

5/7. DVO Meldung Format
ANHANG I

ANHANG I

ANHANG I

Normen und Format für die Übermittlung der Meldungen an die zuständigen Behörden gemäß Verordnung (EU) Nr. 596/2014

Tabelle 1
Legende zu Tabelle 3

| SYMBOL | 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 | <ul style="list-style-type: none"> – Datum und Zeit in folgendem Format: – J J J J - M M - T T - Thh:mm:ss.ffffffZ. – „JJJ”: 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 gemäß ISO 8601 | Formatierung des Datums: JJJJ-MM-TT. |
| {DECIMAL-n/m} | Dezimalzahl von bis zu n Stellen insgesamt, von denen bis zu m Stellen Bruchziffern sein können | Numerisches Feld für positive und negative Werte. <ul style="list-style-type: none"> – Dezimaltrennzeichen: „.” (Punkt) – 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 |

5/7. DVO Meldung Format
ANHANG I

| SYMBOL | DATENTYP | DEFINITION |
|---------------|---|--|
| | | „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 von 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. |

Marktmissbrauchs-
 VO + Ven
 MAD-Sankt
 DRL-Meldung
 Del-VO Ausn
 DfVO Meldung Form
 DfVO Eigengeschäft
 DfVO Insider
 TransRL + delVen
 DfVO Infoaustausch
 ESMA

Tabelle 2

Klassifizierung von Warenderivaten und Derivaten von Emissionszertifikaten für Tabelle 3 (Felder 35-37)

| Basisprodukt | Unterprodukt | Weiteres Unterprodukt |
|--|--------------------------------|------------------------------|
| „AGRI“ – Agrarprodukt | „GROS“ – Getreide und Ölsaaten | „FWHT“ – Futterweizen |
| | | „SOYB“ – Sojabohnen |
| | | „CORN“ – Mais |
| | | „RPSD“ – Raps |
| | | „RICE“ – Reis |
| | | „OTHR“ – Sonstiges |
| | „SOFT“ – Weichwaren | „CCOA“ – Kakao |
| | | „ROBU“ – Robusta-Kaffee |
| | | „WHSG“ – Weißzucker |
| | | „BRWN“ – Rohzucker |
| „OTHR“ – Sonstiges | | |
| „POTA“ – Kartoffeln | | |
| „OOLI“ – Olivenöl | „LAMP“ – Lampantöl | |
| „DIRY“ – Molkereiprodukte | | |
| „FRST“ – forstwirtschaftliche Produkte | | |
| „SEAF“ – Fisch und Meeresfrüchte | | |
| „LSTK“ – Vieh | | |
| „GRIN“ – Getreide | „MWHT“ – Mahlweizen | |

5/7. DVO Meldung Format
ANHANG I

| Basisprodukt | Unterprodukt | Weiteres Unterprodukt |
|---------------------|--|---|
| „NRGY“ – Energie | „ELEC“ – Strom | „BSLD“ – Grundlast „FITR“ – finanzielle Übertragungsrechte „PKLD“ – Spitzenlast „OFFP“ – Schwachlast „OTHR“ – Sonstiges |
| | „NGAS“ – Erdgas | „GASP“ – GASPOOL „LNGG“ – LNG „NBP“ – NBP „NCGG“ – NCG „TTF“ – 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 „EUAE“ – EUA „EUAA“ – EUA „OTHR“ – Sonstige |
| | „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 | |

5/7. DVO Meldung Format ANHANG I

| Basisprodukt | Unterprodukt | Weiteres Unterprodukt |
|---|---|--|
| | „UAAN“ – UAN (Harnstoff und Ammoniumnitrat) | |
| „INDP“ – Industrieerzeugnisse | „CSTR“ – Baugewerbe „MFTG“ – Verarbeitendes Gewerbe | |
| „METL“ – Metalle | „NPRM“ – Nichtelegmetalle | „ALUM“ – Aluminium „ALUA“ – Aluminiumlegierung „CBLT“ – Kobalt „COPR“ – Kupfer „IRON“ – Eisenerz „LEAD“ – Blei „MOLY“ – Molybdän „NASC“ – NASAAC „NICK“ – Nickel „STEL“ – Stahl „TINN“ – Zinn „ZINC“ – Zink „OTHR“ – Sonstiges |
| | „PRME“ – Edelmetalle | „GOLD“ – Gold „SLVR“ – Silber „PTNM“ – Platin „PLDM“ – Palladium „OTHR“ – Sonstiges |
| „MCEX“ – Multi Commodity exotisch | | |
| „PAPR“ – Papier | „CBRD“ – Wellpappenroh papier „NSPT“ – Zeitungsdruckpapier „PULP“ – Holz- und Zellstoff „RCVP“ – Recyclingpapier | |
| „POLY“ – Polypropylen | „PLST“ – Kunststoff | |
| „INFL“ – Inflation | | |
| „OEST“ – Offizielle Wirtschaftsstatistik | | |
| „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. | „DLVR“ – Lieferbar „NDLV“ – Nicht lieferbar | |
| „OTHR“ – Sonstige | | |

Marktmisbrauchs-
VO + Ven
MAD-Sankt
DRL-Meldung
Del-VO Ausn
DfVO Meldung Form
DfVO Eigengeschäft
DfVO Insider
TransRL + delVen
DfVO Infoaustausch
ESMA

Tabelle 3

Normen und Format für die Meldungen nach Artikel 4 Absatz 1 und 2 der Verordnung (EU) Nr. 596/2014

5/7. DVO Meldung Format
ANHANG I

| Nr. | FELD | FÜR DIE MELDUNGEN ZU VERWENDEDE STANDARDS UND FORMATE |
|---|---|--|
| Allgemeine Felder | | |
| 1 | Kennung des Instruments | {ISIN} |
| 2 | Vollständige Bezeichnung des Instruments | {ALPHANUM-350} |
| 3 | Klassifizierung des Instruments | {CFI_CODE} |
| 4 | Indikator für Warenderivate | „richtig“ – Ja „falsch“ – Nein |
| Felder mit Bezug auf den Emittenten | | |
| 5 | Kennung des Emittenten oder Handelsplatzbetreibers | {LEI} |
| Felder mit Bezug auf den Handelsplatz | | |
| 6 | Handelsplatz | {MIC} |
| 7 | Kurzbezeichnung des Finanzinstruments | {FISN} |
| 8 | Antrag auf Zulassung zum Handel durch den Emittenten | „richtig“ – Ja „falsch“ – Nein |
| 9 | Datum der Zulassung zum Handel | {DATE_TIME_FORMAT} |
| 10 | Datum der Beantragung der Zulassung zum Handel | {DATE_TIME_FORMAT} |
| 11 | Datum der Zulassung zum Handel oder Datum des ersten Handelsabschlusses | {DATE_TIME_FORMAT} |
| 12 | Kontraktende | {DATE_TIME_FORMAT} |
| Felder mit Bezug auf den Nennwert | | |
| 13 | Nennwährung 1 | {CURRENCYCODE_3} |
| Felder mit Bezug auf Schuldverschreibungen und sonstige verbrieftete Schuldtitel | | |
| 14 | Ausgegebener Gesamtnennbetrag | {DECIMAL-18/5} |
| 15 | Fälligkeitstermin | {DATEFORMAT} |
| 16 | Währung des Nennbetrags | {CURRENCYCODE_3} |
| 17 | Nennwert je Stück/gehandelter Mindestwert | {DECIMAL-18/5} |
| 18 | Festsatz | {DECIMAL-11/10} Ausgedrückt als Prozentanteil (z. B. 7,0 bedeutet 7 % und 0,3 bedeutet 0,3 %) |
| 19 | Kennung des Indexes/Benchmark einer variabel verzinslichen Schuldverschreibung | {ISIN} |
| 20 | Bezeichnung des Indexes/Benchmarks einer variabel verzinslichen Schuldverschreibung | {INDEX} oder {ALPHANUM-25} – wenn die Bezeichnung des Index nicht in der {INDEX}-Liste enthalten ist |
| 21 | Laufzeit des Indexes/Benchmark einer variabel verzinslichen Schuldverschreibung | {INTEGER-3}+„TAGE“ – Tage {INTEGER-3}+„WOCHE“ – Wochen {INTEGER-3}+„MONATE“ – Monate {INTEGER-3}+„JAHR“ – Jahre |
| 22 | Basispunkt-Spread des Indexes/Benchmark einer variabel | {INTEGER-5} |

5/7. DVO Meldung Format
ANHANG I

| Nr. | FELD | FÜR DIE MELDUNGEN ZU VERWENDEnde STANDARDS UND FORMATE |
|--|---------------------------------------|--|
| | verzinslichen Schuldverschreibung | |
| 23 | Vorrangigkeit der Schuldverschreibung | „SNDB“ – vorrangige Schuld „MZZD“ – Mezzanin „SBOD“ – nachrangig „JUND“ – Junior |
| Felder mit Bezug auf Derivate und verbriefte Derivate | | |
| 24 | Ablaufdatum: | {DATEFORMAT} |
| 25 | Preismultiplikator | {DECIMAL-18/17} |
| 26 | Code des Basisinstruments | {ISIN} |
| 27 | Basisemittent | {LEI} |
| 28 | Bezeichnung des Basisindex | {INDEX} oder {ALPHANUM-25} – wenn die Bezeichnung des Indexes nicht in der {IN-DEX}-Liste enthalten ist |
| 29 | Laufzeit des Basisindex | {INTEGER-3}+„TAGE“ – Tage {INTEGER-3}+„WOCHE“ – Wochen {INTEGER-3}+„MONATE“ – Monate {INTEGER-3}+„JAHR“ – Jahre |
| 30 | Art der Option | „PUTO“ – Put-Option „CALL“ – Call-Option „OTHR“ – wenn nicht bestimmt werden kann, ob es sich um eine Call- oder Put-Option handelt |
| 31 | Ausübungspreis | {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 | {CURRENCYCODE_3} |
| 33 | Art der Option (mögliche Ausübung) | „EURO“ – Europäische Option „AMER“ – Amerikanische Option „ASIA“ – Asiatische Option „BERM“ – Bermuda-Option „OTHR“ – Sonstige |
| 34 | Art der Lieferung | „PHYS“ – physisch „CASH“ – bar „OPTN“ – Optional für die Gegenpartei oder bei Festlegung durch einen Dritten |
| Warenderivate und Derivate von Emissionszertifikaten | | |
| 35 | Basisprodukt | Es sind nur Eintragungen aus der Spalte „Basisprodukt“ der Tabel- |

Marktmisbrauchs-
VO + Ven
MAD-Sankt
DRL-Meldung
Del-VO Ausn
DfVO Meldung Form
DfVO Eigengeschäft
DfVO Insider
TransRL + delVen
DfVO Infoaustausch
ESMA

5/7. DVO Meldung Format
ANHANG I

| Nr. | FELD | FÜR DIE MELDUNGEN ZU VERWENDEnde STANDARDS UND FORMATE |
|-----|-----------------------|---|
| | | le zur Klassifizierung von Warenderivaten und Derivaten von Emissionszertifikaten zulässig. |
| 36 | Unterprodukt | Es sind nur Eintragungen aus der Spalte „Unterprodukt“ der Tabelle zur Klassifizierung von Warenderivaten und Derivaten von Emissionszertifikaten zulässig. |
| 37 | Weiteres Unterprodukt | Es sind nur Eintragungen aus der Spalte „Weiteres Unterprodukt“ der Tabelle zur Klassifikation von Warenderivaten und Derivaten von Emissionszertifikaten zulässig. |
| 38 | Art der Transaktion | „FUTR“ – Terminkontrakt „OPTN“ – Option „TAPO“ – TAPO „SWAP“ – Swap „MINI“ – Mini-Future „OTCT“ – OTC-Derivate „ORIT“ – Direktverkauf „CRCK“ – Crack-Option „DIF“ – Differenzgeschäft „OTHR“ – Sonstiges |
| 39 | Art des Schlusskurses | „ARGM“ – Argus/McCloskey „BLTC“ – Baltic „EXOF“ – Exchange „GBCL“ – GlobalCOAL „IHSM“ – IHS McCloskey „PLAT“ – Platts „OTHR“ – Sonstige |

Zinsderivate

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

| | | |
|----|-----------------------|--|
| 40 | Referenzzinssatz | {INDEX} oder {ALPHANUM-25} – wenn der Referenzzinssatz nicht in der {INDEX}-Liste enthalten ist |
| 41 | IR-Kontraktlaufzeit | {INTEGER-3}+„TAGE“ – Tage {INTEGER-3}+„WOCHE“ – Wochen {INTEGER-3}+„MONATE“ – Monate {INTEGER-3}+„JAHR“ – Jahre |
| 42 | Nennwährung 2 | {CURRENCYCODE_3} |
| 43 | Festsatz, Leg 1 | {DECIMAL-11/10} Ausgedrückt als Prozentanteil (z. B. 7.0 bedeutet 7 % und 0.3 bedeutet 0,3 %) |
| 44 | Festsatz, Leg 2 | {DECIMAL-11/10} Ausgedrückt als Prozentanteil (z. B. 7.0 bedeutet 7 % und 0.3 bedeutet 0,3 %) |
| 45 | Variabler Satz, Leg 2 | {INDEX} |

5/7. DVO Meldung Format ANHANG I

| Nr. | FELD | FÜR DIE MELDUNGEN ZU VERWENDEDE STAN- DARDS UND FORMATE |
|-----|-------------------------------|--|
| | | oder {ALPHANUM-25} – wenn der Referenzsatz nicht in der {IN- DEX}-Liste enthalten ist |
| 46 | IR-Kontraktlaufzeit von Leg 2 | {INTEGER-3}+,,TAGE" – Tage {INTEGER-3}+,,WOCHE" – Wochen {INTEGER-3}+,,MONATE" – Monate {INTEGER-3}+,,JAHR" – Jahre |

Fremdwährungsderivate

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

| | | |
|----|---------------|--|
| 47 | Nennwährung 2 | {CURRENCYCODE_3} |
| 48 | FX-Art | „FXCR" – FX Cross Rates „FXEM" – FX Emerging Mar- kets „FXMJ" – FX Majors |

Marktmissbrauchs-
 VO + Ven
 MAD-Sankt
 DRL-Meldung
 Del-VO Ausn
 DfVO Meldung Form
 DfVO Eigengeschäft
 DfVO Insider
 TransRL + delVen
 DfVO Infoaustausch
 ESMA