettävä miinusmerkkiä, sitä ei lasketa numeeriseksi merkiksi.
49	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Hinnan valuutta	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.
	Kentät 50–52 ovat toistuvia, ja ne täytetään sellaisten johdannaisten osalta, joihin liittyy hinta-luetteloita.		
50	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Hinnan oikaisematon voimaantulopäivä	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä UTC-muodossa VVVV-KK-PP.
51	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Hinnan oikaisematon päättymispäivä	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä UTC-muodossa VVVV-KK-PP.
52	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Oikaisemattoman voimaantulo-päivän ja päättymispäivän välillä voimassa oleva hinta	— Jos hinta ilmaistaan rahallisena arvona, mikä tahansa arvo, jossa voi olla enintään 18 numeerista merkkiä ja enintään 13 desimaalia. Jos arvossa on enemmän kuin 13 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä arvo ylöspäin. — Jos hinta ilmaistaan prosentteina, mikä tahansa arvo, jossa voi olla enintään 11 numeerista merkkiä ja enintään 10 desimaalia prosentteina ilmaistuna (esimerkiksi 2,57 eikä 2,57 %). Jos arvossa on enemmän kuin 10 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä arvo ylöspäin.

	Jakso	Kenttä	Muoto
			Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä. Jos on käytettävä miinusmerkkiä, sitä ei lasketa numeeriseksi merkiksi.
53	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Liiketoimikokonaisuuden hinta	— Jos liiketoimikokonaisuuden hinta ilmaistaan rahallisena arvona, mikä tahansa arvo, jossa voi olla enintään 18 numeerista merkkiä ja enintään 13 desimaalia. Jos arvossa on enemmän kuin 13 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä arvo ylöspäin. — Jos liiketoimikokonaisuuden hinta ilmaistaan prosentteina, mikä tahansa arvo, jossa voi olla enintään 11 numeerista merkkiä ja enintään 10 desimaalia prosentteina ilmaistuna (esimerkiksi 2,57 eikä 2,57 %). Jos arvossa on enemmän kuin 10 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä arvo ylöspäin. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä. Jos on käytettävä miinusmerkkiä, sitä ei lasketa numeeriseksi merkiksi.
54	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Liiketoimikokonaisuuden hinnan valuutta	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.
55	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Ensimmäisen korkovirran nimellismäärä	Mikä tahansa arvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 25 numeerista merkkiä ja enintään 5 desimaalia. Jos arvossa on enemmän kuin 5 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä puolivälistä ylöspäin. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.
56	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Nimellisvaluutta 1	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.
	Kentät 57–59 ovat toistuvia, ja ne täytetään sellaisten johdannaisten osalta, joihin liittyy nimellis-määrää koskevia luetteloita.		
57	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Ensimmäisen korkovirran nimellismäärän voimaantulopäivä	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä UTC-muodossa VVVV-KK-PP.
58	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Ensimmäisen korkovirran nimellismäärän päättymispäivä	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä UTC-muodossa VVVV-KK-PP.

	Jakso	Kenttä	Muoto
59	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Ensimmäisen korkovirran voimaantulo-päivänä voimassa oleva nimellismäärä	Mikä tahansa arvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 25 numeerista merkkiä ja enintään 5 desimaalia. Jos arvossa on enemmän kuin 5 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä puolivälistä ylöspäin. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.
60	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Ensimmäisen korkovirran nimellis-lukumäärä yhteensä	Mikä tahansa arvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 25 numeerista merkkiä ja enintään 5 desimaalia. Jos arvossa on enemmän kuin 5 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä puolivälistä ylöspäin. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.
	Kentät 61–63 ovat toistuvia, ja ne täytetään sellaisten johdannaisten osalta, joihin liittyy nimellis-lukumäärää koskevia luetteloita.		
61	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Ensimmäisen korkovirran nimellis-lukumäärän voimaantulopäivä	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä UTC-muodossa VVVV-KK-PP.
62	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Ensimmäisen korkovirran nimellis-lukumäärän päättymispäivä	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä UTC-muodossa VVVV-KK-PP.
63	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Ensimmäisen korkovirran voimaantulo-päivänä voimassa oleva nimellis-lukumäärä	Mikä tahansa arvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 25 numeerista merkkiä ja enintään 5 desimaalia. Jos arvossa on enemmän kuin 5 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä puolivälistä ylöspäin. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.
64	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Toisen korkovirran nimellismäärä	Mikä tahansa arvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 25 numeerista merkkiä ja enintään 5 desimaalia. Jos arvossa on enemmän kuin 5 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä puolivälistä ylöspäin. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.
65	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Nimellisvaluutta 2	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.

	Jakso	Kenttä	Muoto
	Kentät 66–68 ovat toistuvia, ja ne täytetään sellaisten johdannaisten osalta, joihin liittyy nimellis-määrää koskevia luetteloita.		
66	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Toisen korkovirran nimellismäärän voimaantulopäivä	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä UTC-muodossa VVVV-KK-PP.
67	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Toisen korkovirran nimellismäärän päättymispäivä	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä UTC-muodossa VVVV-KK-PP.
68	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Toisen korkovirran voimaantulo-päivänä voimassa oleva nimellismäärä	Mikä tahansa arvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 25 numeerista merkkiä ja enintään 5 desimaalia. Jos arvossa on enemmän kuin 5 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä puolivälistä ylöspäin. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.
69	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Toisen korkovirran nimellis-lukumäärä yhteensä	Mikä tahansa arvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 25 numeerista merkkiä ja enintään 5 desimaalia. Jos arvossa on enemmän kuin 5 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä puolivälistä ylöspäin. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.
	Kentät 70–72 ovat toistuvia, ja ne täytetään sellaisten johdannaisten osalta, joihin liittyy nimellis-lukumäärää koskevia luetteloita.		
70	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Toisen korkovirran nimellis-lukumäärän voimaantulopäivä	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä UTC-muodossa VVVV-KK-PP.
71	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Toisen korkovirran nimellis-lukumäärän päättymispäivä	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä UTC-muodossa VVVV-KK-PP.
72	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Toisen korkovirran voimaantulo-päivänä voimassa oleva nimellis-lukumäärä	Mikä tahansa arvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 25 numeerista merkkiä ja enintään 5 desimaalia. Jos arvossa on enemmän kuin 5 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä puolivälistä ylöspäin. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.

	Jakso	Kenttä	Muoto
	Kenttien 73–78 jakso on toistettava.		
73	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Muu maksutyyppi	4 aakkosellista merkkiä: UFRO = ennakkomaksu eli ensimmäinen maksu, jonka jokin vastapuoli suorittaa transaktion saattamiseksi käypään arvoon tai jostakin muusta syystä, joka voi olla markkinoiden ulkopuolisen transaktion syy UWIN = purkaminen / täydellinen päättäminen eli toimituksen loppumaksu, joka suoritetaan, kun transaktio puretaan ennen sen päättymispäivää; maksut, jotka voivat johtua johdannaistransaktion (johdannaistransaktioiden) täydellisestä päättämisestä PEXH = ensisijainen pörssi eli koron- ja valuutanvaihtosopimusten nimellisarvojen pörssi.
74	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Muun maksun määrä	Enintään 25 numeerista merkkiä, joista enintään 5 desimaaleja. Jos arvossa on enemmän kuin 5 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä puolivälistä ylöspäin. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä. Mikä tahansa arvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, on sallittu.
75	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Muun maksun valuutta	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.
76	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Muun maksun päivämäärä	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä UTC-muodossa VVVV-KK-PP.
77	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Muun maksun maksaja	— ISO 17442 -standardin mukainen oikeushenkilötunnus (LEI), jossa on 20 aakkosnumeerista merkkiä ja joka sisältyy maailmanlaajuisen LEI-säätiön julkaisemiin LEI-tietoihin, tai enintään 72 aakkosnumeerisen merkin pituinen koodi yksityishenkilöinä toimiville luonnollisille henkilöille, jotka eivät voi valvontaelimen lausunnon mukaisesti saada LEI-tunnusta. Luonnollisen henkilön yksilöivä koodi muodostuu vastapuolen 1 LEI-tunnuksesta, jota seuraa vastapuolen 1 kyseiselle luonnolliselle henkilölle (kyseisille luonnollisille henkilöille) lakisääteistä raportointia varten antama ja johdonmukaisesti ylläpitämä yksilöllinen tunnus.
78	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Muun maksun vastaanottaja	— ISO 17442 -standardin mukainen oikeushenkilötunnus (LEI), jossa on 20 aakkosnumeerista merkkiä ja joka sisältyy maailmanlaajuisen LEI-säätiön julkaisemiin LEI-tietoihin, tai enintään 72 aakkosnumeerisen merkin pituinen koodi yksityishenkilöinä toimiville luonnollisille henkilöille, jotka eivät voi valvontaelimen lausunnon mukaisesti saada LEI-tunnusta.

	Jakso	Kenttä	Muoto
			Luonnollisen henkilön yksilöivä koodi muodostuu vastapuolen 1 LEI-tunnuksesta, jota seuraa vastapuolen 1 kyseiselle luonnolliselle henkilölle (kyseisille luonnollisille henkilöille) lakisääteistä raportointia varten antama ja johdonmukaisesti ylläpitämä yksilöllinen tunnus.
79	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran kiinteä korko tai kuponki	Positiivinen ja negatiivinen arvo, jossa voi olla enintään 11 numeerista merkkiä ja enintään 10 desimaalia prosentteina ilmaistuna (esimerkiksi 2,57 eikä 2,57 %). Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä. Jos on käytettävä miinusmerkkiä, sitä ei lasketa numeeriseksi merkiksi.
80	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran kiinteän koron tai kupongin laskukäytäntö	4 aakkosnumeerista merkkiä: 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 = vapaa vastaus.
81	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran kiinteän koron tai kupongin maksutiheysjakso	4 aakkosellista merkkiä: DAIL = päivittäinen WEEK = viikoittainen MNTH = kuukausittainen YEAR = vuosittainen ADHO = tapauskohtainen jakso, jota sovelletaan, kun maksut ovat epäsäännöllisiä EXPI = maksu erääntymispäivänä.

	Jakso	Kenttä	Muoto
82	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran kiinteän koron tai kupongin maksutiheys-jakson kerroin	Mikä tahansa kokonaislukuarvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 3 numeerista merkkiä.
83	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron tunnus	Jos vaihtuvalla korolla on ISIN-tunnus, kyseisen koron ISIN-tunnus.
84	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron indikaattori	Vaihtuvan koron indeksin merkintä. 4 aakkosellista merkkiä: 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.

	Jakso	Kenttä	Muoto
85	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron nimi	Enintään 50 aakkosnumeerista merkkiä. Erikoismerkit ovat sallittuja, jos ne muodostavat osan indeksin koko nimestä.
86	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron laskukäytäntö	4 aakkosnumeerista merkkiä: 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 = vapaa vastaus.
87	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron maksutiheysjakso	4 aakkosellista merkkiä: DAIL = päivittäinen WEEK = viikoittainen MNTH = kuukausittainen YEAR = vuosittainen ADHO = tapauskohtainen jakso, jota sovelletaan, kun maksut ovat epäsäännöllisiä EXPI = maksu erääntymispäivänä.
88	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron maksutiheys-jakson kerroin	Mikä tahansa kokonaislukuarvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 3 numeerista merkkiä.
89	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron viitekausi – ajanjakso	4 aakkosellista merkkiä: DAIL = päivittäinen WEEK = viikoittainen MNTH = kuukausittainen YEAR = vuosittainen ADHO = tapauskohtainen jakso, jota sovelletaan, kun maksut ovat epäsäännöllisiä EXPI = maksu erääntymispäivänä.

	Jakso	Kenttä	Muoto
90	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron viitekausi – kerroin	Mikä tahansa kokonaislukuarvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 3 numeerista merkkiä.
91	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron muutostiheys-jakso	4 aakkosellista merkkiä: DAIL = päivittäinen WEEK = viikoittainen MNTH = kuukausittainen YEAR = vuosittainen ADHO = tapauskohtainen jakso, jota sovelletaan, kun maksut ovat epäsäännöllisiä EXPI = maksu erääntymispäivänä.
92	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron muutostiheyden kerroin	Mikä tahansa kokonaislukuarvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 3 numeerista merkkiä.
93	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran spread	— Jos spread ilmaistaan rahallisena määränä, mikä tahansa arvo, jossa voi olla enintään 18 numeerista merkkiä ja enintään 13 desimaalia. — Jos spread ilmaistaan prosentteina, mikä tahansa arvo, jossa voi olla enintään 11 numeerista merkkiä ja enintään 10 desimaalia prosentteina ilmaistuna (esimerkiksi 2,57 eikä 2,57 %). — Jos spread ilmaistaan peruspisteinä, mikä tahansa kokonaislukuarvo, jossa voi olla enintään 5 numeerista merkkiä peruspisteinä (esimerkiksi 257 eikä 2,57 %).
94	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran spreadin valuutta	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.
95	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran kiinteä korko	Positiivinen ja negatiivinen arvo, jossa voi olla enintään 11 numeerista merkkiä ja enintään 10 desimaalia prosentteina ilmaistuna (esimerkiksi 2,57 eikä 2,57 %). Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä. Jos on käytettävä miinusmerkkiä, sitä ei lasketa numeeriseksi merkiksi.
96	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran kiinteän koron laskukäytäntö	4 aakkosnumeerista merkkiä: A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA

	Jakso	Kenttä	Muoto
			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 = vapaa vastaus.
97	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran kiinteän koron maksutiheys	4 aakkosellista merkkiä: DAIL = päivittäinen WEEK = viikoittainen MNTH = kuukausittainen YEAR = vuosittainen ADHO = tapauskohtainen jakso, jota sovelletaan, kun maksut ovat epäsäännöllisiä EXPI = maksu erääntymispäivänä.
98	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran kiinteän koron maksutiheyden kerroin	Mikä tahansa kokonaislukuarvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 3 numeerista merkkiä.
99	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran vaihtuvan koron tunnus	Jos vaihtuvalla korolla on ISIN-tunnus, kyseisen koron ISIN-tunnus.
100	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran vaihtuvan koron indikaattori	Vaihtuvan koron indeksin merkintä. 4 aakkosellista merkkiä: 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

	Jakso	Kenttä	Muoto
			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.
101	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran vaihtuvan koron nimi	Enintään 50 aakkosnumeerista merkkiä. Erikoismerkit ovat sallittuja, jos ne muodostavat osan indeksin koko nimestä.
102	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran vaihtuvan koron laskukäytäntö	4 aakkosnumeerista merkkiä: 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

	Jakso	Kenttä	Muoto
			A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = vapaa vastaus.
103	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran vaihtuvan koron maksutiheysjakso	4 aakkosellista merkkiä: DAIL = päivittäinen WEEK = viikoittainen MNTH = kuukausittainen YEAR = vuosittainen ADHO = tapauskohtainen jakso, jota sovelletaan, kun maksut ovat epäsäännöllisiä EXPI = maksu erääntymispäivänä.
104	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran vaihtuvan koron maksutiheysjakson kerroin	Mikä tahansa kokonaislukuarvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 3 numeerista merkkiä.
105	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran vaihtuvan koron viitekausi – ajanjakso	4 aakkosellista merkkiä: DAIL = päivittäinen WEEK = viikoittainen MNTH = kuukausittainen YEAR = vuosittainen ADHO = tapauskohtainen jakso, jota sovelletaan, kun maksut ovat epäsäännöllisiä EXPI = maksu erääntymispäivänä.
106	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran vaihtuvan koron viitekausi – kerroin	Mikä tahansa kokonaislukuarvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 3 numeerista merkkiä.
107	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran vaihtuvan koron muutostiheys-jakso	4 aakkosellista merkkiä: DAIL = päivittäinen WEEK = viikoittainen MNTH = kuukausittainen YEAR = vuosittainen ADHO = tapauskohtainen jakso, jota sovelletaan, kun maksut ovat epäsäännöllisiä EXPI = maksu erääntymispäivänä.
108	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran vaihtuvan koron muutostiheyden kerroin	Mikä tahansa kokonaislukuarvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 3 numeerista merkkiä.

	Jakso	Kenttä	Muoto
109	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran spread	— Jos spread ilmaistaan rahallisena määränä, mikä tahansa arvo, jossa voi olla enintään 18 numeerista merkkiä ja enintään 13 desimaalia. — Jos spread ilmaistaan prosentteina, mikä tahansa arvo, jossa voi olla enintään 11 numeerista merkkiä ja enintään 10 desimaalia prosentteina ilmaistuna (esimerkiksi 2,57 eikä 2,57 %). — Jos spread ilmaistaan peruspisteinä, mikä tahansa kokonaislukuarvo, jossa voi olla enintään 5 numeerista merkkiä peruspisteinä (esimerkiksi 257 eikä 2,57 %).
110	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran spreadin valuutta	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.
111	Jakso 2h – Korot	Liiketoimi-kokonaisuuden spread	— Jos liiketoimikokonaisuuden spread ilmaistaan rahallisena määränä, positiivinen ja negatiivinen arvo, jossa voi olla enintään 18 numeerista merkkiä ja enintään 13 desimaalia. Jos arvossa on enemmän kuin 13 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä arvo ylöspäin. — Jos liiketoimikokonaisuuden spread ilmaistaan prosentteina, positiivinen ja negatiivinen arvo, jossa voi olla enintään 11 numeerista merkkiä ja enintään 10 desimaalia prosentteina ilmaistuna (esimerkiksi 2,57 eikä 2,57 %). Jos arvossa on enemmän kuin 10 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä arvo ylöspäin. — Jos liiketoimikokonaisuuden spread ilmaistaan peruspisteinä, mikä tahansa kokonaislukuarvo, jossa voi olla enintään 5 numeerista merkkiä peruspisteinä (esimerkiksi 257 eikä 2,57 %). Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä. Jos on käytettävä miinusmerkkiä, sitä ei lasketa numeeriseksi merkiksi.
112	Jakso 2h – Korot	Liiketoimi-kokonaisuuden spreadin valuutta	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.
113	Jakso 2i – Valuutat	Valuuttakurssi 1	Mikä tahansa arvo, joka on suurempi kuin nolla, enintään 18 numeerista merkkiä ja enintään 13 desimaalia. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.
114	Jakso 2i – Valuutat	Valuutan termiinikurssi	Mikä tahansa arvo, joka on suurempi kuin nolla, enintään 18 numeerista merkkiä ja enintään 13 desimaalia. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.

	Jakso	Kenttä	Muoto
115	Jakso 2i – Valuutat	Valuuttapari	7 merkkiä, jotka edustavat kahta ISO 4217 -standardin mukaista valuuttakoodia erotettuina toisistaan merkillä ”/” rajoittamatta valuuttaparin järjestystä. Ensimmäisellä valuuttakodilla ilmoitetaan yksikkövaluutta ja toisella valuuttakoodilla hintavaluutta.
116	Jakso 2j – Hyödyk-keet ja päästö-oikeudet (yleinen)	Perustuote	Ainoastaan hyödykejohdannaisten jaottelutaulukon ”Perustuote”-sarakkeen arvot ovat sallittuja.
117	Jakso 2j – Hyödyk-keet ja päästö-oikeudet (yleinen)	Alatuote	Ainoastaan hyödykejohdannaisten jaottelutaulukon ”Alatuote”-sarakkeen arvot ovat sallittuja.
118	Jakso 2j – Hyödyk-keet ja päästö-oikeudet (yleinen)	Alatuotteen jaottelu	Ainoastaan hyödykejohdannaisten jaottelutaulukon ”Alatuotteen jaottelu” -sarakkeen arvot ovat sallittuja.
119	Jakso 2k – Hyödyk-keet ja päästö-oikeudet (energia)	Jakelupaikka tai -alue	EIC-koodi, 16 aakkosnumeerista merkkiä. Toistuva kenttä.
120	Jakso 2k – Hyödyk-keet ja päästö-oikeudet (energia)	Yhteenliitäntä-piste	EIC-koodi, 16 aakkosnumeerista merkkiä.
121	Jakso 2k – Hyödyk-keet ja päästö-oikeudet (energia)	Kuormitustyyppi	BSLD = peruskuormitus PKLD = huippukuormitus OFFP = huippukuormitusajan ulkopuolinen HABH = tuntiperiodi SHPD = shaped (mukautettu) GASD = kaasutoimituspäivä OTHR = muu.
	Kenttien 122–131 jakso on toistettava.		
122	Jakso 2k – Hyödyk-keet ja päästö-oikeudet (energia)	Toimituksen aikavälin alkamisaika	hh:mm:ssZ.
123	Jakso 2k – Hyödyk-keet ja päästö-oikeudet (energia)	Toimituksen aikavälin päättymisaika	hh:mm:ssZ.

	Jakso	Kenttä	Muoto
124	Jakso 2k – Hyödyk-keet ja päästö-oikeudet (energia)	Toimituksen alkamispäivä	Päivämäärä ISO 8601 -muodossa (VVVV-KK-PP).
125	Jakso 2k – Hyödyk-keet ja päästö-oikeudet (energia)	Toimituksen päättymispäivä	Päivämäärä ISO 8601 -muodossa (VVVV-KK-PP).
126	Jakso 2k – Hyödyk-keet ja päästö-oikeudet (energia)	Kesto	MNUT = minuutti HOUR = tunti DASD = päivä WEEK = viikko MNTH = kuukausi QURT = vuosineljännes SEAS = kausi YEAR = vuosi OTHR = muu.
127	Jakso 2k – Hyödyk-keet ja päästö-oikeudet (energia)	Viikonpäivät	WDAY = arkipäivät WEND = viikonloppu MOND = maanantai TUED = tiistai WEDD = keskiviikko THUD = torstai FRID = perjantai SATD = lauantai SUND = sunnuntai XBHL – paitsi yleiset vapaapäivät IBHL – mukaan lukien yleiset vapaapäivät. Useat arvot ovat sallittuja.
128	Jakso 2k – Hyödyk-keet ja päästö-oikeudet (energia)	Toimitus-kapasiteetti	Enintään 20 numeerista merkkiä, desimaalit mukaan lukien. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä. Jos on käytettävä miinusmerkkiä, sitä ei lasketa numeeriseksi merkiksi.
129	Jakso 2k – Hyödyk-keet ja päästö-oikeudet (energia)	Määräyksikkö	KWAT = KW KWHH = KWh/h KWHD = KWh/d MWAT = MW MWHH = MWh/h MWHD = MWh/d GWAT = GW

	Jakso	Kenttä	Muoto
			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	Jakso 2k – Hyödyk-keet ja päästö-oikeudet (energia)	Hinta määräyksikköä kohden per aikaväli	Enintään 20 numeerista merkkiä, desimaalit mukaan lukien. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä. Jos on käytettävä miinusmerkkiä, sitä ei lasketa numeeriseksi merkiksi.
131	Jakso 2k – Hyödyk-keet ja päästö-oikeudet (energia)	Määräyksikköä kohden per aikaväli käytetyn hinnan valuutta	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.
132	Jakso 2l – Optiot	Option tyyppi	4 aakkosellinen merkki: PUTO = myyntioptio CALL = osto-optio OTHR = jollei voida määrittää, onko kyseessä osto- vai myyntioptio.
133	Jakso 2l – Optiot	Option tyyppi	4 aakkosellista merkkiä: AMER = amerikkalainen BERM = bermudalainen EURO = eurooppalainen.
134	Jakso 2l – Optiot	Toteutushinta	— Jos toteutushinta ilmaistaan rahamääränä: mikä tahansa arvo, jossa on enintään 18 numeerista merkkiä, joista enintään 13 on desimaaleja (esimerkiksi 6,39 Yhdysvaltain dollaria ilmaistaan 6,39), osakeoptioiden, hyödykeoptioiden, valuuttaoptioiden ja vastaavien tuotteiden osalta. Jos arvossa on enemmän kuin 13 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä arvo ylöspäin.

	Jakso	Kenttä	Muoto
			— Jos toteutushinta ilmaistaan prosentteina: mikä tahansa arvo, jossa on enintään 11 numeerista merkkiä, joista enintään 10 on desimaaleja, prosenttiosuutena ilmaistuna (esimerkiksi 2,1 eikä 2,1 %) korko-optioiden, spreadiin noteerattujen korko- ja luottoswaptioiden sekä vastaavien tuotteiden osalta. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä. Jos on käytettävä miinusmerkkiä, sitä ei lasketa numeeriseksi merkiksi.
	Kentät 135–137 ovat toistuvia, ja ne täytetään sellaisten johdannaisten osalta, joihin liittyy toteutus-hintaluetteloita.		
135	Jakso 2l – Optiot	Toteutushinnan voimaantulopäivä	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä UTC-muodossa VVVV-KK-PP.
136	Jakso 2l – Optiot	Toteutushinnan päättymispäivä	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä UTC-muodossa VVVV-KK-PP.
137	Jakso 2l – Optiot	Toteutushinta, joka on voimassa voimaantulopäivänä	— Jos toteutushinta ilmaistaan rahamääränä: mikä tahansa arvo, jossa on enintään 18 numeerista merkkiä, joista enintään 13 on desimaaleja (esimerkiksi 6,39 Yhdysvaltain dollaria ilmaistaan 6,39), osakeoptioiden, hyödykeoptioiden, valuuttaoptioiden ja vastaavien tuotteiden osalta. Jos arvossa on enemmän kuin 13 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä arvo ylöspäin. — Jos toteutushinta ilmaistaan prosentteina: mikä tahansa arvo, jossa on enintään 11 numeerista merkkiä, joista enintään 10 on desimaaleja, prosenttiosuutena ilmaistuna (esimerkiksi 2,1 eikä 2,1 %) korko-optioiden, spreadiin noteerattujen korko- ja luottoswaptioiden sekä vastaavien tuotteiden osalta. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä. Jos on käytettävä miinusmerkkiä, sitä ei lasketa numeeriseksi merkiksi.
138	Jakso 2l – Optiot	Toteutushinnan valuutta/valuutta-pari	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi tai valuuttaoptioiden osalta: 7 merkkiä, jotka edustavat kahta ISO 4217 -standardin mukaista valuuttakoodia erotettuina toisistaan merkillä ”/” rajoittamatta valuuttaparin järjestystä Ensimmäisellä valuuttakodilla ilmoitetaan perusvaluutta ja toisella valuuttakoodilla hintavaluutta.

	Jakso	Kenttä	Muoto
139	Jakso 2l – Optiot	Option preemion määrä	Mikä tahansa arvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 25 numeerista merkkiä ja enintään 5 desimaalia. Jos arvossa on enemmän kuin 5 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä puolivälistä ylöspäin. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.
140	Jakso 2l – Optiot	Option preemion valuutta	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.
141	Jakso 2l – Optiot	Option preemion maksupäivä	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä UTC-muodossa VVVV-KK-PP.
142	Jakso 2l – Optiot	Kohde-etuuden erääntymispäivä	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä UTC-muodossa VVVV-KK-PP.
143	Jakso 2m – Luottojohdannaiset	Etuoikeusasema	4 aakkosellista merkkiä: 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.
144	Jakso 2m – Luottojohdannaiset	Viiteyhteisö	ISO 3166 -standardin mukainen maakoodi – 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.
145	Jakso 2m – Luottojohdannaiset	Sarja	Kokonaislukukenttä, jossa enintään 5 merkkiä.
146	Jakso 2m – Luottojohdannaiset	Versio	Kokonaislukukenttä, jossa enintään 5 merkkiä.
147	Jakso 2m – Luottojohdannaiset	Indeksikerroin	Mikä tahansa arvo, jossa voi olla enintään 11 numeerista merkkiä, mukaan lukien enintään 10 desimaalia, ilmaistuna desimaalilukuna (esimerkiksi 0,05 eikä 5 %) välillä 0–1 (mukaan lukien 0 ja 1). Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.

	Jakso	Kenttä	Muoto
148	Jakso 2m – Luottojohdannaiset	Etuoikeusluokka	Boolen arvo: TRUE = etuoikeusluokkiin jaettu FALSE = etuoikeusluokkiin jakamaton.
149	Jakso 2m – Luottojohdannaiset	Luottojohdannaisswapin indeksin kiinnitystaso	Mikä tahansa arvo, jossa voi olla enintään 11 numeerista merkkiä, mukaan lukien enintään 10 desimaalia, ilmaistuna desimaalilukuna (esimerkiksi 0,05 eikä 5 %) välillä 0–1 (mukaan lukien 0 ja 1). Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.
150	Jakso 2m – Luottojohdannaiset	Luottojohdannaisswapin indeksin irrottautumistaso	Mikä tahansa arvo, jossa voi olla enintään 11 numeerista merkkiä, mukaan lukien enintään 10 desimaalia, ilmaistuna desimaalilukuna (esimerkiksi 0,05 eikä 5 %) välillä 0–1 (mukaan lukien 0 ja 1). Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.
151	Jakso 2n – Johdannaisen muutokset	Toimen tyyppi	4 aakkosellista merkkiä: NEWT = uusi MODI = muutos CORR = oikaisu TERM = päättyminen EROR = virhe REVI = uudelleenavaaminen VALU = arvostus POSC = position komponentti.
152	Jakso 2n – Johdannaisen muutokset	Tapahtuman tyyppi	4 aakkosellista merkkiä: TRAD = kauppa NOVA = novaatio COMP = kaupan jälkeinen riskinvähennys ETRM = ennenaikainen päättyminen CLRG = määritys EXER = toteutus ALOC = allokaatio CREV = luottotapahtuma CORP = yritystapahtuma INCP = sisällyttäminen positioon UPDT = päivitys.
153	Jakso 2n – Johdannaisen muutokset	Tapahtuman päivämäärä	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä UTC-muodossa VVVV-KK-PP.

	Jakso	Kenttä	Muoto
154	Jakso 2n – Johdannaisen muutokset	Taso	4 aakkosellista merkkiä: TCTN = kauppa PSTN = positio.

Taulukko 3

	Jakso	Kenttä	Muoto
1	Johdan-naissopimuksen osapuolet	Raportoinnin aikaleima	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä koordinoituna yleisaikana (UTC) muodossa VVVV-KK-PPThh:mm:ssZ.
2	Johdan-naissopimuksen osapuolet	Raportoivan yhteisön tunnistetiedot	ISO 17442 -standardin mukainen oikeushenkilötunnus (LEI), 20 aakkosnumeerista merkkiä pitkä koodi, joka sisältyy maailmanlaajuisen LEI-säätiön julkaisemiin LEI-tietoihin.
3	Johdan-naissopimuksen osapuolet	Raportoinnista vastaava yhteisö	ISO 17442 -standardin mukainen oikeushenkilötunnus (LEI), 20 aakkosnumeerista merkkiä pitkä koodi, joka sisältyy maailmanlaajuisen LEI-säätiön julkaisemiin LEI-tietoihin. LEI-tunnus on uusittava asianmukaisesti maailmanlaajuisen LEI-järjestelmän jonkin hyväksytyn paikallisen toimintayksikön ehtojen mukaisesti.
4	Johdan-naissopimuksen osapuolet	Vastapuoli 1 (raportoiva vastapuoli)	ISO 17442 -standardin mukainen oikeushenkilötunnus (LEI), 20 aakkosnumeerista merkkiä pitkä koodi, joka sisältyy maailmanlaajuisen LEI-säätiön julkaisemiin LEI-tietoihin. LEI-tunnus on uusittava asianmukaisesti maailmanlaajuisen LEI-järjestelmän jonkin hyväksytyn paikallisen toimintayksikön ehtojen mukaisesti.
5	Johdan-naissopimuksen osapuolet	Vastapuolen 2 tunnuksen tyyppi	Boolen arvo: — TRUE — FALSE niiden yksityishenkilöinä toimivien luonnollisten henkilöiden osalta, jotka eivät voi valvontaelimen lausunnon mukaisesti saada LEI-tunnusta.
6	Johdan-naissopimuksen osapuolet	Vastapuoli 2	— ISO 17442 -standardin mukainen oikeushenkilötunnus (LEI), jossa on 20 aakkosnumeerista merkkiä ja joka sisältyy maailmanlaajuisen LEI-säätiön julkaisemiin LEI-tietoihin, tai enintään 72 aakkosnumeerisen merkin pituinen koodi yksityishenkilöinä toimiville luonnollisille henkilöille, jotka eivät voi valvontaelimen lausunnon mukaisesti saada LEI-tunnusta. Luonnollisen henkilön yksilöivä koodi muodostuu vastapuolen 1 LEI-tunnuksesta, jota seuraa vastapuolen 1 kyseiselle luonnolliselle henkilölle (kyseisille luonnollisille henkilöille) lakisääteistä raportointia varten antama ja johdonmukaisesti ylläpitämä yksilöllinen tunnus.
7	Vakuus	Vakuuden aikaleima	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä UTC-muodossa VVVV-KK-PPThh:mm:ssZ.
8	Vakuus	Vakuussalkun indikaattori	Boolen arvo: TRUE = vakuus asetettu salkkuperusteisesti FALSE = ei osa salkkua.

	Jakso	Kenttä	Muoto
9	Vakuus	Vakuussalkun koodi	Enintään 52 aakkosnumeerista merkkiä. Erikoismerkkejä ei sallita.
10	Vakuus	UTI	Enintään 52 aakkosnumeerista merkkiä, ainoastaan isot kirjaimet A–Z ja numerot 0–9 ovat sallittuja.
11	Vakuus	Vakuuden asettamisen luokka	4 aakkosellista merkkiä: UNCL = ei vakuuksia PRC1 = osittaiset vakuudet: ainoastaan vastapuoli 1 PRC2 = osittaiset vakuudet: ainoastaan vastapuoli 2 PRCL = osittaiset vakuudet OWC1 = yksisuuntaiset vakuudet: ainoastaan vastapuoli 1 OWC2 = yksisuuntaiset vakuudet: ainoastaan vastapuoli 2 OWP1 = yksisuuntaiset/osittaiset vakuudet: ainoastaan vastapuoli 1 OWP2 = yksisuuntaiset/osittaiset vakuudet: ainoastaan vastapuoli 2 FLCL = täydet vakuudet. Täytetään tämän asetuksen 5 artiklan mukaisesti.
12	Vakuus	Vastapuolen 1 asettama alkumarginaali (ennen aliarvostusta)	Mikä tahansa arvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 25 numeerista merkkiä ja enintään 5 desimaalia. Jos arvossa on enemmän kuin 5 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä puolivälistä ylöspäin. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.
13	Vakuus	Vastapuolen 1 asettama alkumarginaali (aliarvostuksen jälkeen)	Mikä tahansa arvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 25 numeerista merkkiä ja enintään 5 desimaalia. Jos arvossa on enemmän kuin 5 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä puolivälistä ylöspäin. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.
14	Vakuus	Asetetun alkumarginaalin valuutta	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.
15	Vakuus	Vastapuolen 1 asettama vaihtelumarginaali (ennen aliarvostusta)	Mikä tahansa arvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 25 numeerista merkkiä ja enintään 5 desimaalia. Jos arvossa on enemmän kuin 5 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä puolivälistä ylöspäin. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.

	Jakso	Kenttä	Muoto
16	Vakuus	Vastapuolen 1 asettama vaihtelumarginaali (aliarvostuksen jälkeen)	Mikä tahansa arvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 25 numeerista merkkiä ja enintään 5 desimaalia. Jos arvossa on enemmän kuin 5 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä puolivälistä ylöspäin. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.
17	Vakuus	Asetettujen vaihtelumarginaalien valuutta	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.
18	Vakuus	Vastapuolen 1 asettama ylimääräinen vakuus	Mikä tahansa arvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 25 numeerista merkkiä ja enintään 5 desimaalia. Jos arvossa on enemmän kuin 5 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä puolivälistä ylöspäin. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.
19	Vakuus	Asetetun ylimääräisen vakuuden valuutta	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.
20	Vakuus	Vastapuolen 1 keräämä alkumarginaali (ennen aliarvostusta)	Mikä tahansa arvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 25 numeerista merkkiä ja enintään 5 desimaalia. Jos arvossa on enemmän kuin 5 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä puolivälistä ylöspäin. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.
21	Vakuus	Vastapuolen 1 keräämä alkumarginaali (aliarvostuksen jälkeen)	Mikä tahansa arvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 25 numeerista merkkiä ja enintään 5 desimaalia. Jos arvossa on enemmän kuin 5 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä puolivälistä ylöspäin. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.
22	Vakuus	Kerätyn alkumarginaalin valuutta	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.
23	Vakuus	Vastapuolen 1 keräämä vaihtelumarginaali (ennen aliarvostusta)	Mikä tahansa arvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 25 numeerista merkkiä ja enintään 5 desimaalia. Jos arvossa on enemmän kuin 5 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä puolivälistä ylöspäin. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.

	Jakso	Kenttä	Muoto
24	Vakuus	Vastapuolen 1 keräämä vaihtelumarginaali (aliarvostuksen jälkeen)	Mikä tahansa arvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 25 numeerista merkkiä ja enintään 5 desimaalia. Jos arvossa on enemmän kuin 5 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä puolivälistä ylöspäin. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.
25	Vakuus	Kerätyn vaihtelumarginaalin valuutta	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.
26	Vakuus	Vastapuolen 1 keräämä ylimääräinen vakuus	Mikä tahansa arvo, joka on suurempi tai yhtä suuri kuin nolla, enintään 25 numeerista merkkiä ja enintään 5 desimaalia. Jos arvossa on enemmän kuin 5 numeroa desimaalin jälkeen, raportoivien vastapuolten on pyöristettävä puolivälistä ylöspäin. Desimaalimerkkiä ei lasketa numeeriseksi merkiksi. Jos sitä käytetään, käytetään pistettä.
27	Vakuus	Kerätyn ylimääräisen vakuuden valuutta	ISO 4217 -standardin mukainen kolmikirjaiminen valuuttakoodi.
28	Vakuus	Toimen tyyppi	”MARU” – marginaalin saattaminen ajan tasalle ”CORR” – oikaisu.
29	Vakuus	Tapahtuman päivämäärä	ISO 8601 -standardin mukainen päivämäärä UTC-muodossa VVVV-KK-PP.

Taulukko 4

Hyödykkeiden luokittelu

Perustuote	Alatuote	Alatuotteen jaottelu
”AGRI” – maatalous	”GROS” – viljat ja öljykasvit	”FWHT” – rehuvehnä ”SOYB” – soijapavut ”CORN” – maissi ”RPSD” – rapsinsiemenet ”RICE” – riisi ”OTHR” – muu
	”SOFT” – viljellyt tuotteet, muut kuin viljat ja öljykasvit (softs)	”CCOA” – kaakao ”ROBU” – kahvi (robusta) ”WHSG” – valkoinen sokeri ”BRWN” – raakasokeri ”OTHR” – muu
	”POTA” – peruna	
	”OOLI” – oliiviöljy	”LAMP” – oliivilamppuöljy ”OTHR” – muu

Perustuote	Alatuote	Alatuotteen jaottelu
	”DIRY”– maitotuotteet	
	”FRST” – metsätalous	
	”SEAF” – kalat ja äyriäiset	
	”LSTK” – kotieläimet	
	”GRIN” – vilja	”MWHT” – myllyvehnä ”OTHR” – muu
	”OTHR” – muu	
”NRGY”– energia	”ELEC” – sähkö	”BSLD” – peruskuormitus ”FITR” – finanssisiirto-oikeudet ”PKLD” – huippukuormitus ”OFFP” – huippukuormitusajan ulkopuolinen ”OTHR” – muu
	”NGAS” – maakaasu	”GASP” – GASPOOL ”LNGG” – LNG ”NBPG” – NBP ”NCGG” – NCG ”TTFG” – TTF ”OTHR” – muu
	”OILP” – öljy	”BAKK” – Bakken ”BDSL” – biodiesel ”BRNT” – Brent ”BRNX” – Brent NX ”CNDA” – Canadian ”COND” – kondensaatti ”DSEL” – diesel ”DUBA” – Dubai ”ESPO” – ESPO ”ETHA” – etanoli ”FUEL” – polttoaine ”FOIL” – polttoöljy ”GOIL” – kaasuöljy ”GSLN” – bensiini ”HEAT” – lämmitysöljy ”JTFL” – lentopetroli ”KERO” – kerosiini ”LLSO” – Light Louisiana Sweet (LLS) ”MARS” – Mars ”NAPH” – Naphta ”NGLO” – nesteytetty maakaasu (LNG) ”TAPI” – Tapis

Perustuote	Alatuote	Alatuotteen jaottelu
		”URAL” – Urals ”WTIO” – WTI ”OTHR” – muu
	”COAL” – hiili ”INRG” – energialajien välinen ”RNNG” – uusiutuva energia ”LGHT” – kevyet jalosteet ”DIST” – tisleet ”OTHR” – muu	
”ENVR” – ympäristö	”EMIS” – päästöt	”CERE” – CER ”ERUE” – ERU ”EUAE” – EUA ”EUAA” – EUAA ”OTHR” – muu
	”WTHR” – sää ”CRBR”– hiileen liittyvä ”OTHR” – muu	
”FRGT” – rahti	”WETF” – nestemäinen rahti	”TNKR” – säiliöalukset ”OTHR” – muu
	”DRYF” – kuivarahti	”DBCR” – kuivairtolastialukset ”OTHR” – muu
	”CSHP” – konttialukset	
	”OTHR” – muu	
”FRTK” – lannoite	”AMMO” – ammoniakki ”DAPH” – DAP (diammoniumfosfaatti) ”PTSH” – kaliumkarbonaatti ”SLPH” – rikki ”Urea” – urea ”UAAN” – UAN (urea ja ammoniumnitraatti) ”OTHR” – muu	
”INDP” – teollisuustuotteet	”CSTR” – rakentaminen ”MFTG” – valmistusteollisuus	

Perustuote	Alatuote	Alatuotteen jaottelu
”METL” – metallit	”NPRM” – muut kuin jalometallit	”ALUM” – alumiini ”ALUA” – alumiiniseokset ”CBLT” – koboltti ”COPR” – kupari ”IRON” – rautamalmi ”LEAD” – lyijy ”MOLY” – molybdeeni ”NASC” – NASAAC ”NICK” – nikkeli ”STEL” – teräs ”TINN” – tina ”ZINC” – sinkki ”OTHR” – muu
	”PRME” – jalometallit	”GOLD” – kulta ”SLVR” – hopea ”PTNM” – platina ”PLDM” – palladium ”OTHR” – muu
”MCEX” – monta hyödykettä käsittävä eksoottinen (Multi Commodity Exotic)		
”PAPR” – paperi	”CBRD” – pakkauskartonki ”NSPT” – sanomalehtipaperi ”PULP” – sellu ”RCVP” – keräyspaperi ”OTHR” – muu	
”POLY” – polypropeeni	”PLST” – muovi ”OTHR” – muu	
”INFL” – inflaatio		
”OEST” – viralliset taloustilastot		
”OTHC” – ”muut C10-johdannaiset”, sellaisina kuin ne on määritelty komission delegoidun asetuksen (EU) 2017/583 ([1]) liitteessä III olevassa taulukossa 10.1		
”OTHR” – muu		

([1]) Komission delegoitu asetus (EU) 2017/583, annettu 14 päivänä heinäkuuta 2016, rahoitusvälineiden markkinoista annetun Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 600/2014 täydentämisestä kauppapaikoille ja sijoituspalveluyrityksille joukkovelkakirjalainojen, strukturoitujen rahoitustuotteiden, päästöoikeuksien ja johdannaisten osalta asetettavia avoimuusvaatimuksia koskevilla teknisillä sääntelystandardeilla (EUVL L 87, 31.3.2017, s. 229).