



Euroopan unionin
neuvosto

Bryssel, 17. kesäkuuta 2022
(OR. en)

10387/22
ADD 1

EF 179
ECOFIN 638
DELECT 98

SAATE

Lähettäjä:	Euroopan komission pääsihteeri, allekirjoittajana johtaja Martine DEPREZ
Vastaanottaja:	Neuvoston pääsihteeristö
Kom:n asiak. nro:	C(2022) 3589 final
Asia:	LIITE asiakirjaan KOMISSION DELEGOITU ASETUS (EU) .../... Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 648/2012 täydentämisestä kauppätietorekistereihin ilmoitettavien tietojen vähimmäisyksityiskohtia ja käytettävien ilmoitusten tyyppiä koskevilla teknisillä sääntelystandardeilla

Valtuuskunnille toimitetaan oheisena asiakirja C(2022) 3589 final.

Liite: C(2022) 3589 final



Bryssel 10.6.2022
C(2022) 3589 final

ANNEX

LIITE

asiakirjaan

KOMISSION DELEGOITU ASETUS (EU) .../...

**Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 648/2012 täydentämisestä
kauppatietorekistereihin ilmoitettavien tietojen vähimmäisyksityiskohtia ja käytettävien
ilmoitusten tyyppiä koskevilla teknisillä sääntelystandardeilla**

LIITE

Taulukko 1

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
1	Johdannaissopimuksen osapuolet	Raportoinnin aikaleima	Kauppatietorekisteriin annetun ilmoituksen toimittamisen päivämäärä ja aika.
2	Johdannaissopimuksen osapuolet	Raportoivan yhteisön tunnistetiedot	Jos raportoinnista vastaava yhteisö on siirtänyt ilmoituksen antamisen kolmannen osapuolen tai toisen vastapuolen tehtäväksi, kyseinen yhteisö on täsmennettävä tässä kentässä yksilöllisellä koodilla. Muussa tapauksessa raportoinnista vastaava yhteisö olisi täsmennettävä tässä kentässä.
3	Johdannaissopimuksen osapuolet	Raportoinnista vastaava yhteisö	Jos finanssialalla toimivalla vastapuolella on yksinomainen vastuu, myös oikeudellinen vastuu, tietojen ilmoittamisesta molempien vastapuolten puolesta Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 648/2012 ¹ 9 artiklan 1 a kohdan mukaisesti ja finanssialan ulkopuolinen vastapuoli päättää olla itse ilmoittamatta finanssialalla toimivan vastapuolen kanssa tekemiensä OTC-johdannaissopimusten tietoja, kyseisen finanssialalla toimivan vastapuolen yksilöivä koodi. Jos rahastoyhtiöllä on vastuu, myös oikeudellinen vastuu, siirtokelpoisiin arvopapereihin kohdistuvaa yhteistä sijoitustoimintaa harjoittavan yrityksen (yhteissijoitusyritys) tietojen ilmoittamisesta mainitun asetuksen 9 artiklan 1 b kohdan mukaisesti, kyseisen rahastoyhtiön yksilöivä koodi. Jos

¹ Euroopan parlamentin ja neuvoston asetus (EU) N:o 648/2012, annettu 4 päivänä heinäkuuta 2012, OTC-johdannaisista, keskusvastapuolista ja kauppatietorekistereistä (EUVL L 201, 27.7.2012, s. 1).

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			vaihtoehtoisen sijoitusrahaston hoitajalla on yksinomainen vastuu, myös oikeudellinen vastuu, vaihtoehtoisen sijoitusrahaston tietojen ilmoittamisesta mainitun asetuksen 9 artiklan 1 c kohdan mukaisesti, kyseisen vaihtoehtoisen sijoitusrahaston hoitajan yksilöivä koodi. Jos lisäeläkelaitoksen hallinnoinnista vastaavalla ja sen puolesta toimivalla hyväksytyllä yhteisöllä on yksinomainen vastuu, myös oikeudellinen vastuu, tietojen ilmoittamisesta sen puolesta mainitun asetuksen 9 artiklan 1 d kohdan mukaisesti, kyseisen yhteisön yksilöivä koodi. Tätä kenttää sovelletaan ainoastaan OTC-johdannaisiin.
4	Johdannaissopimuksen osapuolet	Vastapuoli 1 (raportoiva vastapuoli)	Johdannaistransaktion sen vastapuolen tunnus, joka täyttää ilmoitusvelvollisuutensa kyseisellä ilmoituksella. Kun kyseessä on rahastonhoitajan rahaston puolesta toteuttama allokoitu johdannaistransaktio, vastapuoleksi ilmoitetaan rahasto eikä rahastonhoitaja.
5	Johdannaissopimuksen osapuolet	Vastapuolen 1 luonne	Ilmoitetaan, onko vastapuoli 1 keskusvastapuoli, finanssialalla toimiva vastapuoli, asetuksen (EU) N:o 648/2012 2 artiklan 1, 8 ja 9 kohdassa määritelty finanssialan ulkopuolinen vastapuoli vai kyseisen asetuksen 1 artiklan 5 kohdassa tarkoitettu yhteisö.

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
6	Johdannaissopimuksen osapuolet	Vastapuolen 1 yrityssektori	<p>Vastapuolen 1 yritystoiminnan luonne.</p> <p>Jos vastapuoli 1 on finanssialalla toimiva vastapuoli, tässä kentässä on oltava kaikki tarvittavat koodit, jotka sisältyvät [<i>julkaisutoimisto lisää viittauksen asiakirjaan C(2022) 3588</i>] liitteessä olevan taulukon 1 kentässä 6 olevaan finanssialalla toimivien vastapuolten luokitteluun ja joita sovelletaan kyseiseen vastapuoleen.</p> <p>Jos vastapuoli 1 on finanssialan ulkopuolinen vastapuoli, tässä kentässä on oltava kaikki tarvittavat koodit, jotka sisältyvät [<i>julkaisutoimisto lisää viittauksen asiakirjaan C(2022) 3588</i>] liitteessä olevan taulukon 1 kentässä 6 olevaan finanssialan ulkopuolisten vastapuolten luokitteluun ja joita sovelletaan kyseiseen vastapuoleen.</p> <p>Jos ilmoitetaan useampi kuin yksi toiminto, koodit on täytettävä vastaavien toimintojen suhteellinen tärkeyden mukaisessa järjestyksessä.</p>
7	Johdannaissopimuksen osapuolet	Vastapuolen 1 määrittelykynnysarvo	Tieto siitä, onko vastapuoli 1 asetuksen (EU) N:o 648/2012 4 a artiklan 3 kohdassa tai 10 artiklan 3 kohdassa tarkoitetun määrittelykynnysarvon yläpuolella transaktion toteuttamispäivänä.
8	Johdannaissopimuksen osapuolet	Vastapuolen 2 tunnuksen tyyppi	Tieto siitä, käytettiinkö vastapuolen 2 yksilöinnissä LEI-tunnusta.
9	Johdannaissopimuksen osapuolet	Vastapuoli 2	<p>Johdannaistransaktion toisen vastapuolen tunnus.</p> <p>Kun kyseessä on rahastonhoitajan rahaston puolesta toteuttama allokoitu johdannaistransaktio, vastapuoleksi ilmoitetaan rahasto eikä rahastonhoitaja.</p>

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
10	Johdannaissopimuksen osapuolet	Vastapuolen 2 maa	Jos vastapuoli 2 on luonnollinen henkilö, kyseisen henkilön asuinmaan koodi.
11	Johdannaissopimuksen osapuolet	Vastapuolen 2 luonne	Ilmoitetaan, onko vastapuoli 2 keskusvastapuoli, finanssialalla toimiva vastapuoli, asetuksen (EU) N:o 648/2012 2 artiklan 1, 8 ja 9 kohdassa määritelty finanssialan ulkopuolinen vastapuoli vai kyseisen asetuksen 1 artiklan 5 kohdassa tarkoitettu yhteisö.
12	Johdannaissopimuksen osapuolet	Vastapuolen 2 yrityssektori	Vastapuolen 2 yritystoiminnan luonne. Jos vastapuoli 2 on finanssialalla toimiva vastapuoli, tässä kentässä on oltava kaikki tarvittavat koodit, jotka sisältyvät <i>[julkaisutoimisto lisää viittauksen asiakirjaan C(2022) 3588]</i> liitteessä olevan taulukon 1 kentässä 6 olevaan finanssialalla toimivien vastapuolten luokitteluun ja joita sovelletaan kyseiseen vastapuoleen. Jos vastapuoli 2 on finanssialan ulkopuolinen vastapuoli, tässä kentässä on oltava kaikki tarvittavat koodit, jotka sisältyvät <i>[julkaisutoimisto lisää viittauksen asiakirjaan C(2022) 3588]</i> liitteessä olevan taulukon 1 kentässä 6 olevaan finanssialan ulkopuolisten vastapuolten luokitteluun ja joita sovelletaan kyseiseen vastapuoleen. Jos ilmoitetaan useampi kuin yksi toiminto, koodit on täytettävä vastaavien toimintojen suhteellinen tärkeyden mukaisessa järjestyksessä.
13	Johdannaissopimuksen osapuolet	Vastapuolen 2 määrittämissarvo	Tieto siitä, onko vastapuoli 2 asetuksen (EU) N:o 648/2012 4 a artiklan 3 kohdassa tai 10 artiklan 3 kohdassa tarkoitettu

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			määrityskynnysarvon yläpuolella transaktion toteuttamispäivänä.
14	Johdannaissopimuksen osapuolet	Vastapuolen 2 ilmoitusvelvollisuus	Tieto siitä, onko vastapuolella 2 asetuksen (EU) N:o 648/2012 mukainen ilmoitusvelvollisuus, riippumatta siitä, kenellä on yksinomainen vastuu, myös oikeudellinen vastuu, tietojen ilmoittamisesta.
15	Johdannaissopimuksen osapuolet	Välittäjän tunnistetiedot	Jos välittäjä toimii vastapuolen 1 puolesta ilman, että siitä itsestään tulee vastapuoli, vastapuolen 1 on täsmennettävä tämä välittäjä yksilöllisen koodin avulla.
16	Johdannaissopimuksen osapuolet	Määrittösosapuoli	Sen määrittösosapuolen tunnus, jonka kautta johdannaistransaktio on määritetty keskusvastapuolella. Tätä dataelementtiä sovelletaan määritettyihin transaktioihin.
17	Johdannaissopimuksen osapuolet	Suunta	Tieto siitä, onko vastapuoli 1 johdannaissopimuksen toteuttamispäivänä määritetty ostaja vai myyjä.
18	Johdannaissopimuksen osapuolet	Ensimmäisen korkovirran suunta	Tieto siitä, onko vastapuoli 1 johdannaissopimuksen toteuttamispäivänä määritetty ensimmäisen korkovirran maksaja vai vastaanottaja.
19	Johdannaissopimuksen osapuolet	Toisen korkovirran suunta	Tieto siitä, onko vastapuoli 1 johdannaissopimuksen toteuttamispäivänä määritetty toisen korkovirran maksaja vai vastaanottaja.
20	Johdannaissopimuksen osapuolet	Liittyy liiketoimintaan tai rahoitustoimintaan suoraan	Tieto siitä, onko sopimus objektiivisesti mitattavissa, koska se liittyy vastapuolen 1 liiketoimintaan tai rahoitustoimintaan suoraan asetuksen (EU) N:o 648/2012 10 artiklan 3 kohdassa

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			tarkoitettulla tavalla. Tämä kenttä täytetään ainoastaan, jos vastapuoli 1 on asetuksen (EU) N:o 648/2012 2 artiklan 9 kohdassa määritelty finanssialan ulkopuolinen vastapuoli.

Taulukko 2

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
1	Jakso 2a – Tunnukset ja linkit	UTI	[<i>Julkaisutoimisto lisää viittauksen asiakirjaan C(2022) 3588</i>] 7 artiklassa tarkoitettu yksilöllinen kauppatus.
2	Jakso 2a – Tunnukset ja linkit	Ilmoituksen seurantanumero	Jos johdannainen on toteutettu markkinapaikassa, markkinapaikan antama ja kyseiselle toteuttamiselle ainutlaatuinen numero.
3	Jakso 2a – Tunnukset ja linkit	Aiempi UTI-tunnus (yksi yhteen- ja yhdestä moneen -suhteet transaktioiden välillä)	Sellainen UTI-tunnus, joka on annettu sille edeltävälle transaktiolle, joka on aiheuttanut ilmoitetun transaktion elinkaaritapahtuman vuoksi, transaktioiden välisessä yksi yhteen -suhteessa (esimerkiksi novaation tapauksessa, kun transaktio päätetään ja tehdään uusi transaktio) tai transaktioiden välisessä yhdestä moneen -suhteessa (esimerkiksi määrittämisessä tai siinä tapauksessa, että transaktio jaetaan useaan eri transaktioon).

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			Tätä dataelementtiä ei voida soveltaa, kun raportoidaan transaktioiden välisistä monesta yhteen- ja monesta moneen -suhteista (esimerkiksi tiivistämisen tapauksessa).
4	Jakso 2a – Tunnukset ja linkit	Myöhemmän position UTI-tunnus	Sen position UTI-tunnus, johon johdannainen sisältyy. Tätä kenttää sovelletaan ainoastaan ilmoituksiin, jotka liittyvät johdannaisten päättymiseen sen vuoksi, että se on sisällytetty positioon.
5	Jakso 2a – Tunnukset ja linkit	Kaupan jälkeisen riskinvähennyksen tunnistetiedot	Kaupan jälkeisten riskinvähennyspalvelujen tarjoajan tai kaupan jälkeisiä riskinvähennyspalveluja tarjoavan keskusvastapuolen antama tunnus, jonka avulla voidaan yhdistää kaikki tiettyyn kaupan jälkeistä riskinvähennystä koskevaan tapahtumaan liittyvät ja siitä johtuvat johdannaiset.
6	Jakso 2a – Tunnukset ja linkit	Liiketoimikokonaisuuden tunnus	Tunnus (vastapuolen 1 määrittämä) saman liiketoimintakokonaisuuden johdannaisten liittämiseksi yhteen tämän asetuksen 1 artiklan 3 kohdan kolmannen alakohdan mukaisesti. Liiketoimikokonaisuuteen voi sisältyä ilmoitettavia ja muita kuin ilmoitettavia transaktioita.
7	Jakso 2b – Sopimuksen tiedot	Kansainvälinen arvopaperien tunnusnumero (ISIN)	ISIN-tunnus, jolla tuote tunnistetaan, jos kyseinen tuote on otettu kaupankäynnin kohteeksi tai sillä käydään kauppaa säännellyillä markkinoilla,

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			monenkeskisessä kaupankäyntijärjestelmässä, organisoidussa kaupankäyntijärjestelmässä tai kauppojen sisäisessä toteuttajassa.
8	Jakso 2b – Sopimuksen tiedot	Yksilöllinen tuotetunnus (UPI)	Tuotteen tunnistamiseen käytetty UPI-tunnus.
9	Jakso 2b – Sopimuksen tiedot	Tuotteen luokitus	Välineeseen liittyvä CFI-koodi (Classification of Financial Instruments).
10	Jakso 2b – Sopimuksen tiedot	Sopimustyyppi	Jokainen ilmoitettu sopimus on luokiteltava sen tyyhin mukaan.
11	Jakso 2b – Sopimuksen tiedot	Omaisuuslaji	Jokainen ilmoitettu sopimus on luokiteltava sen omaisuuslajin mukaan, johon se perustuu.
12	Jakso 2b – Sopimuksen tiedot	Kryptovaroihin perustuva johdannainen	Tieto siitä, perustuuko johdannainen kryptovaroihin.
13	Jakso 2b – Sopimuksen tiedot	Kohde-etuuden tunnistetietojen tyyppi	Asianomaisen kohde-etuuden tunnuksen tyyppi.
14	Jakso 2b – Sopimuksen tiedot	Kohde-etuuden tunnistetiedot	Suora kohde-etuus on täsmennettävä käyttäen sen yksilöllistä tunnusta kohde-etuuden tyyppiin perustuen. Luottoriskinvaihtosopimusten tapauksessa olisi ilmoitettava referenssiomaisuuden ISIN-tunnus.
15	Jakso 2b – Sopimuksen tiedot	Kohde-etuutena olevan indeksin indikaattori	Tieto kohde-etuutena olevasta indeksistä, jos sellainen on saatavilla.

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
16	Jakso 2b – Sopimuksen tiedot	Kohde-etuutena olevan indeksin nimi	Indeksin tarjoajan antama kohde-etuutena olevan indeksin koko nimi.
17	Jakso 2b – Sopimuksen tiedot	Mukautetun korin koodi	Jos johdannaistransaktio perustuu mukautettuun koriin, yksilöllinen koodi, jonka mukautetun korin järjestäjä on antanut sen osien yhdistämiseksi.
18	Jakso 2b – Sopimuksen tiedot	Korin osien tunnus	Jos kyseessä on mukautettu kori, joka koostuu muun muassa rahoitusvälineistä, joilla käydään kauppaa markkinapaikassa, täsmennetään ainoastaan rahoitusvälineet, joilla käydään kauppaa markkinapaikassa.
19	Jakso 2b – Sopimuksen tiedot	Toimitusvaluutta 1	Tarvittaessa valuutta, jota käytetään transaktion käteissuoritukseen. Sellaisten monivaluuttaisten tuotteiden osalta, joita ei nettouteta, ensimmäisen korkovirran toimitusvaluutta. Tätä dataelementtiä ei sovelleta kohde-etuus luovuttamalla toteutettaviin tuotteisiin (esimerkiksi kohde-etuus luovuttamalla toteutettavat swaptiot).
20	Jakso 2b – Sopimuksen tiedot	Toimitusvaluutta 2	Tarvittaessa valuutta, jota käytetään transaktion käteissuoritukseen. Sellaisten monivaluuttaisten tuotteiden osalta, joita ei nettouteta, toisen korkovirran toimitusvaluutta. Tätä dataelementtiä ei sovelleta kohde-etuus luovuttamalla toteutettaviin tuotteisiin (esimerkiksi

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			kohde-etuus luovuttamalla toteutettavat swaptiot).
21	Jakso 2c – Arvostus	Arvostuksen määrä	Tämän asetuksen 4 artiklassa tarkoitettu sopimuksen markkinahintaan arvostus tai malliin perustuva arvostus. Keskusvastapuolen arvostusta on käytettävä määritettyjen kauppojen osalta.
22	Jakso 2c – Arvostus	Arvostusvaluutta	Valuutta, jonka määräinen arvostuksen määrä on.
23	Jakso 2c – Arvostus	Arvostuksen aikaleima	Viimeisimmän markkinahintaan arvostuksen päivämäärä ja kellonaika, jotka keskusvastapuoli on toimittanut tai jotka on laskettu käyttämällä syöttötietojen nykyistä tai viimeisintä saatavilla olevaa markkinahintaa.
24	Jakso 2c – Arvostus	Arvostusmenetelmä	Vastapuolen 1 transaktion arvostuksessa käyttämä lähde ja menetelmä. Jos käytetään vähintään yhtä arvostuksen syöttötietoa, joka luokitellaan malliin perustuvaksi arvostukseksi, koko arvostus luokitellaan malliin perustuvaksi arvostukseksi. Jos käytetään ainoastaan sellaisia syöttötietoja, jotka

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			luokitellaan markkinahintaan arvostukseksi, koko arvostus luokitellaan markkinahintaan arvostukseksi.
25	Jakso 2c – Arvostus	Delta	Johdannaistransaktion hinnan muutoksen suhde kohde-etuuden hinnan muutokseen. Tätä kenttää sovelletaan ainoastaan optioihin ja swaptioihin. Finanssialalla toimivien vastapuolten ja asetuksen (EU) N:o 648/2012 10 artiklassa tarkoitettujen finanssialan ulkopuolisten vastapuolten on ilmoitettava päivitetty delta päivittäin.
26	Jakso 2d – Vakuus	Vakuussalkun indikaattori	Tieto siitä, onko vakuus asetettu salkkuperusteisesti. Ilmaisulla ”salkkuperusteisesti” tarkoitetaan transaktioiden muodostamaa kokonaisuutta, jolle lasketaan marginaali yhdessä (joko netto- tai bruttoperusteisesti), toisin kuin tilanteessa, jossa marginaali lasketaan ja kirjataan erikseen kunkin yksittäisen transaktion osalta.
27	Jakso 2d – Vakuus	Vakuussalkun koodi	Jos vakuus ilmoitetaan salkkuperusteisesti, vastapuolen 1 salkulle antama yksilöllinen koodi. Tätä dataelementtiä ei sovelleta, jos vakuus on asetettu transaktiotasolla, jos vakuussopimusta ei ole tai jos vakuutta ei ole asetettu tai saatu.

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
28	Jakso 2e – Riskin vähentäminen / raportointi	Vahvistamisen aikaleima	Vahvistamisen päivämäärä ja aika komission delegoidun asetuksen (EU) N:o 149/2013 ² 12 artiklassa määritellyllä tavalla. Sovelletaan ainoastaan OTC-johdannaissopimuksiin, joita ei määritetä keskusvastapuolella.
29	Jakso 2e – Riskin vähentäminen / raportointi	Vahvistettu	Uusien ilmoitettavien transaktioiden osalta se, onko OTC-johdannaissopimuksen oikeudellisesti sitovat ehdot dokumentoitu ja hyväksytty (vahvistettu) vai ei (vahvistamaton). Jos ne on dokumentoitu ja hyväksytty, ilmoitetaan se, onko tällainen vahvistus tehty <ul style="list-style-type: none"> • yhteisen vahvistusvälineen tai - järjestelmän taikka yksityisen tai kahdenvälisen sähköisen järjestelmän kautta (sähköinen); • ihmisen luettavissa olevalla kirjallisella asiakirjalla, kuten faksilla, paperilla tai manuaalisesti käsitellyillä sähköpostiviesteillä (muu kuin sähköinen). Sovelletaan ainoastaan OTC-johdannaissopimuksiin, joita ei määritetä keskusvastapuolella.

² Komission delegoitu asetus (EU) N:o 149/2013, annettu 19 päivänä joulukuuta 2012, Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 648/2012 täydentämisestä epäsuoria määrittämenettelyjä, määrittäsvollisuutta, julkista rekisteriä, markkinapaikkaan pääsyä, finanssialan ulkopuolisia vastapuolia ja sellaisiin OTC-johdannaissopimuksiin sovellettavia riskienpientämistekniikoita, joita ei määritetä keskusvastapuolella, koskevien teknisten sääntelystandardien osalta (EUVL L 52, 23.2.2013, s. 11).

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
30	Jakso 2f – Määrittäminen	Määrittämisvelvollisuus	Ilmoitetaan, kuuluuko ilmoitettu sopimus OTC-johdannaisluokkaan, johon sovelletaan määrittämisvelvollisuutta, ja sovelletaanko molempiin sopimuspuolina oleviin vastapuoliin asetuksen (EU) N:o 648/2012 mukaista määrittämisvelvollisuutta sopimuksen täytäntöönpanoajankohtana. Sovelletaan ainoastaan OTC-johdannais sopimuksiin.
31	Jakso 2f – Määrittäminen	Määritetty	Tieto siitä, onko johdannainen määritetty keskusvastapuolella.
32	Jakso 2f – Määrittäminen	Määrittämisen aikaleima	Kellonaika ja päivämäärä, jona määrittäminen on tehty. Sovelletaan ainoastaan johdannaisiin, joita ei määritetä keskusvastapuolella.
33	Jakso 2f – Määrittäminen	Keskusvastapuoli	Sen keskusvastapuolen, jossa transaktio on määritetty, tunnus. Tätä dataelementtiä ei sovelleta, jos dataelementin ”Määritetty” arvo on ”N” (”Ei määritetty keskitetysti”).
34	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Vakiosopimuksen tyyppi	Ilmoitetaan, minkä tyyppisen vakiosopimuksen mukaisesti vastapuolet ovat tehneet johdannais sopimuksen.
35	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Muun vakiosopimuksen tyyppi	Vakiosopimuksen nimi. Tämä kenttä täytetään vain, jos tämän taulukon kentässä 34 ilmoitetaan ”OTHR”.

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
36	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Vakiosopimuksen versio	Ilmoitetaan tarpeen mukaan, miltä vuodelta ilmoitetussa kaupassa käytetty vakiosopimus on peräisin.
37	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Konsernin sisäinen	Ilmoitetaan, onko sopimus tehty asetuksen (EU) N:o 648/2012 3 artiklassa määriteltynä konsernin sisäisenä transaktiona.
38	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Kaupan jälkeinen riskinvähennys	Ilmoitetaan, perustuuko sopimus kaupan jälkeiseen riskinvähennykseen.
39	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Kaupan jälkeisen riskinvähennyksen tekniikan tyyppi	Kaupan jälkeisen riskinvähennyksen toiminnon tyyppin ilmoittaminen asetuksen (EU) N:o 648/2012 mukaista raportointia varten. Salkun tiivistäminen ilman kolmannen osapuolen palveluntarjoajaa: järjestely, jolla vähennetään olemassa oleviin kauppasalkkuihin liittyvää riskiä käyttämällä hinnanmuodostukseen vaikuttamattomia kauppoja pääasiassa auki olevan nimellismäärän vähentämiseksi, transaktioiden määrän vähentämiseksi tai ehtojen yhdenmukaistamiseksi muulla tavoin päättämällä kaupat kokonaan tai osittain ja yleensä korvaamalla päättetyt johdannaiset uusilla korvaavilla kaupoilla. Salkun tiivistäminen kolmannen osapuolen palveluntarjoajan tai keskusvastapuolen kanssa: palveluntarjoajan tai keskusvastapuolen tarjoama kaupan jälkeinen

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			<p>riskinvähennyspalvelu, jolla vähennetään olemassa oleviin kauppasalkkuihin liittyvää riskiä käyttämällä hinnanmuodostukseen vaikuttamattomia kauppvoja pääasiassa auki olevan nimellismäärän vähentämiseksi, transaktioiden määrän vähentämiseksi tai ehtojen yhdenmukaistamiseksi muulla tavoin päättämällä kaupat kokonaan tai osittain ja yleensä korvaamalla päätetyt johdannaiset uusilla korvaavilla kaupoilla.</p> <p>Salkun sijoituspainotusten muutos / marginaalin hallinta: palveluntarjoajan tarjoama kaupan jälkeinen riskinvähennyspalvelu, jolla vähennetään olemassa olevaan kauppasalkkuun liittyvää riskiä lisäämällä siihen uusia hinnanmuodostukseen vaikuttamattomia kauppvoja ja jossa mitään salkun olemassa olevia kauppvoja ei päätetä tai korvata, ja nimellismäärä pikemminkin kasvaa kuin pienenee.</p> <p>Salkun muut kaupan jälkeiset riskinvähennyspalvelut: palveluntarjoajan tarjoama kaupan jälkeinen riskinvähennyspalvelu, jolla vähennetään olemassa oleviin kauppasalkkuihin liittyvää riskiä käyttämällä hinnanmuodostukseen vaikuttamattomia kauppvoja, ja jos tällaista palvelua ei voida pitää salkun tiivistämisenä tai salkun sijoituspainotusten</p>

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			muutoksena.
40	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Kaupan jälkeisten riskinvähennyspalvelujen tarjoaja	Kaupan jälkeisten riskinvähennyspalvelujen tarjoajan LEI-tunnus.
41	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Toteuttamispaikka	<p>Sen paikan yksilöiminen, jossa toimeksianto on toteutettu.</p> <p>Kauppapaikassa, kauppojen sisäisessä toteuttajassa tai organisoidussa kaupankäyntijärjestelmässä unionin ulkopuolella toteutetuista liiketoimista käytetään ISO 10383 -standardin mukaista ”segment MIC” -koodia. Jos ”segment MIC” -koodia ei ole olemassa, käytetään ”operating MIC” -koodia.</p> <p>Rahoitusvälineistä, jotka on otettu kaupankäynnin kohteeksi tai joilla käydään kauppaa markkinapaikassa tai joiden kaupankäynnin kohteeksi ottamista on pyydetty, käytetään MIC-koodia ”XOFF”, jos kyseistä rahoitusvälinettä koskevaa transaktiota ei toteuteta markkinapaikassa, kauppojen sisäisessä toteuttajassa tai organisoidussa kaupankäyntijärjestelmässä unionin ulkopuolella tai jos vastapuoli ei ole tietoinen siitä, että vastapuoli 2, jonka kanssa se käy kauppaa, toimii kauppojen sisäisenä toteuttajana.</p> <p>Rahoitusvälineistä, joita ei ole otettu kaupankäynnin kohteeksi tai joilla ei käydä</p>

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			kauppaa markkinapaikassa tai joiden kaupankäynnin kohteeksi ottamista ei ole pyydetty ja joilla ei käydä kauppaa organisoidussa kaupankäyntijärjestelmässä unionin ulkopuolella, käytetään MIC-koodia ”XXXX”.
42	Jakso 2c – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Toteutuksen aikaleima	Päivämäärä ja kellonaika, jolloin transaktio alun perin toteutettiin siten, että se johti uuden UTI-tunnuksen antamiseen. Tämä dataelementti pysyy muuttumattomana UTI-tunnuksen koko elinkaaren ajan. Positiotason raportoinnin osalta sen olisi viitattava ajankohtaan, jolloin positio avattiin ensimmäistä kertaa.
43	Jakso 2c – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Voimaantulopäivä	OTC-johdannaistransaktioon liittyvien velvoitteiden oikaisematon voimaantulopäivä, sellaisena kuin se on sisällytetty vahvistukseen. Jos voimaantulopäivää ei ole määritetty osana sopimuksen ehtoja, vastapuolten on ilmoitettava tässä kentässä johdannaisen täytäntöönpanopäivä.
44	Jakso 2c – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Voimassaolon päätymispäivä	Johdannaistransaktioon liittyvien velvoitteiden oikaisematon voimassaolon päätymispäivä, sellaisena kuin se on sisällytetty vahvistukseen. Ennenaikainen päättyminen ei vaikuta tähän dataelementtiin.

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
45	Jakso 2c – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Ennenaikaisen päättymisen päivämäärä	Ilmoitettavan transaktion ennenaikaisen päättymisen voimaantulopäivä. Tätä dataelementtiä sovelletaan, jos transaktio päätyy ennen sen erääntymistä vastapuolen (tai vastapuolten) kesken kaiken tekemän päätöksen vuoksi.
46	Jakso 2c – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Sopimuksen lopullinen toimituspäivä	Sopimuksen mukainen oikaisematon päivämäärä, johon mennessä kaikki käteisvarojen tai varojen siirrot olisi toteutettava, eikä vastapuolilla saisi enää olla kyseisen sopimuksen mukaisia täyttämättömiä velvoitteita toisiaan kohtaan. Niiden tuotteiden osalta, joilla ei ehkä ole lopullista sovittua toimituspäivää (esimerkiksi amerikkalaiset optiot), tämä dataelementti vastaa päivää, johon mennessä käteisvarojen tai varojen siirto tapahtuisi, jos sopimuksen voimassaolo päätyisi eräpäivänä.
47	Jakso 2c – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Toimitustapa	Ilmoitetaan, onko sopimuksen toimitusmuoto fyysinen vai käteinen.
48	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Hinta	Johdannaistransaktiossa määritetty hinta. Siihen ei sisälly maksuja, veroja tai palkkioita. Jos hinta ei ole tiedossa, kun ilmoitetaan uudesta transaktiosta, hinta päivitetään silloin, kun se on saatavilla. Liiketoimikokonaisuuteen kuuluvien transaktioiden osalta tämä dataelementti sisältää tarvittaessa

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			osatransaktion hinnan.
49	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Hinnan valuutta	Valuutta, jonka määräinen hinta on. Hinnan valuuttaa sovelletaan ainoastaan, jos hinta ilmaistaan rahallisena arvona.
	Kentät 50–52 ovat toistuvia, ja ne täytetään sellaisten johdannaisten osalta, joihin liittyy hintaluetteloita.		
50	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Hinnan oikaisematon voimaantulopäivä	Hinnan oikaisematon voimaantulopäivä.
51	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Hinnan oikaisematon päättymispäivä	Hinnan oikaisematon päättymispäivä (ei sovelleta, jos tietyn luettelon jakson oikaisematon päättymispäivä on sama kuin seuraavan jakson oikaisematon voimaantulopäivä).
52	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Oikaisemattoman voimaantulopäivän ja päättymispäivän välillä voimassa oleva hinta.	Oikaisemattoman voimaantulopäivän ja oikaisemattoman päättymispäivän välillä, mukaan lukien päättymispäivä, voimassa oleva hinta.
53	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Liiketoimikokonaisuuden hinta	Koko sen liiketoimikokonaisuuden kauppahinta, jonka osa ilmoitettu

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			<p>johdannaistransaktio on. Tätä dataelementtiä ei sovelleta, jos</p> <ul style="list-style-type: none"> • kyse ei ole liiketoimikokonaisuudesta tai • käytetään liiketoimikokonaisuuden spreadia. <p>Hinnat ja niihin liittyvät transaktioiden dataelementit (hinnan valuutta), jotka edustavat liiketoimikokonaisuuden yksittäisiä osia, ilmoitetaan, kun ne ovat saatavilla. Liiketoimikokonaisuuden hinta ei välttämättä ole tiedossa, kun uudesta transaktiosta ilmoitetaan, mutta se voidaan päivittää myöhemmin.</p>
54	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Liiketoimikokonaisuuden hinnan valuutta	<p>Valuutta, jonka määräinen liiketoimikokonaisuuden hinta on. Tätä dataelementtiä ei sovelleta, jos</p> <ul style="list-style-type: none"> • kyse ei ole liiketoimikokonaisuudesta tai • käytetään liiketoimikokonaisuuden spreadia tai • liiketoimikokonaisuuden hinta ilmaistaan prosentteina.
55	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Ensimmäisen korkovirran nimellismäärä	Tämän asetuksen 5 artiklassa tarkoitettu ensimmäisen korkovirran nimellismäärä.
56	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Nimellisvaluutta 1	Tarvittaessa valuutta, jonka määräinen ensimmäisen korkovirran nimellismäärä on.

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
	Kentät 57–59 ovat toistuvia, ja ne täytetään sellaisten johdannaisten osalta, joihin liittyy nimellismäärää koskevia luetteloita.		
57	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Ensimmäisen korkovirran nimellismäärän voimaantulopäivä	Oikaisematon päivä, jona ensimmäisen korkovirran nimellismäärä tulee voimaan.
58	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Ensimmäisen korkovirran nimellismäärän päättymispäivä	Ensimmäisen korkovirran nimellismäärän oikaisematon päättymispäivä (ei sovelleta, jos tietyn luettelon jakson oikaisematon päättymispäivä on sama kuin seuraavan jakson oikaisematon voimaantulopäivä).
59	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Ensimmäisen korkovirran voimaantulopäivänä voimassa oleva nimellismäärä	Ensimmäisen korkovirran nimellismäärä, joka tulee voimaan oikaisemattomana voimaantulopäivänä.
60	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Ensimmäisen korkovirran nimellislukumäärä yhteensä	Ensimmäisen korkovirran kohde-etuuden yhteenlaskettu nimellislukumäärä transaktion voimassaoloaikana. Jos kokonaisnimellislukumäärä ei ole tiedossa, kun ilmoitetaan uudesta transaktiosta, kokonaisnimellislukumäärä päivitetään silloin, kun se on saatavilla.
	Kentät 61–63 ovat toistuvia, ja ne täytetään sellaisten johdannaisten osalta, joihin liittyy		

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
	nimellislukumäärää koskevia luetteloita.		
61	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Ensimmäisen korkovirran nimellislukumäärän voimaantulopäivä	Oikaisematon päivä, jona ensimmäisen korkovirran nimellislukumäärä tulee voimaan.
62	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Ensimmäisen korkovirran nimellislukumäärän päättymispäivä	Ensimmäisen korkovirran nimellislukumäärän oikaisematon päättymispäivä (ei sovelleta, jos tietyn luettelon jakson oikaisematon päättymispäivä on sama kuin seuraavan jakson oikaisematon voimaantulopäivä).
63	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Ensimmäisen korkovirran voimaantulopäivänä voimassa oleva nimellislukumäärä	Ensimmäisen korkovirran nimellislukumäärä, joka tulee voimaan oikaisemattomana voimaantulopäivänä.
64	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Toisen korkovirran nimellismäärä	Tarvittaessa tämän asetuksen 5 artiklassa tarkoitettu toisen korkovirran nimellismäärä.
65	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Nimellisvaluutta 2	Tarvittaessa valuutta, jonka määräinen toisen korkovirran nimellismäärä on.
	Kentät 66–68 ovat toistuvia, ja ne täytetään sellaisten johdannaisten osalta, joihin liittyy nimellismäärää koskevia luetteloita.		
66	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Toisen korkovirran nimellismäärän voimaantulopäivä	Oikaisematon päivä, jona toisen korkovirran nimellismäärä tulee voimaan.

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
67	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Toisen korkovirran nimellismäärän päättymispäivä	Toisen korkovirran nimellismäärän oikaisematon päättymispäivä (ei sovelleta, jos tietyn luettelon jakson oikaisematon päättymispäivä on sama kuin seuraavan jakson oikaisematon voimaantulopäivä).
68	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Toisen korkovirran voimaantulopäivänä voimassa oleva nimellismäärä	Toisen korkovirran nimellismäärä, joka tulee voimaan oikaisemattomana voimaantulopäivänä.
69	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Toisen korkovirran nimellislukumäärä yhteensä	Toisen korkovirran kohde- etuuden yhteenlaskettu nimellislukumäärä transaktion voimassaoloaikana. Jos kokonaisnimellislukumäärä ei ole tiedossa, kun ilmoitetaan uudesta transaktiosta, kokonaisnimellislukumäärä päivitetään silloin, kun se on saatavilla.
	Kentät 70–72 ovat toistuvia, ja ne täytetään sellaisten johdannaisten osalta, joihin liittyy nimellislukumäärää koskevia luetteloita.		
70	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Toisen korkovirran nimellislukumäärän voimaantulopäivä	Oikaisematon päivä, jona toisen korkovirran nimellislukumäärä tulee voimaan.
71	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Toisen korkovirran nimellislukumäärän päättymispäivä	Toisen korkovirran nimellislukumäärän oikaisematon päättymispäivä (ei sovelleta, jos tietyn luettelon jakson

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			oikaisematon päättymispäivä on sama kuin seuraavan jakson oikaisematon voimaantulopäivä).
72	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Toisen korkovirran voimaantulopäivänä voimassa oleva nimellislukumäärä	Toisen korkovirran nimellislukumäärä, joka tulee voimaan oikaisemattomana voimaantulopäivänä.
	Kenttien 73–78 jakso on toistettava.		
73	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Muun maksun tyyppi	Muun maksun määrän tyyppi. Option preemiomaksu ei ole maksutyyppi, sillä option preemiot ilmoitetaan käyttämällä option preemiota koskevaa dataelementtiä.
74	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Muun maksun määrä	Maksujen määrät ja vastaavat maksutyyppit eri omaisuuslajien transaktioiden kuvaamista koskevien vaatimusten täyttämiseksi.
75	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Muun maksun valuutta	Valuutta, jonka määräinen muun maksun määrä on.
76	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Muun maksun päivämäärä	Muun maksun määrän oikaisematon maksupäivä.
77	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Muun maksun maksaja	Muun maksun määrän maksajan tunnus.
78	Jakso 2g – Yksityiskohtaiset tiedot transaktiosta	Muun maksun vastaanottaja	Muun maksun määrän vastaanottajan tunnus.

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
79	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran tai kupongin kiinteä korko	Ilmoitetaan tarvittaessa ensimmäisen korkovirran tai kupongin kiinteä korko.
80	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran tai kupongin kiinteän koron laskukäytäntö	Tarvittaessa koronlaskukäytäntö, joka määrittää korkomaksujen laskentatavan. Sitä käytetään laskentajakson vuosiosuuden laskemiseen, ja se ilmaisee laskentajakson päivien lukumäärän jaettuna vuoden päivien lukumäärällä.
81	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran tai kupongin kiinteän koron maksutiheysjakso	Tarvittaessa maksutiheyteen liittyvä aikayksikkö, esimerkiksi päivä, viikko, kuukausi, vuosi tai maksuvirran kesto, kun kyseessä on ensimmäisen korkovirran tai kupongin kiinteä korko.
82	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran tai kupongin kiinteän koron maksutiheysjakson kerroin	Tarvittaessa aikayksiköiden lukumäärä (ilmaistuna maksutiheysjaksolla), joka määrittää, kuinka usein jaksoittaisia maksupäiviä esiintyy ensimmäisen korkovirran tai kupongin kiinteän koron osalta. Esimerkiksi sellaisen transaktion, jossa maksut suoritetaan joka toinen kuukausi, osalta ilmoitetaan maksutiheysjakso ”MNTH” (kuukausittain) ja maksutiheysjakson kerroin 2. Tätä dataelementtiä ei sovelleta, jos maksutiheysjakso on ”ADHO”. Jos maksutiheysjakso on ”EXPI”, maksutiheysjakson kerroin on 1. Jos maksutiheys on päivänsisäinen,

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			maksutiheysjakso on ”DAIL” ja maksutiheyden kerroin on 0.
83	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron tunnus	Tarvittaessa niiden käytettyjen korkojen tunnus, jotka vaihtuvat ennalta määrättyin väliajoin markkinoiden viitekurssin mukaisesti.
84	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron indikaattori	Tieto korosta, jos sellainen on saatavilla.
85	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron nimi	Indeksin tarjoajan antama koron koko nimi.
86	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron laskukäytäntö	Tarvittaessa koronlaskukäytäntö, joka määrittää ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron korkomaksujen laskentatavan. Sitä käytetään laskentajakson vuosiosuuden laskemiseen, ja se ilmaisee laskentajakson päivien lukumäärän jaettuna vuoden päivien lukumäärällä.
87	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron maksutiheysjakso	Tarvittaessa maksutiheyteen liittyvä aikayksikkö, esimerkiksi päivä, viikko, kuukausi, vuosi tai maksuvirran kesto, kun kyseessä on ensimmäisen korkovirran vaihtuva korko.
88	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron maksutiheysjakson kerroin	Tarvittaessa aikayksiköiden lukumäärä (ilmaistuna maksutiheysjaksolla), joka määrittää, kuinka usein jaksoittaisia maksupäiviä esiintyy ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron osalta. Esimerkiksi sellaisen transaktion, jossa maksut suoritetaan joka toinen kuukausi, osalta ilmoitetaan

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			maksutiheysjakso ”MNTH” (kuukausittain) ja maksutiheysjakson kerroin 2. Tätä dataelementtiä ei sovelleta, jos maksutiheysjakso on ”ADHO”. Jos maksutiheysjakso on ”EXPI”, maksutiheysjakson kerroin on 1. Jos maksutiheys on päivänsisäinen, maksutiheysjakso on ”DAIL” ja maksutiheyden kerroin on 0.
89	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron viitekausi – ajanjakso	Aikaväli, jolla kuvataan vaihtuvan koron ensimmäisen korkovirran viitekautta.
90	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron viitekausi – kerroin	Kerroin aikavälille, jolla kuvataan vaihtuvan koron ensimmäisen korkovirran viitekautta.
91	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron muutostiheysjakso	Tarvittaessa maksutiheyden muutoksiin liittyvä aikayksikkö, esimerkiksi päivä, viikko, kuukausi, vuosi tai maksuvirran kesto, kun kyseessä on ensimmäisen korkovirran vaihtuva korko.
92	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron muutostiheyden kerroin	Tarvittaessa aikayksiköiden lukumäärä (ilmaistuna maksutiheysjaksolla), joka määrittää, kuinka usein jaksoittaisia maksujen muutospäiviä esiintyy ensimmäisen korkovirran vaihtuvan koron osalta. Esimerkiksi sellaisen transaktion, jossa maksut suoritetaan joka toinen kuukausi, osalta ilmoitetaan

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			<p>maksutiheysjakso ”MNTH” (kuukausittain) ja maksutiheysjakson kerroin 2.</p> <p>Tätä dataelementtiä ei sovelleta, jos maksutiheysjakso on ”ADHO”. Jos maksutiheysjakso on ”EXPI”, maksutiheysjakson kerroin on 1. Jos maksutiheys on päivänsisäinen, maksutiheysjakso on ”DAIL” ja maksutiheyden kerroin on 0.</p>
93	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran spread	<p>Ilmoitetaan ensimmäisen korkovirran spread, jos sovellettavissa: sellaisten OTC-johdannaistransaktioiden osalta, joihin liittyy jaksoittaisia maksuja (esimerkiksi kiinteät/vaihtuvat korkoihin perustuvat swapit, korkoihin perustuvat swapit ja hyödykkeisiin perustuvat swapit)</p> <ul style="list-style-type: none"> • yksittäisen vaihtuvakorkoisen puolen (yksittäisten vaihtuvakorkoisten puolten) indeksin viitehinnan spread, jos vaihtuvakorkoisessa puolessa (vaihtuvakorkoisissa puolissa) on spread • kahden vaihtuvakorkoisen puolen indeksin viitehintojen välinen ero.
94	Jakso 2h – Korot	Ensimmäisen korkovirran spreadin valuutta	<p>Tarvittaessa valuutta, jonka määräinen ensimmäisen korkovirran spread on. Tätä dataelementtiä sovelletaan ainoastaan, jos</p>

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			spread ilmaistaan rahallisena määränä.
95	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran kiinteä korko	Ilmoitetaan toisen korkovirran kiinteä korko, jos sovellettavissa.
96	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran kiinteän koron laskukäytäntö	Tarvittaessa koronlaskukäytäntö, joka määrittää korkomaksujen laskentatavan. Sitä käytetään laskentajakson vuosiosuuden laskemiseen, ja se ilmaisee laskentajakson päivien lukumäärän jaettuna vuoden päivien lukumäärällä.
97	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran kiinteän koron maksutiheys	Tarvittaessa maksutiheyteen liittyvä aikayksikkö, esimerkiksi päivä, viikko, kuukausi, vuosi tai maksuvirran kesto, kun kyseessä on toisen korkovirran kiinteä korko.
98	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran kiinteän koron maksutiheyden kerroin	Tarvittaessa aikayksiköiden lukumäärä (ilmaistuna maksutiheysjaksolla), joka määrittää, kuinka usein jaksoittaisia maksupäiviä esiintyy toisen korkovirran kiinteän koron osalta. Esimerkiksi sellaisen transaktion, jossa maksut suoritetaan joka toinen kuukausi, osalta ilmoitetaan maksutiheysjakso ”MNTH” (kuukausittain) ja maksutiheysjakson kerroin 2. Tätä dataelementtiä ei sovelleta, jos maksutiheysjakso on ”ADHO”. Jos maksutiheysjakso on ”EXPI”, maksutiheysjakson kerroin on 1. Jos

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			maksutiheys on päivänsisäinen, maksutiheysjakso on ”DAIL” ja maksutiheyden kerroin on 0.
99	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran vaihtuvan koron tunnus	Tarvittaessa niiden käytettyjen korkojen tunnus, jotka vaihtuvat ennalta määrätyn väliajoin markkinoiden viitekurssin mukaisesti.
100	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran vaihtuvan koron indikaattori	Tieto korosta, jos sellainen on saatavilla.
101	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran vaihtuvan koron nimi	Indeksin tarjoajan antama koron koko nimi.
102	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran vaihtuvan koron laskukäytäntö	Tarvittaessa koronlaskukäytäntö, joka määrittää toisen korkovirran vaihtuvan koron korkomaksujen laskentatavan. Sitä käytetään laskentajakson vuosiosuuden laskemiseen, ja se ilmaisee laskentajakson päivien lukumäärän jaettuna vuoden päivien lukumäärällä.
103	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran vaihtuvan koron maksutiheysjakso	Tarvittaessa maksutiheyteen liittyvä aikayksikkö, esimerkiksi päivä, viikko, kuukausi, vuosi tai maksuvirran kesto, kun kyseessä on toisen korkovirran vaihtuva korko.
104	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran vaihtuvan koron maksutiheysjakson kerroin	Tarvittaessa aikayksiköiden lukumäärä (ilmaistuna maksutiheysjaksolla), joka määrittää, kuinka usein jaksoittaisia maksupäiviä esiintyy toisen korkovirran vaihtuvan koron osalta. Esimerkiksi sellaisen transaktion, jossa maksut

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			suoritetaan joka toinen kuukausi, osalta ilmoitetaan maksutiheysjakso ”MNTH” (kuukausittain) ja maksutiheysjakson kerroin 2. Tätä dataelementtiä ei sovelleta, jos maksutiheysjakso on ”ADHO”. Jos maksutiheysjakso on ”EXPI”, maksutiheysjakson kerroin on 1. Jos maksutiheys on päivänsisäinen, maksutiheysjakso on ”DAIL” ja maksutiheyden kerroin on 0.
105	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran vaihtuvan koron viitekausi – ajanjakso	Aikaväli, jolla kuvataan vaihtuvan koron toisen korkovirran viitekautta.
106	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran vaihtuvan koron viitekausi – kerroin	Kerroin aikavälille, jolla kuvataan vaihtuvan koron toisen korkovirran viitekautta.
107	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran vaihtuvan koron muutostiheysjakso	Tarvittaessa maksutiheyden muutoksiin liittyvä aikayksikkö, esimerkiksi päivä, viikko, kuukausi, vuosi tai maksuvirran kesto, kun kyseessä on toisen korkovirran vaihtuva korko.
108	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran vaihtuvan koron muutostiheyden kerroin	Tarvittaessa aikayksiköiden lukumäärä (ilmaistuna maksutiheysjaksolla), joka määrittää, kuinka usein jaksoittaisia maksujen muutospäiviä esiintyy toisen korkovirran vaihtuvan koron osalta. Esimerkiksi sellaisen transaktion, jossa maksut suoritetaan joka toinen kuukausi, osalta ilmoitetaan maksutiheysjakso ”MNTH”

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			(kuukausittain) ja maksutiheysjakson kerroin 2. Tätä dataelementtiä ei sovelleta, jos maksutiheysjakso on ”ADHO”. Jos maksutiheysjakso on ”EXPI”, maksutiheysjakson kerroin on 1. Jos maksutiheys on päivänsisäinen, maksutiheysjakso on ”DAIL” ja maksutiheyden kerroin on 0.
109	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran spread	Ilmoitetaan toisen korkovirran spread, jos sovellettavissa: sellaisten OTC-johdannaistransaktioiden osalta, joihin liittyy jaksoittaisia maksuja (esimerkiksi kiinteät tai vaihtuvat korkoihin perustuvat swapit, korkoihin perustuvat swapit ja hyödykkeisiin perustuvat swapit) • yksittäisen vaihtuvakorkoisen puolen (yksittäisten vaihtuvakorkoisten puolten) indeksin viitehinnan spread, jos vaihtuvakorkoisessa puolessa (vaihtuvakorkoisissa puolissa) on spread • kahden vaihtuvakorkoisen puolen indeksin viitehintojen välinen ero.
110	Jakso 2h – Korot	Toisen korkovirran spreadin valuutta	Tarvittaessa valuutta, jonka määräinen toisen korkovirran spread on. Tätä dataelementtiä sovelletaan ainoastaan, jos spread ilmaistaan rahallisena

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			määränä.
111	Jakso 2h – Korot	Liiketoimikokonaisuuden spread	<p>Koko sen liiketoimikokonaisuuden kauppahinta, jossa ilmoitettu johdannaistransaktio on osa liiketoimikokonaisuutta. Liiketoimikokonaisuuden hinta, kun kokonaisuuden hinta ilmaistaan spreadina eli kahden viitehinnan välisenä erona. Tätä dataelementtiä ei sovelleta, jos</p> <ul style="list-style-type: none"> • kyse ei ole liiketoimikokonaisuudesta tai • käytetään liiketoimikokonaisuuden hintaa. <p>Spread ja siihen liittyvät transaktioiden dataelementit (spreadin valuutta), jotka edustavat liiketoimikokonaisuuden yksittäisiä osia, ilmoitetaan, kun ne ovat saatavilla. Liiketoimikokonaisuuden spread ei välttämättä ole tiedossa, kun uudesta transaktiosta ilmoitetaan, mutta se voidaan päivittää myöhemmin.</p>
112	Jakso 2h – Korot	Liiketoimikokonaisuuden spreadin valuutta	<p>Valuutta, jonka määräinen liiketoimikokonaisuuden spread on. Tätä dataelementtiä ei sovelleta, jos</p> <ul style="list-style-type: none"> • kyse ei ole liiketoimikokonaisuudesta tai • käytetään liiketoimikokonaisuuden hintaa tai

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			<ul style="list-style-type: none"> • liiketoimikokonaisuuden spread ilmaistaan prosentteina tai peruspisteinä.
113	Jakso 2i – Valuutat	Valuuttakurssi 1	Johdannaistransaktiossa määritettyjen kahden eri valuutan välinen valuuttakurssi, josta vastapuolet ovat sopineet transaktion alussa, ilmaistuna vaihtokurssina, joka saadaan muuntamalla yksikkövaluutta noteeratuksi valuutaksi.
114	Jakso 2i – Valuutat	Valuutan termiinkurssi	Vastapuolten sopimuksessa sopima valuutan termiinkurssi. Ilmaistaan perusvaluutan hintana noteeratussa valuutassa.
115	Jakso 2i – Valuutat	Valuuttapari	Valuuttapari ja järjestys, jossa valuuttakurssi on ilmaistu, ilmaistuna yksikkövaluuttana tai noteerattuna valuuttana.
116	Jakso 2j – Hyödykkeet ja päästöoikeudet (yleinen)	Perustuote	Perustuote sellaisena kuin se on määritetty [<i>julkaisutoimisto lisää viittauksen asiakirjaan C(2022) 3588</i>] liitteessä olevan taulukon 4 hyödykkeiden luokittelussa.
117	Jakso 2j – Hyödykkeet ja päästöoikeudet (yleinen)	Alatuote	Alatuote sellaisena kuin se on määritetty [<i>julkaisutoimisto lisää viittauksen asiakirjaan C(2022) 3588</i>] liitteessä olevan taulukon 4 hyödykkeiden luokittelussa. Tämä kenttä edellyttää, että kentässä on erityinen perustuote.

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
118	Jakso 2j – Hyödykkeet ja päästöoikeudet (yleinen)	Alatuotteen jaottelu	Alatuote sellaisena kuin se on määritetty [<i>julkaisutoimisto lisää viittauksen asiakirjaan C(2022) 3588</i>] liitteessä olevan taulukon 4 hyödykkeiden luokittelussa. Tämä kenttä edellyttää, että kentässä on erityinen alatuote.
119	Jakso 2k – Hyödykkeet ja päästöoikeudet (energia)	Jakelupaikka tai -alue	Jakelupaikka (jakelupaikat) tai markkina-alue (markkina-alueet).
120	Jakso 2k – Hyödykkeet ja päästöoikeudet (energia)	Yhteenliitännätpiste	Siirtosopimuksessa tarkoitettu raja (rajat) tai rajapiste (rajapisteet).
121	Jakso 2k – Hyödykkeet ja päästöoikeudet (energia)	Kuormitustyyppi	Ilmoitetaan toimitusprofiili.
	Kenttien 122–131 jakso on toistettava.		
122	Jakso 2k – Hyödykkeet ja päästöoikeudet (energia)	Toimituksen aikavälin alkamisaika	Kunkin jakson tai profiilin toimituksen aikavälin alkamisaika.
123	Jakso 2k – Hyödykkeet ja päästöoikeudet (energia)	Toimituksen aikavälin päättymisaika	Kunkin jakson tai profiilin toimituksen aikavälin päättymisaika.
124	Jakso 2k – Hyödykkeet ja päästöoikeudet (energia)	Toimituksen alkamispäivä	Päivä, jona toimitus alkaa.

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
125	Jakso 2k – Hyödykkeet ja päästöoikeudet (energia)	Toimituksen päättymispäivä	Päivä, jona toimitus päättyy.
126	Jakso 2k – Hyödykkeet ja päästöoikeudet (energia)	Kesto	Toimitusjakson kesto.
127	Jakso 2k – Hyödykkeet ja päästöoikeudet (energia)	Viikonpäivät	Täsmennetään viikonpäivät, joina toimitus tapahtuu.
128	Jakso 2k – Hyödykkeet ja päästöoikeudet (energia)	Toimituskapasiteetti	Transaktioon sisältyvien yksiköiden määrä kultakin kentissä 122 ja 123 ilmoitetulta toimitusväliltä.
129	Jakso 2k – Hyödykkeet ja päästöoikeudet (energia)	Määräyksikkö	Käytetty mittayksikkö.
130	Jakso 2k – Hyödykkeet ja päästöoikeudet (energia)	Hinta määräyksikköä kohden per aikaväli	Tähän merkitään tarvittaessa määräkohtainen hinta toimituksen aikaväliä kohden.
131	Jakso 2k – Hyödykkeet ja päästöoikeudet (energia)	Määräyksikköä kohden per aikaväli käytetyn hinnan valuutta	Valuutta, jossa aikavälikohtainen hinta ilmaistaan.

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
132	Jakso 21 – Optiot	Option tyyppi	<p>Ilmoitetaan, onko johdannaissopimus osto-optio (oikeus ostaa tietty kohde-etuus) vai myyntioptio (oikeus myydä tietty kohde-etuus) vai onko mahdotonta määrittää, onko johdannaissopimus osto- vai myyntioptio johdannaissopimuksen täytäntöönpanoajankohtana. Swaptiot ovat</p> <ul style="list-style-type: none"> – myyntioptioita, kun ne ovat saajatyyppisiä eli kun ostajalla on vaihtosopimuksen mukaan oikeus saada suorituksina kiinteää korkoa, – osto-optioita, kun ne ovat maksutyyppisiä eli kun ostajalla on vaihtosopimuksen mukaan oikeus maksaa kiinteää korkoa. <p>Enimmäis- ja vähimmäiskorkojen vaihtosopimukset ovat</p> <ul style="list-style-type: none"> – myyntioptioita, kun kyseessä on korkolattia, – osto-optioita, kun kyseessä on korkokatto.
133	Jakso 21 – Optiot	Option toteutustapa	<p>Ilmoitetaan, voiko option toteuttaa vain tietyssä päivänä (eurooppalainen tapa), tiettyinä ennalta määrättyinä päivinä (bermudalainen tapa) vai milloin tahansa sopimuksen voimassaoloaikana (amerikkalainen tapa).</p>

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
134	Jakso 21 – Optiot	Toteutushinta	<ul style="list-style-type: none"> • Muiden optioiden kuin valuuttaoptioiden, swaptioiden ja vastaavien tuotteiden osalta hinta, jolla option omistaja voi ostaa tai myydä option kohde-etuuden. • Valuuttaoptioiden osalta valuuttakurssi, jolla optio voidaan toteuttaa, ilmaistuna vaihtokurssina, joka saadaan muuntamalla yksikkövaluutta noteeratuksi valuutaksi. Esimerkki 0,9426 USD/EUR – Yhdysvaltain dollari on yksikkövaluutta ja euro on noteerattu valuutta: 1 Yhdysvaltain dollari = 0,9426 euroa. Jos toteutushinta ei ole tiedossa, kun ilmoitetaan uudesta transaktiosta, toteutushinta päivitetään silloin, kun se on saatavilla. • Volatileetti- ja varianssiswapien ja vastaavien tuotteiden osalta volatileettiin perustuva toteutushinta ilmoitetaan tässä dataelementissä.
	Kentät 135–137 ovat toistuvia, ja ne täytetään sellaisten johdannaisten osalta, joihin liittyy toteutushintaluettelointia.		
135	Jakso 21 – Optiot	Toteutushinnan voimaantulopäivä	Toteutushinnan oikaisematon voimaantulopäivä.
136	Jakso 21 – Optiot	Toteutushinnan päättymispäivä	Toteutushinnan oikaisematon päättymispäivä (ei sovelleta, jos tietyn luettelon jakson

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			oikaisematon päättymispäivä on sama kuin seuraavan jakson oikaisematon voimaantulopäivä).
137	Jakso 21 – Optiot	Toteutushinta, joka on voimassa voimaantulopäivänä	Oikaisemattoman voimaantulopäivän ja oikaisemattoman päättymispäivän välillä, mukaan lukien päättymispäivä, voimassa oleva toteutushinta.
138	Jakso 21 – Optiot	Toteutushinnan valuutta/valuuttapari	Osakeoptioiden, hyödykeoptioiden ja vastaavien tuotteiden osalta valuutta, jonka määräisenä toteutushinta on. Valuuttaoptioiden osalta: valuuttapari ja järjestys, jossa toteutushinta on ilmaistu. Ilmaistaan yksikkövaluuttana noteerattua valuuttaa kohden.
139	Jakso 21 – Optiot	Option premion määrä	Kaikkien omaisuuslajien optioiden ja swaptioiden osalta option ostajan maksama rahamäärä. Tätä dataelementtiä ei sovelleta, jos väline ei ole optio tai siihen ei sisälly valinnaisuutta.
140	Jakso 21 – Optiot	Option premion valuutta	Kaikkien omaisuuslajien optioiden ja swaptioiden osalta valuutta, jonka määräinen option premio on. Tätä dataelementtiä ei sovelleta, jos väline ei ole optio tai siihen ei sisälly valinnaisuutta.
141	Jakso 21 – Optiot	Option premion maksupäivä	Option premion oikaisematon maksupäivä.

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
142	Jakso 2l – Optiot	Kohde-etuuden erääntymispäivä	Jos kyseessä on swaptio, kohde-etuutena olevan swapin erääntymispäivä.
143	Jakso 2m – Luottojohdannaiset	Etuoikeusasema	Osoittaa johdannaisen kohde-etuutena olevan velkapaperin tai velkakorin tai -indeksin etuoikeusaseman.
144	Jakso 2m – Luottojohdannaiset	Viiteyhteisö	Yksilöidään kohde-etuutena oleva viiteyhteisö.
145	Jakso 2m – Luottojohdannaiset	Sarja	Indeksin koostumuksen sarjanumero tarvittaessa.
146	Jakso 2m – Luottojohdannaiset	Versio	Sarjasta luodaan uusi versio, jos jokin luottoriskinvaihtosopimuksista ja indeksi on painotettava uudestaan vastaamaan indeksiin sisältyvien osien uutta kokonaismäärää.
147	Jakso 2m – Luottojohdannaiset	Indeksikerroin	Kerroin, jota sovelletaan nimellismäärään (tämän taulukon kenttä 55) sen mukauttamiseksi kaikkiin edellisiin luottotapahtumiin kyseisessä indeksisarjassa.
148	Jakso 2m – Luottojohdannaiset	Etuoikeusluokka	Ilmoitetaan, onko johdannaisopimus jaettu eriin.
149	Jakso 2m – Luottojohdannaiset	Luottoriskinvaihtosopimuksen (CDS) indeksin kiinnitystaso	Määritelty matalampi taso, jossa tappioiden taso kohde-etuutena olevassa salkussa pienentää etuoikeusluokan nimellisarvoa. Esimerkiksi etuoikeusluokan, jossa kiinnitystaso on 3 prosenttia, nimellisarvoa vähennetään sen jälkeen, kun salkussa on tapahtunut 3 prosentin tappiot. Tätä dataelementtiä ei sovelleta, jos transaktio ei

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			ole luottoriskinvaihtosopimuksen etuoikeusluokan transaktio (indeksi tai mukautettu kori).
150	Jakso 2m – Luottojohdannaiset	Luottoriskinvaihtosopimuksen indeksin irrottautumistaso	Määritetty taso, jonka jälkeen tappiot kohde-etuutena olevasta salkusta eivät enää vähennä etuoikeusluokan nimellisarvoa. Esimerkiksi etuoikeusluokan, jossa kiinnitystaso on 3 prosenttia ja irrottautumistaso 6 prosenttia, nimellisarvoa vähennetään sen jälkeen, kun salkussa on tapahtunut 3 prosentin tappiot. Salkun 6 prosentin tappiot mitätöivät etuoikeusluokan nimellisarvon. Tätä dataelementtiä ei sovelleta, jos transaktio ei ole luottoriskinvaihtosopimuksen etuoikeusluokan transaktio (indeksi tai mukautettu kori).
151	Jakso 2n – Johdannaisen muutokset	Toimen tyyppi	<ul style="list-style-type: none"> • Uusi: ilmoitus johdannaisesta kauppaa- tai positiotasolla ensimmäistä kertaa. • Muutos: aiemmin ilmoitetun johdannaisen ehtojen tai yksityiskohtien muuttaminen kauppaa- tai positiotasolla, mutta ei ilmoituksen oikaisemista. • Oikaisu: ilmoitus, jossa korjataan aiemmin toimitetun ilmoituksen virheelliset tietokentät. • Päättyminen: olemassa olevan johdannaisen päättäminen kauppaa- tai positiotasolla. • Virhe: virheellisesti

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			<p>toimitetun kokonaisen ilmoituksen peruuttaminen kauppaa- tai positiotasolla, jos johdannaista ei koskaan ollut olemassa tai siihen ei sovellettu asetuksen (EU) N:o 648/2012 raportointivaatimuksia, mutta siitä ilmoitettiin kauppatietorekisteriin erehdyksessä tai ilmoituksen kaksoiskappaleen peruuttamisen vuoksi.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Uudelleenavaaminen: sellaisen johdannaisten uudelleenavaaminen kauppaa- tai positiotasolla, joka on peruutettu toimen tyyppillä ”Virhe” tai päätetty erehdyksessä. • Arvostus: johdannaisten arvostuksen päivittäminen kauppaa- tai positiotasolla. • Position komponentti: ilmoitus uudesta johdannaista, joka sisältyy erilliseen positiota koskevaan ilmoitukseen samana päivänä.
152	Jakso 2n – Johdannaisten muutokset	Tapahtuman tyyppi	<ul style="list-style-type: none"> • Kauppa: johdannaissopimuksen tekeminen tai sen ehtojen uudelleenneuvottelut, jotka eivät johda vastapuolen vaihtumiseen. • Novaatio: tapahtuma, jossa osa johdannaista tai koko johdannainen siirretään vastapuolelle 2 (ja ilmoitetaan uutena johdannaista) ja olemassa oleva johdannainen joko päätetään tai sen nimellisarvoa muutetaan. • Kaupan jälkeinen riskinvähennys: kaupan jälkeisen riskinvähennyksen

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			<p>toteuttaminen.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Ennenaikainen päättymisen: johdannaisen päättäminen kauppa- tai positiotasolla. • Määrittely: asetuksen (EU) N:o 648/2012 2 artiklan 3 kohdassa määritelty määrittely. • Toteutus: transaktion yhden vastapuolen tekemä option tai swaption toteuttaminen kokonaan tai osittain. • Allokaatio: allokaatiotapahtuma, jossa olemassa oleva johdannainen allokoidaan eri vastapuolille ja ilmoitetaan uusina johdannaisina, joiden nimellismäärät ovat pienemmät. • Luottotapahtuma: sovelletaan ainoastaan luottojohdannaisiin. Luottotapahtuma, joka johtaa johdannaisen muuttamiseen kauppa- tai positiotasolla. Yritystapahtuma: kohde-etuutena olevaa osaketta koskeva yritystapahtuma, joka vaikuttaa kyseisen osakkeen johdannaisiin. • Sisällyttäminen positioon: keskusvastapuolella määritetyn johdannaisen tai hinnanerosopimuksen sisällyttäminen positioon, kun olemassa oleva johdannainen päätetään ja joko luodaan uusi positio tai muutetaan olemassa olevan position nimellisarvoa. Päivitys: avoinna olevan johdannaisen päivitys siirtymäkauden aikana sen varmistamiseksi, että se on

	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			muutettujen raportointivaatimusten mukainen.
153	Jakso 2n – Johdannaisen muutokset	Tapahtuman päivämäärä	Päivä, jona johdannaissopimukseen liittyvä ilmoitettava tapahtuma, josta on ilmoitettu ilmoituksessa, on tapahtunut, tai, jos kyseessä on muutos, se päivä, jona muutos tulee voimaan.
154	Jakso 2n – Johdannaisen muutokset	Taso	Ilmoitetaan, annetaanko ilmoitus kauppaa- vai positiotasolla. Positiotason ilmoituksia voidaan käyttää ainoastaan täydentämään kauppataason ilmoituksia kaupan jälkeisistä tapahtumista ilmoittamiseksi ja ainoastaan, jos positiolla on korvattu paljoustavaroilla tehdyt yksittäiset kaupat.

Taulukko 3

Kohta	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
1	Johdannaissopimuksen osapuolet	Raportoinnin aikaleima	Kauppätietorekisteriin annetun ilmoituksen toimittamisen päivämäärä ja aika.

Kohta	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
2	Johdannaissopimuksen osapuolet	Raportoivan yhteisön tunnistetiedot	<p>Jos raportoinnista vastaava yhteisö on siirtänyt ilmoituksen antamisen kolmannen osapuolen tai toisen vastapuolen tehtäväksi, kyseinen yhteisö on täsmennettävä tässä kentässä yksilöllisellä koodilla. Muussa tapauksessa raportoinnista vastaava yhteisö olisi täsmennettävä tässä kentässä.</p>
3	Johdannaissopimuksen osapuolet	Raportoinnista vastaava yhteisö	<p>Jos finanssialalla toimivalla vastapuolella on yksinomainen vastuu, myös oikeudellinen vastuu, tietojen ilmoittamisesta molempien vastapuolten puolesta asetuksen (EU) N:o 648/2012 9 artiklan 1 a kohdan mukaisesti ja finanssialan ulkopuolinen vastapuoli päättää olla itse ilmoittamatta finanssialalla toimivan vastapuolen kanssa tekemiensä OTC-johdannaissopimusten tietoja, kyseisen finanssialalla toimivan vastapuolen yksilöivä koodi. Jos rahastoyhtiöllä on vastuu, myös oikeudellinen vastuu, siirtokelpoisiin arvopapereihin kohdistuvaa yhteistä sijoitustoimintaa harjoittavan yrityksen (yhteissijoitusyritys) tietojen ilmoittamisesta mainitun asetuksen 9 artiklan 1 b kohdan mukaisesti, kyseisen rahastoyhtiön yksilöivä koodi. Jos vaihtoehtoisen sijoitusrahaston hoitajalla on yksinomainen vastuu, myös oikeudellinen vastuu, vaihtoehtoisen sijoitusrahaston tietojen ilmoittamisesta mainitun asetuksen 9 artiklan 1 c kohdan mukaisesti, kyseisen vaihtoehtoisen sijoitusrahaston hoitajan yksilöivä koodi. Jos lisäeläkelaitoksen hallinnoinnista vastaavalla ja sen puolesta toimivalla hyväksytyllä yhteisöllä on yksinomainen vastuu, myös oikeudellinen vastuu, tietojen</p>

Kohta	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			ilmoittamisesta sen puolesta mainitun asetuksen 9 artiklan 1 d kohdan mukaisesti, kyseisen yhteisön yksilöivä koodi. Tätä kenttää sovelletaan ainoastaan OTC-johdannaisiin.
4	Johdannaissopimuksen osapuolet	Vastapuoli 1 (raportoiva vastapuoli)	Johdannaistransaktion sen vastapuolen tunnus, joka täyttää ilmoitusvelvollisuutensa kyseisellä ilmoituksella. Kun kyseessä on rahastonhoitajan rahaston puolesta toteuttama allokoitu johdannaistransaktio, vastapuoleksi ilmoitetaan rahasto eikä rahastonhoitaja.
5	Johdannaissopimuksen osapuolet	Vastapuolen 2 tunnuksen tyyppi	Tieto siitä, käytettiinkö vastapuolen 2 yksilöinnissä LEI-tunnusta.
6	Johdannaissopimuksen osapuolet	Vastapuoli 2	Johdannaistransaktion toisen vastapuolen tunnus. Kun kyseessä on rahastonhoitajan rahaston puolesta toteuttama allokoitu johdannaistransaktio, vastapuoleksi ilmoitetaan rahasto eikä rahastonhoitaja.
7	Vakuus	Vakuuden aikaleima	Päivä ja kellonaika, josta alkaen marginaalien arvot ilmoitetaan.

Kohta	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
8	Vakuus	Vakuussalkun indikaattori	Tieto siitä, onko vakuus asetettu salkkuperusteisesti. Ilmaisulla ”salkkuperusteisesti” tarkoitetaan transaktioiden muodostamaa kokonaisuutta, jolle lasketaan marginaali yhdessä (joko netto- tai bruttoperusteisesti), toisin kuin tilanteessa, jossa marginaali lasketaan ja kirjataan erikseen kunkin yksittäisen transaktion osalta.
9	Vakuus	Vakuussalkun koodi	Jos vakuus ilmoitetaan salkkuperusteisesti, vastapuolen 1 salkulle antama yksilöllinen koodi. Tätä dataelementtiä ei sovelleta, jos vakuus on asetettu transaktiotasolla, jos vakuussopimusta ei ole tai jos vakuutta ei ole asetettu tai saatu.
10	Vakuus	UTI	[<i>Julkaisutoimisto lisää viittauksen asiakirjaan C(2022) 3588</i>] 7 artiklassa tarkoitettu yksilöllinen kauppatunnus.
11	Vakuus	Vakuuden asettamisen luokka	Ilmoitetaan, onko vastapuolten välillä tehty vakuussopimus. Tämä dataelementti ilmoitetaan kustakin transaktiosta tai salkusta sen mukaan, asetetaanko vakuus transaktion vai salkun tasolla, ja sitä sovelletaan sekä määritettyihin että määrittämättömiin transaktioihin.

Kohta	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
12	Vakuus	Vastapuolen 1 asettama alkumarginaali (ennen aliarvostusta)	<p>Vastapuolen 1 asettaman alkumarginaalin rahallinen arvo, mukaan lukien siirto- ja toimitusvaiheessa olevat marginaalit. Jos vakuus asetetaan salkun tasolla, asetettu alkumarginaali liittyy koko salkkuun, kun taas jos vakuus asetetaan yksittäisille transaktioille, asetettu alkumarginaali liittyy tällaiseen yksittäiseen transaktioon.</p> <p>Tämä kenttä viittaa alkumarginaalin nykyiseen kokonaisarvoon eikä sen päivittäiseen muutokseen. Dataelementti viittaa sekä määrittämättömiin että keskitetysti määritettyihin transaktioihin. Keskitetysti määritettyjen transaktioiden osalta dataelementti ei sisällä maksukyvyttömyysrahastoon suoritettavia osuuksia eikä keskusvastapuolelle likviditeetin tarjoamista vastaan asetettuja vakuuksia eli sitovia luottolimiittejä. Jos asetettu alkumarginaali on useamman kuin yhden valuutan määräinen, nämä määrät muunnetaan vastapuolen 1 valitsemaksi yhdeksi valuutaksi ja ilmoitetaan yhtenä kokonaisarvona.</p>
13	Vakuus	Vastapuolen 1 asettama alkumarginaali (aliarvostuksen jälkeen)	<p>Vastapuolen 1 asettaman alkumarginaalin rahallinen arvo, mukaan lukien siirto- ja toimitusvaiheessa olevat marginaalit. Jos vakuus asetetaan salkun tasolla, asetettu alkumarginaali liittyy koko salkkuun, kun taas jos vakuus asetetaan yksittäisille transaktioille, asetettu alkumarginaali liittyy tällaiseen yksittäiseen transaktioon.</p> <p>Tämä kenttä viittaa alkumarginaalin nykyiseen kokonaisarvoon aliarvostuksen soveltamisen jälkeen (jos sovellettavissa) eikä sen</p>

Kohta	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			<p>päivittäiseen muutokseen. Dataelementti viittaa sekä määrittämättömiin että keskitetysti määritettyihin transaktioihin. Keskitetysti määritettyjen transaktioiden osalta dataelementti ei sisällä maksukyvyttömyysrahastoon suoritettavia osuuksia eikä keskusvastapuolelle likviditeetin tarjoamista vastaan asetettuja vakuuksia eli sitovia luottolimiittejä. Jos asetettu alkumarginaali on useamman kuin yhden valuutan määräinen, nämä määrät muunnetaan vastapuolen 1 valitsemaksi yhdeksi valuutaksi ja ilmoitetaan yhtenä kokonaisarvona.</p>
14	Vakuus	Asetetun alkumarginaalin valuutta	<p>Valuutta, jonka määräinen asetettu alkumarginaali on. Jos asetettu alkumarginaali on useamman kuin yhden valuutan määräinen, tämä dataelementti kuvaa yhtä niistä valuutoista, johon vastapuoli 1 on päättänyt muuntaa kaikki asetettujen alkumarginaalien arvot.</p>
15	Vakuus	Vastapuolen 1 asettama vaihtelumarginaali (ennen aliarvostusta)	<p>Vastapuolen 1 asettaman vaihtelumarginaalin rahallinen arvo, mukaan lukien käteissuorituksena maksettava marginaali ja mahdolliset siirto- ja toimitusvaiheessa olevat marginaalit. Ehdollista vaihtelumarginaalia ei oteta huomioon. Jos vakuus asetetaan salkun tasolla, asetettu vaihtelumarginaali liittyy koko salkkuun, kun taas jos vakuus asetetaan yksittäisille transaktioille, asetettu vaihtelumarginaali liittyy tällaiseen yksittäiseen transaktioon. Tämä kenttä viittaa salkkuun tai transaktioon asetettujen</p>

Kohta	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			<p>vaihtelumarginaalien ensimmäisen ilmoittamisen jälkeen kertyneen vaihtelumarginaalin nykyiseen kokonaisarvoon.</p> <p>Jos asetettu vaihtelumarginaali on useamman kuin yhden valuutan määräinen, nämä määrät muunnetaan vastapuolen 1 valitsemaksi yhdeksi valuutaksi ja ilmoitetaan yhtenä kokonaisarvona.</p>
16	Vakuus	Vastapuolen 1 asettama vaihtelumarginaali (aliarvostuksen jälkeen)	<p>Vastapuolen 1 asettaman vaihtelumarginaalin rahallinen arvo, mukaan lukien käteissuorituksena maksettava marginaali ja mahdolliset siirto- ja toimitusvaiheessa olevat marginaalit.</p> <p>Ehdollista vaihtelumarginaalia ei oteta huomioon.</p> <p>Jos vakuus asetetaan salkun tasolla, asetettu vaihtelumarginaali liittyy koko salkkuun, kun taas jos vakuus asetetaan yksittäisille transaktioille, asetettu vaihtelumarginaali liittyy tällaiseen yksittäiseen transaktioon.</p> <p>Tämä kenttä viittaa salkkuun tai transaktioon asetettujen vaihtelumarginaalien ensimmäisen ilmoittamisen jälkeen kertyneen vaihtelumarginaalin nykyiseen kokonaisarvoon aliarvostamisen soveltamisen jälkeen (jos sovellettavissa).</p> <p>Jos asetettu vaihtelumarginaali on useamman kuin yhden valuutan määräinen, nämä määrät muunnetaan vastapuolen 1 valitsemaksi yhdeksi valuutaksi ja ilmoitetaan yhtenä</p>

Kohta	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			kokonaisarvona.
17	Vakuus	Asetettujen vaihtelumarginaalien valuutta	Valuutta, jonka määräinen asetettu vaihtelumarginaali on. Jos asetettu vaihtelumarginaali on useamman kuin yhden valuutan määräinen, tämä dataelementti kuvaa yhtä niistä valuutoista, johon vastapuoli 1 on päättänyt muuntaa kaikki asetettujen vaihtelumarginaalien arvot.
18	Vakuus	Vastapuolen 1 asettama ylimääräinen vakuus	Vastapuolen 1 asettaman ylimääräisen vakuuden rahallinen arvo, joka on erillinen ja riippumaton alku- ja vaihtelumarginaalista. Tämä kenttä viittaa ylimääräisen vakuuden nykyiseen kokonaisarvoon ennen aliarvostuksen soveltamista (jos sovellettavissa) eikä sen päivittäiseen muutokseen. Asetetun alku- tai vaihtelumarginaalin määrä, joka ylittää vaaditun alku- tai vaihtelumarginaalin, ilmoitetaan osana asetettua alku- tai vaihtelumarginaalia, eikä sitä sisällytetä asetettuihin ylimääräisiin vakuuksiin. Keskitetysti määritettyjen transaktioiden osalta ylimääräiset vakuudet ilmoitetaan vain siltä osin kuin ne voidaan kohdistaa tiettyyn salkkuun tai transaktioon.
19	Vakuus	Asetetun ylimääräisen vakuuden valuutta	Valuutta, jonka määräinen asetettu ylimääräinen vakuus on. Jos asetettu ylimääräinen vakuus on useamman kuin yhden valuutan määräinen, tämä dataelementti kuvaa yhtä niistä valuutoista, johon vastapuoli 1 on päättänyt muuntaa kaikki asetetun ylimääräisen vakuuden arvot.

Kohta	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
20	Vakuus	Vastapuolen 1 keräämä alkumarginaali (ennen aliarvostusta)	<p>Vastapuolen 1 keräämän alkumarginaalin rahallinen arvo, mukaan lukien siirto- ja toimitusvaiheessa olevat marginaalit. Jos vakuus asetetaan salkun tasolla, kerätty alkumarginaali liittyy koko salkkuun, kun taas jos vakuus asetetaan yksittäisille transaktioille, kerätty alkumarginaali liittyy tällaiseen yksittäiseen transaktioon.</p> <p>Tämä kenttä viittaa alkumarginaalin nykyiseen kokonaisarvoon eikä sen päivittäiseen muutokseen. Dataelementti viittaa sekä määrittämättömiin että keskitetysti määritettyihin transaktioihin. Keskitetysti määritettyjen transaktioiden osalta dataelementti ei sisällä vakuuksia, jotka keskusvastapuoli on kerännyt osana sijoitustoimintaansa.</p> <p>Jos kerätty alkumarginaali on useamman kuin yhden valuutan määräinen, nämä määrät muunnetaan vastapuolen 1 valitsemaksi yhdeksi valuutaksi ja ilmoitetaan yhtenä kokonaisarvona.</p>
21	Vakuus	Vastapuolen 1 keräämä alkumarginaali (aliarvostuksen jälkeen)	<p>Vastapuolen 1 keräämän alkumarginaalin rahallinen arvo, mukaan lukien siirto- ja toimitusvaiheessa olevat marginaalit. Jos vakuus asetetaan salkun tasolla, kerätty alkumarginaali liittyy koko salkkuun, kun taas jos vakuus asetetaan yksittäisille transaktioille, kerätty alkumarginaali liittyy tällaiseen yksittäiseen transaktioon.</p> <p>Tämä kenttä viittaa alkumarginaalin nykyiseen kokonaisarvoon aliarvostuksen soveltamisen jälkeen (jos sovellettavissa) eikä sen päivittäiseen muutokseen. Dataelementti viittaa sekä</p>

Kohta	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			<p>määrittämättömiin että keskitetysti määritettyihin transaktioihin. Keskitetysti määritettyjen transaktioiden osalta dataelementti ei sisällä vakuuksia, jotka keskusvastapuoli on kerännyt osana sijoitustoimintaansa. Jos kerätty alkumarginaali on useamman kuin yhden valuutan määräinen, nämä määrät muunnetaan vastapuolen 1 valitsemaksi yhdeksi valuutaksi ja ilmoitetaan yhtenä kokonaisarvona.</p>
22	Vakuus	Kerätyn alkumarginaalin valuutta	<p>Valuutta, jonka määräinen kerätty alkumarginaali on. Jos kerätty alkumarginaali on useamman kuin yhden valuutan määräinen, tämä dataelementti kuvaa yhtä niistä valuutoista, johon vastapuoli 1 on päättänyt muuntaa kaikki kerättyjen alkumarginaalien arvot.</p>
23	Vakuus	Vastapuolen 1 keräämä vaihtelumarginaali (ennen aliarvostusta)	<p>Vastapuolen 1 keräämän vaihtelumarginaalin rahallinen arvo, mukaan lukien käteissuorituksena maksettava marginaali ja mahdolliset siirto- ja toimitusvaiheessa olevat marginaalit. Ehdollista vaihtelumarginaalia ei oteta huomioon. Jos vakuus asetetaan salkun tasolla, kerätty vaihtelumarginaali liittyy koko salkkuun, kun taas jos vakuus asetetaan yksittäisille transaktioille, kerätty vaihtelumarginaali liittyy tällaiseen yksittäiseen transaktioon. Tämä kenttä viittaa salkusta tai transaktiosta kerättyjen vaihtelumarginaalien ensimmäisen ilmoittamisen jälkeen kertyneen vaihtelumarginaalin nykyiseen</p>

Kohta	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			<p>kokonaisarvoon. Jos kerätty vaihtelumarginaali on useamman kuin yhden valuutan määräinen, nämä määrät muunnetaan vastapuolen 1 valitsemaksi yhdeksi valuutaksi ja ilmoitetaan yhtenä kokonaisarvona.</p>
24	Vakuus	Vastapuolen 1 keräämä vaihtelumarginaali (aliarvostuksen jälkeen)	<p>Vastapuolen 1 keräämän vaihtelumarginaalin rahallinen arvo, mukaan lukien käteissuorituksena maksettava marginaali ja mahdolliset siirto- ja toimitusvaiheessa olevat marginaalit. Ehdollista vaihtelumarginaalia ei oteta huomioon. Jos vakuus asetetaan salkun tasolla, kerätty vaihtelumarginaali liittyy koko salkkuun, kun taas jos vakuus asetetaan yksittäisille transaktioille, kerätty vaihtelumarginaali liittyy tällaiseen yksittäiseen transaktioon. Tässä kentässä viitataan kerätyn vaihtelumarginaalin tämänhetkiseen kokonaisarvoon aliarvostuksen soveltamisen jälkeen (jos sovellettavissa), joka on kertynyt salkun tai transaktion osalta kerättyjen vaihtelumarginaalien ensimmäisen ilmoituksen jälkeen. Jos kerätty vaihtelumarginaali on useamman kuin yhden valuutan määräinen, nämä määrät muunnetaan vastapuolen 1 valitsemaksi yhdeksi valuutaksi ja ilmoitetaan yhtenä</p>

Kohta	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
			kokonaisarvona.
25	Vakuus	Kerätyn vaihtelumarginaalin valuutta	Valuutta, jonka määräinen kerätty vaihtelumarginaali on. Jos kerätty vaihtelumarginaali on useamman kuin yhden valuutan määräinen, tämä dataelementti kuvaa yhtä niistä valuutoista, johon vastapuoli 1 on päättänyt muuntaa kaikki kerättyjen vaihtelumarginaalien arvot.
26	Vakuus	Vastapuolen 1 keräämä ylimääräinen vakuus	Vastapuolen 1 keräämän ylimääräisen vakuuden rahallinen arvo, joka on erillinen ja riippumaton alku- ja vaihtelumarginaalista. Tämä dataelementti viittaa ylimääräisen vakuuden nykyiseen kokonaisarvoon ennen aliarvostuksen soveltamista (jos sovellettavissa) eikä sen päivittäiseen muutokseen. Kerätyn alku- tai vaihtelumarginaalin määrä, joka ylittää vaaditun alku- tai vaihtelumarginaalin, ilmoitetaan osana kerättyä alku- tai vaihtelumarginaalia, eikä sitä sisällytetä kerättyihin ylimääräisiin vakuuksiin. Keskitetysti määritettyjen transaktioiden osalta ylimääräiset vakuudet ilmoitetaan vain siltä osin kuin ne voidaan kohdistaa tiettyyn salkkuun tai transaktioon.
27	Vakuus	Kerätyn ylimääräisen vakuuden valuutta	Valuutta, jonka määräinen kerätty ylimääräinen vakuus on. Jos kerätty ylimääräinen vakuus on useamman kuin yhden valuutan määräinen, tämä dataelementti kuvaa yhtä niistä valuutoista, johon vastapuoli 1 on päättänyt muuntaa kaikki kerätyn ylimääräisen vakuuden arvot.

Kohta	Jakso	Kenttä	Ilmoitettavat tiedot
28	Vakuus	Toimen tyyppi	<p>Ilmoituksen kohteena on oltava jokin seuraavista toimen tyypeistä:</p> <p>a) kun ilmoitetaan uusi marginaalin saldo tai marginaalien yksityiskohtien muutos, ilmoitetaan ”Marginaalin saattaminen ajan tasalle”;</p> <p>b) kun oikaistaan aiemmassa ilmoituksessa väärin ilmoitettuja tietokenttiä, ilmoitetaan ”Oikaisu”.</p>
29	Vakuus	Tapahtuman päivämäärä	<p>Päivä, jona johdannaissopimukseen liittyvä ilmoitettava tapahtuma, josta on ilmoitettu ilmoituksessa, on tapahtunut. Kun on kyse vakuuksien päivittämisestä, päivämäärä, jonka osalta ilmoitukseen sisältyvät tiedot on annettu.</p>