

5/11. DeIVO Meldung Format

ANHANG

ANHANG

ANHANG

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

Tabelle 1

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

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

5/11. DelVO Meldung Format ANHANG

Basisprodukt	Unterprodukt	Weiteres Unterprodukt
		„KERO“ – Kerosin „LLSO“ – Light Louisiana Sweet (LLS) „MARS“ – MARS „NAPH“ – Naptha „NGLO“ – NGL „TAPI“ – Tapis „URAL“ – Ural „WTIO“ – WTI
	„COAL“ – Kohle „INRG“ – Arbitragegeschäft „RNGG“ – erneuerbare Energie „LGHT“ – leichte Bestandteile „DIST“ – Destillate	
„ENVR“ – Umwelt	„EMIS“ – Emissionen	„CERE“ – CER „ERUE“ – ERU „EUAE“ – EUA „EUAA“ – EUAA „OTHR“ – Sonstige
	„WTHR“ – Wetter „CRBR“ – Kohlenstoff	
„FRGT“ – Fracht	„WETF“ – Nass	„TNKR“ – Tanker
	„DRYF“ – Trocken	„DBCR“ – Massengutschiff
	„CSHP“ – Containerschiffe	
„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 „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“ – Wellpappenrohpapier „NSPT“ – Zeitungsdruckpapier	

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

5/11. DeIVO Meldung Format

ANHANG

Basisprodukt	Unterprodukt	Weiteres Unterprodukt
	„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 im Hinblick auf technische Regulierungsstandards für Transparenzanforderungen für Handelsplätze und Wertpapierfirmen in Bezug auf Schuldverschreibungen, strukturierte Finanzprodukte, Emissionszertifikate und Derivate.	„DLVR“ – Lieferbar „NDLV“ – Nicht lieferbar	
„OTHR“ – Sonstige		

Tabelle 2

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

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

5/11. DelVO Meldung Format ANHANG

Nr.	Feld	Zu meldender Inhalt
11	Datum der Zulassung zum Handel oder Datum des ersten Handelsabschlusses	Datum und Uhrzeit der Zulassung zum Handel auf einem Handelsplatz oder Datum und Zeitpunkt des erstmaligen Handels bzw. des erstmaligen Eingangs eines Auftrags oder einer Offerte auf dem Handelsplatz.
12	Kontraktende	Datum und Uhrzeit, zu dem/der Handel mit dem Finanzinstrument auf dem Handelsplatz eingestellt wird bzw. zu dem/der seine Zulassung zum Handel erlischt. Wenn Datum und Uhrzeit nicht verfügbar sind, ist das Feld nicht auszufüllen.
Felder mit Bezug auf den Nennwert		
13	Nennwährung 1	Währung des Nennwerts. Bei Zinsderivatkontrakten oder Währungsderivatkontrakten ist dies die Nennwährung von Leg 1 oder die Währung 1 des Paares. Im Falle von Swaptions, bei denen der zugrunde liegende Swap in einheitlicher Währung erfolgt, ist dies die Nennwährung des zugrunde liegenden Swaps. Im Falle von Swaptions, bei denen der zugrunde liegende Swap in mehreren Währungen erfolgt, ist dies die Nennwährung von Leg 1 des Swaps.
Felder mit Bezug auf Schuldverschreibungen und sonstige verbrieftete Schuldtitel		
14	Ausgebener Gesamtnennbetrag	Ausgebener Gesamtnennbetrag in monetärem Wert.
15	Fälligkeitstermin	Datum der Fälligkeit des angegebenen Finanzinstruments. Dieses Feld gilt für Schuldtitel mit festgelegter Fälligkeit.
16	Währung des Nennbetrags	Währung des Nennbetrags bei Schuldtiteln.
17	Nennwert je Stück/gehandelter Mindestwert	Nennwert jedes Instruments. Falls nicht verfügbar, ist der gehandelte Mindestwert anzugeben.
18	Festsatz	Fester Prozentsatz der Rendite eines Schuldtitels, wenn dieser bis zur Fälligkeit gehalten wird, in Prozenten angegeben.
19	Kenntnis des Indexes/Benchmark einer variabel verzinslichen Schuldverschreibung	Sofern eine Kenntnis vorhanden ist.
20	Bezeichnung des Indexes/Benchmark einer variabel verzinslichen Schuldverschreibung	Wenn keine Kenntnis vorhanden, Bezeichnung des Index.
21	Laufzeit des Indexes/Benchmark einer variabel verzinslichen Schuldverschreibung	Laufzeit des Index/Benchmark einer variabel verzinslichen Schuldverschreibung. Die Laufzeit ist in Tagen, Wochen, Monaten oder Jahren anzugeben.
22	Basispunkte-Spread des Index/ Benchmark einer variabel verzinslichen Schuldverschreibung	Zahl der Basispunkte über oder unter dem Index für die Preisberechnung.
23	Vorrangigkeit der Schuldverschreibung	Angabe der Art der Schuldverschreibung: vorrangige Schuld, Mezzanin, nachrangig oder Junior.
Felder mit Bezug auf Derivate und verbrieftete Derivate		
24	Ablaufdatum	Ablaufdatum des Finanzinstruments. Das Feld gilt nur für Derivate mit festgelegtem Ablaufdatum.
25	Preismultiplikator	Zahl der Anteile des Basisinstruments, die von einem einzelnen Derivatkontrakt erfasst werden. Bei Future oder Option auf einen Index: Betrag je Indexpunkt. Bei Spreadbets die Bewegung des Kurses des Basisinstruments, auf dem der Spreadbet beruht.
26	Code des Basisinstruments	ISIN - Code des Basisinstruments.

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

5/11. DeIVO Meldung Format

ANHANG

Nr.	Feld	Zu meldender Inhalt
		<p>Bei ADR, GDR und ähnlichen Instrumenten Angabe des ISIN-Codes des Finanzinstruments, auf denen diese Instrumente beruhen.</p> <p>Bei Wandelschuldverschreibungen Angabe des ISIN-Codes des Instruments, in das die Wandelschuldverschreibung umgewandelt werden kann.</p> <p>Bei Derivaten oder anderen Instrumenten mit einem Basiswert Angabe des ISIN-Codes des Basisinstruments, wenn der Basiswert auf einem Handelsplatz zum Handel zugelassen ist oder gehandelt wird. Handelt es sich beim Basiswert um eine Aktiendividende, Angabe des Instrument Code der betreffenden Aktie, die den Anspruch auf die zugrunde liegenden Dividenden begründet.</p> <p>Bei Credit Default Swaps sollte die ISIN der Referenzverbindlichkeit angegeben werden.</p> <p>Wenn der Basiswert ein Index ist und eine ISIN hat, Angabe des ISIN-Codes für diesen Index.</p> <p>Wenn es sich beim Basiswert um einen Korb handelt, Angabe des ISIN-Codes für jeden Bestandteil des Korbes, der auf einem Handelsplatz zum Handel zugelassen ist oder gehandelt wird. Daher sind die Felder 26 und 27 so oft zu melden, bis alle im Korb enthaltenen Instrumente aufgeführt sind.</p>
27	Basisemittent	Wenn sich das Instrument auf einen Emittenten und nicht auf ein einzelnes Instrument bezieht, Angabe des LEI-Codes des Emittenten.
28	Bezeichnung des Basisindex	Wenn der Basiswert ein Index ist, Bezeichnung des Indexes.
29	Laufzeit des Basisindex	Wenn der Basiswert ein Index ist, Laufzeit des Indexes.
30	Art der Option	<p>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:</p> <ul style="list-style-type: none"> – „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. <p>Im Fall von Caps und Floors gilt Folgendes:</p> <ul style="list-style-type: none"> – „Put-Option“ im Falle eines Floors. – „Call-Option“ im Falle eines Caps. <p>Das Feld gilt nur für Derivate, die Optionen oder Optionsscheine sind.</p>
31	Ausübungspreis	<p>Festgelegter Preis, bei dem der Inhaber das Basisinstrument kaufen oder verkaufen muss, oder Angabe, dass der Preis zum Zeitpunkt der Ausübung nicht bestimmt werden kann.</p> <p>Das Feld gilt nur für Optionen oder Optionsscheine, bei denen der Ausübungspreis zum Zeitpunkt der Ausübung bestimmt werden kann.</p> <p>Wenn der Preis momentan nicht verfügbar, aber „in der Schwebe“ ist, lautet der Wert „PNDG“.</p> <p>Wenn kein Ausübungspreis zutrifft, ist das Feld nicht auszufüllen.</p>
32	Währung des Ausübungspreises	Währung des Ausübungspreises.

5/11. DelVO Meldung Format

ANHANG

Nr.	Feld	Zu meldender Inhalt
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.
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.

Warenderivate und Derivate von Emissionszertifikaten

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

Zinsderivate

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

40	Referenzzinssatz	Bezeichnung des Referenzzinssatzes.
41	IR-Kontraktlaufzeit	Wenn es sich bei der Anlageklasse um Zinssätze handelt, ist in diesem Feld die Kontraktlaufzeit anzugeben. Die Laufzeit ist in Tagen, Wochen, Monaten oder Jahren anzugeben.
42	Nennwährung 2	Im Fall von Multi-Currency- oder Cross-Currency-Swaps die Währung, auf die Leg 2 des Kontrakts lautet. Bei Swaptions, denen ein Multi-Currency-Swap zugrunde liegt, die Währung, auf die Leg 2 des Swaps lautet.
43	Festsatz, Leg 1	Angabe des verwendeten Festsatzes von Leg 1, sofern zutreffend.
44	Festsatz, Leg 2	Angabe des verwendeten Festsatzes von Leg 2, sofern zutreffend.
45	Variabler Satz, Leg 2	Angabe des verwendeten Zinssatzes, sofern zutreffend.
46	IR-Kontraktlaufzeit von Leg 2	Angabe des Referenzzeitraums des Zinssatzes, der in im Voraus festgelegten Zeitabständen unter Bezugnahme auf einen marktüblichen Referenzzinssatz festgesetzt wird. Der Zeitraum ist in Tagen, Wochen, Monaten oder Jahren anzugeben.

Fremdwährungsderivate

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

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

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