

A BIZOTTSÁG 1247/2012/EU VÉGREHAJTÁSI RENDELETE

(2012. december 19.)

a tőzsdén kívüli származtatott ügyletekről, a központi szerződő felekről és a kereskedési adattárakról szóló 648/2012/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletnek megfelelően a kereskedési adattáraknak benyújtandó kereskedési jelentések formátumára és gyakoriságára vonatkozó végrehajtási technikai standardok meghatározásáról

(EGT-vonatkozású szöveg)

AZ EURÓPAI BIZOTTSÁG,

tekintettel az Európai Unió működéséről szóló szerződésre,

tekintettel az Európai Központi Bank véleményére ⁽¹⁾,

tekintettel a tőzsdén kívüli származtatott ügyletekről, a központi szerződő felekről és a kereskedési adattárakról szóló, 2012. július 4-i 648/2012/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletre ⁽²⁾ és különösen annak 9. cikke (6) bekezdésére,

mivel:

- (1) A következtelenségek elkerülése érdekében a 648/2012/EU rendelet 9. cikke értelmében a kereskedési adattáraknak bejelentett minden adatnak ugyanazon szabályokat, standardokat és formátumokat kell követnie minden kereskedési adattár, minden szerződő fél és a származtatott termékek minden típusa vonatkozásában. A származtatott ügyletek leírásához ezért egy egyedi adatkészletet kell használni.
- (2) Mivel a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek jellemzően nem azonosíthatók egyedileg a pénzügyi piacokon széles körben használt meglévő kódokkal – mint például a nemzetközi értékpapír-azonosító szám (ISIN) –, és nem is írhatók körül az ISO pénzügyi instrumentumok besorolása (CFI) kód használatával, az azonosítás új és univerzális módját kell kidolgozni. Amennyiben rendelkezésre áll egy egyedi termékazonosító, amely követi az egység, semlegesség, megbízhatóság, nyílt forrás, mértezhetőség, hozzáférhetőség elvét, ésszerű a költségalapja, megfelelő irányítási keretrendszerbe tartozik és használata az Unióban elfogadott, akkor azt kell használni. Amennyiben az említett követelményeknek megfelelő egyedi termékazonosító nem áll rendelkezésre, ideiglenes taxonómiát kell használni.
- (3) Az alapul szolgáló eszközt egyetlen azonosító használatával kell azonosítani, mindazonáltal jelenleg nincs a kosáron belüli alapul szolgáló eszköz azonosítására szolgáló, az egész piacon elterjedt szabványosított kód. A szerződő felek számára ezért elő kell írni legalább annak a feltüntetését, hogy az alapul szolgáló eszköz kosár, valamint, ha lehetséges, a szabványosított indexekre vonatkozó ISIN használatát.
- (4) A következtesség biztosítása érdekében a származtatott ügyletben részt vevő minden felet egyedi kóddal kell azonosítani. Az Unión belüli használatra elfogadott, az adatkövetelményekkel kapcsolatos FSB ajánlásokkal összeegyeztethető, irányítási keretrendszerben meghatározandó globális jogalany-azonosítót vagy ideiglenes jogalany-azonosítót kell használni minden pénzügyi és nem pénzügyi szerződő fél, bróker, központi szerződő fél és kedvezményezett azonosítására, amint rendelkezésre áll, különösen a Fizetési és Elszámolási Rendszerek Bizottság (CPPS) és az Értékpapír-felügyelet Nemzetközi Szervezete (IOSCO) által kiadott, az adatszolgáltatási és adatösszesítési követelményekről szóló, a jogalany-azonosítókat az adatösszesítés eszközeként meghatározó jelentéssel való összhang biztosítása érdekében. Az ügynökön keresztül kereskedés esetében a kedvezményezettek az azon magánszemélyként vagy jogalanyként kell azonosítani, akinek a nevében a szerződést kötötték.
- (5) Figyelembe kell venni a harmadik országokban használt, és üzleti tevékenységük megkezdésekor a kereskedési adattárak által is alkalmazott megközelítést. A szerződő felek számára költséghatékony megoldás biztosítása, valamint a kereskedési adattárak számára a működési kockázat mérséklése érdekében ezért a jelentéstétel kezdő időpontját a származtatott termékek különböző kategóriái szerint fokozatosan kell bevezetni, kezdve legszabványosítottabb kategóriával, majd kiterjesztve a többi kategóriára. A 648/2012/EU rendelet hatálybalépésének napján, azt megelőzően vagy azt követően kötött származtatott ügyleteknek, amelyek a jelentéstétel kezdő időpontjában vagy azt követően lezártak, szabályozási szempontból nincs nagy jelentőségük. Mindazonáltal ezeket a 648/2012/EU rendelet 9. cikke (1) bekezdésének a) pontja értelmében be kell jelenteni. Ezekben az esetekben a hatékony és arányos jelentéstételi rendszer biztosítása érdekében, valamint a lezárt ügyletekre vonatkozó adatok rekonstrukciójának nehézségeit figyelembe véve hosszabb határidőt kell megállapítani az ilyen jelentéstételre.
- (6) Ez a rendelet az Európai Értékpapírpiaci Hatóság (EÉPH) által a Bizottságnak benyújtott végrehajtási technikai standardtervezeten alapul.
- (7) Az EÉPH az európai felügyeleti hatóság (Európai Értékpapírpiaci Hatóság) létrehozásáról szóló, 2010. november 24-i 1095/2010/EU európai parlamenti és tanácsi

⁽¹⁾ A Hivatalos Lapban még nem tették közzé.

⁽²⁾ HL L 201., 2012.7.27., 1. o.

rendelet ⁽¹⁾ 15. cikkével összhangban nyilvános konzultációkat folytatott e végrehajtási technikai standardtervezetek kapcsán, elemezte a lehetséges kapcsolódó költségeket és hasznokat, és kikérte az említett rendelet 37. cikke szerint létrehozott EÉPH Értékpapíripiaci Érdekviseleti Csoport véleményét,

ELFOGADTA EZT A RENDELETET:

1. cikk

A származtatott ügyletekre vonatkozó bejelentés formátuma

A 648/2012/EU rendelet 9. cikke szerinti bejelentésben foglalt információt az e rendelet mellékletében meghatározott formátumban kell megadni.

2. cikk

A származtatott ügyletekre vonatkozó bejelentés gyakorisága

Amennyiben a 648/2012/EU rendelet 11. cikkének (2) bekezdése úgy rendelkezik, a kereskedési adattárnak bejelentett ügyletek piaci értéken történő vagy modell alapú értékelését naponta kell elvégezni. Az e rendelet mellékletében, valamint a 648/2012/EU rendelet 9. cikkének (5) bekezdése alapján a kereskedési adattáraknak bejelentendő adatok minimális részleteit meghatározó szabályozási technikai standardokat létrehozó, felhatalmazáson alapuló jogi aktus mellékletében előírt egyéb jelentéstételi elemeket azok előfordulásakor, az ügylet megkötése, módosítása vagy lezárása tekintetében a 648/2012/EU rendelet 9. cikkében meghatározott határidő figyelembevételével kell bejelenteni.

3. cikk

Szerződő felek és egyéb jogalanyok azonosítása

(1) A bejelentésben jogalany-azonosítót kell alkalmazni a következők azonosítására:

- jogi személy kedvezményezett;
- bróker jogalany;
- központi szerződő fél;
- jogi személy klíringtag;
- jogalany szerződő fél;
- benyújtó jogalany;

(2) Amennyiben a jogalany-azonosító nem áll rendelkezésre, a bejelentésnek uniós szinten meghatározott olyan ideiglenes jogalany-azonosítót kell tartalmaznia, amely:

- egyedi;
- semleges;
- megbízható;
- nyílt forrású;
- méretezhető;
- hozzáférhető;
- ésszerű költségalapon rendelkezésre áll;

h) megfelelő irányítási keretrendszer alá tartozik.

(3) Ha sem jogalany-azonosító, sem ideiglenes jogalany-azonosító nem áll rendelkezésre, a bejelentésben az ISO 9362 szerinti vállalat-azonosító kódot kell alkalmazni, amennyiben rendelkezésre áll.

4. cikk

Származtatott ügyletek azonosítása

(1) A bejelentésben a származtatott ügyletet olyan egyedi termékazonosító használatával kell azonosítani, amely:

- egyedi;
- semleges;
- megbízható;
- nyílt forrású;
- méretezhető;
- hozzáférhető;
- ésszerű költségalapon rendelkezésre áll;
- megfelelő irányítási keretrendszer alá tartozik.

(2) Amennyiben nem létezik egyedi termékazonosító, a bejelentésben a származtatott ügyletet a hozzárendelt ISO 6166 ISIN kód vagy az alternatív eszközazonosító kód, valamint a megfelelő ISO 10962 CFI kód kombinációjának használatával kell azonosítani.

(3) Ha a (2) bekezdésben említett kombináció nem áll rendelkezésre, a származtatott ügylet típusát a következők alapján kell azonosítani:

- a származtatott termék kategóriáját a következők egyikeként kell azonosítani:
 - árúk;
 - hitel;
 - deviza;
 - részvény;
 - kamatláb;
 - egyéb.
- a származtatott ügylet-típust a következők egyikeként kell azonosítani:
 - különbözetre vonatkozó szerződések,
 - tőzsdén kívüli határidős kamatláb-megállapodások;
 - forward ügyletek;
 - határidős ügyletek;
 - opciók;
 - swapügyletek;
 - egyéb.
- az olyan származtatott termékek esetében, amelyek nem esnek a származtatott termékek egy konkrét kategóriájába vagy típusába, a bejelentést a származtatott termékek azon kategóriája vagy típusa alapján kell megtenni, amelyhez a származtatott ügylet a szerződő felek megegyezése szerint a leginkább hasonlít.

⁽¹⁾ HL L 331., 2010.12.15., 84. o.

5. cikk

A jelentéstétel kezdő időpontja

(1) A hitelderivatíva-ügyletek és a származtatott kamat-ügyletek bejelentését meg kell tenni:

- a) 2013. július 1-jéig, ha a származtatott termékek meghatározott kategóriájának vonatkozásában 2013. április 1-je előtt sor került a kereskedési adattár 648/2012/EU rendelet 55. cikke szerinti nyilvántartásba vételére;
 - b) 90 nappal azt követően, hogy sor került a kereskedési adattár a származtatott termékek adott kategóriájának vonatkozásában történő, a 648/2012/EU rendelet 55. cikke szerinti nyilvántartásba vételére, amennyiben a származtatott termékek meghatározott kategóriájának vonatkozásában 2013. április 1-jén vagy azt megelőzően nem került sor a kereskedési adattár nyilvántartásba vételére;
 - c) 2015. július 1-jéig, ha a származtatott termékek meghatározott kategóriájának vonatkozásában 2015. július 1-jéig nem került sor a kereskedési adattár 648/2012/EU rendelet 55. cikke szerinti nyilvántartásba vételére. A jelentéstételi kötelezettség ezen a napon kezdődik, az ügyleteket pedig az említett rendelet 9. cikke (3) bekezdésének megfelelően az EÉPH-nak kell bejelenteni, amíg a származtatott termékek meghatározott kategóriájának vonatkozásában sor kerül a kereskedési adattár nyilvántartásba vételére.
- (2) Az (1) bekezdésben nem említett származtatott ügyleteket be kell jelenteni:
- a) 2014. január 1-jéig, ha a származtatott termékek meghatározott kategóriájának vonatkozásában 2013. október 1-je előtt sor került a kereskedési adattár 648/2012/EU rendelet 55. cikke szerinti nyilvántartásba vételére;
 - b) 90 nappal azt követően, hogy sor került a kereskedési adattár a származtatott termékek egy adott kategóriájának vonatkozásában történő, a 648/2012/EU rendelet 55. cikke szerinti nyilvántartásba vételére, amennyiben a származtatott termékek meghatározott kategóriájának vonatkozásában 2013. október 1-jén vagy azt megelőzően nem került sor a kereskedési adattár nyilvántartásba vételére;

c) 2015. július 1-jéig, ha a származtatott termékek meghatározott kategóriájának vonatkozásában 2015. július 1-jéig nem került sor a kereskedési adattár 648/2012/EU rendelet 55. cikke szerinti nyilvántartásba vételére. A jelentéstételi kötelezettség ezen a napon kezdődik, az ügyleteket pedig az említett rendelet 9. cikke (3) bekezdésének megfelelően az EÉPH-nak kell bejelenteni, amíg a származtatott termékek meghatározott kategóriájának vonatkozásában sor kerül a kereskedési adattár nyilvántartásba vételére.

(3) A 2012. augusztus 16-án nem lezárt, és a jelentéstétel kezdő időpontjában még mindig nem lezárt származtatott ügyleteket a származtatott termékek adott kategóriájára vonatkozó jelentéstétel kezdő időpontjától számított 90 napon belül be kell jelenteni a kereskedési adattárnak.

(4) Azokat a származtatott ügyleteket, amelyek:

- a) megkötésére 2012. augusztus 16. előtt került sor, és amelyeket 2012. augusztus 16-án még nem zártak le, vagy
- b) amelyek megkötésére 2012. augusztus 16-án vagy azt követően került sor,

és amelyeket a jelentéstétel kezdő időpontjában vagy azt követően lezártak, a származtatott termékek adott kategóriájára vonatkozó jelentéstétel kezdő időpontjától számított 3 éven belül be kell jelenteni a kereskedési adattárnak.

(5) A jelentéstétel kezdő időpontját 180 nappal el kell halasztani a 648/2012/EU rendelet 9. cikkének (5) bekezdése alapján a kereskedési adattáraknak bejelentendő adatok minimális részleteit meghatározó szabályozási technikai standardokat létrehozó, felhatalmazáson alapuló jogi aktus 3. cikkében említett információ bejelentése céljából.

6. cikk

Hatálybalépés

Ez a rendelet az *Európai Unió Hivatalos Lapjában* való kihirdetését követő huszadik napon lép hatályba.

Ez a rendelet teljes egészében kötelező és közvetlenül alkalmazandó valamennyi tagállamban.

Kelt Brüsszelben, 2012. december 19-én.

a Bizottság részéről
az elnök

José Manuel BARROSO

MELLÉKLET

1. táblázat

A szerződő felek adatai

	Mező	Formátum
	Az ügylet szerződő felei	
1	A bejelentés időbélyegzője	ISO 8601 dátumformátum / UTC időformátum.
2	Szerződő fél azonosítója	Jogalany-azonosító (LEI) (20 alfanumerikus karakter), ideiglenes jogalany-azonosító (20 alfanumerikus karakter), BIC (11 alfanumerikus karakter) vagy ügyfélkód (50 alfanumerikus karakter)
3	A másik szerződő fél azonosítója	Jogalany-azonosító (LEI) (20 alfanumerikus karakter), ideiglenes jogalany-azonosító (20 alfanumerikus karakter), BIC (11 alfanumerikus karakter) vagy ügyfélkód (50 alfanumerikus karakter).
4	Szerződő fél neve	100 alfanumerikus karakter vagy üresen hagyva, ha a jogalany-azonosító (LEI) már tartalmazza
5	Szerződő fél letelepedési helye	500 alfanumerikus karakter vagy üresen hagyva, ha a jogalany-azonosító (LEI) már tartalmazza
6	A szerződő fél vállalati szektora	Taxonómia: A = a 2002/83/EK irányelvvel összhangban engedélyezett biztosító-intézet; C = a 2006/48/EK irányelvvel összhangban engedélyezett hitelintézet; F = a 2004/39/EK irányelv szerinti befektetési vállalkozás; I = a 73/239/EGK irányelvvel összhangban engedélyezett biztosító; L = a 2011/61/EU irányelvvel összhangban engedélyezett vagy nyilvántartásba vett, ABAK-ok által kezelt alternatív befektetési alap O = a 2003/41/EK irányelv 6. cikke a) pontjának megfelelő foglalkoztatói nyugellátást szolgáltató intézmények; R = a 2005/68/EK irányelvvel összhangban engedélyezett viszontbiztosító; U = a 2009/65/EK irányelvvel összhangban engedélyezett ÁÉKBV és kezelő társasága; vagy üresen hagyva, ha a jogalany-azonosító már tartalmazza, vagy nem pénzügyi szerződő fél esetében.
7	A szerződő fél pénzügyi vagy nem pénzügyi jellege	F=pénzügyi szerződő fél, N=nem pénzügyi szerződő fél.
8	Bróker azonosítója	Jogalany-azonosító (LEI) (20 alfanumerikus karakter), ideiglenes jogalany-azonosító (20 alfanumerikus karakter), BIC (11 alfanumerikus karakter) vagy ügyfélkód (50 alfanumerikus karakter).

	Mező	Formátum
	Az ügylet szerződő felei	
9	Bejelentő jogalany azonosítója	Jogalany-azonosító (LEI) (20 alfanumerikus karakter), ideiglenes jogalany-azonosító (20 alfanumerikus karakter), BIC (11 alfanumerikus karakter) vagy ügyléfkód (50 alfanumerikus karakter).
10	Klíringtag azonosítója	Jogalany-azonosító (LEI) (20 alfanumerikus karakter), ideiglenes jogalany-azonosító (20 alfanumerikus karakter), BIC (11 alfanumerikus karakter) vagy ügyléfkód (50 alfanumerikus karakter).
11	Kedvezményezett azonosítója	Jogalany-azonosító (LEI) (20 alfanumerikus karakter), ideiglenes jogalany-azonosító (20 alfanumerikus karakter), BIC (11 alfanumerikus karakter) vagy ügyléfkód (50 alfanumerikus karakter).
12	Kereskedési szerep	P=saját számlára, A=ügylékszámára.
13	Vétel/eladás jelzése	B=vevő, S=eladó.
14	Nem EGT-beli szerződő féllel folytatott kereskedés	Y=igen, N=nem.
15	Kereskedelmi tevékenységhez vagy likviditásfinanszírozáshoz közvetlenül kapcsolódik	Y=igen, N=nem.
16	Elszámolási értékhatár	Y=felette, N=alatta.
17	Az ügylet piaci értéke	Legfeljebb 20 numerikus karakter xxxx,yyyyy formátumban.
18	Az ügylet piaci értékének pénzneme	ISO 4217 pénznemkód, 3 alfabétikus karakter.
19	Értékelés napja	ISO 8601 dátumformátum.
20	Értékelés ideje	UTC időformátum
21	Értékelés típusa	M=piaci értéken / O=modell alapján.
22	Biztosítésközökkel való fedezettség	U=biztosítésközökkel nem fedezett, PC= biztosítésközökkel részben fedezett, OC=egyoldalúan fedezett vagy FC=teljes mértékben fedezett.
23	Biztosítésköz portfóliószinten	Y=igen, N=nem.
24	Biztosítésközökkel fedezett portfólió kódja	Legfeljebb 10 numerikus karakter
25	A biztosítésköz értéke	A nyújtott biztosítésköz teljes összegének értéke; legfeljebb 20 numerikus karakter xxxx,yyyyy formátumban.

	Mező	Formátum
	Az ügylet szerződő felei	
26	A biztosítékeszköz értékének pénzneme	A 25. rovat pénzneme; ISO 4217 pénznemkód, 3 alfabetikus karakter.

2. táblázat

Általános adatok

	Mező	Formátum	Érintett származtatott-ügylet-típusok
	2a. szakasz – ügylettípus		Minden ügylet
1	Használt taxonómia	A használt taxonómia azonosítása: U = [Európában elfogadott] termékazonosító I = ISIN/AII + CFI E = ideiglenes taxonómia	
2	Termékazonosító 1	Ha a taxonómia = U: Termékazonosító (UPI), meghatározásra vár Ha a taxonómia = I: ISIN vagy AII, 12 karakterből álló alfanumerikus kód Ha a taxonómia = E: Származtatott termék kategóriája: CO = áru CR = hitel CU = deviza EQ = részvény IR = kamatláb OT = egyéb	
3	Termékazonosító 2	Ha a taxonómia = U: Üres Ha a taxonómia = I: CFI, 6 karakterből álló alfabetikus kód Ha a taxonómia = E: A származtatott ügylet típusa: CD = különbözetre vonatkozó szerződések FR = határidős kamatláb-megállapodások FU = határidős ügyletek FW = forward ügyletek OP = opciók SW = Swap OT = egyéb	

	Mező	Formátum	Érintett származtatott- ügylet-típusok
4	Alapul szolgáló eszköz	ISIN (12 alfanumerikus karakter); LEI (20 alfanumerikus karakter); ideiglenes jogalany-azonosító (20 alfanumerikus karakter); UPI (meghatározásra vár); B = kosár; I = index.	
5	Nominális pénznem 1	ISO 4217 pénznemkód, 3 alfabetikus karakter.	
6	Nominális pénznem 2	ISO 4217 pénznemkód, 3 alfabetikus karakter.	
7	Teljesítés pénzneme	ISO 4217 pénznemkód, 3 alfabetikus karakter.	
	2b. szakasz – az ügylet részletei		Minden ügylet
8	Kereskedési azonosító	Legfeljebb 52 alfanumerikus karakter	
9	Az ügylet hivatkozási száma	Legfeljebb 40 karaktert tartalmazó alfanumerikus mező	
10	Végrehajtás helyszíne	ISO 10383 piacazonosító kód (MIC), 4 alfabetikus karakter. Adott esetben XOFF a tőzsdén kívül kereskedett jegyzett származtatott ügyletek, vagy XXXX az OTC származtatott ügyletek esetében.	
11	Tömörítés	Y = ha az ügylet tömörítés eredménye; N = ha az ügylet nem tömörítés eredménye.	
12	Ár / ráta	Legfeljebb 20 numerikus karakter xxxx,yyyyy formátumban.	
13	Árjelzés	Például ISO 4217 pénznemkód, 3 alfabetikus karakter, százalék.	
14	Nominális összeg	Legfeljebb 20 numerikus karakter xxxx,yyyyy formátumban.	
15	Árszorzó	Legfeljebb 10 numerikus karakter	
16	Mennyiség	Legfeljebb 10 numerikus karakter	
17	Előlegfizetés	Legfeljebb 10 numerikus karakter xxxx,yyyyy formátumban a bejelentő szerződő fél által teljesített fizetések esetében, és xxxx,yyyyy formátumban a bejelentő szerződő fél által kapott fizetések esetében.	
18	Teljesítés típusa	C=készpénz, P=fizikai, O=opcionális a szerződő fél számára.	
19	A végrehajtás időbélyegzője	ISO 8601 dátumformátum / UTC időformátum.	
20	Hatálybalépés napja	ISO 8601 dátumformátum.	
21	Lejárat napja	ISO 8601 dátumformátum.	

	Mező	Formátum	Érintett származtatott- ügylet-típusok
22	Lezárás napja	ISO 8601 dátumformátum.	
23	Elszámolás napja	ISO 8601 dátumformátum.	
24	Keretmegállapodás típusa	Szabad szöveg, legfeljebb 50 karaktert tartalmazó mező, a használt keretmegállapodás nevének azonosítására, ha van ilyen.	
25	Keretmegállapodás verziója	Év, xxxx.	
	2c. szakasz – kockázatmérséklés / bejelentés		Minden ügylet
26	A visszaigazolás időbélyegzője	ISO 8601 dátumformátum, UTC időformátum.	
27	Visszaigazolás módja	Y=nem elektronikusan visszaigazolt, N=nem visszaigazolt, E=elektronikusan visszaigazolt.	
	2d. szakasz – elszámolás		Minden ügylet
28	Elszámolási kötelezettség	Y=igen, N=nem.	
29	Elszámolva	Y=igen, N=nem.	
30	Az elszámolás időbélyegzője	ISO 8601 dátumformátum / UTC időformátum.	
31	Központi szerződő fél azonosítója	Jogalany-azonosító (LEI) (20 alfanumerikus karakter), vagy ha nem áll rendelkezésre, ideiglenes jogalany-azonosító (20 alfanumerikus karakter), vagy ha nem áll rendelkezésre BIC (11 alfanumerikus karakter)	
32	Csoporton belüli	Y=igen, N=nem.	
	2e. szakasz – kamatlábak		Származtatott kamatügyletek
33	Az 1. ág rögzített kamatlába	Numerikus karakterek xxxx,yyyy formátumban.	
34	A 2. ág rögzített kamatlába	Numerikus karakterek xxxx,yyyy formátumban.	
35	A rögzített kamat-számítási időszak napjainak száma	Tényleges/365, 30B/360 vagy egyéb.	
36	Rögzített láb –fizetési gyakoriság	Egy időszak egész szorzója, amely leírja, hogy a szerződő felek milyen gyakran teljesítenek egymásnak kifizetéseket, pl. 10D, 3M, 5Y.	
37	Változó kamatláb – fizetési gyakoriság	Egy időszak egész szorzója, amely leírja, hogy a szerződő felek milyen gyakran teljesítenek egymásnak kifizetéseket, pl. 10D, 3M, 5Y.	
38	A változó kamatláb ismételt megállapításának gyakorisága	D = egy időszak egész szorzója, amely leírja, hogy a szerződő felek milyen gyakran teljesítenek egymásnak kifizetéseket, pl. 10D, 3M, 5Y.	
39	Az 1. ág változó kamatlába	A változó kamatláb indexének neve, pl. 3M Euribor.	

	Mező	Formátum	Érintett származtatott- ügylet-típusok
40	A 2. ág változó kamatlába	A változó kamatláb indexének neve, pl. 3M Euribor.	
	2f. szakasz – deviza		Származtatott devizaügyletek
41	Pénznem 2	ISO 4217 pénznemkód, 3 alfabetikus karakter.	
42	Átváltási árfolyam 1	Legfeljebb 10 numerikus karakter xxxx,yyyyy formátumban.	
43	Forward átváltási árfolyam	Legfeljebb 10 numerikus karakter xxxx,yyyyy formátumban.	
44	Átváltási árfolyam alapja	Pl. EUR/USD vagy USD/EUR	
	2g. szakasz – áruk	Egyedi termékazonosító bejelentése esetén, amely tartalmazza az összes alábbi információt, erre nincs szükség, kivéve ha a 1227/2011/EU rendelet értelmében be kell jelenteni	Árúpiaci származtatott termékek
	Általános		
45	Árualap	AG = mezőgazdasági EN = energia FR = áruszállítás ME = fémek IN = index EV = környezeti EX = egzotikus	
46	Az áru részletei	<i>Mezőgazdasági</i> GO = gabona, olajos magvak DA = tejtermékek LI = állatállomány FO = erdészeti termékek SO = puha áruk <i>Energia</i> OI = olaj NG = földgáz CO = szén EL = villamos energia IE = energiaközi termékek <i>Fémek</i> PR = nemesfémek NP = nem nemesfémek <i>Környezet</i> WE = időjárás EM = kibocsátás	

	Mező	Formátum	Érintett származtatott- ügylet-típusok
	Energia		
47	Teljesítési pont vagy zóna	EIC-kód, 16 karakterből álló alfanumerikus kód	
48	Összekapcsolási pont	Szabad szöveg, legfeljebb 50 karaktert tartalmazó mező	
49	Terhelés típusa	Az 50–54. mező ismételtető szakasza, a napi teljesítési időszakoknak megfelelő termékteljesítési profilok azonosítására BL = alapterhelés PL = csúcsterhelés OP = völgyidőszak BH = Időblokk OT = egyéb	
50	Teljesítés kezdőnapja és időpontja	ISO 8601 dátumformátum / UTC időformátum.	
51	Teljesítés zárónapja és időpontja	ISO 8601 dátumformátum / UTC időformátum.	
52	Szerződéses kapacitás	Szabad szöveg, legfeljebb 50 karaktert tartalmazó mező	
53	Mennyiségi egység	10 numerikus karakter xxxx,yyyy formátumban.	
54	Ár / időintervallum mennyiségek	10 numerikus karakter xxxx,yyyy formátumban.	
	2h. szakasz – opciók		Opciót tartalmazó ügyletek
55	Opció típusa	P=eladási, C=vételi.	
56	Opció jellege (lehívása)	A=amerikai típusú opció, B=Bermuda-opció, E=európai típusú opció, S=ázsiai típusú opció.	
57	Lehívási ár (plafon/padló)	Legfeljebb 10 numerikus karakter xxxx,yyyy formátumban.	
	2i. szakasz Az ügylet módosítása		Minden ügylet
58	Intézkedés típusa	N = Új M = Módosítás, E = Hiba, C = Törlés, Z = Tömörítés, V = Értékelési frissítés, O = Egyéb.	
59	Az intézkedéstípus részletei	Szabad szöveg, legfeljebb 50 karaktert tartalmazó mező	