



Rat der
Europäischen Union

111854/EU XXV. GP
Eingelangt am 15/07/16

Brüssel, den 14. Juli 2016
(OR. en)

11298/16
ADD 1

EF 240
ECOFIN 714
DELECT 162

ÜBERMITTLUNGSVERMERK

Absender:	Herr Jordi AYET PUIGARNAU, Direktor, im Auftrag des Generalsekretärs der Europäischen Kommission
Eingangsdatum:	14. Juli 2016
Empfänger:	Herr Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, Generalsekretär des Rates der Europäischen Union
Nr. Komm.dok.:	C(2016) 4405 final ANNEX 1
Betr.:	ANHANG zu DELEGIERTE VERORDNUNG (EU) .../... DER KOMMISSION vom XXX zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates im Hinblick auf technische Regulierungsstandards für die Datenstandards und -formate für die Referenzdaten für Finanzinstrumente und die technischen Maßnahmen in Bezug auf die von der ESMA und den zuständigen Behörden zu treffenden Vorkehrungen

Die Delegationen erhalten in der Anlage das Dokument C(2016) 4405 final ANNEX 1.

Anl.: C(2016) 4405 final ANNEX 1



EUROPÄISCHE
KOMMISSION

Brüssel, den 14.7.2016
C(2016) 4405 final

ANNEX 1

ANHANG

zu

DELEGIERTE VERORDNUNG (EU) .../... DER KOMMISSION vom XXX

zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates im Hinblick auf technische Regulierungsstandards für die Datenstandards und -formate für die Referenzdaten für Finanzinstrumente und die technischen Maßnahmen in Bezug auf die von der ESMA und den zuständigen Behörden zu treffenden Vorkehrungen

ANHANG

zu

DELEGIERTE VERORDNUNG (EU) .../... DER KOMMISSION vom XXX

zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates im Hinblick auf technische Regulierungsstandards für die Datenstandards und -formate für die Referenzdaten für Finanzinstrumente und die technischen Maßnahmen in Bezug auf die von der ESMA und den zuständigen Behörden zu treffenden Vorkehrungen

ANHANG

Tabelle 1

Legende zu Tabelle 3

ZEICHEN	DATENTYP	DEFINITION
{ALPHANUM-n}	Bis zu n alphanumerische Zeichen	Freitextfeld
{CFI_CODE}	6 Zeichen	ISO 10962 (CFI-Code)
{COUNTRYCODE_2}	2 alphanumerische Zeichen	Ländercode aus 2 Buchstaben gemäß ISO 3166-1 Alpha-2-Ländercode
{CURRENCYCODE_3}	3 alphanumerische Zeichen	Ländercode aus 3 Buchstaben gemäß den Währungs_codes nach ISO 4217
{DATE_TIME_FORMAT}	Datums- und Zeitformat gemäß ISO 8601	- Datum und Zeit in folgendem Format: JJJJ-MM-TTThh:mm:ss.ffffffZ. - „JJJJ“: Jahr - „MM“: Monat - „TT“: Tag - „T“ : Trenner von Datum und Uhrzeit (time) - „hh“: Stunde - „mm“: Minute - „ss.ffffff“ Sekunde und dezimale Bruchteile einer Sekunde - Z: Zeitzone UTC (koordinierte Weltzeit) Datum und Uhrzeit sind in UTC anzugeben.
{DATEFORMAT}	Datumsformat nach ISO 8601	Formatierung des Datums: JJJJ-MM-TT.
{DECIMAL-n/m}	Dezimalzahl mit bis zu n Stellen	Numerisches Feld für positive und negative Werte. - Dezimalzeichen: „.“ (Punkt);

	insgesamt, von denen bis zu m Stellen Bruchziffern sein können	- Negativen Zahlen wird „-“ (Minuszeichen) vorangestellt; - Werte werden gerundet und nicht gekürzt.
{INDEX}	4 Buchstaben	„EONA“ – EONIA „EONS“ – EONIA SWAP „EURI“ – EURIBOR „EUUS“ – EURODOLLAR „EUCH“ – EuroSwiss „GCFR“ – GCF REPO „ISDA“ – ISDAFIX „LIBI“ – LIBID „LIBO“ – LIBOR „MAAA“ – Muni AAA „PFAN“ – Pfandbriefe „TIBO“ – TIBOR „STBO“ – STIBOR „BBSW“ – BBSW „JIBA“ – JIBAR „BUBO“ – BUBOR „CDOR“ – CDOR „CIBO“ – CIBOR „MOSP“ – MOSPRIM „NIBO“ – NIBOR „PRBO“ – PRIBOR „TLBO“ – TELBOR

		„WIBO“ – WIBOR „TREA“ – Treasury „SWAP“ – SWAP „FUSW“ – Future SWAP
{INTEGER-n}	Ganze Zahl mit bis zu n Stellen insgesamt	Numerisches Feld für sowohl positive als auch negative ganze Zahlenwerte
{ISIN}	12 alphanumerische Zeichen	ISIN-Code gemäß ISO 6166
{LEI}	20 alphanumerische Zeichen	LEI-Code gemäß ISO 17442
{MIC}	4 alphanumerische Zeichen	MIC-Code gemäß ISO 10383
{FISN}	35 alphanumerische Zeichen	FISN-Code gemäß ISO 18774.

Tabelle 2

**Klassifizierung von Warenderivaten und Derivaten von Emissionszertifikaten für
Tabelle 3 (Felder 35 bis 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 „FTR“ – finanzielle Übertragungsrechte „PKLD“ – Spitzenlast „OFFP“ – Schwachlast „OTHR“ – Sonstiges
	„NGAS“ – Erdgas	„GASP“ – GASPOOL „LNGG“ – LNG „NBPG“ – NBP „NCGG“ – NCG „TTFG“ – TTF
	„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“ – Naphtha „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 „EUA“ – EUA „EUAA“ – EUAA „OTHR“ – Sonstiges
	„WTHR“ – Wetter „CRBR“ – Kohlenstoff	
„FRGT“ – Fracht	„WETF“ – Nass	„TNKR“ – Tanker
	„DRYF“ – Trocken	„DBCR“ – Massengutschiff
	„CSHP“ – Containerschiffe	
„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“ – Nichtedelmetalle	„ALUM“ – Aluminium „ALUA“ – Aluminiumlegierung „BLT“ – 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		
„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 des Europäischen Parlaments und des Rates im Hinblick auf technische Regulierungsstandards für Transparenzanforderungen für Handelsplätze und Wertpapierfirmen in Bezug auf Schuldverschreibungen, strukturierte Finanzprodukte, Emissionszertifikate und Derivate.		
„OTHR“ – Sonstiges		

Tabelle 3

Als Referenzdaten für Finanzinstrumente zu meldende Angaben

Nr.	FELD	ZU MELDENDER INHALT	FÜR DIE MELDUNGEN ZU VERWENDEDE STANDARDS UND FORMATE
Allgemeine Felder			
1	Kennung des Instruments	Zur Identifizierung des Finanzinstruments verwendeter Code.	{ISIN}
2	Vollständige Bezeichnung des Instruments	Vollständige Bezeichnung des Finanzinstruments.	{ALPHANUM-350}
3	Klassifizierung des Instruments	Zur Klassifizierung des Finanzinstruments verwendete Taxonomie. Es ist ein vollständiger und richtiger CFI-Code anzugeben.	{CFI_CODE}
4	Indikator für Warenderivate und Derivate von Emissionszertifikaten	Angabe, ob das Finanzinstrument unter die Definition der Warenderivate nach Artikel 2 Absatz 1 Nummer 30 der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 fällt oder ein Derivat im Zusammenhang mit Emissionszertifikaten nach Anhang I Abschnitt C Nummer 4 der Richtlinie 2014/65/EU ist.	„richtig“ – Ja „falsch“ – Nein
Felder mit Bezug auf den Emittenten			
5	Kennung des Emittenten oder Handelsplatzbetreiber s	LEI des Emittenten oder Handelsplatzbetreibers.	{LEI}
Felder mit Bezug auf den Handelsplatz			
6	Handelsplatz	Segment MIC für den Handelsplatz oder systematischen Internalisierer, sofern verfügbar, ansonsten Operating MIC.	{MIC}
7	Kurzbezeichnung des Finanzinstruments	Kurzbezeichnung des Finanzinstruments des Finanzinstruments nach ISO 18774.	{FISN}
8	Antrag auf Zulassung zum Handel durch	Angabe, ob der Emittent des Finanzinstruments beantragt oder genehmigt	„richtig“ – Ja

	den Emittenten	hat, dass sein Finanzinstrument auf einem Handelsplatz gehandelt bzw. zum Handel zugelassen wird.	„falsch“ – Nein
9	Datum 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.	{DATE_TIME_FORMAT}
10	Datum der Beantragung der Zulassung zum Handel	Datum und Uhrzeit der Beantragung der Zulassung zum Handel auf dem Handelsplatz.	{DATE_TIME_FORMAT}
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.	{DATE_TIME_FORMAT}
12	Kontraktende	Sofern vorhanden, Datum und Uhrzeit, zu dem/der Handel mit dem Finanzinstrument auf dem Handelsplatz eingestellt wird bzw. zu dem/der seine Zulassung zum Handel erlischt.	{DATE_TIME_FORMAT}
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.	{CURRENCYCODE_3}
Felder mit Bezug auf Schuldverschreibungen und sonstige verbrieft Schuldtitle			
14	Ausgegebener Gesamtnennbetrag	Ausgegebener Gesamtnennbetrag in monetärem Wert.	{DECIMAL-18/5}

15	Fälligkeitstermin	Datum der Fälligkeit des Finanzinstruments. Dieses Feld gilt für Schuldtitel mit festgelegter Fälligkeit.	{DATEFORMAT}
16	Währung des Nennbetrags	Währung des Nennbetrags bei Schuldtiteln.	{CURRENCYCODE_3}
17	Nennwert je Stück/gehandelter Mindestwert	Nennwert jedes Instruments. Falls nicht verfügbar, ist der gehandelte Mindestwert anzugeben.	{DECIMAL-18/5}
18	Festsatz	Fester Prozentsatz der Rendite eines Schuldtitels, wenn dieser bis zur Fälligkeit gehalten wird, in Prozenten angeben.	{DECIMAL-11/10} Ausgedrückt als Prozentanteil (z. B. 7.0 bedeutet 7 % und 0.3 bedeutet 0,3 %)
19	Kennung des Indexes/der Benchmark einer variabel verzinslichen Schuldverschreibung	Sofern eine Kennung vorhanden ist.	{ISIN}
20	Bezeichnung des Indexes/der Benchmark einer variabel verzinslichen Schuldverschreibung	Wenn keine Kennung vorhanden, Bezeichnung des Index.	{INDEX} oder {ALPHANUM-25} – wenn die Bezeichnung des Indexes nicht in der {INDEX}-Liste enthalten ist
21	Laufzeit des Indexes/der Benchmark einer variabel verzinslichen Schuldverschreibung	Laufzeit des Indexes/der Benchmark einer variabel verzinslichen Schuldverschreibung Die Laufzeit ist in Tagen, Wochen, Monaten oder Jahren anzugeben.	{INTEGER-3}+„TAGE“ – Tage {INTEGER-3}+„WOCHE“ – Wochen {INTEGER-3}+„MONATE“ – Monate {INTEGER-3}+„JAHR“ – Jahre
22	Basispunkt-Spread des Indexes/der Benchmark einer variabel verzinslichen Schuldverschreibung	Zahl der Basispunkte über oder unter dem Index für die Preisberechnung	{INTEGER-5}

23	Vorrangigkeit der Schuldverschreibung	Angabe der Art der Schuldverschreibung: vorrangige Schuld, Mezzanin, nachrangig oder Junior.	„SNDB“ – vorrangige Schuld „MZZD“ – Mezzanin „SBOD“ – nachrangig „JUND“ – Junior
Felder mit Bezug auf Derivate und verbriefte Derivate			
24	Ablaufdatum:	Ablaufdatum des Finanzinstruments. Das Feld gilt für Derivate mit festgelegtem Ablaufdatum.	{DATEFORMAT}
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.	{DECIMAL-18/17}
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 ISIN-Code der betreffenden Aktie, die den Anspruch auf die zugrunde liegende Dividende begründet. Bei Credit Default Swaps werden die ISIN der Referenzverbindlichkeit angegeben. Wenn der Basiswert ein Index ist und eine ISIN hat, Angabe des ISIN-Codes für diesen	{ISIN}

		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. Die Felder 26 und 27 sind 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.	{LEI}
28	Bezeichnung des Basisindexes	Wenn der Basiswert ein Index ist, Bezeichnung des Indexes.	{INDEX} oder {ALPHANUM-25} – wenn die Bezeichnung des Indexes nicht in der {INDEX}-Liste enthalten ist
29	Laufzeit des Basisindexes	Wenn der Basiswert ein Index ist, Laufzeit des Indexes.	{INTEGER-3}+„TAGE“ – Tage {INTEGER-3}+„WOCHE“ – Wochen {INTEGER-3}+„MONATE“ – Monate {INTEGER-3}+„JAHR“ – Jahre
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:	„PUTO“ – Put-Option „CALL“ – Call-Option „OTHR“ – wenn nicht bestimmt werden kann, ob es sich um eine Call- oder Put-Option handelt

		- „Put-Option“ im Falle eines Floors. - „Call-Option“ im Falle eines Caps. Das Feld gilt nur für Derivate, die Optionen oder Optionsscheine sind.	
31	Ausübungspreis	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. Das Feld gilt für Optionen oder Optionsscheine, bei denen der Ausübungspreis zum Zeitpunkt der Ausübung bestimmt werden kann. Wenn der Preis momentan nicht verfügbar, aber „in der Schwebe“ ist, lautet der Wert „PNDG“. Wenn kein Ausübungspreis zutrifft, ist das Feld nicht auszufüllen.	{DECIMAL-18/13} wenn der Preis als Geldwert angegeben wird {DECIMAL-11/10} wenn der Preis als Prozentsatz oder Rendite angegeben wird {DECIMAL-18/17} wenn der Preis als Basispunkte angegeben wird „PNDG“ wenn der Preis nicht verfügbar ist
32	Währung des Ausübungspreises	Währung des Ausübungspreises	{CURRENCYCODE_3}
33	Art der Option (mögliche Ausübung)	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. Dieses Feld gilt nur für Optionen, Optionsscheine und Berechtigungsscheine.	„EURO“ – Europäische Option „AMER“ – Amerikanische Option „ASIA“ – Asiatische Option „BERM“ – Bermuda-Option „OTHR“ – Sonstige
34	Art der Lieferung	Angabe, ob das Finanzinstrument in physischer Form oder bar abgegolten wird. Wenn die Lieferart zum Zeitpunkt des Abschlusses nicht bestimmt werden kann, ist der Wert „OPTL“ anzugeben. Dieses Feld gilt nur für Derivate.	„PHYS“ – physisch „CASH“ – bar „OPTL“ – Optional für die Gegenpartei oder bei Festlegung durch einen Dritten
Warenderivate und Derivate von Emissionszertifikaten			
35	Basisprodukt	Basisprodukt für die zugrunde liegende Anlageklasse gemäß der Tabelle zur Klassifizierung von Warenderivaten und Derivaten von Emissionszertifikaten.	Es sind nur Eintragungen aus der Spalte „Basisprodukt“ der Tabelle zur Klassifizierung von Warenderivaten zulässig.

36	Unterprodukt	Das Unterprodukt für die zugrunde liegende Anlageklasse gemäß der Tabelle zur Klassifizierung von Warenderivaten und Derivaten von Emissionszertifikaten. Das Feld setzt ein Basisprodukt voraus.	Es sind nur Eintragungen aus der Spalte „Unterprodukt“ der Tabelle zur Klassifizierung von Warenderivaten zulässig.
37	Weiteres Unterprodukt	Das weitere Unterprodukt für die zugrunde liegende Anlageklasse gemäß der Tabelle zur Klassifizierung von Warenderivaten und Derivaten von Emissionszertifikaten. Das Feld setzt ein Unterprodukt voraus.	Es sind nur Eintragungen aus der Spalte „Weiteres Unterprodukt“ der Tabelle zur Klassifikation von Warenderivaten zulässig.
38	Art der Transaktion	Art der Transaktion laut Angabe des Handelsplatzes	„FUTR“ – Terminkontrakt „OPTN“ – Option „TAPO“ – TAPO „SWAP“ – Swap „MINI“ – Mini-Future „OTCT“ – OTC-Derivate „ORIT“ – Direktverkauf „CRCK“ – Crack-Option „DIFF“ – Differenzgeschäft „OTHR“ – Sonstiges
39	Art des Schlusskurses	Art des Schlusskurses laut Angabe des Handelsplatzes	„ARGM“ – Argus/McCloskey „BLTC“ – Baltic „EXOF“ – Exchange „GBCL“ – GlobalCOAL „IHSM“ – IHS McCloskey „PLAT“ – Platts „OTHR“ – Sonstiges
Zinsderivate Die Felder in diesem Abschnitt werden nur für Instrumente ausgefüllt, deren Basiswert ein Nicht-Finanzinstrument vom Typ Zinssatz ist.			
40	Referenzzinssatz	Bezeichnung des Referenzzinssatzes.	{INDEX} oder {ALPHANUM-25} – wenn der Referenzzinssatz nicht in der {INDEX}-Liste enthalten ist
41	IR-Kontraktlaufzeit	Wenn es sich bei der Anlageklasse um Zinssätze handelt, ist in diesem Feld die Kontraktlaufzeit anzugeben. Die Laufzeit ist	{INTEGER-3}+„TAGE“ – Tage {INTEGER-3}+„WOCHE“ – Wochen {INTEGER-3}+„MONATE“ – Monate

		in Tagen, Wochen, Monaten oder Jahren anzugeben.	{INTEGER-3}+„JAHR“ – Jahre
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.	{CURRENCYCODE_3}
43	Festsatz, Leg 1	Angabe des verwendeten Festsatzes von Leg 1, sofern zutreffend.	{DECIMAL-11/10} Ausgedrückt als Prozentanteil (z. B. 7.0 bedeutet 7 % und 0.3 bedeutet 0,3 %)
44	Festsatz, Leg 2	Angabe des verwendeten Festsatzes von Leg 2, sofern zutreffend.	{DECIMAL-11/10} Ausgedrückt als Prozentanteil (z. B. 7.0 bedeutet 7 % und 0.3 bedeutet 0,3 %)
45	Variabler Satz, Leg 2	Angabe des verwendeten Zinssatzes, sofern zutreffend.	{INDEX} oder {ALPHANUM-25} – wenn der Referenzzinssatz nicht in der {INDEX}-Liste enthalten ist
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. Die Laufzeit ist in Tagen, Wochen, Monaten oder Jahren anzugeben.	{INTEGER-3}+„TAGE“ – Tage {INTEGER-3}+„WOCHE“ – Wochen {INTEGER-3}+„MONATE“ – Monate {INTEGER-3}+„JAHR“ – Jahre
Fremdwährungsderivate Die Felder in diesem Abschnitt werden nur für Instrumente ausgefüllt, deren Basiswert ein Nicht-Finanzinstrument vom Typ Fremdwährung ist.			
47	Nennwährung 2	In das Feld wird die zugrunde liegende Währung 2 des Währungspaares eingegeben (die Währung eins wird unter Nennwährung 1 im Feld 13 eingegeben).	{CURRENCYCODE_3}
48	FX-Art	Art der zugrunde liegenden Währung	„FXCR“ – FX Cross Rates „FXEM“ – FX Emerging Markets „FXMJ“ – FX Majors