

ΕΚΤΕΛΕΣΤΙΚΟΣ ΚΑΝΟΝΙΣΜΟΣ (ΕΕ) αριθ. 1247/2012 ΤΗΣ ΕΠΙΤΡΟΠΗΣ

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 αντισυμβαλλομένους 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 τη γνώμη της Ευρωπαϊκής Κεντρικής Τράπεζας ⁽¹⁾,Έχοντας υπόψη τον κανονισμό (ΕΕ) αριθ. 648/2012 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 4ης Ιουλίου 2012, για τα εξωχρηματιστηριακά παράγωγα, τους κεντρικούς αντισυμβαλλομένους και τα αρχεία καταγραφής συναλλαγών ⁽²⁾, και ιδίως το άρθρο 9 παράγραφος 6,

Εκτιμώντας ότι:

- (1) Προκειμένου να αποφευχθούν ανακολουθίες, όλα τα δεδομένα που αποστέλλονται σε αρχεία καταγραφής συναλλαγών βάσει του άρθρου 9 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012 θα πρέπει να ακολουθούν τους ίδιους κανόνες, πρότυπα και μορφοτύπους για όλα τα αρχεία καταγραφής συναλλαγών, όλους τους αντισυμβαλλομένους και όλους τους τύπους παραγώγων. Ως εκ τούτου, θα πρέπει να χρησιμοποιείται ένα μοναδικό σύνολο δεδομένων για την περιγραφή των συναλλαγών παραγώγων.
- (2) Εφόσον τα εξωχρηματιστηριακά παράγωγα δεν είναι τυπικά ούτε με μοναδικό τρόπο αναγνωρίσιμα από υπάρχοντες κωδικούς που χρησιμοποιούνται ευρέως στις χρηματαγορές, όπως οι Διεθνείς Αριθμοί Αναγνώρισης Τίτλων (ISIN), ούτε περιγράψιμα με τον κωδικό ISO ταξινόμησης χρηματοπιστωτικών μέσων (CFI), θα πρέπει να αναπτυχθεί μια νέα και καθολική μέθοδος αναγνώρισης. Εάν καταστεί διαθέσιμος ένας μοναδικός αναγνωριστικός κωδικός προϊόντος και ακολουθεί τις αρχές της μοναδικότητας, της ουδετερότητας, της αξιοπιστίας, της ανοικτής πηγής, της κλιμακωσιμότητας, της προσβασιμότητας, έχει βάση εύλογου κόστους, προσφέρεται βάσει κατάλληλου πλαισίου διακυβέρνησης και εγκρίνεται για χρήση στην Ένωση, θα πρέπει να χρησιμοποιείται. Εάν δεν είναι διαθέσιμος μοναδικός αναγνωριστικός κωδικός προϊόντος που πληροί αυτές τις απαιτήσεις, θα πρέπει να χρησιμοποιείται προσωρινή ταξινόμηση.
- (3) Το υποκείμενο στοιχείο θα πρέπει να αναγνωρίζεται χρησιμοποιώντας μοναδικό αναγνωριστικό κωδικό, ωστόσο δεν υπάρχει προς το παρόν ευρέως τυποποιημένος κωδικός αγοράς που να αναγνωρίζει τα υποκείμενα στοιχεία εντός ενός καλαθιού. Οι αντισυμβαλλόμενοι θα πρέπει, συνεπώς, να καταδεικνύουν τουλάχιστον ότι το υποκείμενο στοιχείο είναι ένα καλάθι και ότι χρησιμοποιούν ISIN για τυποποιημένους δείκτες, όπου αυτό είναι εφικτό.

- (4) Για να διασφαλιστεί η συνοχή, όλα τα μέρη σύμβασης παραγώγων θα πρέπει να αναγνωρίζονται με μοναδικό κωδικό. Ένας παγκόσμιος αναγνωριστικός κωδικός νομικής οντότητας ή προσωρινός αναγνωριστικός κωδικός οντότητας, ο οποίος θα οριστεί βάσει πλαισίου διακυβέρνησης το οποίο είναι συμβατό με τις συστάσεις του Συμβουλίου Χρηματοπιστωτικής Σταθερότητας (FSB) για τις απαιτήσεις δεδομένων και εγκρίνεται για χρήση στην Ένωση, θα πρέπει να χρησιμοποιείται για την αναγνώριση όλων των χρηματοοικονομικών και μη χρηματοοικονομικών αντισυμβαλλομένων, χρηματομεστών, κεντρικών αντισυμβαλλομένων και δικαιούχων ατόμου καταστεί διαθέσιμος, για να διασφαλίζεται ειδικότερα η συνοχή με την έκθεση της Επιτροπής Συστημάτων Πληρωμών και Διακανονισμού (CPSS) και του Διεθνούς Οργανισμού των Επιτροπών Κεφαλαιαγοράς (IOSCO) σχετικά με τις απαιτήσεις αναφοράς και συγκέντρωσης δεδομένων για εξωχρηματιστηριακά παράγωγα, που περιγράφει τους αναγνωριστικούς κωδικούς νομικής οντότητας ως εργαλείο για τη συγκέντρωση δεδομένων. Στην περίπτωση συναλλαγών για λογαριασμό τρίτων, οι δικαιούχοι θα πρέπει να αναγνωρίζονται ως το άτομο ή η οντότητα για λογαριασμό των οποίων έχει συναφθεί η σύμβαση.

- (5) Η προσέγγιση που ακολουθείται σε τρίτες χώρες και επίσης από τα ίδια τα αρχεία καταγραφής συναλλαγών, κατά την έναρξη των δραστηριοτήτων τους, θα πρέπει επίσης να συνεκτιμηθεί. Ως εκ τούτου, για να διασφαλιστεί οικονομικά αποδοτική λύση για τους αντισυμβαλλομένους και για να μετριαστεί ο λειτουργικός κίνδυνος για τα αρχεία καταγραφής συναλλαγών, η ημερομηνία έναρξης της αναφοράς θα πρέπει να περιλαμβάνει ημερομηνίες σταδιακής εφαρμογής για διάφορες κατηγορίες παραγώγων, αρχής γενομένης με τις πλέον τυποποιημένες κατηγορίες και, στη συνέχεια, με επέκταση στις λοιπές κατηγορίες. Οι συμβάσεις παραγώγων που έχουν τεθεί σε ισχύ πριν, κατά ή μετά την έναρξη ισχύος του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012, που δεν είναι άληκτες κατά ή μετά την ημερομηνία έναρξης της αναφοράς, δεν έχουν μείζονα σημασία για κανονιστικούς σκοπούς. Ωστόσο, πρέπει να αποτελούν αντικείμενο αναφοράς βάσει του άρθρου 9 παράγραφος 1 στοιχείο α) του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012. Προκειμένου να διασφαλιστεί αποτελεσματικό και αναλογικό καθεστώς αναφοράς σε αυτές τις περιπτώσεις και να ληφθούν υπόψη οι δυσκολίες στην αναδιάρθρωση δεδομένων των συμβάσεων που έχουν λήξει, θα πρέπει να παρέχεται μεγαλύτερη προθεσμία για την εν λόγω αναφορά.

- (6) Ο παρών κανονισμός βασίζεται σε σχέδια εκτελεστικών τεχνικών προτύπων που έχει υποβάλει η Ευρωπαϊκή Αρχή Κινητών Αξιών και Αγορών (εφεξής ΕΑΚΑΑ) στην Επιτροπή.

- (7) Σύμφωνα με το άρθρο 15 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 1095/2010 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 24ης Νοεμβρίου 2010, σχετικά με τη σύσταση Ευρωπαϊκής Εποπτικής Αρχής (Ευρωπαϊκή Αρχή Κινητών

⁽¹⁾ Δεν έχει ακόμη δημοσιευθεί στην Επίσημη Εφημερίδα.⁽²⁾ ΕΕ L 201 της 27.7.2012.

Αξιών και Αγορών⁽¹⁾, η ΕΑΚΑΑ διενήργησε ανοιχτές δημόσιες διαβουλεύσεις για τα εν λόγω σχέδια εκτελεστικών τεχνικών προτύπων, ανέλυσε τα ενδεχόμενα συναφή κόστη και τις ωφέλειες και ζήτησε τη γνώμη της ομάδας συμφεροντούχων κινητών αξιών και αγορών της ΕΑΚΑΑ, που έχει συσταθεί σύμφωνα με το άρθρο 37 του εν λόγω κανονισμού,

ΕΞΕΔΩΣΕ ΤΟΝ ΠΑΡΟΝΤΑ ΚΑΝΟΝΙΣΜΟ:

Άρθρο 1

Μορφότυπος των αναφορών συμβάσεων παραγώγων

Οι πληροφορίες που περιλαμβάνονται σε αναφορά που υποβάλλεται βάσει του άρθρου 9 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012 παρέχονται στον μορφότυπο που προσδιορίζεται στο παράρτημα του παρόντος κανονισμού.

Άρθρο 2

Συχνότητα των αναφορών στο πλαίσιο συμβάσεων παραγώγων

Στις περιπτώσεις που προβλέπονται στο άρθρο 11 παράγραφος 2 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012, οι αποτιμήσεις συμβάσεων στην τρέχουσα τιμή της αγοράς (mark to market) ή βάσει μοντέλου (mark to model) που αναφέρονται σε αρχείο καταγραφής συναλλαγών πραγματοποιούνται σε καθημερινή βάση. Οποιαδήποτε άλλα στοιχεία αναφοράς που προβλέπονται στο παράρτημα του παρόντος κανονισμού και στο παράρτημα της κατ' εξουσιοδότηση πράξης που αφορά τα ρυθμιστικά τεχνικά πρότυπα, όπου καθορίζονται οι ελάχιστες λεπτομέρειες των δεδομένων που πρέπει να αναφέρονται στα αρχεία καταγραφής συναλλαγών σύμφωνα με το άρθρο 9 παράγραφος 5 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012, αναφέρονται κατά την εμφάνισή τους και λαμβάνοντας υπόψη το χρονικό όριο που προβλέπεται βάσει του άρθρου 9 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012, ιδίως όσον αφορά τη σύναψη, την τροποποίηση ή τη λήξη σύμβασης.

Άρθρο 3

Αναγνώριση αντισυμβαλλομένων και άλλων οντοτήτων

1. Η αναφορά χρησιμοποιεί αναγνωριστικό κωδικό νομικής οντότητας για την αναγνώριση:

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

2. Σε περίπτωση που δεν είναι διαθέσιμος αναγνωριστικός κωδικός νομικής οντότητας, η αναφορά περιλαμβάνει προσωρινό αναγνωριστικό κωδικό οντότητας, όπως ορίζεται στο επίπεδο της Ένωσης, ο οποίος 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.

3. Σε περίπτωση που δεν είναι διαθέσιμος ούτε αναγνωριστικός κωδικός νομικής οντότητας ούτε προσωρινός αναγνωριστικός κωδικός οντότητας, η αναφορά χρησιμοποιεί επιχειρηματικό αναγνωριστικό κωδικό (BIC) σύμφωνα με το ISO 9362 όπου είναι διαθέσιμος.

Άρθρο 4

Αναγνώριση παραγώγων

1. Η αναφορά αναγνωρίζει σύμβαση παραγώγων χρησιμοποιώντας μοναδικό αναγνωριστικό κωδικό προϊόντος που είναι:

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

2. Σε περίπτωση που δεν υπάρχει μοναδικός αναγνωριστικός κωδικός, η αναφορά αναγνωρίζει σύμβαση παραγώγων χρησιμοποιώντας τον συνδυασμό καθορισμένου κωδικού ISO 6166 ISIN ή εναλλακτικού αναγνωριστικού κωδικού του μέσου με τον αντίστοιχο κωδικό ISO 10962 CFI.

3. Σε περίπτωση που δεν είναι διαθέσιμος ο συνδυασμός που αναφέρεται στην παράγραφο 2, ο τύπος του παραγώγου αναγνωρίζεται στην ακόλουθη βάση:

- α) Η κατηγορία του παραγώγου αναγνωρίζεται ως μία από τις ακόλουθες:
 - i) βασικό προϊόν·
 - ii) πίστωση·
 - iii) συνάλλαγμα·
 - iv) μετοχή·
 - v) επιτόκιο·
 - vi) άλλη.
- β) Ο τύπος παραγώγου αναγνωρίζεται ως ένας από τους ακόλουθους:
 - i) σύμβαση επί διαφοράς·
 - ii) προθεσμιακή συμφωνία επιτοκίων·
 - iii) προθεσμιακή πράξη·
 - iv) σύμβαση μελλοντικής εκπλήρωσης·
 - v) δικαίωμα προαίρεσης·
 - vi) πράξη ανταλλαγής (swap)·
 - vii) άλλος.

γ) Στην περίπτωση παραγώγων που δεν εμπίπτουν σε ειδική κατηγορία παραγώγου ή τύπο παραγώγου, η αναφορά γίνεται στη βάση κατηγορίας παραγώγου ή τύπου παραγώγου που οι αντισυμβαλλόμενοι συμφωνούν όσον αφορά την κατηγορία η οποία ομοιάζει περισσότερο στη σύμβαση παραγώγων.

⁽¹⁾ ΕΕ L 331 της 15.12.2010 σ. 84.

Άρθρο 5

Ημερομηνία έναρξης της αναφοράς

1. Οι συμβάσεις πιστωτικών παραγώγων και παραγώγων επιτοκίου δηλώνονται:

- α) έως την 1η Ιουλίου 2013, όταν το αρχείο καταγραφής συναλλαγών για τη συγκεκριμένη κατηγορία παραγώγων έχει καταχωριστεί βάσει του άρθρου 55 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012 πριν από την 1η Απριλίου 2013·
- β) 90 ημέρες μετά την καταχώριση αρχείου καταγραφής συναλλαγών για συγκεκριμένη κατηγορία παραγώγων βάσει του άρθρου 55 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012, όταν δεν υπάρχει αρχείο καταγραφής συναλλαγών καταχωρισμένο για τη συγκεκριμένη κατηγορία παραγώγων πριν ή κατά την 1η Απριλίου 2013·
- γ) έως την 1η Ιουλίου 2015, όταν δεν υπάρχει αρχείο καταγραφής συναλλαγών καταχωρισμένο για τη συγκεκριμένη κατηγορία παραγώγων βάσει του άρθρου 55 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012 μέχρι την 1η Ιουλίου 2015. Η υποχρέωση αναφοράς αρχίζει να ισχύει κατά την ημερομηνία αυτή και οι συμβάσεις αναφέρονται στην ΕΑΚΑΑ σύμφωνα με το άρθρο 9 παράγραφος 3 του εν λόγω κανονισμού, μέχρις ότου καταχωριστεί αρχείο καταγραφής συναλλαγών για τη συγκεκριμένη κατηγορία παραγώγων.

2. Οι συμβάσεις παραγώγων που δεν αναφέρονται στην παράγραφο 1 δηλώνονται:

- α) έως την 1η Ιανουαρίου 2014, όταν το αρχείο καταγραφής συναλλαγών για τη συγκεκριμένη κατηγορία παραγώγων έχει καταχωριστεί βάσει του άρθρου 55 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012 πριν από την 1η Οκτωβρίου 2013·
- β) 90 ημέρες μετά την καταχώριση αρχείου καταγραφής συναλλαγών για συγκεκριμένη κατηγορία παραγώγων βάσει του άρθρου 55 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012, όταν δεν υπάρχει αρχείο καταγραφής συναλλαγών καταχωρισμένο για τη συγκεκριμένη κατηγορία παραγώγων πριν ή κατά την 1η Οκτωβρίου 2013·

γ) έως την 1η Ιουλίου 2015, όταν δεν υπάρχει αρχείο καταγραφής συναλλαγών καταχωρισμένο για τη συγκεκριμένη κατηγορία παραγώγων βάσει του άρθρου 55 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012 μέχρι την 1η Ιουλίου 2015. Η υποχρέωση αναφοράς αρχίζει να ισχύει κατά την ημερομηνία αυτή και οι συμβάσεις αναφέρονται στην ΕΑΚΑΑ σύμφωνα με το άρθρο 9 παράγραφος 3 του εν λόγω κανονισμού, μέχρις ότου καταχωριστεί αρχείο καταγραφής συναλλαγών για τη συγκεκριμένη κατηγορία παραγώγων.

3. Οι συμβάσεις παραγώγων που ήταν άληκτες στις 16 Αυγούστου 2012 και που παραμένουν άληκτες κατά την ημερομηνία έναρξης της αναφοράς δηλώνονται σε αρχείο καταγραφής συναλλαγών εντός 90 ημερών από την ημερομηνία έναρξης της αναφοράς για συγκεκριμένη κατηγορία παραγώγων.

4. Οι συμβάσεις παραγώγων

α) που τέθηκαν σε ισχύ πριν από τις 16 Αυγούστου 2012 και παρέμεναν άληκτες στις 16 Αυγούστου 2012 ή

β) που τέθηκαν σε ισχύ κατά ή μετά τις 16 Αυγούστου 2012,

και που δεν είναι άληκτες κατά την ημερομηνία έναρξης της αναφοράς ή μετά από αυτή, αναφέρονται σε αρχείο καταγραφής συναλλαγών εντός τριών ετών από την ημερομηνία έναρξης της αναφοράς για συγκεκριμένη κατηγορία παραγώγων.

5. Η ημερομηνία έναρξης της αναφοράς παρατείνεται κατά 180 ημέρες για την αναφορά πληροφοριών που αναφέρονται στο άρθρο 3 της κατ' εξουσιοδότηση πράξης που αφορά τα ρυθμιστικά τεχνικά πρότυπα, όπου καθορίζονται οι ελάχιστες λεπτομέρειες των δεδομένων που πρέπει να αναφέρονται στα αρχεία καταγραφής συναλλαγών σύμφωνα με το άρθρο 9 παράγραφος 5 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012.

Άρθρο 6

Έναρξη ισχύος

Ο παρών κανονισμός αρχίζει να ισχύει την εικοστή ημέρα από τη δημοσίευσή του στην *Επίσημη Εφημερίδα της Ευρωπαϊκής Ένωσης*.

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

Βρυξέλλες, 19 Δεκεμβρίου 2012.

Για την Επιτροπή
Ο Πρόεδρος
José Manuel BARROSO

ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ

Πίνακας 1

Δεδομένα αντισυμβαλλομένου

	Τομέας	Μορφότυπος
	Μέρη της σύμβασης	
1	Χρονοσφραγίδα αναφοράς	Μορφότυπος ημερομηνίας ISO 8601 / μορφότυπος ώρας UTC.
2	ID αντισυμβαλλομένου	Αναγνωριστικός κωδικός νομικής οντότητας (LEI) (20 αλφαριθμητικά ψηφία), προσωρινός αναγνωριστικός κωδικός οντότητας (20 αλφαριθμητικά ψηφία), BIC (11 αλφαριθμητικά ψηφία) ή κωδικός πελάτη (50 αλφαριθμητικά ψηφία).
3	ID του άλλου αντισυμβαλλομένου	Αναγνωριστικός κωδικός νομικής οντότητας (LEI) (20 αλφαριθμητικά ψηφία), προσωρινός αναγνωριστικός κωδικός οντότητας (20 αλφαριθμητικά ψηφία), BIC (11 αλφαριθμητικά ψηφία) ή κωδικός πελάτη (50 αλφαριθμητικά ψηφία).
4	Ονομασία του αντισυμβαλλομένου	100 αλφαριθμητικά ψηφία ή κενό σε περίπτωση κάλυψης από αναγνωριστικό κωδικό νομικής οντότητας (LEI).
5	Διεύθυνση του αντισυμβαλλομένου	500 αλφαριθμητικά ψηφία ή κενό σε περίπτωση κάλυψης από αναγνωριστικό κωδικό νομικής οντότητας (LEI).
6	Εταιρικός τομέας του αντισυμβαλλομένου	Ταξινόμηση: A = Ασφαλιστική επιχείρηση με άδεια λειτουργίας σύμφωνα με την οδηγία 2002/83/ΕΚ. C = Πιστωτικό ίδρυμα με άδεια λειτουργίας σύμφωνα με την οδηγία 2006/48/ΕΚ. F = Επιχείρηση επενδύσεων σύμφωνα με την οδηγία 2004/39/ΕΚ. I = Ασφαλιστική επιχείρηση με άδεια λειτουργίας σύμφωνα με την οδηγία 73/239/ΕΟΚ. L = Οργανισμός εναλλακτικών επενδύσεων διαχειριζόμενος από ΔΟΕΕ με άδεια λειτουργίας ή καταχώριση σύμφωνα με την οδηγία 2011/61/ΕΕ. O = Ίδρυμα επαγγελματικών συνταξιοδοτικών παροχών κατά την έννοια του άρθρου 6 στοιχείο α) της οδηγίας 2003/41/ΕΚ. R = Αντασφαλιστική επιχείρηση με άδεια λειτουργίας σύμφωνα με την οδηγία 2005/68/ΕΚ. U = ΟΣΕΚΑ και η διαχειριστική εταιρεία του σύμφωνα με την οδηγία 2009/65/ΕΚ ή κενό σε περίπτωση κάλυψης από αναγνωριστικό κωδικό νομικής οντότητας (LEI) ή στην περίπτωση μη χρηματοοικονομικών αντισυμβαλλομένων.
7	Χρηματοοικονομικός ή μη χρηματοοικονομικός χαρακτήρας του αντισυμβαλλομένου	F=χρηματοοικονομικός αντισυμβαλλόμενος, N=μη χρηματοοικονομικός αντισυμβαλλόμενος.
8	ID χρηματομεσίτη	Αναγνωριστικός κωδικός νομικής οντότητας (LEI) (20 αλφαριθμητικά ψηφία), προσωρινός αναγνωριστικός κωδικός οντότητας (20 αλφαριθμητικά ψηφία), BIC (11 αλφαριθμητικά ψηφία) ή κωδικός πελάτη (50 αλφαριθμητικά ψηφία).

	Τομέας	Μορφότυπος
	Μέρη της σύμβασης	
9	ID οντότητας αναφοράς	Αναγνωριστικός κωδικός νομικής οντότητας (LEI) (20 αλφαριθμητικά ψηφία), προσωρινός αναγνωριστικός κωδικός οντότητας (20 αλφαριθμητικά ψηφία), BIC (11 αλφαριθμητικά ψηφία) ή κωδικός πελάτη (50 αλφαριθμητικά ψηφία).
10	ID εκκαθαριστικού μέλους	Αναγνωριστικός κωδικός νομικής οντότητας (LEI) (20 αλφαριθμητικά ψηφία), προσωρινός αναγνωριστικός κωδικός οντότητας (20 αλφαριθμητικά ψηφία), BIC (11 αλφαριθμητικά ψηφία) ή κωδικός πελάτη (50 αλφαριθμητικά ψηφία).
11	ID δικαιούχου	Αναγνωριστικός κωδικός νομικής οντότητας (LEI) (20 αλφαριθμητικά ψηφία), προσωρινός αναγνωριστικός κωδικός οντότητας (20 αλφαριθμητικά ψηφία), BIC (11 αλφαριθμητικά ψηφία) ή κωδικός πελάτη (50 αλφαριθμητικά ψηφία).
12	Συναλλακτική ικανότητα	P=Κύριος, A=Εκπρόσωπος.
13	Πλευρά αντισυμβαλλομένου	B=Αγοραστής, S=Πωλητής.
14	Συναλλαγή με αντισυμβαλλόμενο εκτός ΕΟΧ	Y=Ναι, N=Όχι.
15	Άμεσα συνδεδεμένη με εμπορική δραστηριότητα ή χρηματοδότηση ταμειακών διαθεσίμων	Y=Ναι, N=Όχι.
16	Κατώφλι εκκαθάρισης	Y=Άνω, N=Κάτω.
17	Αποτίμηση της σύμβασης στην τρέχουσα τιμή της αγοράς	Μέχρι 20 αριθμητικά ψηφία στον μορφότυπο xxxx,yyyyy.
18	Νόμισμα της αποτίμησης της σύμβασης στην τρέχουσα τιμή της αγοράς	Κωδικός νομίσματος ISO 4217, 3 αλφαριθμητικά ψηφία.
19	Ημερομηνία αποτίμησης	Μορφότυπος ημερομηνίας ISO 8601.
20	Ώρα αποτίμησης	Μορφότυπος ώρας UTC.
21	Τύπος αποτίμησης	M=τρέχουσα τιμή της αγοράς / O=βάσει μοντέλου.
22	Παροχή πρόσθετης ασφάλειας	U=μη εξασφαλισμένη, PC= μερικώς εξασφαλισμένη, OC= μονομερώς εξασφαλισμένη ή FC= πλήρως εξασφαλισμένη.
23	Χαρτοφυλάκιο πρόσθετης ασφάλειας	Y=Ναι, N=Όχι.
24	Κωδικός χαρτοφυλακίου πρόσθετης ασφάλειας	Μέχρι 10 αριθμητικά ψηφία.
25	Αξία της πρόσθετης ασφάλειας	Προσδιορισμός της αξίας του συνολικού ποσού της παρασχεθείσας πρόσθετης ασφάλειας· μέχρι 20 αριθμητικά ψηφία στον μορφότυπο xxxx,yyyyy.

	Τομέας	Μορφότυπος
	Μέρη της σύμβασης	
26	Νόμισμα της αξίας της πρόσθετης ασφάλειας	Προσδιορισμός νομίσματος του πεδίου 25· κωδικός νομίσματος ISO 4217, 3 αλφαβητικά ψηφία.

Πίνακας 2

Κοινά δεδομένα

	Τομέας	Μορφότυπος	Ισχυντές τύποι της σύμβασης παραγώγων
	Τμήμα 2α – Τύπος σύμβασης		Όλες οι συμβάσεις
1	Χρησιμοποιούμενη ταξινόμηση	Προσδιορισμός της χρησιμοποιούμενης ταξινόμησης: U = αναγνωριστικός κωδικός προϊόντος [εγκεκριμένος στην Ευρώπη] I = ISIN/AII + CFI E = Προσωρινή ταξινόμηση	
2	ID 1 προϊόντος	Για ταξινόμηση = U: Αναγνωριστικός κωδικός προϊόντος (UPI), να καθοριστεί Για ταξινόμηση = I: ISIN ή AII, 12ψήφιος αλφαριθμητικός κωδικός Για ταξινόμηση = E: Κατηγορία παραγώγου: CO = Βασικό προϊόν CR = Πίστωση N = Συνάλλαγμα EQ = Μετοχή IR = Επιτόκιο OT = Άλλη	
3	ID 2 προϊόντος	Για ταξινόμηση = U: Κενό Για ταξινόμηση = I: CFI, 6ψήφιος αλφαβητικός κωδικός Για ταξινόμηση = E: Τύπος παραγώγου: CD = Σύμβαση επί διαφοράς FR = Προθεσμιακή συμφωνία επιτοκίων FU = Σύμβαση μελλοντικής εκπλήρωσης FW = Προθεσμιακή πράξη OP = Δικαίωμα προαίρεσης SW = Πράξη ανταλλαγής (swap) OT = Άλλος.	

	Τομέας	Μορφότυπος	Ισχυοντές τύποι της σύμβασης παραγώνων
4	Υποκείμενο στοιχείο	ISIN (12 αλφαριθμητικά ψηφία) LEI (20 αλφαριθμητικά ψηφία) Προσωρινός αναγνωριστικός κωδικός οντότητας (20 αλφαριθμητικά ψηφία) UPI (να καθοριστεί) B = Καλάθι I = Δείκτης.	
5	Εικονικό νόμισμα 1	Κωδικός νομίσματος ISO 4217, 3 αλφαβητικά ψηφία.	
6	Εικονικό νόμισμα 2	Κωδικός νομίσματος ISO 4217, 3 αλφαβητικά ψηφία.	
7	Παραδοτέο νόμισμα	Κωδικός νομίσματος ISO 4217, 3 αλφαβητικά ψηφία.	
	Τμήμα 2β – Λεπτομερή στοιχεία για τη συναλλαγή		Όλες οι συμβάσεις
8	ID συναλλαγής	Μέχρι 52 αλφαριθμητικά ψηφία.	
9	Κωδικός αριθμός συναλλαγής	Αλφαριθμητικό πεδίο μέχρι 40 χαρακτήρες	
10	Τόπος εκτέλεσης	Αναγνωριστικός κωδικός αγοράς (MIC), ISO 10383 4 αλφαβητικά ψηφία. Αναλόγως, XOFF για εισηγμένα παράγωγα που αποτελούν αντικείμενο διαπραγμάτευσης εκτός χρηματιστηρίων ή XXXX για εξωχρηματιστηριακά παράγωγα.	
11	Συμπίεση	Y = εάν η σύμβαση προέρχεται από συμπίεση· N= εάν η σύμβαση δεν προέρχεται από συμπίεση.	
12	Τιμή / ισοτιμία	Μέχρι 20 αριθμητικά ψηφία στον μορφότυπο xxxx,yyyyy.	
13	Συμβολισμός τιμής	Π.χ. κωδικός νομίσματος ISO 4217, 3 αλφαβητικά ψηφία, ποσοστό.	
14	Εικονικό ποσό	Μέχρι 20 αριθμητικά ψηφία στον μορφότυπο xxxx,yyyyy.	
15	Πολλαπλασιαστές τιμής	Μέχρι 10 αριθμητικά ψηφία	
16	Ποσότητα	Μέχρι 10 αριθμητικά ψηφία	
17	Προκαταβολική πληρωμή	Μέχρι 10 αριθμητικά ψηφία στον μορφότυπο xxxx,yyyyy για πληρωμές που πραγματοποιεί το αναφέρον αντισυμβαλλόμενο μέρος και στον μορφότυπο xxxx,yyyyy για πληρωμές που εισέπραξε το αναφέρον αντισυμβαλλόμενο μέρος.	
18	Τύπος παράδοσης	C = μετρητά, P = φυσική, O = προαιρετικός για τον αντισυμβαλλόμενο.	
19	Χρονοσφραγίδα εκτέλεσης	Μορφότυπος ημερομηνίας ISO 8601/ μορφότυπος ώρας UTC.	
20	Ημερομηνία έναρξης ισχύος	Μορφότυπος ημερομηνίας ISO 8601	
21	Ημερομηνία ωρίμανσης	Μορφότυπος ημερομηνίας ISO 8601	

	Τομέας	Μορφότυπος	Ισχυοντές τύποι της σύμβασης παραγώνων
22	Ημερομηνία λήξης	Μορφότυπος ημερομηνίας ISO 8601	
23	Ημερομηνία διακανονισμού	Μορφότυπος ημερομηνίας ISO 8601	
24	Τύπος βασικής συμφωνίας (master agreement)	Ελεύθερο κείμενο, πεδίο έως 50 χαρακτήρες, που προσδιορίζουν την ονομασία της χρησιμοποιούμενης βασικής συμφωνίας, εάν υπάρχει.	
25	Έκδοση βασικής συμφωνίας	Έτος, xxxx.	
	Τμήμα 2γ - Μετριάσμός του κινδύνου / Αναφορά		Όλες οι συμβάσεις
26	Χρονοσφραγίδα επιβεβαίωσης	Μορφότυπος ημερομηνίας ISO 8601, μορφότυπος ώρας UTC	
27	Μέσα επιβεβαίωσης	Y=Μη ηλεκτρονικά επιβεβαιωμένο, N=Μη επιβεβαιωμένο, E=Ηλεκτρονικά επιβεβαιωμένο.	
	Τμήμα 2δ - Εκκαθάριση		Όλες οι συμβάσεις
28	Υποχρέωση εκκαθάρισης	Y=Ναι, N=Όχι.	
29	Εκκαθαρισμένο	Y=Ναι, N=Όχι.	
30	Χρονοσφραγίδα εκκαθάρισης	Μορφότυπος ημερομηνίας ISO 8601/ μορφότυπος ώρας UTC.	
31	ID κεντρικού αντισυμβαλλομένου	Αναγνωριστικός κωδικός νομικής οντότητας (LEI) (20 αλφαριθμητικά ψηφία) ή, αν μη διαθέσιμος, προσωρινός αναγνωριστικός κωδικός οντότητας (20 αλφαριθμητικά ψηφία) ή, αν μη διαθέσιμος, BIC (11 αλφαριθμητικά ψηφία).	
32	Ενδοομιλική	Y=Ναι, N=Όχι.	
	Τμήμα 2ε - Επιτόκια		Παράγωγα επιτοκίου
33	Σταθερό επιτόκιο σκέλους 1	Αριθμητικά ψηφία στον μορφότυπο xxxx,yyyy.	
34	Σταθερό επιτόκιο σκέλους 2	Αριθμητικά ψηφία στον μορφότυπο xxxx,yyyy.	
35	Υπολογισμός ημερών σταθερού επιτοκίου	Πραγματικό/365, 30B/360 ή άλλο.	
36	Συχνότητα πληρωμής σταθερού σκέλους	Ακέραιος πολλαπλασιαστής χρονικής περιόδου που περιγράφει τη συχνότητα ανταλλαγής πληρωμών μεταξύ των αντισυμβαλλομένων, π.χ. 10D, 3M, 5Y.	
37	Συχνότητα πληρωμής κυμαινόμενου επιτοκίου	Ακέραιος πολλαπλασιαστής χρονικής περιόδου που περιγράφει τη συχνότητα ανταλλαγής πληρωμών μεταξύ των αντισυμβαλλομένων, π.χ. 10D, 3M, 5Y.	
38	Συχνότητα επαναφοράς κυμαινόμενου επιτοκίου	D = Ακέραιος πολλαπλασιαστής χρονικής περιόδου που περιγράφει τη συχνότητα ανταλλαγής πληρωμών μεταξύ των αντισυμβαλλομένων, π.χ. 10D, 3M, 5Y..	
39	Κυμαινόμενο επιτόκιο σκέλους 1	Η ονομασία δείκτη κυμαινόμενου επιτοκίου, π.χ. 3M Euribor.	

	Τομέας	Μορφότυπος	Ισχυοντές τύποι της σύμβασης παραγώνων
40	Κυμαινόμενο επιτόκιο σκέλους 2	Η ονομασία δείκτη κυμαινόμενου επιτοκίου, π.χ. 3M Euribor	
	Τμήμα 2στ - Συνάλλαγμα		Παράγωγα συναλλάγματος
41	Νόμισμα 2	Κωδικός νομίσματος ISO 4217, 3 αλφαβητικά ψηφία.	
42	Ισοτιμία 1	Μέχρι 10 αριθμητικά ψηφία στον μορφότυπο xxxx,yyyyy.	
43	Προθεσμιακή ισοτιμία	Μέχρι 10 αριθμητικά ψηφία στον μορφότυπο xxxx,yyyyy.	
44	Βάση ισοτιμίας	Π.χ. EUR/USD ή USD/EUR.	
	Τμήμα 2ζ – Βασικά προϊόντα	Εάν ο UPI αναφέρεται και περιλαμβάνει όλες τις παρακάτω πληροφορίες, αυτές δεν απαιτούνται εκτός εάν πρέπει να αναφερθούν σύμφωνα με τον κανονισμό (ΕΕ) αριθ. 1227/2011.	Παράγωγα βασικών προϊόντων
	Γενικά		
45	Βάση των βασικών προϊόντων	AG = Γεωργικά προϊόντα EN = Ενέργεια FR = Φορτία M = Μέταλλα IN = Δείκτης EV = Περιβαλλοντικά EX = Εξωτικά	
46	Λεπτομερή στοιχεία για βασικά προϊόντα	Γεωργικά προϊόντα GO = Ελαιούχοι σπόροι DA = Γαλακτοκομικά LI = Ζωικό κεφάλαιο FO = Δασοκομικά SO = Μαλακά εμπορεύματα (Softs) Ενέργεια OI = Πετρέλαιο NG = Φυσικό αέριο CO = Ανθρακας EL = Ηλεκτρική ενέργεια IE = Δια-ενεργειακά Μέταλλα PR = Πολύτιμα NP = Μη πολύτιμα Περιβαλλοντικά WE = Καιρός EM = Εκπομπές	

	Τομέας	Μορφότυπος	Ισχυοντές τύποι της σύμβασης παραγώγων
	Ενέργεια		
47	Σημείο ή ζώνη παράδοσης	Κωδικός EIC, αλφαριθμητικός κωδικός 16 χαρακτήρων.	
48	Σημείο διασύνδεσης	Ελεύθερο κείμενο, πεδίο μέχρι 50 χαρακτήρες.	
49	Τύπος φορτίου	Επαναλαμβανόμενο τμήμα πεδίων 50-54 για τον προσδιορισμό των χαρακτηριστικών της παράδοσης προϊόντος, που αντιστοιχούν στις περιόδους παράδοσης εντός της ημέρας: BL = Βασικό φορτίο PL = Φορτίο αιχμής OP = Φορτίο εκτός φορτίου αιχμής BH = Block Hours (χρονικές ενότητες λειτουργίας) OT = Άλλο	
50	Ημερομηνία και ώρα έναρξης της παράδοσης	Μορφότυπος ημερομηνίας ISO 8601 / μορφότυπος ώρας UTC.	
51	Ημερομηνία και ώρα λήξης της παράδοσης	Μορφότυπος ημερομηνίας ISO 8601 / μορφότυπος ώρας UTC.	
52	Συμβατική ικανότητα	Ελεύθερο κείμενο, πεδίο μέχρι 50 χαρακτήρες.	
53	Ποσοτική μονάδα	10 αριθμητικά ψηφία στον μορφότυπο xxxx,yyyyy.	
54	Τιμή ανά ποσότητα ανά χρονικό διάστημα παράδοσης	10 αριθμητικά ψηφία στον μορφότυπο xxxx,yyyyy.	
	Τμήμα 2η - Δικαιώματα προαίρεσης		Συμβάσεις που περιλαμβάνουν δικαιώματα προαίρεσης
55	Τύπος δικαιωμάτων προαίρεσης	P=Πώληση, C=Αγορά.	
56	Τύπος δικαιωμάτων προαίρεσης (άσκηση)	A=Αμερικανικός, B=Βερμούδων, E=Ευρωπαϊκός, S=Ασιατικός.	
57	Τιμή άσκησης (ανώτατο/κατώτατο όριο)	Μέχρι 10 αριθμητικά ψηφία στο μορφότυπο xxxx,yyyyy.	
	Τμήμα 2θ - Τροποποιήσεις στη σύμβαση		Όλες οι συμβάσεις
58	Τύπος πράξης	N = Νέα M = Τροποποίηση E = Σφάλμα C = Ακύρωση Z = Συμπύεση V = Επικαιροποίηση αποτίμησης O = Άλλη.	
59	Λεπτομέρειες του τύπου πράξης	Ελεύθερο κείμενο, πεδίο μέχρι 50 χαρακτήρες	