

DELEGIERTE VERORDNUNG (EU) 2016/909 DER KOMMISSION**vom 1. März 2016****zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 596/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates im Hinblick auf technische Regulierungsstandards für den Inhalt der Meldungen, die den zuständigen Behörden zu übermitteln sind, sowie für die Zusammenstellung, Veröffentlichung und Pflege der Liste der Meldungen****(Text von Bedeutung für den EWR)**

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

gestützt auf die Verordnung (EU) Nr. 596/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 16. April 2014 über Marktmissbrauch (Marktmissbrauchsverordnung) und zur Aufhebung der Richtlinie 2003/6/EG des Europäischen Parlaments und des Rates und der Richtlinien 2003/124/EG, 2003/125/EG und 2004/72/EG ⁽¹⁾, insbesondere auf Artikel 4 Absatz 4 Unterabsatz 3,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) Die Delegierte Verordnung der Kommission, die gemäß Artikel 27 Absatz 3 Unterabsatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽²⁾ angenommen werden soll, sieht die fortlaufende Übermittlung von Referenzdaten für die zum Handel zugelassenen Finanzinstrumente vor. Dagegen übermitteln die Handelsplätze gemäß Artikel 4 der Verordnung (EU) Nr. 596/2014 ihren zuständigen Behörden jeweils nur eine Meldung mit ausführlichen Angaben zu den Finanzinstrumenten, die Gegenstand eines Antrags auf Zulassung zum Handel sind, zum Handel zugelassen werden oder gehandelt werden, sowie eine nachfolgende Meldung, wenn ein Finanzinstrument nicht mehr gehandelt wird oder seine Zulassung zum Handel erlischt. In Anbetracht der unterschiedlichen Meldepflichten, die sich aus der Verordnung (EU) Nr. 596/2014 und der oben genannten Delegierten Verordnung ergeben, sollten die in der vorliegenden Verordnung vorgesehenen Meldepflichten an die entsprechenden Anforderungen der oben genannten Delegierten Verordnung angeglichen werden, um den Verwaltungsaufwand der von diesen Pflichten betroffenen Unternehmen zu verringern.
- (2) Um eine effektive und effiziente Nutzung der Liste der Meldungen von Finanzinstrumenten zu ermöglichen, sollten die Handelsplätze vollständige und genaue Meldungen zu den Finanzinstrumenten vorlegen. Aus denselben Gründen sollten die zuständigen Behörden die eingehenden Meldungen zu den Finanzinstrumenten auf Vollständigkeit und Genauigkeit hin prüfen und bewerten und die Handelsplätze unverzüglich über festgestellte Unvollständigkeiten oder Ungenauigkeiten in Kenntnis setzen. Ebenso sollte die Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) die Vollständigkeit und Genauigkeit der von den zuständigen Behörden übermittelten Meldungen prüfen und diese Behörden unverzüglich über festgestellte Unvollständigkeiten oder Ungenauigkeiten in Kenntnis setzen.
- (3) Die Liste der Meldungen zu den Finanzinstrumenten sollte von der ESMA in elektronischer, maschinenlesbarer und herunterladbarer Form veröffentlicht werden, um einen effizienten Gebrauch und Austausch der Daten zu ermöglichen.
- (4) Diese Verordnung basiert auf den Entwürfen technischer Regulierungsstandards, die der Kommission von der ESMA vorgelegt wurden. Die ESMA hat zu diesen Entwürfen offene öffentliche Konsultationen durchgeführt, die damit verbundenen potenziellen Kosten und Nutzeffekte analysiert und die Stellungnahme der nach Artikel 37 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽³⁾ eingesetzten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte eingeholt.
- (5) Zur Sicherung reibungslos funktionierender Finanzmärkte sollte diese Verordnung baldmöglichst in Kraft treten und sollten die darin festgelegten Bestimmungen ab demselben Zeitpunkt gelten wie die Bestimmungen der Verordnung (EU) Nr. 596/2014 —

⁽¹⁾ ABl. L 173 vom 12.6.2014, S. 1.⁽²⁾ Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 15. Mai 2014 über Märkte für Finanzinstrumente und zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 (ABl. L 173 vom 12.6.2014, S. 84).⁽³⁾ Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde), zur Änderung des Beschlusses Nr. 716/2009/EG und zur Aufhebung des Beschlusses 2009/77/EG der Kommission (ABl. L 331 vom 15.12.2010, S. 84).

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

Artikel 1

Die Meldungen zu den Finanzinstrumenten gemäß Artikel 4 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 596/2014 beinhalten alle in Tabelle 2 des Anhangs der vorliegenden Verordnung genannten Angaben zu den betreffenden Finanzinstrumenten.

Artikel 2

(1) Die zuständigen Behörden überprüfen und beurteilen mithilfe automatisierter Verfahren, ob die gemäß Artikel 4 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 596/2014 übermittelten Meldungen den Anforderungen von Artikel 1 der vorliegenden Verordnung und Artikel 2 der Durchführungsverordnung (EU) 2016/378 der Kommission⁽¹⁾ entsprechen.

(2) Die Handelsplatzbetreiber werden mithilfe automatisierter Verfahren unverzüglich über unvollständige Angaben bei eingegangenen Meldungen und über eine etwaige Nichteinhaltung der in Artikel 1 der Durchführungsverordnung (EU) 2016/378 genannten Meldefrist in Kenntnis gesetzt.

(3) Die zuständigen Behörden übermitteln der ESMA gemäß Artikel 1 mithilfe automatisierter Verfahren vollständige und genaue Meldungen zu den Finanzinstrumenten.

Am Tag nach dem Eingang der Meldungen zu den Finanzinstrumenten gemäß Artikel 4 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 596/2014 konsolidiert die ESMA mithilfe automatisierter Verfahren die von allen zuständigen Behörden übermittelten Meldungen.

(4) Die ESMA überprüft und beurteilt mithilfe automatisierter Verfahren, ob die eingegangenen Meldungen der zuständigen Behörden vollständig und genau sind und dem in Tabelle 3 des Anhangs zur Durchführungsverordnung (EU) 2016/378 vorgegebenen Format sowie den dort angegebenen Normen entsprechen.

(5) Die ESMA setzt die zuständigen Behörden mithilfe automatisierter Verfahren unverzüglich über unvollständige Angaben bei eingegangenen Meldungen und über eine etwaige Nichteinhaltung der in Artikel 1 Absatz 3 der Durchführungsverordnung (EU) 2016/378 genannten Meldefrist in Kenntnis.

(6) Die ESMA veröffentlicht mithilfe automatisierter Verfahren die vollständige Liste der Meldungen in elektronischer, herunterladbarer und maschinenlesbarer Form auf ihrer Website.

Artikel 3

Diese Verordnung tritt am Tag nach ihrer Veröffentlichung im *Amtsblatt der Europäischen Union* in Kraft.

Sie gilt ab dem 3. Juli 2016.

Diese Verordnung ist in allen ihren Teilen verbindlich und gilt unmittelbar in jedem Mitgliedstaat.

Brüssel, den 1. März 2016

Für die Kommission
Der Präsident
Jean-Claude JUNCKER

⁽¹⁾ Durchführungsverordnung (EU) 2016/378 der Kommission vom 11. März 2016 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards in Bezug auf den Zeitplan, das Format und Muster für die Übermittlung der Meldungen an die zuständigen Behörden gemäß der Verordnung (EU) Nr. 596/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates (ABl. L 72 vom 17.3.2016, S. 1).

ANHANG

Meldungen zu Finanzinstrumenten gemäß Artikel 4 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 596/2014

Tabelle 1

Klassifizierung von Warenderivaten und Derivaten von Emissionszertifikaten für Tabelle 2 (Felder 35-37)

Basisprodukt	Unterprodukt	Weiteres Unterprodukt
„AGRI“ — Agrarprodukt	„GROS“ — Getreide und Ölsaaten	„FWHT“ — Futterweizen „SOYB“ — Sojabohnen „CORN“ — Mais „RPSD“ — Raps „RICE“ — Reis „OTHR“ — Sonstiges
	„SOFT“ — Weichwaren	„CCOA“ — Kakao „ROBU“ — Robusta-Kaffee „WHSG“ — Weißzucker „BRWN“ — Rohzucker „OTHR“ — Sonstiges
	„POTA“ — Kartoffeln	
	„OOLI“ — Olivenöl	„LAMP“ — Lampantöl
	„DIRY“ — Molkereiprodukte	
	„FRST“ — forstwirtschaftliche Produkte	
	„SEAF“ — Fisch und Meeresfrüchte	
	„LSTK“ — Vieh	
	„GRIN“ — Getreide	„MWHT“ — Mahlweizen
„NRGY“ — Energie	„ELEC“ — Strom	„BSLD“ — Grundlast „FITR“ — finanzielle Übertragungsrechte „PKLD“ — Spitzenlast „OFFP“ — Schwachlast „OTHR“ — Sonstiges
	„NGAS“ — Erdgas	„GASP“ — GASPOOL „LNGG“ — LNG „NBPG“ — NBP „NCGG“ — NCG „TTFG“ — TTF

Basisprodukt	Unterprodukt	Weiteres Unterprodukt
	„OILP“ — Öl	„BAKK“ — Bakken „BDSL“ — Biodiesel „BRNT“ — Brent „BRNX“ — Brent NX „CNDA“ — Kanadisch „COND“ — Kondensat „DSEL“ — Diesel „DUBA“ — Dubai „ESPO“ — ESPO „ETHA“ — Ethanol „FUEL“ — Brennstoff „FOIL“ — Motorentreibstoffe „GOIL“ — Gasöl „GSLN“ — Ottokraftstoff „HEAT“ — Heizöl „JTFL“ — Flugturbinenkraftstoff „KERO“ — Kerosin „LLSO“ — Light Louisiana Sweet (LLS) „MARS“ — MARS „NAPH“ — Naptha „NGLO“ — NGL „TAPI“ — Tapis „URAL“ — Ural „WTIO“ — WTI
	„COAL“ — Kohle „INRG“ — Arbitragegeschäft „RNNG“ — erneuerbare Energie „LGHT“ — leichte Bestandteile „DIST“ — Destillate	
„ENVR“ — Umwelt	„EMIS“ — Emissionen	„CERE“ — CER „ERUE“ — ERU „EUAE“ — EUA „EUAA“ — EUAA „OTHR“ — Sonstige
	„WTHR“ — Wetter „CRBR“ — Kohlenstoff	
„FRGT“ — Fracht	„WETF“ — Nass	„TNKR“ — Tanker
	„DRYF“ — Trocken	„DBCR“ — Massengutschiff
	„CSHP“ — Containerschiffe	

Basisprodukt	Unterprodukt	Weiteres Unterprodukt
„FRTL“ — Dünger	„AMMO“ — Ammoniak „DAPH“ — DAP (Diammoniumphosphat) „PTSH“ — Kali „SLPH“ — Schwefel „UREA“ — Harnstoff „UAAN“ — UAN (Harnstoff und Ammoniumnitrat)	
„INDP“ — Industrieerzeugnisse	„CSTR“ — Baugewerbe „MFTG“ — Verarbeitendes Gewerbe	
„METL“ — Metalle	„NPRM“ — Nichtelegmetalle	„ALUM“ — Aluminium „ALUA“ — Aluminiumlegierung „CBLT“ — Kobalt „COPR“ — Kupfer „IRON“ — Eisenerz „LEAD“ — Blei „MOLY“ — Molybdän „NASC“ — NASAAC „NICK“ — Nickel „STEL“ — Stahl „TINN“ — Zinn „ZINC“ — Zink „OTHR“ — Sonstiges
	„PRME“ — Edelmetalle	„GOLD“ — Gold „SLVR“ — Silber „PTNM“ — Platin „PLDM“ — Palladium „OTHR“ — Sonstiges
„MCEX“ — Multi Commodity exotisch		
„PAPR“ — Papier	„CBRD“ — Wellpappenroh papier „NSPT“ — Zeitungsdruckpapier „PULP“ — Holz- und Zellstoff „RCVP“ — Recyclingpapier	
„POLY“ — Polypropylen	„PLST“ — Kunststoff	
„INFL“ — Inflation		
„OEST“ — Offizielle Wirtschaftsstatistik		

Basisprodukt	Unterprodukt	Weiteres Unterprodukt
„OTHC“ — Sonstige C10 entsprechend der Definition in Anhang III Abschnitt „Sonstige C10-Derivate“, Tabelle 10.1, der Delegierten Verordnung der Kommission zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 im Hinblick auf technische Regulierungsstandards für Transparenzanforderungen für Handelsplätze und Wertpapierfirmen in Bezug auf Schuldverschreibungen, strukturierte Finanzprodukte, Emissionszertifikate und Derivate.	„DLVR“ — Lieferbar „NDLV“ — Nicht lieferbar	
„OTHR“ — Sonstige		

Tabelle 2

Inhalt der Meldungen, die den zuständigen Behörden gemäß Artikel 4 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 596/2014 zu übermitteln sind

Nr.	Feld	Zu meldender Inhalt
Allgemeine Felder		
1	Kennung des Instruments	Zur Identifizierung des Finanzinstruments verwendeter Code.
2	Vollständige Bezeichnung des Instruments	Vollständige Bezeichnung des Finanzinstruments.
3	Klassifizierung des Instruments	Zur Klassifizierung des Finanzinstruments verwendete Taxonomie. Es ist ein vollständiger und richtiger CFI-Code anzugeben.
4	Warenderivatindikator	Angabe, ob das Finanzinstrument unter die Definition der Warenderivate nach Artikel 2 Absatz 1 Nummer 30 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 fällt.
Felder mit Bezug auf den Emittenten		
5	Kennung des Emittenten oder Handelsplatzbetreibers	LEI des Emittenten oder Handelsplatzbetreibers.
Felder mit Bezug auf den Handelsplatz		
6	Handelsplatz	Segment MIC für den Handelsplatz oder systematischen Internalisierer, sofern verfügbar, ansonsten Operating MIC.
7	Kurzbezeichnung des Finanzinstruments	Kurzbezeichnung des Finanzinstruments des Finanzinstruments nach ISO 18774.
8	Antrag des Emittenten auf Zulassung zum Handel	Angabe, ob der Emittent des Finanzinstruments beantragt oder genehmigt hat, dass seine Finanzinstrumente auf einem Handelsplatz gehandelt bzw. zum Handel zugelassen werden.

Nr.	Feld	Zu meldender Inhalt
9	Datum der Genehmigung der Zulassung zum Handel	Datum und Uhrzeit der Genehmigung des Emittenten für den Handel mit seinen Finanzinstrumenten bzw. für deren Zulassung zum Handel auf einem Handelsplatz.
10	Datum der Beantragung der Zulassung zum Handel	Datum und Uhrzeit der Beantragung der Zulassung zum Handel auf dem Handelsplatz.
11	Datum der Zulassung zum Handel oder Datum des ersten Handelsabschlusses	Datum und Uhrzeit der Zulassung zum Handel auf einem Handelsplatz oder Datum und Zeitpunkt des erstmaligen Handels bzw. des erstmaligen Eingangs eines Auftrags oder einer Offerte auf dem Handelsplatz.
12	Kontraktende	Datum und Uhrzeit, zu dem/der Handel mit dem Finanzinstrument auf dem Handelsplatz eingestellt wird bzw. zu dem/der seine Zulassung zum Handel erlischt. Wenn Datum und Uhrzeit nicht verfügbar sind, ist das Feld nicht auszufüllen.

Felder mit Bezug auf den Nennwert

13	Nennwährung 1	Währung des Nennwerts. Bei Zinsderivatkontrakten oder Währungsderivatkontrakten ist dies die Nennwährung von Leg 1 oder die Währung 1 des Paares. Im Falle von Swaptions, bei denen der zugrunde liegende Swap in einheitlicher Währung erfolgt, ist dies die Nennwährung des zugrunde liegenden Swaps. Im Falle von Swaptions, bei denen der zugrunde liegende Swap in mehreren Währungen erfolgt, ist dies die Nennwährung von Leg 1 des Swaps.
----	---------------	---

Felder mit Bezug auf Schuldverschreibungen und sonstige verbrieftete Schuldtitel

14	Ausgebener Gesamtnennbetrag	Ausgebener Gesamtnennbetrag in monetärem Wert.
15	Fälligkeitstermin	Datum der Fälligkeit des angegebenen Finanzinstruments. Dieses Feld gilt für Schuldtitel mit festgelegter Fälligkeit.
16	Währung des Nennbetrags	Währung des Nennbetrags bei Schuldtiteln.
17	Nennwert je Stück/gehandelter Mindestwert	Nennwert jedes Instruments. Falls nicht verfügbar, ist der gehandelte Mindestwert anzugeben.
18	Festsatz	Fester Prozentsatz der Rendite eines Schuldtitels, wenn dieser bis zur Fälligkeit gehalten wird, in Prozenten angeben.
19	Kennung des Indexes/Benchmark einer variabel verzinslichen Schuldverschreibung	Sofern eine Kennung vorhanden ist.
20	Bezeichnung des Indexes/Benchmark einer variabel verzinslichen Schuldverschreibung	Wenn keine Kennung vorhanden, Bezeichnung des Index.
21	Laufzeit des Indexes/Benchmark einer variabel verzinslichen Schuldverschreibung	Laufzeit des Index/Benchmark einer variabel verzinslichen Schuldverschreibung. Die Laufzeit ist in Tagen, Wochen, Monaten oder Jahren anzugeben.
22	Basispunkte-Spread des Index/Benchmark einer variabel verzinslichen Schuldverschreibung	Zahl der Basispunkte über oder unter dem Index für die Preisberechnung.

Nr.	Feld	Zu meldender Inhalt
23	Vorrangigkeit der Schuldverschreibung	Angabe der Art der Schuldverschreibung: vorrangige Schuld, Mezzanin, nachrangig oder Junior.
Felder mit Bezug auf Derivate und verbriefte Derivate		
24	Ablaufdatum	Ablaufdatum des Finanzinstruments. Das Feld gilt nur für Derivate mit festgelegtem Ablaufdatum.
25	Preismultiplikator	Zahl der Anteile des Basisinstruments, die von einem einzelnen Derivatkontrakt erfasst werden. Bei Future oder Option auf einen Index: Betrag je Indexpunkt. Bei Spreadbets die Bewegung des Kurses des Basisinstruments, auf dem der Spreadbet beruht.
26	Code des Basisinstruments	ISIN-Code des Basisinstruments. Bei ADR, GDR und ähnlichen Instrumenten Angabe des ISIN-Codes des Finanzinstruments, auf denen diese Instrumente beruhen. Bei Wandelschuldverschreibungen Angabe des ISIN-Codes des Instruments, in das die Wandelschuldverschreibung umgewandelt werden kann. Bei Derivaten oder anderen Instrumenten mit einem Basiswert Angabe des ISIN-Codes des Basisinstruments, wenn der Basiswert auf einem Handelsplatz zum Handel zugelassen ist oder gehandelt wird. Handelt es sich beim Basiswert um eine Aktiendividende, Angabe des Instrument Code der betreffenden Aktie, die den Anspruch auf die zugrunde liegenden Dividenden begründet. Bei Credit Default Swaps sollte die ISIN der Referenzverbindlichkeit angegeben werden. Wenn der Basiswert ein Index ist und eine ISIN hat, Angabe des ISIN-Codes für diesen Index. Wenn es sich beim Basiswert um einen Korb handelt, Angabe des ISIN-Codes für jeden Bestandteil des Korbes, der auf einem Handelsplatz zum Handel zugelassen ist oder gehandelt wird. Daher sind die Felder 26 und 27 so oft zu melden, bis alle im Korb enthaltenen Instrumente aufgeführt sind.
27	Basisemittent	Wenn sich das Instrument auf einen Emittenten und nicht auf ein einzelnes Instrument bezieht, Angabe des LEI-Codes des Emittenten.
28	Bezeichnung des Basisindex	Wenn der Basiswert ein Index ist, Bezeichnung des Indexes.
29	Laufzeit des Basisindex	Wenn der Basiswert ein Index ist, Laufzeit des Indexes.
30	Art der Option	Angabe, ob es sich beim Derivatkontrakt um eine Call-Option (Berechtigung zum Erwerb eines spezifischen Basiswerts) oder eine Put-Option (Berechtigung zum Verkauf eines spezifischen Basiswerts) handelt oder ob zum Zeitpunkt der Ausübung nicht bestimmt werden kann, ob es sich um eine Call- oder Put-Option handelt. Im Fall von Swaptions gilt Folgendes: — „Put-Option“, wenn es sich um eine Receiver Swaption handelt, bei der der Käufer das Recht hat, in einen Swap einzutreten, in dem er einen festen Zinssatz empfängt. — „Call-Option“, wenn es sich um eine Payer Swaption handelt, bei der der Käufer das Recht hat, in einen Swap einzutreten, in dem er einen festen Zinssatz zahlt. Im Fall von Caps und Floors gilt Folgendes: — „Put-Option“ im Falle eines Floors. — „Call-Option“ im Falle eines Caps. Das Feld gilt nur für Derivate, die Optionen oder Optionsscheine sind.

Nr.	Feld	Zu meldender Inhalt
31	Ausübungspreis	<p>Festgelegter Preis, bei dem der Inhaber das Basisinstrument kaufen oder verkaufen muss, oder Angabe, dass der Preis zum Zeitpunkt der Ausübung nicht bestimmt werden kann.</p> <p>Das Feld gilt nur für Optionen oder Optionsscheine, bei denen der Ausübungspreis zum Zeitpunkt der Ausübung bestimmt werden kann.</p> <p>Wenn der Preis momentan nicht verfügbar, aber „in der Schwebe“ ist, lautet der Wert „PNDG“.</p> <p>Wenn kein Ausübungspreis zutrifft, ist das Feld nicht auszufüllen.</p>
32	Währung des Ausübungspreises	Währung des Ausübungspreises.
33	Art der Option (mögliche Ausübung)	<p>Angabe, ob die Option ausschließlich zu einem bestimmten Termin (europäische, asiatische Option), zu verschiedenen im Voraus festgelegten Daten (Bermuda-Option) oder jederzeit vor ihrem Verfallsdatum (American Style Option) ausgeübt werden kann.</p> <p>Dieses Feld gilt nur für Optionen, Optionsscheine und Berechtigungsscheine.</p>
34	Art der Lieferung	<p>Angabe, ob das Finanzinstrument in physischer Form oder bar abgegolten wird.</p> <p>Wenn die Lieferart zum Zeitpunkt des Abschlusses nicht bestimmt werden kann, ist der Wert „OPTL“ anzugeben.</p> <p>Dieses Feld gilt nur für Derivate.</p>

Warenderivate und Derivate von Emissionszertifikaten

35	Basisprodukt	Basisprodukt für die zugrunde liegende Anlageklasse gemäß der Tabelle zur Klassifizierung von Warenderivaten und Derivaten von Emissionszertifikaten.
36	Unterprodukt	<p>Das Unterprodukt für die zugrunde liegende Anlageklasse gemäß der Tabelle zur Klassifizierung von Warenderivaten und Derivaten von Emissionszertifikaten.</p> <p>Das Feld setzt ein Basisprodukt voraus.</p>
37	Weiteres Unterprodukt	<p>Das weitere Unterprodukt für die zugrunde liegende Anlageklasse gemäß der Tabelle zur Klassifizierung von Warenderivaten und Derivaten von Emissionszertifikaten.</p> <p>Das Feld setzt ein Unterprodukt voraus.</p>
38	Art der Transaktion	Art der Transaktion laut Angabe des Handelsplatzes.
39	Art des Schlusskurses	Art des Schlusskurses laut Angabe des Handelsplatzes.

Zinsderivate

— Die Felder in diesem Abschnitt sollten nur für Instrumente ausgefüllt werden, deren Basiswert ein Nicht-Finanzinstrument vom Typ Zinssatz ist.

40	Referenzzinssatz	Bezeichnung des Referenzzinssatzes.
41	IR-Kontraktlaufzeit	Wenn es sich bei der Anlageklasse um Zinssätze handelt, ist in diesem Feld die Kontraktlaufzeit anzugeben. Die Laufzeit ist in Tagen, Wochen, Monaten oder Jahren anzugeben.

Nr.	Feld	Zu meldender Inhalt
42	Nennwährung 2	Im Fall von Multi-Currency- oder Cross-Currency-Swaps die Währung, auf die Leg 2 des Kontrakts lautet. Bei Swaptions, denen ein Multi-Currency-Swap zugrunde liegt, die Währung, auf die Leg 2 des Swaps lautet.
43	Festsatz, Leg 1	Angabe des verwendeten Festsatzes von Leg 1, sofern zutreffend.
44	Festsatz, Leg 2	Angabe des verwendeten Festsatzes von Leg 2, sofern zutreffend.
45	Variabler Satz, Leg 2	Angabe des verwendeten Zinssatzes, sofern zutreffend.
46	IR-Kontraktlaufzeit von Leg 2	Angabe des Referenzzeitraums des Zinssatzes, der in im Voraus festgelegten Zeitabständen unter Bezugnahme auf einen marktüblichen Referenzzinssatz festgesetzt wird. Der Zeitraum ist in Tagen, Wochen, Monaten oder Jahren anzugeben.

Fremdwährungsderivate

— Die Felder in diesem Abschnitt sollten nur für Instrumente ausgefüllt werden, deren Basiswert ein Nicht-Finanzinstrument vom Typ Fremdwährung ist.

47	Nennwährung 2	In das Feld sollte die zugrunde liegende Währung 2 des Währungspaares eingegeben werden (die Währung eins wird unter Nennwährung 1 im Feld 13 eingegeben).
48	FX-Art	Art der zugrunde liegenden Währung.