

ΕΚΤΕΛΕΣΤΙΚΟΣ ΚΑΝΟΝΙΣΜΟΣ (ΕΕ) 2017/105 ΤΗΣ ΕΠΙΤΡΟΠΗΣ

της 19ης Οκτωβρίου 2016

για την τροποποίηση του εκτελεστικού κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 1247/2012 για τον καθορισμό εκτελεστικών τεχνικών προτύπων όσον αφορά τον μορφότυπο και τη συχνότητα αναφορών συναλλαγών σε αρχεία καταγραφής συναλλαγών σύμφωνα με τον κανονισμό (ΕΕ) αριθ. 648/2012 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου για τα εξωχρηματιστηριακά παράγωγα, τους κεντρικούς αντισυμβαλλόμενους και τα αρχεία καταγραφής συναλλαγών

(Κείμενο που παρουσιάζει ενδιαφέρον για τον ΕΟΧ)

Η ΕΥΡΩΠΑΪΚΗ ΕΠΙΤΡΟΠΗ,

Έχοντας υπόψη τη Συνθήκη για τη λειτουργία της Ευρωπαϊκής Ένωσης,

Έχοντας υπόψη τον κανονισμό (ΕΕ) αριθ. 648/2012 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 4ης Ιουλίου 2012, για τα εξωχρηματιστηριακά παράγωγα, τους κεντρικούς αντισυμβαλλόμενους και τα αρχεία καταγραφής συναλλαγών ⁽¹⁾, και ιδίως το άρθρο 9 παράγραφος 6,

Εκτιμώντας τα ακόλουθα:

- (1) Ο εκτελεστικός κανονισμός (ΕΕ) αριθ. 1247/2012 της Επιτροπής ⁽²⁾ προβλέπει τη χρήση προσωρινών αναγνωριστικών κωδικών οντότητας, όταν δεν διατίθεται αναγνωριστικός κωδικός νομικής οντότητας. Προσφάτως κατέστη διαθέσιμη υποδομή που επιτρέπει την απόδοση αναγνωριστικών κωδικών νομικής οντότητας σε οντότητες, ενώ επίσης οι συμμετέχοντες στην αγορά έχουν εξοικειωθεί με τη χρήση αυτών των αναγνωριστικών κωδικών νομικής οντότητας. Ως εκ τούτου, οι αναγνωριστικοί κωδικοί νομικής οντότητας θα πρέπει πλέον να αποτελούν το μόνο επιτρεπόμενο μέσο αναγνώρισης των νομικών οντοτήτων.
- (2) Στην περίπτωση των συμβάσεων παραγώγων ανταλλαγής, είναι ιδιαίτερα πολύπλοκο να προσδιοριστεί εάν το αναφέρον αντισυμβαλλόμενο μέρος είναι αγοραστής ή πωλητής στη σύμβαση, καθώς οι εν λόγω συμβάσεις αφορούν την ανταλλαγή χρηματοπιστωτικών μέσων μεταξύ των μερών. Ως εκ τούτου, θα πρέπει να θεσπιστούν ειδικοί κανόνες ώστε να διασφαλιστεί ο ακριβής και συνεπής προσδιορισμός του ποιοι είναι οι αγοραστές και ποιοι είναι οι πωλητές στις συμβάσεις παραγώγων ανταλλαγής.
- (3) Προκειμένου να προσδιοριστούν τα πραγματικά ανοίγματα των αντισυμβαλλόμενων, οι αρμόδιες αρχές απαιτούν πλήρεις και ακριβείς πληροφορίες σχετικά με την παροχή ασφάλειας που ανταλλάσσουν αυτοί οι αντισυμβαλλόμενοι. Κατά συνέπεια, θα πρέπει να θεσπιστούν ειδικοί κανόνες που θα διασφαλίζουν μια συνεπή προσέγγιση όσον αφορά την υποβολή αναφορών σχετικά με την παροχή ασφάλειας για μια δεδομένη σύμβαση παραγώγων ή ένα δεδομένο χαρτοφυλάκιο.
- (4) Η ακριβής ταξινόμηση και αναγνώριση των παραγώγων είναι ουσιώδους σημασίας για την αποτελεσματική χρήση των δεδομένων και την έγκυρη ομαδοποίηση δεδομένων μεταξύ αρχείων καταγραφής συναλλαγών, και ως εκ τούτου, συμβάλλει στην επίτευξη των στόχων του Συμβουλίου Χρηματοπιστωτικής Σταθερότητας που ορίζονται στη μελέτη σκοπιμότητας σχετικά με την ομαδοποίηση δεδομένων του αρχείου καταγραφής συναλλαγών εξωχρηματιστηριακών παραγώγων ⁽³⁾ που δημοσιεύθηκε στις 19 Σεπτεμβρίου 2014. Συνεπώς, οι απαιτήσεις υποβολής αναφοράς που αφορούν την ταξινόμηση και την αναγνώριση των παραγώγων θα πρέπει να τροποποιηθούν, ώστε οι πληροφορίες αυτές να βρίσκονται στο σύνολό τους στη διάθεση των αρμόδιων αρχών.
- (5) Προκειμένου να επιτραπεί η υποβολή αναφορών για τους νέους τύπους συμβάσεων παραγώγων που έχουν καταστεί διαθέσιμοι και αποτελούν αντικείμενο διαπραγμάτευσης σε τακτική βάση, χάρη στην καινοτομία του χρηματοπιστωτικού τομέα, στον κατάλογο κατηγοριών συμβάσεων παραγώγων θα πρέπει να προστεθούν τα δικαιώματα προαίρεσης επί συμβάσεων ανταλλαγής (swaptions) και τα στοιχήματα επί ανοιγμάτων (spreadbets). Γενικότερα, λόγω της συνεχιζόμενης καινοτομίας του χρηματοπιστωτικού τομέα η οποία οδήγησε σε νέους τύπους συμβάσεων παραγώγων, είναι σημαντικό να διασφαλιστεί ότι οι νέοι τύποι συμβάσεων παραγώγων που δεν υπάγονται σε κάποια από τις υφιστάμενες κατηγορίες μπορούν ωστόσο να αποτελούν αντικείμενο υποβολής αναφοράς. Ως εκ τούτου, είναι σκόπιμο να διατηρηθεί η κατηγορία «άλλο» στην ταξινόμηση των τύπων συμβάσεων παραγώγων.
- (6) Εάν οι δύο αντισυμβαλλόμενοι δεν μπορούν να συμφωνήσουν σχετικά με το ποιος εκ των δύο θα πρέπει να δημιουργήσει ένα μοναδικό αναγνωριστικό συναλλαγής εντός της ταχθείσας προθεσμίας υποβολής αναφοράς, ενδέχεται να μην είναι εφικτή η ορθή αναγνώριση και συσχέτιση των δύο αναφορών που σχετίζονται με την ίδια συναλλαγή. Επομένως, είναι αναγκαίο να καθοριστούν κριτήρια για την παραγωγή μοναδικών αναγνωριστικών των συναλλαγών κατά τρόπο ώστε να αποφεύγεται η μέτρηση της ίδιας συναλλαγής δύο φορές.

⁽¹⁾ ΕΕ L 201 της 27.7.2012, σ. 1.

⁽²⁾ Εκτελεστικός κανονισμός (ΕΕ) αριθ. 1247/2012 της Επιτροπής, της 19ης Δεκεμβρίου 2012, για τη θέσπιση εκτελεστικών τεχνικών προτύπων όσον αφορά τον μορφότυπο και τη συχνότητα αναφορών συναλλαγών σε αρχεία καταγραφής συναλλαγών σύμφωνα με τον κανονισμό (ΕΕ) αριθ. 648/2012 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου για τα εξωχρηματιστηριακά παράγωγα, τους κεντρικούς αντισυμβαλλόμενους και τα αρχεία καταγραφής συναλλαγών (ΕΕ L 352 της 21.12.2012, σ. 20).

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

- (7) Οι αντισυμβαλλόμενοι ενδέχεται να αντιμετωπίσουν σημαντικές δυσχέρειες στη συλλογή όλων των συναφών πληροφοριών αναφορικά με τις συναλλαγές που είχαν ολοκληρωθεί πριν από την ημερομηνία έναρξης της υποχρέωσης υποβολής αναφοράς. Δεδομένης της απορρέουσας πολυπλοκότητας της αναφοράς περατωμένων συναλλαγών, καθώς και του γεγονότος ότι οι εν λόγω συναλλαγές δεν αυξάνουν τον συστηματικό κίνδυνο, η προθεσμία υποβολής αναφοράς για περατωμένες συναλλαγές θα πρέπει να παραταθεί από τα 3 στα 5 έτη από την ημερομηνία έναρξης της υποχρέωσης υποβολής αναφοράς.
- (8) Προκειμένου να εξασφαλιστεί πλήρης εναρμόνιση των δεδομένων που αναφέρονται στα αρχεία καταγραφής συναλλαγών και, επομένως, να επιτραπεί η συνεπής ερμηνεία και η ομαδοποίησή τους, θα πρέπει να αποσαφηνιστούν τα πρότυπα και οι μορφότυποι που πρέπει να χρησιμοποιούνται στις αναφορές συναλλαγών. Είναι επίσης σκόπιμο να τροποποιηθούν οι απαιτήσεις υποβολής αναφορών σε σχέση με τους μορφότυπους δεδομένων. Ως εκ τούτου, στους αντισυμβαλλόμενους και τα αρχεία καταγραφής συναλλαγών θα πρέπει να παραχωρηθεί επαρκές χρονικό περιθώριο ώστε να λάβουν όλα τα αναγκαία μέτρα συμμόρφωσης με τις τροποποιημένες απαιτήσεις.
- (9) Συνεπώς, ο εκτελεστικός κανονισμός (ΕΕ) αριθ. 1247/2012 θα πρέπει να τροποποιηθεί αναλόγως.
- (10) Ο παρών κανονισμός βασίζεται στα σχέδια εκτελεστικών τεχνικών προτύπων που υπέβαλε η Ευρωπαϊκή Αρχή Κινητών Αξιών και Αγορών (ΕΑΚΑΑ) στην Επιτροπή.
- (11) Σύμφωνα με το άρθρο 15 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 1095/2010 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου ⁽¹⁾, η ΕΑΚΑΑ διενήργησε ανοικτές διαβουλεύσεις όσον αφορά τα σχέδια εκτελεστικών τεχνικών προτύπων, προέβη σε ανάλυση του δυνητικού συναφούς κόστους/οφέλους και ζήτησε τη γνώμη της ομάδας συμφεροντούχων κινητών αξιών και αγορών που αναφέρεται στο άρθρο 37 του εν λόγω κανονισμού,

ΕΞΕΔΩΣΕ ΤΟΝ ΠΑΡΟΝΤΑ ΚΑΝΟΝΙΣΜΟ:

Άρθρο 1

Ο εκτελεστικός κανονισμός (ΕΕ) αριθ. 1247/2012 τροποποιείται ως εξής:

- 1) Το άρθρο 3 αντικαθίσταται από το ακόλουθο κείμενο:

«Άρθρο 3

Αναγνώριση αντισυμβαλλόμενων και άλλων οντοτήτων

Η αναφορά χρησιμοποιεί αναγνωριστικό κωδικό νομικής οντότητας για την αναγνώριση:

- α) δικαιούχου που είναι νομική οντότητα·
- β) χρηματομεσιτικής οντότητας·
- γ) κεντρικού αντισυμβαλλόμενου·
- δ) εκκαθαριστικού μέλους·
- ε) αντισυμβαλλόμενου που είναι νομική οντότητα·
- στ) υποβάλλουσας οντότητας.».

- 2) Προστίθενται τα ακόλουθα άρθρα 3α και 3β:

«Άρθρο 3α

Πλευρά αντισυμβαλλόμενου

1. Η πλευρά του αντισυμβαλλόμενου στη σύμβαση παραγώγων που αναφέρεται στο πεδίο 14 του πίνακα 1 του παραρτήματος καθορίζεται σύμφωνα με τις παραγράφους 2 έως 10.

2. Στην περίπτωση δικαιωμάτων προαίρεσης και δικαιωμάτων προαίρεσης επί συμβάσεων ανταλλαγής (swaptions), αναγνωρίζεται ως αγοραστής ο αντισυμβαλλόμενος που έχει το δικαίωμα να ασκήσει το δικαίωμα προαίρεσης και ως πωλητής ο αντισυμβαλλόμενος που πωλεί το δικαίωμα προαίρεσης και λαμβάνει την τιμή δικαιώματος (πριμ).

⁽¹⁾ Κανονισμός (ΕΕ) αριθ. 1095/2010 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 24ης Νοεμβρίου 2010, σχετικά με τη σύσταση Ευρωπαϊκής Εποπτικής Αρχής (Ευρωπαϊκή Αρχή Κινητών Αξιών και Αγορών), την τροποποίηση της απόφασης αριθ. 716/2009/ΕΚ και την κατάργηση της απόφασης 2009/77/ΕΚ (ΕΕ L 331 της 15.12.2010, σ. 84).

3. Στην περίπτωση συμβολαίων μελλοντικής εκπλήρωσης και προθεσμιακών συμβάσεων, εκτός αυτών που αφορούν συνάλλαγμα, ως αγοραστής αναγνωρίζεται ο αντισυμβαλλόμενος που αγοράζει το μέσο και ως πωλητής ο αντισυμβαλλόμενος που πωλεί το μέσο.
4. Στην περίπτωση συμβάσεων ανταλλαγής που αφορούν τίτλους, ως πωλητής αναγνωρίζεται ο αντισυμβαλλόμενος που φέρει τον κίνδυνο μεταβολής της τιμής του υποκείμενου τίτλου και εισπράττει το ποσό του τίτλου και ως πωλητής ο αντισυμβαλλόμενος που καταβάλλει το ποσό του τίτλου.
5. Στην περίπτωση συμβάσεων ανταλλαγής που σχετίζονται με επιτόκια ή δείκτες πληθωρισμού, ως αγοραστής αναγνωρίζεται ο αντισυμβαλλόμενος που καταβάλλει το σταθερό επιτόκιο και ως πωλητής ο αντισυμβαλλόμενος που εισπράττει το σταθερό επιτόκιο. Στην περίπτωση συμβάσεων ανταλλαγής κυμαινόμενων επιτοκίων διαφορετικής βάσης (basis swaps), ως αγοραστής αναγνωρίζεται ο αντισυμβαλλόμενος που καταβάλλει τη διαφορά τιμής (άνοιγμα) και ως πωλητής ο αντισυμβαλλόμενος που εισπράττει τη διαφορά τιμής (άνοιγμα).
6. Στην περίπτωση διασυναλλαγματικών συμβάσεων ανταλλαγής, καθώς και συμβάσεων ανταλλαγής και προθεσμιακών συμβάσεων που αφορούν νόμισμα, ως αγοραστής αναγνωρίζεται ο αντισυμβαλλόμενος που λαμβάνει το νόμισμα που εμφανίζεται πρώτο κατά την αλφαβητική κατάταξη σύμφωνα με το πρότυπο ISO 4217 του Διεθνούς Οργανισμού Τυποποίησης και ως πωλητής ο αντισυμβαλλόμενος που παραδίδει το συγκεκριμένο νόμισμα.
7. Στην περίπτωση συμβάσεων ανταλλαγής που αφορούν μερίσματα, ως αγοραστής αναγνωρίζεται ο αντισυμβαλλόμενος που εισπράττει τις αντίστοιχες πραγματικές καταβολές μερισμάτων και ως πωλητής ο αντισυμβαλλόμενος που καταβάλλει το μέρισμα και εισπράττει το σταθερό επιτόκιο.
8. Με εξαίρεση τα δικαιώματα προαίρεσης και τα δικαιώματα προαίρεσης επί συμβάσεων ανταλλαγής (swaptions), στην περίπτωση παράγωγων μέσων για τη μεταφορά πιστωτικού κινδύνου, ως αγοραστής αναγνωρίζεται ο αντισυμβαλλόμενος που αγοράζει την προστασία και ως πωλητής ο αντισυμβαλλόμενος που πωλεί την προστασία.
9. Στην περίπτωση συμβάσεων παραγώγων που αφορούν βασικά εμπορεύματα, ως αγοραστής αναγνωρίζεται ο αντισυμβαλλόμενος που λαμβάνει το εμπόρευμα που καθορίζεται στην αναφορά και ως πωλητής ο αντισυμβαλλόμενος που παραδίδει το εμπόρευμα.
10. Στην περίπτωση προθεσμιακών συμφωνιών επιτοκίου, ως αγοραστής αναγνωρίζεται ο αντισυμβαλλόμενος που καταβάλλει το σταθερό επιτόκιο και ως πωλητής ο αντισυμβαλλόμενος που εισπράττει το σταθερό επιτόκιο.

Άρθρο 3β

Παροχή πρόσθετης ασφάλειας

1. Το είδος της παροχής πρόσθετης ασφάλειας της σύμβασης παραγώγων που αναφέρεται στο πεδίο 21 του πίνακα 1 του παραρτήματος καθορίζεται από τον αναφέροντα αντισυμβαλλόμενο σύμφωνα με τις παραγράφους 2 έως 5.
2. Όταν δεν υπάρχει συμφωνία παροχής πρόσθετης ασφάλειας μεταξύ των αντισυμβαλλόμενων ή όταν η συμφωνία παροχής πρόσθετης ασφάλειας μεταξύ των αντισυμβαλλόμενων ορίζει ότι ο αναφέρων αντισυμβαλλόμενος δεν παρέχει ούτε αρχικό περιθώριο ούτε περιθώριο διαφορών αποτίμησης σε σχέση με τη σύμβαση παραγώγων, ως τύπος της παροχής πρόσθετης ασφάλειας της σύμβασης παραγώγου αναγνωρίζεται ο τύπος “μη εξασφαλισμένη”.
3. Εάν η συμφωνία παροχής πρόσθετης ασφάλειας μεταξύ των αντισυμβαλλόμενων ορίζει ότι ο αναφέρων αντισυμβαλλόμενος παρέχει κατά κανόνα μόνο περιθώρια διαφορών αποτίμησης σε σχέση με τη σύμβαση παραγώγων, ως τύπος της παροχής πρόσθετης ασφάλειας της σύμβασης παραγώγου αναγνωρίζεται ο τύπος “μερικώς εξασφαλισμένη”.
4. Εάν η συμφωνία παροχής πρόσθετης ασφάλειας μεταξύ των αντισυμβαλλόμενων ορίζει ότι ο αναφέρων αντισυμβαλλόμενος παρέχει αρχικό περιθώριο και, κατά κανόνα, παρέχει και περιθώρια διαφορών αποτίμησης και ότι ο άλλος αντισυμβαλλόμενος είτε παρέχει μόνο περιθώρια διαφορών αποτίμησης είτε δεν παρέχει κανένα περιθώριο σε σχέση με τη σύμβαση παραγώγων, ως τύπος της παροχής πρόσθετης ασφάλειας της σύμβασης παραγώγου αναγνωρίζεται ο τύπος “μονομερώς εξασφαλισμένη”.
5. Εάν η συμφωνία παροχής πρόσθετης ασφάλειας μεταξύ των αντισυμβαλλόμενων ορίζει ότι αμφότεροι οι αντισυμβαλλόμενοι παρέχουν αρχικό περιθώριο και, κατά κανόνα, παρέχουν περιθώρια διαφορών αποτίμησης σε σχέση με τη σύμβαση παραγώγων, ως τύπος της παροχής πρόσθετης ασφάλειας της σύμβασης παραγώγου αναγνωρίζεται ο τύπος “πλήρως εξασφαλισμένη”.

3) Το άρθρο 4 αντικαθίσταται από το ακόλουθο κείμενο:

«Άρθρο 4

Προσδιορισμός, αναγνώριση και ταξινόμηση των παραγώγων

1. Μια αναφορά θα πρέπει να προσδιορίζει ένα παράγωγο με βάση το είδος της σύμβασης και την κατηγορία στοιχείων ενεργητικού σύμφωνα με τις παραγράφους 2 και 3.

2. Το παράγωγο πρέπει να καθορίζεται στο πεδίο 1 του πίνακα 2 του παραρτήματος ως ένα από τα ακόλουθα είδη συμβάσεων:

- α) χρηματοοικονομική σύμβαση επί διαφοράς·
- β) προθεσμιακή συμφωνία επιτοκίου·
- γ) προθεσμιακή συμφωνία·
- δ) συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης·
- ε) σύμβαση δικαιώματος προαίρεσης·
- στ) συμφωνία στοιχηματισμού επί ανοιγμάτων (spreadbet)·
- ζ) σύμβαση ανταλλαγής·
- η) δικαιώματα προαίρεσης επί συμβάσεων ανταλλαγής·
- θ) άλλο.

3. Το παράγωγο πρέπει να καθορίζεται στο πεδίο 2 του πίνακα 2 του παραρτήματος ως ένα από τα ακόλουθα είδη συμβάσεων:

- α) συμβάσεις που αφορούν βασικά εμπορεύματα και δικαιώματα εκπομπής·
- β) συμβάσεις που αφορούν πιστώσεις·
- γ) συμβάσεις που αφορούν νομίσματα·
- δ) συμβάσεις που αφορούν ίδια κεφάλαια·
- ε) συμβάσεις που αφορούν επιτόκια.

4. Αν τα παράγωγα δεν εμπίπτουν σε μία από τις κατηγορίες στοιχείων ενεργητικού που αναφέρονται στην παράγραφο 3, οι αντισυμβαλλόμενοι προσδιορίζουν στην αναφορά την κατηγορία στοιχείων ενεργητικού που παρουσιάζει τη μεγαλύτερη ομοιότητα με το παράγωγο. Αμφότεροι οι αντισυμβαλλόμενοι οφείλουν να προσδιορίζουν την ίδια κατηγορία στοιχείων ενεργητικού.

5. Η σύμβαση παραγώγου πρέπει να προσδιορίζεται στο πεδίο 6 του πίνακα 2 του παραρτήματος, χρησιμοποιώντας κατά περίπτωση τα ακόλουθα, εφόσον υπάρχουν:

- α) έναν διεθνή αριθμό αναγνώρισης τίτλων (ISIN) κατά ISO 6166 ή εναλλακτικό αναγνωριστικό κωδικό του μέσου (AII), κατά περίπτωση, έως την ημερομηνία εφαρμογής της κατ' εξουσιοδότηση πράξης που εκδίδεται από την Επιτροπή σύμφωνα με το άρθρο 27 παράγραφος 3 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου (*).
- β) έναν αριθμό ISIN από την ημερομηνία εφαρμογής της κατ' εξουσιοδότηση πράξης που εκδίδεται από την Επιτροπή σύμφωνα με το άρθρο 27 παράγραφος 3 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014.

Αν χρησιμοποιείται κωδικός AII, τότε πρέπει να χρησιμοποιείται ο πλήρης κωδικός AII.

6. Ο πλήρης κωδικός AII που αναφέρεται στην παράγραφο 7 είναι το αποτέλεσμα του συνδυασμού των έξι ακόλουθων στοιχείων:

- α) του αναγνωριστικού κωδικού αγοράς (MIC) κατά ISO 10383 του τόπου διαπραγμάτευσης όπου το παράγωγο είναι αντικείμενο διαπραγμάτευσης, ο οποίος προσδιορίζεται με τη χρήση 4 αλφαριθμητικών χαρακτήρων·
- β) του κωδικού που ανατίθεται από τον τόπο της διαπραγμάτευσης και συνδέεται μοναδικά με ένα συγκεκριμένο υποκείμενο μέσο, καθώς και συγκεκριμένο τύπο διακανονισμού και λοιπά χαρακτηριστικά της σύμβασης, και προσδιορίζεται με τη χρήση έως 12 αλφαριθμητικών χαρακτήρων·

- γ) του μονοψήφιου αναγνωριστικού που προσδιορίζει εάν το μέσο αποτελεί δικαίωμα προαίρεσης ή συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης με χρήση του χαρακτήρα «Ο» όταν πρόκειται για δικαίωμα προαίρεσης και του χαρακτήρα «F» όταν πρόκειται για συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης·
- δ) του μονοψήφιου αναγνωριστικού που προσδιορίζει εάν το δικαίωμα προαίρεσης αφορά δικαίωμα αγοράς ή δικαίωμα πώλησης, με χρήση του χαρακτήρα «P» όταν πρόκειται για δικαίωμα πώλησης και του χαρακτήρα «C» όταν πρόκειται για δικαίωμα αγοράς· εάν το μέσο έχει χαρακτηριστεί ως συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης σύμφωνα με το στοιχείο γ), σημειώνεται με τον χαρακτήρα «F»·
- ε) της ημερομηνίας άσκησης ή λήξης της σύμβασης παραγώγου στη μορφή EEEE-MM-HH που ορίζεται στο πρότυπο ISO 8601·
- στ) της τιμής άσκησης του δικαιώματος προαίρεσης, που προσδιορίζεται με τη χρήση έως και 19 ψηφίων, συμπεριλαμβανομένων έως και πέντε δεκαδικών ψηφίων, και της οποίας το πρώτο και το τελευταίο ψηφίο δεν μπορούν να είναι μηδενικά. Ως διαχωριστής των δεκαδικών ψηφίων χρησιμοποιείται η υποδιαστολή. Δεν επιτρέπονται αρνητικές τιμές. Όταν το μέσο είναι συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης, η τιμή άσκησης συμπληρώνεται με μηδενικά.

7. Το παράγωγο ταξινομείται στο πεδίο 4 του πίνακα 2 του παραρτήματος χρησιμοποιώντας έναν κωδικό ταξινόμησης χρηματοπιστωτικού μέσου (CFI) κατά ISO 10692 για τα προϊόντα που αναγνωρίζονται με κωδικό ISIN ISO 6166 ή με κωδικό AII.

8. Τα παράγωγα για τα οποία δεν διατίθεται κωδικός ISIN ISO 6166 ή κωδικός AII ταξινομούνται με τη βοήθεια ενός ειδικά καθορισμένου κωδικού. Ο εν λόγω κωδικός είναι:

- α) μοναδικός·
- β) ουδέτερος·
- γ) αξιόπιστος·
- δ) προερχόμενος από ανοικτή πηγή·
- ε) κλιμακώσιμος·
- στ) προσβάσιμος·
- ζ) διαθέσιμος σε βάση εύλογου κόστους·
- η) υποκείμενος σε κατάλληλο πλαίσιο διακυβέρνησης.

9. Έως ότου εγκριθεί από την ΕΑΚΑΑ ο κωδικός που αναφέρεται στην παράγραφο 8, τα παράγωγα τα οποία δεν διαθέτουν κωδικό ISIN ISO 6166 ή κωδικό AII, ταξινομούνται με τη χρήση του κωδικού CFI ISO 10692.

(*) Κανονισμός (ΕΕ) αριθ. 600/2014 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 15ης Μαΐου 2014, για τις αγορές χρηματοπιστωτικών μέσων και για την τροποποίηση του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012 (ΕΕ L 173 της 12.6.2014, σ. 84).».

4) Προστίθενται τα ακόλουθα άρθρα 4α και 4β:

«Άρθρο 4α

Μοναδικός αναγνωριστικός κωδικός συναλλαγής

1. Μια αναφορά αναγνωρίζεται είτε μέσω ενός παγκόσμιου μοναδικού αναγνωριστικού κωδικού συναλλαγής που εγκρίνεται από την ΕΑΚΑΑ είτε, ελλείψει αυτού, μέσω ενός μοναδικού αναγνωριστικού κωδικού συναλλαγής που συμφωνείται μεταξύ των αντισυμβαλλόμενων.

2. Αν οι αντισυμβαλλόμενοι δεν συμφωνήσουν ως προς την οντότητα που είναι υπεύθυνη να δημιουργήσει τον μοναδικό αναγνωριστικό κωδικό συναλλαγής που πρόκειται να αποδοθεί στην αναφορά, οι αντισυμβαλλόμενοι καθορίζουν την οντότητα που είναι υπεύθυνη για τη δημιουργία ενός μοναδικού αναγνωριστικού κωδικού συναλλαγής σύμφωνα με τα παρακάτω:

- α) για τις συναλλαγές που εκτελούνται και εκκαθαρίζονται κεντρικά, ο μοναδικός αναγνωριστικός κωδικός συναλλαγής δημιουργείται κατά τη στιγμή της εκκαθάρισης από τον κεντρικό αντισυμβαλλόμενο για το εκκαθαριστικό μέλος. Ένας άλλος μοναδικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής δημιουργείται από το εκκαθαριστικό μέλος για τον αντισυμβαλλόμενο του·
- β) για τις συναλλαγές που εκτελούνται αλλά δεν εκκαθαρίζονται κεντρικά, ο μοναδικός αναγνωριστικός κωδικός συναλλαγής δημιουργείται από τον τόπο διαπραγμάτευσης όπου εκτελείται για το μέλος του·

- γ) για τις συναλλαγές που επιβεβαιώνονται και εκκαθαρίζονται κεντρικά, ο μοναδικός αναγνωριστικός κωδικός συναλλαγής δημιουργείται κατά τη στιγμή της εκκαθάρισης από τον κεντρικό αντισυμβαλλόμενο για το εκκαθαριστικό μέλος. Ένας άλλος μοναδικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής δημιουργείται από το εκκαθαριστικό μέλος για τον αντισυμβαλλόμενο του·
- δ) για τις συναλλαγές που έχουν επιβεβαιωθεί σε κεντρικό επίπεδο με ηλεκτρονικά μέσα, αλλά δεν έχουν εκκαθαριστεί σε κεντρικό επίπεδο, ο μοναδικός αναγνωριστικός κωδικός συναλλαγής δημιουργείται από την πλατφόρμα επιβεβαίωσης συναλλαγών κατά τη στιγμή της επιβεβαίωσης·
- ε) για όλες τις συναλλαγές εκτός εκείνων που αναφέρονται στα στοιχεία α) έως δ) ανωτέρω, ισχύουν τα ακόλουθα:
- i) όταν χρηματοοικονομικοί αντισυμβαλλόμενοι συναλλάσσονται με μη χρηματοοικονομικούς αντισυμβαλλόμενους, οι χρηματοοικονομικοί αντισυμβαλλόμενοι είναι αυτοί που δημιουργούν τον μοναδικό αναγνωριστικό κωδικό συναλλαγής·
- ii) όταν μη χρηματοοικονομικοί αντισυμβαλλόμενοι πάνω από το κατώφλι εκκαθάρισης συναλλαγών συναλλάσσονται με μη χρηματοοικονομικούς αντισυμβαλλόμενους κάτω από το κατώφλι εκκαθάρισης, οι μη χρηματοοικονομικοί αντισυμβαλλόμενοι πάνω από το κατώφλι εκκαθάρισης είναι αυτοί που δημιουργούν τον μοναδικό αναγνωριστικό κωδικό συναλλαγής·
- iii) για όλες τις συναλλαγές εκτός εκείνων που αναφέρονται στα σημεία i) και ii) ανωτέρω, ο πωλητής είναι αυτός που δημιουργεί τον μοναδικό αναγνωριστικό κωδικό συναλλαγής.
3. Ο αντισυμβαλλόμενος που δημιουργεί τον μοναδικό αναγνωριστικό κωδικό συναλλαγής τον ανακοινώνει εγκαίρως στον έτερο αντισυμβαλλόμενο, ούτως ώστε ο τελευταίος να είναι σε θέση να τηρήσει την υποχρέωση υποβολής αναφοράς.

Άρθρο 4β

Τόπος εκτέλεσης

Ο τόπος εκτέλεσης της σύμβασης παραγώγων προσδιορίζεται στο πεδίο 15 του πίνακα 2 του παραρτήματος ως ακολούθως:

- α) έως την ημερομηνία εφαρμογής της κατ' εξουσιοδότηση πράξης που εκδίδεται από την Επιτροπή σύμφωνα με το άρθρο 27 παράγραφος 3 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014:
- i) για έναν τόπο εκτέλεσης εντός της Ένωσης, ο αναγνωριστικός κωδικός αγοράς (MIC) κατά ISO 10383 που δημοσιεύεται στον δικτυακό τόπο της ΕΑΚΑΑ, στο μητρώο που δημιουργείται με βάση τις πληροφορίες που παρέχονται από τις αρμόδιες αρχές σύμφωνα με το άρθρο 13 παράγραφος 2 του κανονισμού (ΕΚ) αριθ. 1287/2006 (*).
- ii) για έναν τόπο εκτέλεσης εκτός της Ένωσης, ο κωδικός MIC ISO 10383 που περιλαμβάνεται στον κατάλογο κωδικών MIC που τηρείται και επικαιροποιείται από τον ISO και δημοσιεύεται στον δικτυακό τόπο του ISO·
- β) από την ημερομηνία εφαρμογής της κατ' εξουσιοδότηση πράξης που εκδίδεται από την Επιτροπή σύμφωνα με το άρθρο 27 παράγραφος 3 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014, ο κωδικός MIC ISO 10383.

(*) Κανονισμός (ΕΚ) αριθ. 1287/2006 της Επιτροπής, της 10ης Αυγούστου 2006, για την εφαρμογή της οδηγίας 2004/39/ΕΚ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου όσον αφορά τις υποχρεώσεις τήρησης αρχείων για τις επιχειρήσεις επενδύσεων, τη γνωστοποίηση συναλλαγών, τη διαφάνεια της αγοράς, την εισαγωγή χρηματοπιστωτικών μέσων προς διαπραγμάτευση, καθώς και τους ορισμούς που ισχύουν για τους σκοπούς της οδηγίας αυτής (ΕΕ L 241 της 2.9.2006, σ. 1).».

- 5) Στο άρθρο 5, η παράγραφος 4 αντικαθίσταται από το ακόλουθο κείμενο:

«4. Οι ακόλουθες συμβάσεις παραγώγων που δεν είναι άληκτες κατά την ημερομηνία έναρξης της υποχρέωσης υποβολής αναφορών για μια συγκεκριμένη κατηγορία παραγώγων, δηλώνονται σε αρχείο καταγραφής συναλλαγών εντός πέντε ετών από την ημερομηνία αυτή:

- α) συμβάσεις παραγώγων που τέθηκαν σε ισχύ πριν από τις 16 Αυγούστου 2012 και παρέμεναν άληκτες στις 16 Αυγούστου 2012·
- β) συμβάσεις παραγώγων που τέθηκαν σε ισχύ στις ή μετά τις 16 Αυγούστου 2012.».

- 6) Το παράρτημα αντικαθίσταται από το κείμενο που περιλαμβάνεται στο παράρτημα του παρόντος κανονισμού.

Άρθρο 2

Ο παρών κανονισμός τίθεται σε ισχύ την εικοστή ημέρα από τη δημοσίευσή του στην *Επίσημη Εφημερίδα της Ευρωπαϊκής Ένωσης*.

Εφαρμόζεται από την 1η Νοεμβρίου 2017, με εξαίρεση το άρθρο 1 παράγραφος 5, το οποίο εφαρμόζεται από την ημερομηνία έναρξης ισχύος του.

Ο παρών κανονισμός είναι δεσμευτικός ως προς όλα τα μέρη του και εφαρμόζεται άμεσα σε κάθε κράτος μέλος.

Βρυξέλλες, 19 Οκτωβρίου 2016.

Για την Επιτροπή
Ο Πρόεδρος
Jean-Claude JUNCKER

ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ

«ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ

Πίνακας 1

Δεδομένα αντισυμβαλλόμενου

	Πεδίο	Μορφότυπος
	Συμβαλλόμενα μέρη	
1	Χρονοσφραγίδα αναφοράς	Ημερομηνία κατά ISO 8601 σε μορφότυπο EEEE-MM-HH και ώρα σε μορφότυπο συντονισμένης παγκόσμιας ώρας (UTC) ωω:λλ:δδΖ
2	Αναγνωριστικός κωδικός αναφέρο- ντος αντισυμβαλλόμενου	Αναγνωριστικός κωδικός νομικής οντότητας (LEI) κατά ISO 17442, μήκους 20 αλ- φαριθμητικών χαρακτήρων.
3	Τύπος αναγνωριστικού κωδικού του άλλου αντισυμβαλλόμενου	“LEI” για τον αναγνωριστικό κωδικό νομικής οντότητας (LEI) κατά ISO 17442 “CLC” για τον κωδικό πελάτη
4	Αναγνωριστικός κωδικός του άλ- λου αντισυμβαλλόμενου	Αναγνωριστικός κωδικός νομικής οντότητας (LEI) κατά ISO 17442, μήκους 20 αλ- φαριθμητικών χαρακτήρων. Κωδικός πελάτη (έως 50 αλφαριθμητικά ψηφία).
5	Χώρα του άλλου αντισυμβαλλό- μενου	ISO 3166- Κωδικός χώρας 2 χαρακτήρων
6	Εταιρικός τομέας του αναφέρο- ντος αντισυμβαλλόμενου	<p>Ταξινόμηση για χρηματοοικονομικούς αντισυμβαλλόμενους:</p> <p>A = ασφαλιστική επιχείρηση που έχει άδεια λειτουργίας σύμφωνα με την οδηγία 2009/138/ΕΚ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου ⁽¹⁾</p> <p>C = πιστωτικό ίδρυμα που έχει άδεια λειτουργίας σύμφωνα με την οδηγία 2013/36/ΕΚ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου ⁽²⁾</p> <p>F = επιχείρηση επενδύσεων που έχει άδεια λειτουργίας σύμφωνα με την οδηγία 2004/39/ΕΕ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου ⁽³⁾</p> <p>I = ασφαλιστική επιχείρηση που έχει άδεια λειτουργίας σύμφωνα με την οδηγία 2009/138/ΕΚ</p> <p>L = οργανισμός εναλλακτικών επενδύσεων υπό τη διεύθυνση διαχειριστών οργανισμών εναλλακτικών επενδύσεων (ΔΟΕΕ) που έχουν άδεια λειτουργίας ή είναι εγγεγραμμένοι σύμφωνα με την οδηγία 2011/61/ΕΕ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου ⁽⁴⁾</p> <p>O = ίδρυμα επαγγελματικών συνταξιοδοτικών παροχών κατά την έννοια του άρθρου 6 στοιχείο α) της οδηγίας 2003/41/ΕΚ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου ⁽⁵⁾</p> <p>R = ανασφαλιστική επιχείρηση που έχει άδεια λειτουργίας σύμφωνα με την οδηγία 2009/138/ΕΚ</p> <p>U = οργανισμοί συλλογικών επενδύσεων σε κινητές αξίες (ΟΣΕΚΑ) και εταιρεία διαχείρισης αυτών, που έχουν άδεια λειτουργίας σύμφωνα με την οδηγία 2009/65/ΕΚ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου ⁽⁶⁾</p> <p>Ταξινόμηση για μη χρηματοοικονομικούς αντισυμβαλλόμενους. Οι ακόλουθες κατηγορίες αντιστοιχούν στα κύρια τμήματα της στατιστικής ταξινόμησης των οικονομικών δραστηριοτήτων στην Ευρωπαϊκή Κοινότητα (NACE) όπως ορίζεται στον κανονισμό (ΕΚ) αριθ. 1893/2006 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου ⁽⁷⁾</p> <p>1 = Γεωργία, δασοκομία και αλιεία</p> <p>2 = Ορυχεία και λατομεία</p> <p>3 = Μεταποιητικές δραστηριότητες</p> <p>4 = Παροχή ηλεκτρικού ρεύματος, φυσικού αερίου, ατμού και κλιματισμού</p>

	Πεδίο	Μορφότυπος
		<p>5 = Παροχή νερού, επεξεργασία λυμάτων, διαχείριση αποβλήτων και δραστηριότητες εξυγίανσης</p> <p>6 = Κατασκευές</p> <p>7 = Χονδρικό και λιανικό εμπόριο, επισκευή μηχανοκίνητων οχημάτων και μοτοσυκλετών</p> <p>8 = Μεταφορά και αποθήκευση</p> <p>9 = Δραστηριότητες υπηρεσιών παροχής καταλύματος και υπηρεσιών εστίασης</p> <p>10 = Ενημέρωση και επικοινωνία</p> <p>11 = Χρηματοπιστωτικές και ασφαλιστικές δραστηριότητες</p> <p>12 = Διαχείριση ακίνητης περιουσίας</p> <p>13 = Επαγγελματικές, επιστημονικές και τεχνικές δραστηριότητες</p> <p>14 = Διοικητικές δραστηριότητες και δραστηριότητες υποστήριξης</p> <p>15 = Δημόσια διοίκηση και άμυνα, υποχρεωτική κοινωνική ασφάλιση</p> <p>16 = Εκπαίδευση</p> <p>17 = Δραστηριότητες σχετικές με την ανθρώπινη υγεία και την κοινωνική μέριμνα</p> <p>18 = Τέχνες, διασκέδαση και ψυχαγωγία</p> <p>19 = Άλλες δραστηριότητες παροχής υπηρεσιών</p> <p>20 = Δραστηριότητες νοικοκυριών ως εργοδοτών· μη διαφοροποιημένες δραστηριότητες νοικοκυριών, που αφορούν την παραγωγή αγαθών –και υπηρεσιών– για ίδια χρήση</p> <p>21 = Δραστηριότητες ετερόδικων οργανισμών και φορέων</p> <p>Όταν αναφέρονται περισσότερες από μία δραστηριότητες, απαριθμήστε τους κωδικούς κατά σειρά προτεραιότητας με βάση τη σχετική σπουδαιότητα των αντίστοιχων δραστηριοτήτων, διαχωρίζοντάς τους με “-”.</p> <p>Αφήστε κενό στην περίπτωση κεντρικών αντισυμβαλλόμενων και άλλων τύπων αντισυμβαλλόμενων, σύμφωνα με το άρθρο 1 παράγραφος 5 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012.</p>
7	Φύση του αναφέροντος αντισυμβαλλόμενου	<p>F = Χρηματοοικονομικός αντισυμβαλλόμενος</p> <p>N = Μη χρηματοοικονομικός αντισυμβαλλόμενος</p> <p>C = Κεντρικός αντισυμβαλλόμενος</p> <p>O = Άλλο</p>
8	Αναγνωριστικός κωδικός χρηματομεσίτη	Αναγνωριστικός κωδικός νομικής οντότητας (LEI) κατά ISO 17442, μήκους 20 αλφαριθμητικών χαρακτήρων.
9	Αναγνωριστικός κωδικός οντότητας που υποβάλλει την αναφορά	Αναγνωριστικός κωδικός νομικής οντότητας (LEI) κατά ISO 17442, μήκους 20 αλφαριθμητικών χαρακτήρων
10	Αναγνωριστικός κωδικός εκκαθαριστικού μέλους	Αναγνωριστικός κωδικός νομικής οντότητας (LEI) κατά ISO 17442, μήκους 20 αλφαριθμητικών χαρακτήρων
11	Τύπος αναγνωριστικού κωδικού δικαιούχου	<p>“LEI” για τον αναγνωριστικό κωδικό νομικής οντότητας (LEI) κατά ISO 17442</p> <p>“CLC” για τον κωδικό πελάτη</p>
12	Αναγνωριστικός κωδικός δικαιούχου	Αναγνωριστικός κωδικός νομικής οντότητας (LEI) κατά ISO 17442, μήκους 20 αλφαριθμητικών χαρακτήρων ή κωδικός πελάτη μήκους έως 50 αλφαριθμητικών χαρακτήρων σε περίπτωση που ο πελάτης δεν είναι επιλέξιμος για αναγνωριστικό κωδικό νομικής οντότητας

	Πεδίο	Μορφότυπος
13	Ιδιότητα διαπραγματευτή	P = Κύριος/Εντολέας A = Αντιπρόσωπος/Εντολοδόχος
14	Πλευρά αντισυμβαλλόμενου	B = Αγοραστής S = Πωλητής Συμπληρώνεται σύμφωνα με το άρθρο 3α
15	Άμεσα συνδεδεμένη με εμπορική δραστηριότητα ή με δραστηριότητα χρηματοδότησης ταμειακών διαθεσίμων	Y = Ναι N = Όχι
16	Κατώφλι εκκαθάρισης	Y = Πάνω από το κατώφλι N = Κάτω από το κατώφλι
17	Αξία της σύμβασης	Έως 20 αριθμητικοί χαρακτήρες, συμπεριλαμβανομένων δεκαδικών. Το σύμβολο των δεκαδικών αριθμών δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας. Εάν υπάρχει, τότε εμφανίζεται με τη μορφή υποδιαστολής. Το αρνητικό πρόσημο, εάν χρησιμοποιείται, δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας.
18	Νόμισμα αξίας	Κωδικός νομίσματος ISO 4217, 3 αλφαβητικοί χαρακτήρες
19	Χρονοσφραγίδα αποτίμησης	Ημερομηνία κατά ISO 8601 σε μορφότυπο EEEE-MM-HH και ώρα σε μορφότυπο συντονισμένης παγκόσμιας ώρας (UTC) ωω:λλ:δδΖ
20	Τύπος αποτίμησης	M = βάσει τρεχουσών τιμών αγοράς O = βάσει υποδείγματος θεωρητικών τιμών C = αποτίμηση κεντρικού αντισυμβαλλόμενου.
21	Παροχή πρόσθετης ασφάλειας	U = μη εξασφαλισμένη PC = μερικώς εξασφαλισμένη OC = μονομερώς εξασφαλισμένη FC = πλήρως εξασφαλισμένη Συμπληρώνεται σύμφωνα με το άρθρο 3β
22	Χαρτοφυλάκιο πρόσθετης ασφάλειας	Y = Ναι N = Όχι
23	Κωδικός χαρτοφυλακίου πρόσθετης ασφάλειας	Μήκους έως 52 αλφαριθμητικών χαρακτήρων, συμπεριλαμβανομένων των εξής τεσσάρων ειδικών χαρακτήρων: “. - _” Δεν επιτρέπονται ειδικοί χαρακτήρες στην αρχή και στο τέλος του κωδικού. Δεν επιτρέπονται κενά διαστήματα.
24	Αρχικό περιθώριο που παρασχέθηκε	Έως 20 αριθμητικοί χαρακτήρες, συμπεριλαμβανομένων δεκαδικών. Το σύμβολο των δεκαδικών αριθμών δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας. Εάν υπάρχει, τότε εμφανίζεται με τη μορφή υποδιαστολής.
25	Νόμισμα του αρχικού περιθωρίου που παρασχέθηκε	Κωδικός νομίσματος ISO 4217, 3 αλφαβητικοί χαρακτήρες

	Πεδίο	Μορφότυπος
26	Περιθώριο διαφορών αποτίμησης που παρασχέθηκε	Έως 20 αριθμητικοί χαρακτήρες, συμπεριλαμβανομένων δεκαδικών. Το σύμβολο των δεκαδικών αριθμών δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας. Εάν υπάρχει, τότε εμφανίζεται με τη μορφή υποδιαστολής.
27	Νόμισμα των περιθωρίων διαφορών αποτίμησης που παρασχέθηκαν	Κωδικός νομίσματος ISO 4217, 3 αλφαβητικοί χαρακτήρες
28	Αρχικό περιθώριο που ελήφθη	Έως 20 αριθμητικοί χαρακτήρες, συμπεριλαμβανομένων δεκαδικών. Το σύμβολο των δεκαδικών αριθμών δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας. Εάν υπάρχει, τότε εμφανίζεται με τη μορφή υποδιαστολής.
29	Νόμισμα του αρχικού περιθωρίου που ελήφθη	Κωδικός νομίσματος ISO 4217, 3 αλφαβητικοί χαρακτήρες
30	Περιθώριο διαφορών αποτίμησης που ελήφθη	Έως 20 αριθμητικοί χαρακτήρες, συμπεριλαμβανομένων δεκαδικών. Το σύμβολο των δεκαδικών αριθμών δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας. Εάν υπάρχει, τότε εμφανίζεται με τη μορφή υποδιαστολής.
31	Νόμισμα των περιθωρίων διαφορών αποτίμησης που ελήφθησαν	Κωδικός νομίσματος ISO 4217, 3 αλφαβητικοί χαρακτήρες
32	Πλεονάζουσα πρόσθετη ασφάλεια που παρασχέθηκε	Έως 20 αριθμητικοί χαρακτήρες, συμπεριλαμβανομένων δεκαδικών. Το σύμβολο των δεκαδικών αριθμών δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας. Εάν υπάρχει, τότε εμφανίζεται με τη μορφή υποδιαστολής.
33	Νόμισμα πλεονάζουσας πρόσθετης ασφάλειας που παρασχέθηκε	Κωδικός νομίσματος ISO 4217, 3 αλφαβητικοί χαρακτήρες
34	Πλεονάζουσα πρόσθετη ασφάλεια που ελήφθη	Έως 20 αριθμητικοί χαρακτήρες, συμπεριλαμβανομένων δεκαδικών. Το σύμβολο των δεκαδικών αριθμών δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας. Εάν υπάρχει, τότε εμφανίζεται με τη μορφή υποδιαστολής.
35	Νόμισμα πλεονάζουσας πρόσθετης ασφάλειας που ελήφθη	Κωδικός νομίσματος ISO 4217, 3 αλφαβητικοί χαρακτήρες

- (¹) Οδηγία 2009/138/ΕΚ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 25ης Νοεμβρίου 2009, σχετικά με την ανάληψη και την άσκηση δραστηριοτήτων ασφάλισης και αντασφάλισης (Φερεγγυότητα II) (ΕΕ L 335 της 17.12.2009, σ. 1).
- (²) Οδηγία 2013/36/ΕΕ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 26ης Ιουνίου 2013, σχετικά με την πρόσβαση στη δραστηριότητα πιστωτικών ιδρυμάτων και την προληπτική εποπτεία πιστωτικών ιδρυμάτων και επιχειρήσεων επενδύσεων, για την τροποποίηση της οδηγίας 2002/87/ΕΚ και για την κατάργηση των οδηγιών 2006/48/ΕΚ και 2006/49/ΕΚ (ΕΕ L 176 της 27.6.2013, σ. 338).
- (³) Οδηγία 2004/39/ΕΚ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 21ης Απριλίου 2004, για τις αγορές χρηματοπιστωτικών μέσων, για την τροποποίηση των οδηγιών 85/611/ΕΟΚ και 93/6/ΕΟΚ του Συμβουλίου και της οδηγίας 2000/12/ΕΚ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου και για την κατάργηση της οδηγίας 93/22/ΕΟΚ του Συμβουλίου (ΕΕ L 145 της 30.4.2004, σ. 1).
- (⁴) Οδηγία 2011/61/ΕΕ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 8ης Ιουνίου 2011, σχετικά με τους διαχειριστές οργανισμών εναλλακτικών επενδύσεων και για την τροποποίηση των οδηγιών 2003/41/ΕΚ και 2009/65/ΕΚ και των κανονισμών (ΕΚ) αριθ. 1060/2009 και (ΕΕ) αριθ. 1095/2010 (ΕΕ L 174 της 1.7.2011, σ. 1).
- (⁵) Οδηγία 2003/41/ΕΚ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 3ης Ιουνίου 2003, για τις δραστηριότητες και την εποπτεία των ιδρυμάτων που προσφέρουν υπηρεσίες επαγγελματικών συνταξιοδοτικών παροχών (ΕΕ L 235 της 23.9.2003, σ. 10).
- (⁶) Οδηγία 2009/65/ΕΚ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 13ης Ιουλίου 2009, για τον συντονισμό των νομοθετικών, κανονιστικών και διοικητικών διατάξεων σχετικά με ορισμένους οργανισμούς συλλογικών επενδύσεων σε κινητές αξίες (ΟΣΕΚΑ) (ΕΕ L 302 της 17.11.2009, σ. 32).
- (⁷) Κανονισμός (ΕΚ) αριθ. 1893/2006 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 20ής Δεκεμβρίου 2006, για τη θέσπιση της στατιστικής ταξινόμησης των οικονομικών δραστηριοτήτων NACE αναθεώρησης 2 και για την τροποποίηση του κανονισμού (ΕΟΚ) αριθ. 3037/90 του Συμβουλίου και ορισμένων κανονισμών των Ευρωπαϊκών Κοινοτήτων σχετικών με ειδικούς στατιστικούς τομείς (ΕΕ L 393 της 30.12.2006, σ. 1).

Πίνακας 2

Κοινά δεδομένα

	Πεδίο	Μορφότυπος	Ισχύοντες τύποι σύμβασης παραγώγων
	Τμήμα 2α — Τύπος σύμβασης		Όλες οι συμβάσεις
1	Είδος σύμβασης	CD = Χρηματοοικονομικές συμβάσεις επί διαφορών FR = Προθεσμιακές συμφωνίες επιτοκίου FU = Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης FW = Προθεσμιακές συμφωνίες OP = Δικαίωμα προαίρεσης SB = Στοιχηματισμός επί ανοιγμάτων (spreadbet) SW = σύμβαση ανταλλαγής ST = Δικαίωμα προαίρεσης επί συμβάσεων ανταλλαγής (swaption) OT = Άλλο	
2	Κατηγορίες στοιχείων ενεργητικού	CO = Βασικά εμπορεύματα και δικαιώματα εκπομπής CR = Πίστωση CU = Συνάλλαγμα EQ = Μετοχές IR = Επιτόκιο	
	Τμήμα 2β — Στοιχεία σύμβασης		Όλες οι συμβάσεις
3	Τύπος ταξινόμησης προϊόντος	C = Κωδικός ταξινόμησης χρηματοπιστωτικού μέσου (CFI) U = Αναγνωριστικός κωδικός προϊόντος (UPI)	
4	Ταξινόμηση προϊόντος	CFI κατά ISO 10692, 6ψήφιος αλφαβητικός κωδικός Εγκεκριμένος UPI	
5	Τύπος αναγνώρισης προϊόντος	Προσδιορισμός εφαρμοστέου τύπου αναγνώρισης: I = Κωδικός ISIN A = Κωδικός AII	
6	Αναγνώριση προϊόντος	Για τον τύπο αναγνωριστικού κωδικού προϊόντος I: κωδικός ISIN κατά ISO 6166, μήκους 12 αλφαριθμητικών χαρακτήρων Για τον τύπο αναγνωριστικού κωδικού προϊόντος A: πλήρης κωδικός AII σύμφωνα με το άρθρο 4 παράγραφος 8	

	Πεδίο	Μορφότυπος	Ισχύοντες τύποι σύμβασης παραγώγων
7	Τύπος αναγνώρισης υποκείμενου στοιχείου	I = Κωδικός ISIN A = Κωδικός ΑΠ U = Αναγνωριστικός κωδικός προϊόντος (UPI) B = Καλάθι X = Δείκτης	
8	Αναγνώριση υποκείμενου στοιχείου	Για τον τύπο αναγνώρισης υποκείμενου στοιχείου I: κωδικός ISIN κατά ISO 6166, μήκους 12 αλφαριθμητικών χαρακτήρων Για τον τύπο αναγνώρισης υποκείμενου στοιχείου A: πλήρης κωδικός ΑΠ σύμφωνα με το άρθρο 4 παράγραφος 8 Για τον τύπο αναγνώρισης υποκείμενου στοιχείου U: κωδικός UPI Για τον τύπο αναγνώρισης υποκείμενου στοιχείου B: όλα τα επιμέρους στοιχεία αναγνώρισης μέσω του κωδικού ISIN κατά ISO 6166 ή πλήρης κωδικός ΑΠ σύμφωνα με το άρθρο 4 παράγραφος 8. Οι αναγνωριστικοί κωδικοί των επιμέρους στοιχείων διαχωρίζονται μεταξύ τους με παύλα "-". Για τον τύπο αναγνώρισης υποκείμενου στοιχείου X: κωδικός ISIN κατά ISO 6166, εφόσον υπάρχει, ειδάλτως το πλήρες όνομα του δείκτη, όπως αυτό αποδίδεται από τον πάροχο του δείκτη	
9	Ονομαστικό νόμισμα 1	Κωδικός νομίσματος ISO 4217, 3 αλφαριθμητικοί χαρακτήρες	
10	Ονομαστικό νόμισμα 2	Κωδικός νομίσματος ISO 4217, 3 αλφαριθμητικοί χαρακτήρες	
11	Παραδοτέο νόμισμα	Κωδικός νομίσματος ISO 4217, 3 αλφαριθμητικοί χαρακτήρες	
	Τμήμα 2γ — Λεπτομερή στοιχεία για τη συναλλαγή		Όλες οι συμβάσεις
12	Αναγνωριστικός κωδικός συναλλαγής	Μέχρι να καταστεί διαθέσιμος ο παγκόσμιος κωδικός UTI, κωδικός μήκους έως 52 αλφαριθμητικών χαρακτήρων, συμπεριλαμβανομένων των εξής τεσσάρων ειδικών χαρακτήρων: ". - _" Δεν επιτρέπονται ειδικοί χαρακτήρες στην αρχή και στο τέλος του κωδικού. Δεν επιτρέπονται κενά διαστήματα.	
13	Αριθμός παρακολούθησης αναφοράς	Αλφαριθμητικό πεδίο μήκους έως 52 χαρακτήρων	
14	Αναγνωριστικός κωδικός συνιστώσας πολύπλοκης συναλλαγής	Αλφαριθμητικό πεδίο μήκους έως 35 χαρακτήρων	
15	Τόπος εκτέλεσης	Αναγνωριστικός κωδικός αγοράς (MIC) κατά ISO 10383, μήκους 4 αλφαριθμητικών χαρακτήρων, σύμφωνα με το άρθρο 4β.	

	Πεδίο	Μορφότυπος	Ισχύοντες τύποι σύμβασης παραγώγων
16	Συμπίεση	Y = σύμβαση που προέρχεται από συμπίεση N = σύμβαση που δεν προέρχεται από συμπίεση	
17	Τιμή/ισοτιμία	Έως 20 αριθμητικοί χαρακτήρες, συμπεριλαμβανομένων δεκαδικών. Το σύμβολο των δεκαδικών αριθμών δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας. Εάν υπάρχει, τότε εμφανίζεται με τη μορφή υποδιαστολής. Το αρνητικό πρόσημο, εάν χρησιμοποιείται, δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας. Σε περίπτωση που η τιμή αναφέρεται σε ποσοστιαίες τιμές, θα πρέπει να εκφράζεται ως ποσοστό όπου το 100 % εκφράζεται ως "100"	
18	Συμβολισμός τιμής	U = Μονάδες P = Ποσοστό Y = Απόδοση	
19	Νόμισμα της τιμής	Κωδικός νομίσματος κατά ISO 4217, μήκους 3 αλφαβητικών χαρακτήρων	
20	Ονομαστικό ποσό	Έως 20 αριθμητικοί χαρακτήρες, συμπεριλαμβανομένων δεκαδικών. Το σύμβολο των δεκαδικών αριθμών δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας. Εάν υπάρχει, τότε εμφανίζεται με τη μορφή υποδιαστολής. Το αρνητικό πρόσημο, εάν χρησιμοποιείται, δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας.	
21	Πολλαπλασιαστικές τιμές	Έως 20 αριθμητικοί χαρακτήρες, συμπεριλαμβανομένων δεκαδικών. Το σύμβολο των δεκαδικών αριθμών δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας. Εάν υπάρχει, τότε εμφανίζεται με τη μορφή υποδιαστολής.	
22	Ποσότητα	Έως 20 αριθμητικοί χαρακτήρες, συμπεριλαμβανομένων δεκαδικών. Το σύμβολο των δεκαδικών αριθμών δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας. Εάν υπάρχει, τότε εμφανίζεται με τη μορφή υποδιαστολής.	
23	Προκαταβολική πληρωμή	Έως 20 αριθμητικοί χαρακτήρες, συμπεριλαμβανομένων δεκαδικών. Το αρνητικό σύμβολο θα χρησιμοποιείται για να υποδείξει ότι η πληρωμή έγινε, αλλά δεν έχει ληφθεί. Το σύμβολο των δεκαδικών αριθμών δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας. Εάν υπάρχει, τότε εμφανίζεται με τη μορφή υποδιαστολής. Το αρνητικό πρόσημο, εάν χρησιμοποιείται, δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας.	

	Πεδίο	Μορφότυπος	Ισχύοντες τύποι σύμβασης παραγώγων
24	Τύπος παράδοσης	C = Μετρητά P = Φυσική O — Προαιρετική για τον αντισυμβαλλόμενο ή όταν καθορίζεται από τρίτο μέρος	
25	Χρονοσφραγίδα εκτέλεσης	Ημερομηνία κατά ISO 8601 σε μορφότυπο EEEE-MM-HH και ώρα σε μορφότυπο συντονισμένης παγκόσμιας ώρας (UTC) ωω:λλ:δδΖ	
26	Ημερομηνία έναρξης ισχύος	Ημερομηνία κατά ISO 8601 με τον μορφότυπο EEEE-MM-HH	
27	Ημερομηνία λήξης	Ημερομηνία κατά ISO 8601 με τον μορφότυπο EEEE-MM-HH	
28	Ημερομηνία εκπνοής	Ημερομηνία κατά ISO 8601 με τον μορφότυπο EEEE-MM-HH	
29	Ημερομηνία διακανονισμού	Ημερομηνία κατά ISO 8601 με τον μορφότυπο EEEE-MM-HH	
30	Τύπος βασικής συμφωνίας	Ελεύθερο κείμενο, πεδίο έως 50 χαρακτήρων που προσδιορίζουν την ονομασία της χρησιμοποιούμενης βασικής συμφωνίας, εάν υπάρχει.	
31	Έκδοση βασικής συμφωνίας	Ημερομηνία κατά ISO 8601 στη μορφή EEEE	
	Τμήμα 2δ — Μετριάσιμος κινδύνου/Αναφορά		Όλες οι συμβάσεις
32	Χρονοσφραγίδα επιβεβαίωσης	Ημερομηνία κατά ISO 8601 σε μορφότυπο EEEE-MM-HH και ώρα σε μορφότυπο συντονισμένης παγκόσμιας ώρας (UTC) ωω:λλ:δδΖ	
33	Μέσα επιβεβαίωσης	Y = Μη ηλεκτρονικά επιβεβαιωμένο N = Μη επιβεβαιωμένο E = Ηλεκτρονικά επιβεβαιωμένο	
	Τμήμα 2ε — Εκκαθάριση		Όλες οι συμβάσεις
34	Υποχρέωση εκκαθάρισης	Y = Ναι N = Όχι	
35	Εκκαθαρισμένο	Y = Ναι N = Όχι	
36	Χρονοσφραγίδα εκκαθάρισης	Ημερομηνία κατά ISO 8601 σε μορφότυπο EEEE-MM-HH και ώρα σε μορφότυπο συντονισμένης παγκόσμιας ώρας (UTC) ωω:λλ:δδΖ	
37	Κεντρικός αντισυμβαλλόμενος	Αναγνωριστικός κωδικός νομικής οντότητας (LEI) κατά ISO 17442 μήκους 20 αλφαριθμητικών χαρακτήρων	

	Πεδίο	Μορφότυπος	Ισχύοντες τύποι σύμβασης παραγώγων
38	Ενδοομιλική	Y = Ναι N = Όχι	
	Τμήμα 2στ — Επιτόκια		Παράγωγα επιτοκίων
39	Σταθερό επιτόκιο σκέλους 1	Μέγιστου μήκους 10 αριθμητικών χαρακτήρων, συμπεριλαμβανομένων δεκαδικών, εκφρασμένο ως ποσοστό όπου το 100 % εκφράζεται ως "100". Το σύμβολο των δεκαδικών αριθμών δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας. Εάν υπάρχει, τότε εμφανίζεται με τη μορφή υποδιαστολής. Το αρνητικό πρόσημο, εάν χρησιμοποιείται, δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας.	
40	Σταθερό επιτόκιο σκέλους 2	Μέγιστου μήκους 10 αριθμητικών χαρακτήρων, συμπεριλαμβανομένων δεκαδικών, εκφρασμένο ως ποσοστό όπου το 100 % εκφράζεται ως "100". Το σύμβολο των δεκαδικών αριθμών δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας. Εάν υπάρχει, τότε εμφανίζεται με τη μορφή υποδιαστολής. Το αρνητικό πρόσημο, εάν χρησιμοποιείται, δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας.	
41	Υπολογισμός ημερών σταθερού επιτοκίου σκέλους 1	Αριθμητής/παρονομαστής όπου τόσο ο αριθμητής όσο και ο παρονομαστής είναι αριθμητικοί χαρακτήρες ή η αλφαβητική έκφραση "Πραγματικές", π.χ. 30/360 ή Πραγματικές/365	
42	Υπολογισμός ημερών σταθερού επιτοκίου σκέλους 2	Αριθμητής/παρονομαστής όπου τόσο ο αριθμητής όσο και ο παρονομαστής είναι αριθμητικοί χαρακτήρες ή η αλφαβητική έκφραση "Πραγματικές", π.χ. 30/360 ή Πραγματικές/365	
43	Συχνότητα πληρωμής σταθερού επιτοκίου σκέλους 1 — χρονική περίοδος	Χρονική περίοδος που περιγράφει τη συχνότητα ανταλλαγής πληρωμών μεταξύ των αντισυμβαλλόμενων, όπου εφαρμόζονται οι ακόλουθες συντομογραφίες: Y = Έτος M = Μήνας W = Εβδομάδα D = Ημέρα	

	Πεδίο	Μορφότυπος	Ισχύοντες τύποι σύμβασης παραγώγων
44	Συχνότητα πληρωμής σταθερού επιτοκίου σκέλους 1 — πολλαπλασιαστής	Ακέραιος πολλαπλασιαστής χρονικής περιόδου που περιγράφει τη συχνότητα ανταλλαγής πληρωμών μεταξύ των αντισυμβαλλόμενων. Έως και 3 αριθμητικοί χαρακτήρες.	
45	Συχνότητα πληρωμής σταθερού επιτοκίου σκέλους 2 — χρονική περίοδος	Χρονική περίοδος που περιγράφει τη συχνότητα ανταλλαγής πληρωμών μεταξύ των αντισυμβαλλόμενων, όπου εφαρμόζονται οι ακόλουθες συντομογραφίες: Y = Έτος M = Μήνας W = Εβδομάδα D = Ημέρα	
46	Συχνότητα πληρωμής σταθερού επιτοκίου σκέλους 2 — πολλαπλασιαστής	Ακέραιος πολλαπλασιαστής χρονικής περιόδου που περιγράφει τη συχνότητα ανταλλαγής πληρωμών μεταξύ των αντισυμβαλλόμενων. Έως και 3 αριθμητικοί χαρακτήρες.	
47	Συχνότητα πληρωμής κυμαινόμενου επιτοκίου σκέλους 1 — χρονική περίοδος	Χρονική περίοδος που περιγράφει τη συχνότητα ανταλλαγής πληρωμών μεταξύ των αντισυμβαλλόμενων, όπου εφαρμόζονται οι ακόλουθες συντομογραφίες: Y = Έτος M = Μήνας W = Εβδομάδα D = Ημέρα	
48	Συχνότητα πληρωμής κυμαινόμενου επιτοκίου σκέλους 1 — πολλαπλασιαστής	Ακέραιος πολλαπλασιαστής χρονικής περιόδου που περιγράφει τη συχνότητα ανταλλαγής πληρωμών μεταξύ των αντισυμβαλλόμενων. Έως και 3 αριθμητικοί χαρακτήρες.	
49	Συχνότητα πληρωμής κυμαινόμενου επιτοκίου σκέλους 2 — χρονική περίοδος	Χρονική περίοδος που περιγράφει τη συχνότητα ανταλλαγής πληρωμών μεταξύ των αντισυμβαλλόμενων, όπου εφαρμόζονται οι ακόλουθες συντομογραφίες: Y = Έτος M = Μήνας W = Εβδομάδα D = Ημέρα	
50	Συχνότητα πληρωμής κυμαινόμενου επιτοκίου σκέλους 2 — πολλαπλασιαστής	Ακέραιος πολλαπλασιαστής χρονικής περιόδου που περιγράφει τη συχνότητα ανταλλαγής πληρωμών μεταξύ των αντισυμβαλλόμενων. Έως και 3 αριθμητικοί χαρακτήρες.	

	Πεδίο	Μορφότυπος	Ισχύοντες τύποι σύμβασης παραγώγων
51	Συχνότητα επαναπροσδιορισμού κυμαινόμενου επιτοκίου σκέλους 1 — χρονική περίοδος	Χρονική περίοδος που περιγράφει τη συχνότητα επαναπροσδιορισμού του κυμαινόμενου επιτοκίου από τους αντισυμβαλλόμενους, όπου εφαρμόζονται οι ακόλουθες συντομογραφίες: Y = Έτος M = Μήνας W = Εβδομάδα D = Ημέρα	
52	Συχνότητα επαναπροσδιορισμού κυμαινόμενου επιτοκίου σκέλους 1 — πολλαπλασιαστής	Ακέραιος πολλαπλασιαστής της χρονικής περιόδου που περιγράφει τη συχνότητα επαναπροσδιορισμού του κυμαινόμενου επιτοκίου από τους αντισυμβαλλόμενους. Έως και 3 αριθμητικοί χαρακτήρες.	
53	Συχνότητα επαναπροσδιορισμού κυμαινόμενου επιτοκίου σκέλους 2 — χρονική περίοδος	Χρονική περίοδος που περιγράφει τη συχνότητα επαναπροσδιορισμού του κυμαινόμενου επιτοκίου από τους αντισυμβαλλόμενους, όπου εφαρμόζονται οι ακόλουθες συντομογραφίες: Y = Έτος M = Μήνας W = Εβδομάδα D = Ημέρα	
54	Συχνότητα επαναπροσδιορισμού κυμαινόμενου επιτοκίου σκέλους 2 — πολλαπλασιαστής	Ακέραιος πολλαπλασιαστής της χρονικής περιόδου που περιγράφει τη συχνότητα επαναπροσδιορισμού του κυμαινόμενου επιτοκίου από τους αντισυμβαλλόμενους. Έως και 3 αριθμητικοί χαρακτήρες.	
55	Κυμαινόμενο επιτόκιο σκέλους 1	Ονομασία του δείκτη κυμαινόμενου επιτοκίου “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	

	Πεδίο	Μορφότυπος	Ισχύοντες τύποι σύμβασης παραγώγων
		“CDOR”— CDOR “CIBO”— CIBOR “MOSP”— MOSPRIM “NIBO”— NIBOR “PRBO”— PRIBOR “TLBO”— TELBOR “WIBO”— WIBOR “TREA”— Treasury (Δημόσιο Ταμείο) “SWAP”— SWAP (σύμβαση ανταλλαγής) “FUSW”— Future SWAP (σύμβαση ανταλλαγής μελλοντικής εκπλήρωσης) Ή έως 25 αλφαριθμητικοί χαρακτήρες εάν το επιτόκιο αναφοράς δεν περιλαμβάνεται στον ανωτέρω κατάλογο	
56	Περίοδος αναφοράς κυμαινόμενου επιτοκίου σκέλους 1— χρονική περίοδος	Χρονική περίοδος που περιγράφει την περίοδο αναφοράς, όπου εφαρμόζονται οι ακόλουθες συντομογραφίες: Y = Έτος M = Μήνας W = Εβδομάδα D = Ημέρα	
57	Περίοδος αναφοράς κυμαινόμενου επιτοκίου σκέλους 1 — πολλαπλασιαστής	Ακέραιος πολλαπλασιαστής χρονικής περιόδου που περιγράφει την περίοδο αναφοράς. Έως και 3 αριθμητικοί χαρακτήρες.	
58	Κυμαινόμενο επιτόκιο σκέλους 2	Ονομασία του δείκτη κυμαινόμενου επιτοκίου “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	

	Πεδίο	Μορφότυπος	Ισχύοντες τύποι σύμβασης παραγώγων
		“NIBO”— NIBOR “PRBO”— PRIBOR “TLBO”— TELBOR “WIBO”— WIBOR “TREA”— Treasury (Δημόσιο Ταμείο) “SWAP”— SWAP (σύμβαση ανταλλαγής) “FUSW”— Future SWAP (σύμβαση ανταλλαγής μελλοντικής εκπλήρωσης) Ή έως 25 αλφαριθμητικοί χαρακτήρες εάν το επιτόκιο αναφοράς δεν περιλαμβάνεται στον ανωτέρω κατάλογο	
59	Περίοδος αναφοράς κυμαινόμενου επιτοκίου σκέλους 2 — χρονική περίοδος	Χρονική περίοδος που περιγράφει την περίοδο αναφοράς, όπου εφαρμόζονται οι ακόλουθες συντομογραφίες: Y = Έτος M = Μήνας W = Εβδομάδα D = Ημέρα	
60	Περίοδος αναφοράς κυμαινόμενου επιτοκίου σκέλους 2 — πολλαπλασιαστής	Ακέραιος πολλαπλασιαστής χρονικής περιόδου που περιγράφει την περίοδο αναφοράς. Έως και 3 αριθμητικοί χαρακτήρες.	
	Τμήμα 2ζ — Συνάλλαγμα		Παράγωγα συναλλάγματος
61	Νόμισμα παράδοσης 2	Κωδικός νομίσματος κατά ISO 4217, μήκους 3 αλφαβητικών χαρακτήρων	
62	Ισοτιμία 1	Έως 10 αριθμητικοί χαρακτήρες, συμπεριλαμβανομένων δεκαδικών. Το σύμβολο των δεκαδικών αριθμών δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας. Εάν υπάρχει, τότε εμφανίζεται με τη μορφή υποδιαστολής. Το αρνητικό πρόσημο, εάν χρησιμοποιείται, δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας.	
63	Προθεσμιακή ισοτιμία	Έως 10 αριθμητικοί χαρακτήρες, συμπεριλαμβανομένων δεκαδικών. Το σύμβολο των δεκαδικών αριθμών δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας. Εάν υπάρχει, τότε εμφανίζεται με τη μορφή υποδιαστολής. Το αρνητικό πρόσημο, εάν χρησιμοποιείται, δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας.	

	Πεδίο	Μορφότυπος	Ισχύοντες τύποι σύμβασης παραγώγων
64	Βάση ισοτιμίας	Δύο κωδικοί νομίσματος κατά ISO 4217 διαχωριζόμενοι με το σύμβολο "/". Ο πρώτος κωδικός νομίσματος υποδεικνύει το νόμισμα βάσης, ενώ ο δεύτερος κωδικός νομίσματος το νόμισμα προσφοράς.	
	Τμήμα 2η — Βασικά εμπορεύματα και δικαιώματα εκπομπής		Παράγωγα επί βασικών εμπορευμάτων και δικαιωμάτων εκπομπής
	Γενικά		
65	Βάση του βασικού προϊόντος	AG = Γεωργικά προϊόντα EN = Ενέργεια FR = Φορτία M = Μέταλλα IN = Δείκτης EV = Περιβαλλοντικά EX = Εξωτικά OT = Άλλο	
66	Λεπτομερή στοιχεία για το βασικό προϊόν	Γεωργικά προϊόντα GO = Ελαιούχοι σπόροι DA = Γαλακτοκομικά LI = Ζωικό κεφάλαιο FO = Δασοκομικά SO = Μαλακά εμπορεύματα (Softs) SF = Θαλασσινά OT = Άλλο Ενέργεια OI = Πετρέλαιο NG = Φυσικό αέριο CO = Άνθρακας EL = Ηλεκτρική ενέργεια IE = Δια-ενεργειακά OT = Άλλο Φορτία DR = Ξηρό WT = Υγρό OT = Άλλο Μέταλλα PR = Πολύτιμα NP = Μη πολύτιμα Περιβαλλοντικά WE = Καιρός EM = Εκπομπές OT = Άλλο	

	Πεδίο	Μορφότυπος	Ισχύοντες τύποι σύμβασης παραγώγων
	Ενέργεια		
67	Σημείο ή ζώνη παράδοσης	Κωδικός EIC, αλφαριθμητικός κωδικός 16 χαρακτήρων Το πεδίο είναι επαναλαμβανόμενο.	
68	Σημείο διασύνδεσης	Κωδικός EIC, αλφαριθμητικός κωδικός 16 χαρακτήρων	
69	Τύπος φορτίου	BL = Βασικό φορτίο PL = Φορτίο αιχμής OP = Φορτίο εκτός φορτίου αιχμής BH = Ώρα/Block Hours (χρονικές ενότητες λειτουργίας) SH = Σχηματισμένο GD = Ημέρα τροφοδοσίας αερίου OT = Άλλο	
	Επαναλαμβανόμενο τμήμα πεδίων 70-77		
70	Διαστήματα παράδοσης φορτίου	ωω:λλΖ	
71	Ημερομηνία και ώρα έναρξης της παράδοσης	Ημερομηνία κατά ISO 8601 σε μορφότυπο EEEE-MM-HH και ώρα σε μορφότυπο συντονισμένης παγκόσμιας ώρας (UTC) ωω:λλ:δδΖ	
72	Ημερομηνία και ώρα λήξης της παράδοσης	Ημερομηνία κατά ISO 8601 σε μορφότυπο EEEE-MM-HH και ώρα σε μορφότυπο συντονισμένης παγκόσμιας ώρας (UTC) ωω:λλ:δδΖ	
73	Διάρκεια	N = Λεπτά H = Ώρα D = Ημέρα W = Εβδομάδα M = Μήνας Q = Τρίμηνο S = Περίοδος Y = Ετήσια O = Άλλο	
74	Ημέρες της εβδομάδας	WD = Δευτέρα — Παρασκευή WN = Σαββατοκύριακο MO = Δευτέρα TU = Τρίτη WE = Τετάρτη TH = Πέμπτη FR = Παρασκευή SA = Σάββατο SU = Κυριακή Επιτρέπονται πολλαπλές τιμές, διαχωρισμένες με το σύμβολο “/”	

	Πεδίο	Μορφότυπος	Ισχύοντες τύποι σύμβασης παραγώγων
75	Δυναμικότητα παράδοσης	Έως 20 αριθμητικοί χαρακτήρες, συμπεριλαμβανομένων δεκαδικών. Το σύμβολο των δεκαδικών αριθμών δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας. Εάν υπάρχει, τότε εμφανίζεται με τη μορφή υποδιαστολής. Το αρνητικό πρόσημο, εάν χρησιμοποιείται, δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας.	
76	Ποσοτική μονάδα	KW KWh/ώρα KWh/ημέρα MW MWh/ώρα MWh/ημέρα GW GWh/ώρα GWh/ημέρα Therm/ημέρα KTherm/ημέρα MTherm/ημέρα cm/ημέρα mcm/ημέρα	
77	Τιμή ανά ποσότητα ανά χρονικό διάστημα	Έως 20 αριθμητικοί χαρακτήρες, συμπεριλαμβανομένων δεκαδικών. Το σύμβολο των δεκαδικών αριθμών δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας. Εάν υπάρχει, τότε εμφανίζεται με τη μορφή υποδιαστολής. Το αρνητικό πρόσημο, εάν χρησιμοποιείται, δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας.	
	Τμήμα 29 — Δικαιώματα προαίρεσης		Συμβάσεις που περιλαμβάνουν δικαίωμα προαίρεσης
78	Είδος δικαιώματος προαίρεσης	P = Πώλησης C = Αγοράς O = όταν δεν είναι δυνατόν να προσδιοριστεί αν πρόκειται για δικαίωμα αγοράς ή πώλησης	
79	Τύπος άσκησης δικαιώματος προαίρεσης	A = Αμερικής B = Βερμούδων E = Ευρώπης S = Ασίας Επιτρέπονται περισσότερες από μία τιμές	

	Πεδίο	Μορφότυπος	Ισχύοντες τύποι σύμβασης παραγώγων
80	Τιμή άσκησης (ανώτατο/κατώτατο όριο)	Έως 20 αριθμητικοί χαρακτήρες, συμπεριλαμβανομένων δεκαδικών. Το σύμβολο των δεκαδικών αριθμών δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας. Εάν υπάρχει, τότε εμφανίζεται με τη μορφή υποδιαστολής. Το αρνητικό πρόσημο, εάν χρησιμοποιείται, δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας. Σε περίπτωση που η τιμή άσκησης αναφέρεται σε ποσοστιαίες τιμές, θα πρέπει να εκφράζεται ως ποσοστό όπου το 100 % εκφράζεται ως "100"	
81	Συμβολισμός τιμής άσκησης	U = Μονάδες P = Ποσοστό Y = Απόδοση	
82	Ημερομηνία λήξης υποκείμενου στοιχείου	Ημερομηνία κατά ISO 8601 με τον μορφότυπο EEEE-MM-HH	
	Τμήμα 2ι — Πιστωτικά παράγωγα		
83	Προτεραιότητα	SNDB = Εξοφλητικής προτεραιότητας, όπως μη εξασφαλισμένα χρεόγραφα με εξοφλητική προτεραιότητα (εταιρικά/χρηματοοικονομικά), δημόσιο χρέος σε ξένο νόμισμα (κρατικά), SBOD = Μειωμένης εξοφλητικής προτεραιότητας, όπως δάνεια μειωμένης εξασφάλισης ή κατώτερης κατηγορίας 2 (τράπεζες), δευτερεύοντα δάνεια μειωμένης εξασφάλισης ή ανώτερης κατηγορίας 2 (τράπεζες), OTHR = Άλλα, όπως προνομιούχες μετοχές ή κεφάλαια κατηγορίας 1 (τράπεζες) ή άλλα πιστωτικά παράγωγα	
84	Οντότητα αναφοράς	ISO 3166- Κωδικός χώρας 2 χαρακτήρων ή Κωδικός χώρας με 2 γράμματα κατά ISO 3166-2, που ακολουθείται από παύλα "-" και κωδικό υποδιαίρεσης χώρας με έως 3 αλφαριθμητικούς χαρακτήρες ή Αναγνωριστικός κωδικός νομικής οντότητας (LEI) κατά ISO 17442, μήκους 20 αλφαριθμητικών χαρακτήρων	
85	Συχνότητα πληρωμής	MNTH = Μηνιαία QURT = Τριμηνιαία MIAN = Εξαμηνιαία YEAR = Ετήσια	
86	Βάση υπολογισμού	Αριθμητής/παρονομαστής, όπου τόσο ο αριθμητής όσο και ο παρονομαστής είναι αριθμητικοί χαρακτήρες ή η αλφαβητική έκφραση "Πραγματικές", π.χ. 30/360 ή Πραγματικές/365	

	Πεδίο	Μορφότυπος	Ισχύοντες τύποι σύμβασης παραγώγων
87	Σειρά	Πεδίο ακέραιου αριθμού μήκους έως 5 χαρακτήρων	
88	Έκδοση	Πεδίο ακέραιου αριθμού μήκους έως 5 χαρακτήρων	
89	Συντελεστής δείκτη	Έως 10 αριθμητικοί χαρακτήρες, συμπεριλαμβανομένων δεκαδικών. Το σύμβολο των δεκαδικών αριθμών δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας. Εάν υπάρχει, τότε εμφανίζεται με τη μορφή υποδιαστολής.	
90	Δόση	T = Σε δόσεις U = Χωρίς δόσεις	
91	Ελάχιστο όριο πιστωτικής προστασίας (attachment point)	Έως 10 αριθμητικοί χαρακτήρες, συμπεριλαμβανομένων δεκαδικών, εκφραζόμενο ως δεκαδικό κλάσμα μεταξύ 0 και 1. Το σύμβολο των δεκαδικών αριθμών δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας. Εάν υπάρχει, τότε εμφανίζεται με τη μορφή υποδιαστολής.	
92	Μέγιστο όριο πιστωτικής προστασίας (detachment point)	Έως 10 αριθμητικοί χαρακτήρες, συμπεριλαμβανομένων δεκαδικών, εκφραζόμενο ως δεκαδικό κλάσμα μεταξύ 0 και 1. Το σύμβολο των δεκαδικών αριθμών δεν προσμετράται ως αριθμητικός χαρακτήρας. Εάν υπάρχει, τότε εμφανίζεται με τη μορφή υποδιαστολής.	
	Τμήμα 2ια — Τροποποιήσεις στη σύμβαση		
93	Τύπος ενέργειας	N = Νέα M = Τροποποίηση E = Σφάλμα C = Πρόωρη εκπνοή R = Διόρθωση Z = Συμπίεση V = Επικαιροποίηση αποτίμησης P = Στοιχείο θέσης	
94	Επίπεδο	T = Συναλλαγή P = Θέση»	