РЕГЛАМЕНТ ЗА ИЗПЪЛНЕНИЕ (ЕС) 2019/363 НА КОМИСИЯТА

от 13 декември 2018 година

за установяване на технически стандарти за изпълнение по отношение на формàта и честотата на докладите с данни за сделките за финансиране с ценни книжа (СФЦК) пред регистрите на трансакции в съответствие с Регламент (ЕС) 2015/2365 на Европейския парламент и на Съвета и за изменение на Регламент за изпълнение (ЕС) № 1247/2012 на Комисията по отношение на използването на кодове за докладването на договори за деривати

(текст от значение за ЕИП)

ЕВРОПЕЙСКАТА КОМИСИЯ,

като взе предвид Регламент (ЕС) 2015/2365 на Европейския парламент и на Съвета от 25 ноември 2015 г. относно прозрачността при сделките за финансиране с ценни книжа и при повторното използване, и за изменение на Регламент (ЕС) № 648/2012 ([1]), и по-специално член 4, параграф 10 от него,

като взе предвид Регламент (ЕС) № 648/2012 на Европейския парламент и на Съвета от 4 юли 2012 г. относно извънборсовите деривати, централните контрагенти и регистрите на трансакции ([2]), и по-специално член 9, параграф 6 от него,

като има предвид, че:

(1) С цел да се улесни събирането, обобщаването и сравняването на данните между регистрите на трансакции информацията, докладвана от контрагентите по сделка за финансиране с ценни книжа (СФЦК) пред регистрите на трансакции или Европейския орган за ценни книжа и пазари (ЕОЦКП), следва да бъде подавана в хармонизиран формат. СФЦК следва да бъдат докладвани, доколкото е възможно, съобразно формàта за докладване на договорите за деривати, предвиден по силата на член 9 от Регламент (ЕС) № 648/2012 на Европейския парламент и на Съвета, за да се сведат до минимум разходите за докладващите контрагенти. Следователно с настоящия регламент се определят форматът за всяко от докладваните полета, както и хармонизиран доклад съгласно широко използван във финансовия сектор стандарт на ISO.

(2) В доклада контрагентите по СФЦК посочват всеки правен субект единствено съгласно напълно въведената глобална система за идентификационен код на правния субект (ИКПС). С оглед ефективното използване на системата на ИКПС контрагентите следва да гарантират, че свързаните с техните ИКПС референтни данни се обновяват в съответствие с условията на акредитиран издател на ИКПС (местно оперативно звено). В момента се подготвя разширяването на глобалната система за ИКПС върху клоновете на правните субекти. Докато това разширяване не бъде завършено, така че да бъде счетено за подходящо за целите на докладването на СФЦК, а настоящият регламент бъде съответно изменен, за идентифицирането на клона на контрагент, чрез който е сключена СФЦК, следва да се използва кодът по ISO на държавата, в която се намира клонът.

(3) Понастоящем е в процес на разработване и глобална система за уникален търговски идентификатор (УТИ). Докато тази глобална система за УТИ не бъде завършена, така че да бъде счетена за подходяща за целите на докладването на СФЦК, и настоящият регламент бъде съответно изменен, за идентифицирането на СФЦК следва да се използва съгласуваният между контрагентите УТИ.

(4) В член 4а от Регламент за изпълнение (ЕС) № 1247/2012 на Комисията ([3]) се съдържа процедура за определяне на субекта, отговарящ за генерирането на УТИ във връзка с докладването на договорите за деривати, когато контрагентите не успеят да се споразумеят кой да бъде този субект. За осигуряване на съгласуваност при докладването на договорите за деривати и на СФЦК подобна процедура следва да бъде предвидена и за контрагентите, които докладват СФЦК.

([1]) ОВ L 337, 23.12.2015 г., стр. 1.
([2]) ОВ L 201, 27.7.2012 г., стр. 1.
([3]) Регламент за изпълнение (ЕС) № 1247/2012 на Комисията от 19 декември 2012 г. за установяване на технически стандарти за изпълнение по отношение на формàта и периодичността на отчетите за трансакциите, предавани на регистрите на трансакции съгласно Регламент (ЕС) № 648/2012 на Европейския парламент и на Съвета относно извънборсовите деривати, централните контрагенти и регистрите на трансакции (ОВ L 352, 21.12.2012 г., стр. 20).

(5) Понастоящем няма обичайна пазарна практика за определяне на ролята на контрагента по СФЦК. Поради това следва да се установят конкретни правила, чрез които точно и последователно да се определят обезпечителят и обезпеченото лице по СФЦК.

(6) Дадена СФЦК може да се докладва няколко пъти, например в случай на последващи промени по СФЦК. За да може всички доклади, свързани с конкретна СФЦК, както и всяка СФЦК като цяло да бъдат правилно разбрани, докладите следва да бъдат подавани в хронологичния ред на настъпване на докладваните събития.

(7) За да се намали тежестта, свързана с докладване на изменението на някои стойности, по-специално на обезпечението, на предоставения или получения маржин и на повторно използваното обезпечение, тези данни следва да бъдат докладвани във вида им към края на деня само ако се различават от вече докладваните данни.

(8) Данните за непогасените маржин заеми следва да се докладват във вида им към края на деня, когато е налице нетен паричен дебит в основната валута или когато пазарната стойност на късата позиция на контрагента е положителна.

(9) Пазарната стойност на ценните книжа, предоставени или получени в заем, следва да бъде докладвана във вида ѝ към края на деня. По същия начин, пазарната стойност на обезпечението се докладва от контрагентите във вида ѝ към края на деня.

(10) Настоящият регламент е изготвен въз основа на проекта на технически стандарти за изпълнение, предоставен от ЕОЦКП на Европейската комисия по реда на член 15 от Регламент (ЕС) № 1095/2010 на Европейския парламент и на Съвета от 24 ноември 2010 г. за създаване на Европейски надзорен орган (Европейски орган за ценни книжа и пазари) ([4]).

(11) ЕОЦКП проведе открити обществени консултации по този проект на технически стандарти за изпълнение, анализира свързаните с тях възможни разходи и ползи и поиска становището на създадената по силата на член 37 от Регламент (ЕС) № 1095/2010 Група на участниците от банковия сектор.

(12) Както при докладването на СФЦК все още предстои да бъдат разработени някои кодове, в т.ч. и идентификационни, които да се използват за докладването на договорите за деривати. Докато тези кодове бъдат разработени, така че да бъдат счетени за подходящи за целите на докладването, а Регламент (ЕС) № 1247/2012 бъде съответно изменен, посоченият регламент предвижда за класифицирането на деривати, за които не е наличен ISIN код по ISO 6166 или AII код, да се използва CFI код съгласно ISO 10692, а за докладването на деривати — уникалният търговски идентификатор, съгласуван между контрагентите. С оглед на правната сигурност при подходящата процедура за изменение на изискванията за докладване на договорите за деривати и на необходимата степен на съгласуваност между докладването на деривати и СФЦК, Регламент (ЕС) № 1247/2012 следва да се отнася само за действащите изисквания за това докладване.

(13) Поради това Регламент за изпълнение (ЕС) № 1247/2012 следва да бъде съответно изменен,

ПРИЕ НАСТОЯЩИЯ РЕГЛАМЕНТ:

Член 1

Стандарти и формати за данните в докладите за СФЦК

Информацията за СФЦК, която се докладва по силата на член 4, параграф 1 от Регламент (ЕС) 2015/2365, се представя в съответствие със стандартите и форматите, посочени в таблици 1—5 от приложение I. Докладът се подава в общ електронен и машинночетим вид и според общ образец във формат XML съгласно методиката по ISO 20022.

([4]) ОВ L 331, 15.12.2010 г., стр. 84.

Член 2

Идентифициране на контрагентите и други субекти

1. В посочения в член 1 доклад се използва идентификационният код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442 за идентифицирането на:

а) бенефициера, който е правен субект;

б) посредника;

в) централния контрагент (ЦК), получил разрешение в съответствие с Регламент (ЕС) № 648/2012;

г) клиринговия член;

д) посредника при заема;

е) участника в централен депозитар на ценни книжа (ЦДЦК);

ж) контрагента, който е правен субект;

з) трето лице — посредник;

и) субекта, който подава доклада;

й) емитента на ценната книга — предоставена или получена в заем или предоставена като обезпечение по СФЦК.

2. Всеки контрагент по СФЦК гарантира, че свързаните с неговия ИКПС по ISO 17442 референтни данни се обновяват съгласно условията на някое от акредитираните местни оперативни звена на Световната система за идентифициране на юридическите лица.

3. Когато СФЦК е сключена посредством клон на контрагент, идентифицирането на този клон в доклада по член 1 става чрез кода, посочен в поле 7 и поле 8 на таблица 1 от приложение I.

Член 3

Уникален търговски идентификатор

1. За всеки доклад се посочва уникалният търговски идентификатор (УТИ), съгласуван между контрагентите в съответствие с формàта, посочен в поле 1 на таблица 2 от приложение I.

2. Ако не успеят да се споразумеят кой субект да отговаря за генерирането на УТИ за доклада, контрагентите определят този субект в съответствие със следното:

а) за СФЦК, които се потвърждават и преминават през клиринг централно, УТИ се генерира при клиринга от централния контрагент (ЦК) за клиринговия член. Друг УТИ се генерира от клиринговия член за неговия контрагент;

б) за СФЦК, които се изпълняват централно, но не преминават през централен клиринг, УТИ се генерира от мястото на търговия за неговия член;

в) за СФЦК, които се потвърждават и преминават през клиринг централно, УТИ се генерира при клиринга от ЦК за клиринговия член. Друг УТИ се генерира от клиринговия член за неговия контрагент;

г) за СФЦК, които са били потвърдени централно по електронен път, но не са преминали през централен клиринг, УТИ се генерира при потвърждаването от платформата за потвърждаване на сделките;

д) за всички СФЦК, различни от посочените в букви а) — г), се прилага следното:

i) когато финансови контрагенти сключват СФЦК с нефинансови контрагенти, УТИ се генерира от финансовите контрагенти;

ii) за всички сделки по предоставяне или получаване в заем на ценни книжа, различни от посочените в подточка i), УТИ се генерира от посочения в член 4 обезпечител;

iii) за всички СФЦК, различни от посочените в подточки i) и ii), УТИ се генерира от посоченото в член 4 обезпечено лице.

3. Контрагентът, който генерира УТИ, своевременно съобщава този код на другия контрагент, за да може последният да изпълни задължението си за докладване.

Член 4

Роля на контрагента

1. Ролята на контрагента по СФЦК, посочена в поле 9 на таблица 1 от приложение I, се определя в съответствие с параграфи 2—4.

2. При репо сделки, сделки за покупка с условие за последваща продажба и сделки за продажба с условие за последваща покупка контрагентът, който по откриващото или спот рамо на сделката купува ценни книжа, стоки или гарантирани права, свързани с правото на собственост върху ценни книжа или стоки, и по закриващото или форуърд рамо на сделката се съгласява да ги продаде по определена цена на определена бъдеща дата, се посочва в поле 9 на таблица 1 от приложение I като обезпечено лице. Контрагентът, който продава тези ценни книжа, стоки или гарантирани права, се посочва в поле 9 на таблица 1 от приложение I като обезпечител.

3. При сделки за получаване в заем на ценни книжа или стоки и сделки за предоставяне в заем на ценни книжа или стоки контрагентът, който предоставя в заем ценните книжа или стоките, при условие че заемополучателят ще върне еквивалентни ценни книжа или стоки на определена бъдеща дата или при поискване от страна на прехвърлителя, се посочва в поле 9 на таблица 1 от приложение I като обезпечено лице. Контрагентът, който получава в заем тези ценни книжа или стоки, се посочва в поле 9 на таблица 1 от приложение I като обезпечител.

4. При маржин заемни сделки заемополучателят, т.е. контрагентът, на когото е предоставен заем срещу обезпечение, се посочва в поле 9 на таблица 1 от приложение I като обезпечител. Заемодателят, т.е. контрагентът, който предоставя заем срещу обезпечение, се посочва в поле 9 на таблица 1 от приложение I като обезпечено лице.

Член 5

Периодичност на докладите за СФЦК

1. Всички доклади с информацията за СФЦК, посочени в член 1, параграф 2 от Делегиран регламент (ЕС) 2019/356 на Комисията ([5]), се подават в хронологичния ред на настъпване на докладваните събития.

2. Контрагентите по маржин заемни сделки докладват данните за непогасените маржин заеми във вида им към края на деня, когато е налице нетен паричен дебит в основната валута или когато пазарната стойност на късата позиция на контрагента е положителна.

3. Контрагентите по неуредена СФЦК докладват всяка промяна на свързаните с обезпечението данни в полета 75—94 на таблица 2 от приложение I, с вид действие „актуализиране на обезпечението“. Контрагентите докладват променените данни във вида им към края на деня, докато не докладват прекратяването на СФЦК или СФЦК с вид действие „грешка“, или до настъпването на падежа на СФЦК — което от тези събития настъпи по-рано.

4. Контрагентите по неуредена СФЦК докладват всяка промяна на пазарната стойност на предоставените или получените в заем ценни книжа в края на деня в поле 57 на таблица 2 от приложение I, с вид действие „актуализиране на оценката“. Контрагентите докладват променената пазарна стойност във вида ѝ към края на деня, докато не докладват прекратяването на СФЦК или СФЦК с вид действие „грешка“, или до настъпването на падежа на СФЦК.

([5]) Делегиран регламент (ЕС) 2019/356 на Комисията от 13 декември 2018 г. за допълнение на Регламент (ЕС) 2015/2365 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на регулаторните технически стандарти за уточняване на подробната информация за сделките за финансиране с ценни книжа (СФЦК), докладвана на регистрите на трансакции (вж. страница 1 от настоящия брой на Официален вестник).

5. Контрагентите докладват всяка промяна на общия размер на маржина, предоставен или получен за всички преминали клиринг СФЦК, във вида му към края на деня в полета 8—19 на таблица 3 от приложение I с вид действие „актуализиране на маржина“, след като са докладвали за първи път общия размер на предоставения или получения маржин с вид действие „нов“.

6. Контрагентите докладват всяко изменение на стойността на повторно използваните обезпечения, реинвестираните парични средства и източниците на финансиране с вид действие „актуализиране на повторната употреба“ във вида му към края на деня в полета 8—14 на таблица 4 от приложение I, след като са докладвали съответните стойности с вид действие „нов“.

Член 6

Изменения на Регламент за изпълнение (ЕС) № 1247/2012

Регламент за изпълнение (ЕС) № 1247/2012 се изменя, както следва:

1) Член 4 се изменя, както следва:

   а) параграф 7 се заменя със следното:

      „Дериватът се класифицира в поле 4 на таблица 2 от приложението, като се използва код съгласно Класификацията на финансовите инструменти по ISO 10692 (CFI код).“;

   б) параграфи 8 и 9 се заличават.

2) В член 4а параграф 1 се заменя със следното:

   „1. За всеки отчет се посочва уникалният търговски идентификатор, съгласуван между контрагентите.“

3) Приложението се заменя с текста на приложение II към настоящия регламент.

Член 7

Влизане в сила

Настоящият регламент влиза в сила на двадесетия ден след деня на публикуването му в *Официален вестник на Европейския съюз*.

Настоящият регламент е задължителен в своята цялост и се прилага пряко във всички държави членки.

Съставено в Брюксел на 13 декември 2018 година.

За Комисията

Председател

Jean-Claude JUNCKER

ПРИЛОЖЕНИЕ I

Формати на данните, използвани за докладване на сделките за финансиране с ценни книжа съгласно посоченото в член 4, параграфи 1 и 5 от Регламент (ЕС) 2015/2365

Таблица 1

Данни за контрагентите

№	Поле	Формат
1	Дата и час на доклада	Формат на датата съгласно ISO 8601. Формат на часа съгласно координираното универсално време (UTC) — ГГГГ-ММ-ДДТчч:мм:ссZ
2	Субект, който подава доклада	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака.
3	Докладващ контрагент	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака.
4	Естество на докладващия контрагент	F - финансов контрагент N - нефинансов контрагент
5	Сектор на докладващия контрагент	Таксономия на финансовите контрагенти: „CDTI“ — кредитна институция, лицензирана в съответствие с Директива 2013/36/ЕС на Европейския парламент и на Съвета (1) или Регламент (ЕС) № 1024/2013 на Съвета (2) или субект от трета държава, за който би било необходимо издаването на лиценз или регистрация в съответствие с този законодателен акт „INVF“ — инвестиционен посредник, лицензиран в съответствие с Директива 2014/65/ЕС на Европейския парламент и на Съвета (3) или субект от трета държава, за който би било необходимо издаването на лиценз или регистрация в съответствие с този законодателен акт „INUN“ — застрахователно предприятие, лицензирано в съответствие с Директива 2009/138/ЕО на Европейския парламент и на Съвета (4) (Платежоспособност II) или субект от трета държава, за който би било необходимо издаването на лиценз или регистрация в съответствие с този законодателен акт „AIFD“ — АИФ, управляван от ЛУАИФ, лицензиран или регистриран в съответствие с Директива 2011/61/ЕС на Европейския парламент и на Съвета (5) или субект от трета държава, за който би било необходимо издаването на лиценз или регистрация в съответствие с този законодателен акт „ORPI“ — институция за професионално пенсионно осигуряване, лицензирана или регистрирана в съответствие с Директива 2003/41/ЕО на Европейския парламент и на Съвета (6) или субект от трета държава, за който би било необходимо издаването на лиценз или регистрация в съответствие с този законодателен акт „CCPS“ — централен контрагент, лицензиран в съответствие с Регламент (ЕС) № 648/2012 на Европейския парламент и на Съвета (7) или субект от трета държава, за който би било необходимо издаването на лиценз или регистрация в съответствие с този законодателен акт „REIN“ — презастрахователно предприятие, лицензирано в съответствие с Платежоспособност II или субект от трета държава, за който би било необходимо издаването на лиценз или регистрация в съответствие с този законодателен акт „CSDS“ — централен депозитар на ценни книжа, лицензиран в съответствие с Регламент (ЕС) № 909/2014 на Европейския парламент и на Съвета (8) или субект от трета държава, за който би било необходимо издаването на лиценз или регистрация в съответствие с този законодателен акт „UCIT“ — ПКИПЦК и неговото управляващо дружество, лицензирано в съответствие с Директива 2009/65/ЕО на Европейския парламент и на Съвета (9) или субект от трета държава, за който би било необходимо издаването на лиценз или регистрация в съответствие с този законодателен акт

№	Поле	Формат
		Таксономия за нефинансови контрагенти. Следните категории отговарят на основните раздели на класификацията NACE, както е установена в Регламент (ЕО) № 1893/2006 на Европейския парламент и на Съвета ([10]) „A“ — Селско, горско и рибно стопанство „B“ — Добивна промишленост „C“ — Преработваща промишленост „D“ — Производство и разпределение на електрическа и топлинна енергия и на газообразни горива „E“ — Доставяне на води, канализационни услуги, управление на отпадъци и възстановяване „F“ — Строителство „G“ — Търговия; ремонт на автомобили и мотоциклети „H“ — Транспорт, складиране и пощи „I“ — Хотелиерство и ресторантьорство „J“ — Създаване и разпространение на информация и творчески продукти; далекосъобщения „K“ — Финансови и застрахователни дейности „L“ — Операции с недвижими имоти „M“ — Професионални дейности и научни изследвания „N“ — Административни и спомагателни дейности „O“ — Публична администрация и отбрана; задължително социално осигуряване „P“ — Образование „Q“ — Хуманно здравеопазване и социална работа „R“ — Култура, спорт и развлечения „S“ — Други дейности „T“ — Дейности на домакинства като работодатели; недиференцирани дейности на домакинства по производство на стоки и услуги за собствено потребление „U“ — Дейности на екстериториални организации и служби
6	Допълнителна секторна класификация	„ETFT“ — борсово търгуван фонд „MMFT“ — фонд на паричния пазар „REIT“ — фонд за инвестиции в недвижимо имущество „OTHR“ — други
7	Клон на докладващия контрагент	Двубуквен код на държавата (код на държава по ISO 3166-1 alpha-2)
8	Клон на другия контрагент	Двубуквен код на държавата (код на държава по ISO 3166-1 alpha-2)
9	Роля на контрагента	„TAKE“ — обезпечено лице „GIVE“ — обезпечител
10	Субект, отговарящ за доклада	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака.
11	Друг контрагент	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака. Клиентски код (до 50 буквено-цифрови знака).
12	Държава на другия контрагент	Двубуквен код на държавата (код на държава по ISO 3166-1 alpha-2)

№	Поле	Формат
13	Бенефициер	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака. Клиентски код (до 50 буквено-цифрови знака).
14	Трето лице — посредник	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака.
15	Брокер	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака.
16	Клирингов член	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака.
17	Участник или индиректен участник в централен депозитар на ценни книжа (ЦДЦК)	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака.
18	Посредник при заема	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака.

([1]) Директива 2013/36/ЕС на Европейския парламент и на Съвета от 26 юни 2013 г. относно достъпа до осъществяването на дейност от кредитните институции и относно пруденциалния надзор върху кредитните институции и инвестиционните посредници (ОВ L 176, 27.6.2013 г., стр. 338).
([2]) Регламент (ЕС) № 1024/2013 на Съвета от 15 октомври 2013 г. за възлагане на Европейската централна банка на конкретни задачи относно политиките, свързани с пруденциалния надзор над кредитните институции (ОВ L 287, 29.10.2013 г., стр. 63).
([3]) Директива 2014/65/ЕС на Европейския парламент и на Съвета от 15 май 2014 г. относно пазарите за финансови инструменти (ОВ L 173, 12.6.2014 г., стр. 349).
([4]) Директива 2009/138/ЕО на Европейския парламент и на Съвета от 25 ноември 2009 г. относно започването и упражняването на застрахователна и презастрахователна дейност (Платежоспособност II) (ОВ L 335, 17.12.2009 г., стр. 1).
([5]) Директива 2011/61/ЕС на Европейския парламент и на Съвета от 8 юни 2011 г. относно лицата, управляващи алтернативни инвестиционни фондове (ОВ L 174, 1.7.2011 г., стр. 1).
([6]) Директива 2003/41/ЕО на Европейския парламент и на Съвета от 3 юни 2003 г. относно дейностите и надзора на институциите за професионално пенсионно осигуряване (ОВ L 235, 23.9.2003 г., стр. 10).
([7]) Регламент (ЕС) № 648/2012 на Европейския парламент и на Съвета от 4 юли 2012 г. относно извънборсовите деривати, централните контрагенти и регистрите на трансакции (ОВ L 201, 27.7.2012 г., стр. 1).
([8]) Регламент (ЕС) № 909/2014 на Европейския парламент и на Съвета от 23 юли 2014 г. за подобряване на сетълмента на ценни книжа в Европейския съюз и за централните депозитари на ценни книжа (ОВ L 257, 28.8.2014 г., стр. 1).
([9]) Директива 2009/65/ЕО на Европейския парламент и на Съвета от 13 юли 2009 г. относно координирането на законовите, подзаконовите и административните разпоредби относно предприятията за колективно инвестиране в прехвърлими ценни книжа (ПКИПЦК) (ОВ L 302, 17.11.2009 г., стр. 32).
([10]) Регламент (ЕО) № 1893/2006 на Европейския парламент и на Съвета от 20 декември 2006 г. за установяване на статистическа класификация на икономическите дейности NACE Rev. 2 (ОВ L 393, 30.12.2006 г., стр. 1).

Таблица 2

Данни за заема и обезпечението

№	Поле	Формат
1	Уникален търговски идентификатор (УТИ)	До 52 буквено-цифрови знака, включително четири специални знака: Разрешени са само главни букви от A до Z включително и цифри от 0 до 9 включително.
2	Номер за проследяване на доклада	До 52 буквено-цифрови знака, включително четири специални знака: Разрешени са само главни букви от A до Z включително и цифри от 0 до 9 включително.
3	Дата на събитието	Формат на датата по ISO 8601 (ГГГГ-ММ-ДД)
4	Вид СФЦК	„SLEB“ — предоставяне в заем на ценни книжа или стоки или получаване в заем на ценни книжа или стоки „SBSC“ — сделка за покупка с условие за последваща продажба и сделка за продажба с условие за последваща покупка „REPO“ — репо сделка „MGLD“ — маржин заемна сделка

№	Поле	Формат
5	Извършен клиринг	„true“ „false“
6	Дата и час на клиринга	Формат на датата съгласно ISO 8601. Формат на часа съгласно координираното универсално време (UTC) — ГГГГ-ММ-ДДТчч:мм:ссZ
7	ЦК	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака.
8	Място на търговия	Идентификационен код на пазара (MIC) по ISO 10383. Код с 4 буквено-цифрови знака. Използват се MIC по сегменти, когато такива съществуват за мястото на търговия.
9	Вид рамков договор	„MRAA“ — MRA „GMRA“ – GMRA „MSLA“ — MSLA „GMSL“ — GMSLA „ISDA“ — ISDA „DERP“ — Deutscher Rahmenvertrag für Wertpapierpensionsgeschäfte „CNBR“ — China Bond Repurchase Master Agreement „KRRA“ — Korea Financial Investment Association (KOFIA) Standard Repurchase Agreement „CARA“ — Investment Industry Regulatory Organization of Canada (IIROC) Repurchase/Reverse Repurchase Transaction Agreement „FRFB“ — Convention-Cadre Relative aux Operations de Pensions Livrees „CHRA“ — Swiss Master Repurchase Agreement „DEMA“ — German Master Agreement „JPBR“ — Japanese Master Agreement on the Transaction with Repurchase Agreement of the Bonds „ESRA“ — Contrato Marco de compraventa y Reporto de valores „OSLA“ — Overseas Securities Lending Agreement (OSLA) „MEFI“ — Master Equity and Fixed Interest Stock Lending Agreement (MEFISLA) „GESL“ — Gilt Edged Stock Lending Agreement (GESLA) „KRSL“ — Korean Securities Lending Agreement (KOSLA) „DERD“ — Deutscher Rahmenvertrag für Wertpapierdarlehen „AUSL“ — Australian Masters Securities Lending Agreement (AMSLA) „JPBL“ — Japanese Master Agreement on Lending Transaction of Bonds „JPSL“ — Japanese Master Agreement on the Borrowing and Lending Transactions of Share Certificates „BIAG“ — bilateral agreement „CSDA“ — CSD bilateral agreement или „OTHR“, ако видът на рамковия договор не фигурира в списъка по-горе
10	Друг вид рамков договор	До 50 буквено-цифрови знака
11	Версия на рамковия договор	Формат на датата по ISO 8601 (ГГГГ).
12	Дата и час на изпълнението	Формат на датата съгласно ISO 8601. Формат на часа съгласно координираното универсално време (UTC) — ГГГГ-ММ-ДДТчч:мм:ссZ
13	Вальор (начална дата)	Формат на датата по ISO 8601 (ГГГГ-ММ-ДД)

№	Поле	Формат
14	Падеж (крайна дата)	Формат на датата по ISO 8601 (ГГГГ-ММ-ДД)
15	Дата на прекратяване	Формат на датата по ISO 8601 (ГГГГ-ММ-ДД)
16	Минимален срок за предизвестие	Поле за цяло число, до 3 цифри.
17	Най-ранна дата за обратно изискване или прекратяване	Формат на датата по ISO 8601 (ГГГГ-ММ-ДД)
18	Индикатор за общо обезпечение	„SPEC“ — конкретно обезпечение „GENE“ — общо обезпечение
19	Индикатор за доставка по стойност (Delivery By Value - DBV)	„true“ „false“
20	Използван метод за предоставяне на обезпечението	„TTCA“— договор за финансово обезпечение с прехвърляне на правата „SICA“ — договор за финансово обезпечение с предоставяне на ценни книжа като залог „SIUR“ — договор за финансово обезпечение с предоставяне на ценни книжа като залог с право на ползване
21	Безсрочна	„true“ „false“
22	Възможности за прекратяване	„EGRN“ — автоматично удължаване „ETSB“ — с възможност за удължаване „NOAP“ — не се прилага
При маржин заемна сделка елементите, изброени в полета 23—34, се повтарят и попълват за всяка валута, използвана при сделката.		
23	Фиксиран лихвен процент	До 11 цифрови знака, в т.ч. до 10 цифри след десетичния знак, представено в процентно изражение, при което 100 % се изразява като „100“. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка.
24	Конвенция за отчитане на дните	Код на конвенцията за отчитане на дните: „A001“ — IC30360ISDA или 30360AmericanBasicRule „A002“ — IC30365 „A003“ — IC30Actual „A004“ — Actual360 „A005“ — Actual365Fixed „A006“ — ActualActualICMA „A007“ — IC30E360 или EuroBondBasismodel1 „A008“ — ActualActualISDA „A009“ — Actual365L или ActuActubasisRule „A010“ — ActualActualAFB „A011“ — IC30360ICMA или 30360basicrule „A012“ — IC30E2360 или Eurobondbasismodel2 „A013“ — IC30E3360 или Eurobondbasismodel3 „A014“ — Actual365NL Или до 35 буквено-цифрови знака, ако конвенцията за отчитане на дните не фигурира в списъка по-горе

№	Поле	Формат
25	Плаващ лихвен процент	Код на плаващия лихвен процент „EONA“ — EONIA „EONS“ — EONIA SWAP „EURI“ — EURIBOR „EUUS“ — EURODOLLAR „EUCH“ — EuroSwiss „GCFR“ — GCF REPO „ISDA“ — ISDAFIX „LIBI“ — LIBID „LIBO“ — LIBOR „MAAA“ — Muni AAA „PFAN“ — Pfandbriefe „TIBO“ — TIBOR „STBO“ — STIBOR „BBSW“ — BBSW „JIBA“ — JIBAR „BUBO“ — BUBOR „CDOR“ — CDOR „CIBO“ — CIBOR „MOSP“ — MOSPRIM „NIBO“ — NIBOR „PRBO“ — PRIBOR „TLBO“ — TELBOR „WIBO“ — WIBOR „TREA“ — Treasury „SWAP“ — SWAP „FUSW“ — Future SWAP Или до 25 буквено-цифрови знака, ако референтният лихвен процент не фигурира в списъка по-горе
26	Референтен период на плаващия лихвен процент — период	Времеви период, използван за обозначаване на референтния период, като се прилагат следните съкращения: „YEAR“ — година „MNTH“ — месец „WEEK“ — седмица „DAYS“ — ден
27	Референтен период на плаващия лихвен процент — множител	Множител — цяло число, на времевия период, използван за обозначаване на референтния период на плаващия лихвен процент. До 3 цифрови знака.
28	Периодичност на плащанията с плаващ лихвен процент — период	Времеви период, използван за обозначаване на периодичността на плащанията между контрагентите, като се прилагат следните съкращения: „YEAR“ — година „MNTH“ — месец „WEEK“ — седмица „DAYS“ — ден
29	Периодичност на плащанията с плаващ лихвен процент — множител	Множител — цяло число, на времевия период, използван за обозначаване на периодичността на плащанията между контрагентите. До 3 цифрови знака.

№	Поле	Формат
30	Периодичност на преразглеждането на плаващия лихвен процент — период	Времеви период, използван за обозначаване на периодичността на преразглеждане на плаващия лихвен процент по репо сделката от контрагентите, като се прилагат следните съкращения: „YEAR“ — година „MNTH“ — месец „WEEK“ — седмица „DAYS“ — ден
31	Периодичност на преразглеждането на плаващия лихвен процент — множител	Множител — цяло число, на времевия период, използван за обозначаване на периодичността на преразглеждане на плаващия лихвен процент по репо сделката от контрагентите. До 3 цифрови знака.
32	Спред	До 5 цифрови знака.
33	Парична стойност на маржин заема	До 18 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Обозначава се с точка, ако бъде попълнен.
34	Валута на маржин заема	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака.

Полета 35—36 се повтарят и попълват за всяка корекция на плаващия лихвен процент.

35	Коригиран лихвен процент	До 11 цифрови знака, в т.ч. до 10 цифри след десетичния знак, представено в процентно изражение, при което 100 % се изразява като „100“. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Обозначава се с точка, ако бъде попълнен.
36	Дата на лихвения процент	Формат на датата по ISO 8601 (ГГГГ-ММ-ДД)
37	Размер на главницата на вальора	До 18 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Обозначава се с точка, ако бъде попълнен.
38	Размер на главницата на падежа	До 18 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Обозначава се с точка, ако бъде попълнен.
39	Валута на главницата	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака.
40	Вид на актива	„SECU“ — ценни книжа „COMM“ — стоки
41	Идентификационен код на ценната книга	ISIN код по ISO 6166, 12 буквено-цифрови знака
42	Класификация на ценната книга	CFI код по ISO 10692, 6 буквени знака.

Когато в заем е била предоставена или получена стока, в полета 43, 44 и 45 се посочва класификацията на тази стока.

43	Основен продукт	Допускат се само стойностите от колона „Основен продукт“ на класификационната таблица на стоковите деривати.

№	Поле	Формат
44	Подпродукт	Допускат се само стойностите от колона „Подпродукт“ на класификационната таблица на стоковите деривати.
45	Допълнителен подпродукт	Допускат се само стойностите от колона „Допълнителен подпродукт“ на класификационната таблица на стоковите деривати.
46	Количество или номинална стойност	До 18 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Обозначава се с точка, ако бъде попълнен.
47	Мерна единица	„KILO“ - Kilogram (килограм), „PIEC“ — Piece (брой), „TONS“ — Ton (тон), „METR“ — Metre (метър), „INCH“ — Inch (инч), „YARD“ — Yard (ярд), „GBGA“ — GBGallon (британски галон), „GRAM“ — Gram (грам), „CMET“ — Centimetre (сантиметър), „SMET“ — SquareMetre (квадратен метър), „FOOT“ — Foot (фут), „MILE“ — Mile (миля), „SQIN“ — SquareInch (квадратен инч), „SQFO“ — SquareFoot (квадратен фут), „SQMI“ — SquareMile (квадратна миля), „GBOU“ — GBOunce (британска унция), „USOU“ — USOunce (американска унция), „GBPI“ — GBPint (британски пинт) „USPI“ — USPint (американски пинт), „GBQA“ — GBQuart (британски кварт), „USQA“ — USQuart (американски кварт), „USGA“ — USGallon (американски галон), „MMET“ — Millimetre (милиметър), „KMET“ — Kilometre (километър), „SQYA“ — SquareYard (квадратен ярд), „ACRE“ — Acre (акър), „ARES“ — Are (ар), „SMIL“ — SquareMillimetre (квадратен милиметър), „SCMT“ — SquareCentimetre (квадратен сантиметър), „HECT“ — Hectare (хектар), „SQKI“ — SquareKilometre (квадратен километър), „MILI“ — MilliLitre (милилитър), „CELI“ — Centilitre (сентилитър), „LITR“ — Litre (литър), „PUND“ — Pound (фунт), „ALOW“ — Allowances (квоти), „ACCY“ — AmountOfCurrency (сума на валутата), „BARL“ — Barrels (барела), „BCUF“ — BillionCubicFeet (млрд. кубични фута), „BDFT“ — BoardFeet (дъскови фута), „BUSL“ — Bushels (бушели), „CEER“ — CertifiedEmissionsReduction (сертифицирано намаление на емисиите), „CLRT“ — ClimateReserveTonnes, „CBME“ — CubicMeters (кубични метра), „DAYS“ — Days (дни), „DMET“ — DryMetricTons (сухи метрични тона), „ENVC“ — EnvironmentalCredit (екологичен кредит), „ENVO“ — EnvironmentalOffset (екологично компенсиране), „HUWG“ — Hundredweight (центнер), „KWDC“ — KilowattDayCapacity (капацитет в киловатдни), „KWHO“ — KilowattHours (киловатчаса), „KWHC“ — KilowattHoursCapacity (капацитет в киловатчаса), „KMOC“ — KilowattMinuteCapacity (капацитет в киловатминути), „KWMC“ — KilowattMonthCapacity (капацитет в киловатмесеца), „KWYC“ — KilowattYearCapacity (капацитет в киловатгодини), „MWDC“ — MegawattDayCapacity (капацитет в мегаватдни), „MWHO“ — MegawattHours (мегаватчаса), „MWHC“ — MegawattHoursCapacity (капацитет в мегаватчаса), „MWMC“ — MegawattMinuteCapacity (капацитет в мегаватминути), „MMOC“ — MegawattMonthCapacity (капацитет в мегаватмесеца), „MWYC“ — MegawattYearCapacity (капацитет в мегаватгодини), „TONE“ — MetricTons (метрични тона), „MIBA“ — MillionBarrels (млн. барела), „MBTU“ — OneMillionBTU (млн. BTU), „OZTR“ — TroyOunces (тройунции), „UCWT“ — USHundredweight (американски центнер), „IPNT“ — IndexPoint (пункт на индекса), „PWRD“ — PrincipalWithRelationToDebtInstrument (главница спрямо дългов инструмент), „DGEU“ — DieselGallonEquivalent (еквивалент на галон дизел), „GGEU“ — GasolineGallonEquivalent (еквивалент на галон бензин), „TOCD“ — TonsOfCarbonDioxide (тона въглероден диоксид).
48	Валута на номиналната стойност	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака.
49	Цена на ценната книга или стоката	До 18 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак, ако цената е изразена в единици. До 11 цифрови знака, в т.ч. до 10 цифри след десетичния знак, ако цената е изразена като процент или доходност. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Обозначава се с точка, ако бъде попълнен.
50	Валута на цената	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака.

№	Поле	Формат
51	Качество на ценната книга	„INVG“ — инвестиционен рейтинг „NIVG“ — неинвестиционен рейтинг „NOTR“ — без рейтинг „NOAP“ — не се прилага
52	Падеж на ценната книга	Формат на датата по ISO 8601 (ГГГГ-ММ-ДД)
53	Юрисдикция на емитента	Двубуквен код на държавата (код на държава по ISO 3166-1 alpha-2)
54	ИКПС на емитента	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака.
55	Вид на ценната книга	„GOVS“ — държавни ценни книжа „SUNS“ — ценни книжа на наднационални организации и агенции „FIDE“ — дългови ценни книжа (включително покрити облигации), емитирани от банки и други финансови институции „NFID“ — корпоративни дългови ценни книжа (включително покрити облигации), емитирани от нефинансови институции „SEPR“ — секюритизирани продукти (включително ценни книжа, гарантирани с вземания, ценни книжа, обезпечени с ипотека върху търговски имот, обезпечени с активи търговски ценни книжа) „MEQU“ — капиталови инструменти, включени в основен борсов индекс (включително конвертируеми облигации) „OEQU“ — други капиталови инструменти (включително конвертируеми облигации) „OTHR“ — други активи (включително дялове във взаимни фондове)
56	Стойност на заема	До 18 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Обозначава се с точка, ако бъде попълнен.
57	Пазарна стойност	До 18 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Обозначава се с точка, ако бъде попълнен.
58	Фиксиран процент на възнаграждението (rebate)	До 11 цифрови знака, в т.ч. до 10 цифри след десетичния знак, представено в процентно изражение, при което 100 % се изразява като „100“. Ако бъде попълнен отрицателен знак, той не се брои като цифров знак.
59	Плаващ процент на възнаграждението	Код на плаващия лихвен процент „EONA“ — EONIA „EONS“ — EONIA SWAP „EURI“ — EURIBOR „EUUS“ — EURODOLLAR „EUCH“ — EuroSwiss „GCFR“ — GCF REPO „ISDA“ — ISDAFIX „LIBI“ — LIBID „LIBO“ — LIBOR „MAAA“ — Muni AAA „PFAN“ — Pfandbriefe „TIBO“ — TIBOR „STBO“ — STIBOR „BBSW“ — BBSW

№	Поле	Формат
		„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 Или до 25 буквено-цифрови знака, ако референтният лихвен процент не фигурира в списъка по-горе
60	Референтен период на плаващия процент на възнаграждението — период	Времеви период, използван за обозначаване на референтния период, като се прилагат следните съкращения: „YEAR“ — година „MNTH“ — месец „WEEK“ — седмица „DAYS“ — ден
61	Референтен период на плаващия процент на възнаграждението — множител	Множител — цяло число, на времевия период, използван за обозначаване на референтния период на плаващия процент на възнаграждението. До 3 цифрови знака.
62	Периодичност на плащанията с плаващ процент на възнаграждението — период	Времеви период, използван за обозначаване на периодичността на плащанията между контрагентите, като се прилагат следните съкращения: „YEAR“ — година „MNTH“ — месец „WEEK“ — седмица „DAYS“ — ден
63	Периодичност на плащанията с плаващ процент на възнаграждението — множител	Множител — цяло число, на времевия период, използван за обозначаване на периодичността на плащанията между контрагентите. До 3 цифрови знака.
64	Периодичност на преразглеждането на плаващия процент на възнаграждението — период	Времеви период, използван за обозначаване на периодичността на преразглеждането на плаващия процент на възнаграждението от контрагентите, като се прилагат следните съкращения: „YEAR“ — година „MNTH“ — месец „WEEK“ — седмица „DAYS“ — ден
65	Периодичност на преразглеждането на плаващия процент на възнаграждението — множител	Множител — цяло число, на времевия период, използван за обозначаване на периодичността на преразглеждане на плаващия процент на възнаграждението от контрагентите. До 3 цифрови знака.
66	Спред на процента на възнаграждението	До 5 цифрови знака.
67	Такса за заемането	До 11 цифрови знака, в т.ч. до 10 цифри след десетичния знак, представено в процентно изражение, при което 100 % се изразява като „100“.

№	Поле	Формат
68	Договорености за изключителни права за достъп до заемните средства	„true“ „false“
69	Непогасен маржин заем	До 18 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Обозначава се с точка, ако бъде попълнен.
70	Основна валута на непогасения маржин заем	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака.
71	Пазарна стойност на късата позиция	До 18 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Обозначава се с точка, ако бъде попълнен.
Данни за обезпечението		
72	Знак за необезпечена сделка по предоставяне в заем на ценни книжа (SL)	„true“ „false“
73	Обезпечаване на нетна експозиция	„true“ „false“
74	Вальор на обезпечението	Формат на датата по ISO 8601 (ГГГГ-ММ-ДД)
Когато се използва обезпечение, полета 75—94 се повтарят и попълват за всеки компонент на обезпечението, когато е приложимо.		
75	Вид на компонента на обезпечението	„SECU“ — ценни книжа „COMM“ — стоки (само за репо сделки, предоставяне и получаване в заем на ценни книжа и стоки и сделки за покупка с условие за последваща продажба) „CASH“ — парични средства
Когато като обезпечение са използвани парични средства, това се посочва в полета 76 и 77.		
76	Стойност на паричното обезпечение	До 18 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Обозначава се с точка, ако бъде попълнен.
77	Валута на паричното обезпечение	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака.
78	Идентификация на ценната книга, използвана като обезпечение	ISIN код по ISO 6166, 12 буквено-цифрови знака
79	Класификация на ценната книга, използвана като обезпечение	CFI код по ISO 10692, 6 буквени знака.

№	Поле	Формат
Когато като обезпечение е използвана стока, в полета 80, 81 и 82 се посочва класификацията на тази стока.		
80	Основен продукт	Допускат се само стойностите от колона „Основен продукт“ на класификационната таблица на стоковите деривати.
81	Подпродукт	Допускат се само стойностите от колона „Подпродукт“ на класификационната таблица на стоковите деривати.
82	Допълнителен подпродукт	Допускат се само стойностите от колона „Допълнителен подпродукт“ на класификационната таблица на стоковите деривати.
83	Количество или номинална стойност на обезпечението	До 18 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Обозначава се с точка, ако бъде попълнен.
84	Мерни единици на обезпечението	„KILO“ - Kilogram (килограм), „PIEC“ — Piece (брой), „TONS“ — Ton (тон), „METR“ — Metre (метър), „INCH“ — Inch (инч), „YARD“ — Yard (ярд), „GBGA“ — GBGallon (британски галон), „GRAM“ — Gram (грам), „CMET“ — Centimetre (сантиметър), „SMET“ — SquareMetre (квадратен метър), „FOOT“ — Foot (фут), „MILE“ — Mile (миля), „SQIN“ — SquareInch (квадратен инч), „SQFO“ — SquareFoot (квадратен фут), „SQMI“ — SquareMile (квадратна миля), „GBOU“ — GBOunce (британска унция), „USOU“ — USOunce (американска унция), „GBPI“ — GBPint (британски пинт) „USPI“ — USPint (американски пинт), „GBQA“ — GBQuart (британски кварт), „USQA“ — USQuart (американски кварт), „USGA“ — USGallon (американски галон), „MMET“ — Millimetre (милиметър), „KMET“ — Kilometre (километър), „SQYA“ — SquareYard (квадратен ярд), „ACRE“ — Acre (акър), „ARES“ — Are (ар), „SMIL“ — SquareMillimetre (квадратен милиметър), „SCMT“ — SquareCentimetre (квадратен сантиметър), „HECT“ — Hectare (хектар), „SQKI“ — SquareKilometre (квадратен километър), „MILI“ — MilliLitre (милилитър), „CELI“ — Centilitre (сентилитър), „LITR“ — Litre (литър), „PUND“ — Pound (фунт), „ALOW“ — Allowances (квоти), „ACCY“ — AmountOfCurrency (сума на валутата), „BARL“ — Barrels (барела), „BCUF“ — BillionCubicFeet (млрд. кубични фута), „BDFT“ — BoardFeet (дъскови фута), „BUSL“ — Bushels (бушели), „CEER“ — CertifiedEmissionsReduction (сертифицирано намаление на емисиите), „CLRT“ — ClimateReserveTonnes, „CBME“ — CubicMeters (кубични метра), „DAYS“ — Days (дни), „DMET“ — DryMetricTons (сухи метрични тона), „ENVC“ — EnvironmentalCredit (екологичен кредит), „ENVO“ — EnvironmentalOffset (екологично компенсиране), „HUWG“ — Hundredweight (центнер), „KWDC“ — KilowattDayCapacity (капацитет в киловатдни), „KWHO“ — KilowattHours (киловатчаса), „KWHC“ — KilowattHoursCapacity (капацитет в киловатчаса), „KMOC“ — KilowattMinuteCapacity (капацитет в киловатминути), „KWMC“ — KilowattMonthCapacity (капацитет в киловатмесеца), „KWYC“ — KilowattYearCapacity (капацитет в киловатгодини), „MWDC“ — MegawattDayCapacity (капацитет в мегаватдни), „MWHO“ — MegawattHours (мегаватчаса), „MWHC“ — MegawattHoursCapacity (капацитет в мегаватчаса), „MWMC“ — MegawattMinuteCapacity (капацитет в мегаватминути), „MMOC“ — MegawattMonthCapacity (капацитет в мегаватмесеца), „MWYC“ — MegawattYearCapacity (капацитет в мегаватгодини), „TONE“ — MetricTons (метрични тона), „MIBA“ — MillionBarrels (млн. барела), „MBTU“ — OneMillionBTU (млн. BTU), „OZTR“ — TroyOunces (тройунции), „UCWT“ — USHundredweight (американски центнер), „IPNT“ — IndexPoint (пункт на индекса), „PWRD“ — PrincipalWithRelationToDebtInstrument (главница спрямо дългов инструмент), „DGEU“ — DieselGallonEquivalent (еквивалент на галон дизел), „GGEU“ — GasolineGallonEquivalent (еквивалент на галон бензин), „TOCD“ — TonsOfCarbonDioxide (тона въглероден диоксид).
85	Валута на номиналната стойност на обезпечението	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака.
86	Валута на цената	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака.
87	Единична цена	До 18 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак, ако цената е изразена в единици. До 11 цифрови знака, в т.ч. до 10 цифри след десетичния знак, ако цената е изразена като процент или доходност. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Обозначава се с точка, ако бъде попълнен.

№	Поле	Формат
88	Пазарна стойност на обезпечението	До 18 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Обозначава се с точка, ако бъде попълнен.
89	Процентно намаление или допълнително обезпечение	До 11 цифрови знака, в т.ч. до 10 цифри след десетичния знак, представено в процентно изражение, при което 100 % се изразява като „100“. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Обозначава се с точка, ако бъде попълнен.
90	Качество на обезпечението	„INVG“ — инвестиционен рейтинг „INVG“ — неинвестиционен рейтинг „NOTR“ — без рейтинг „NOAP“ — не се прилага
91	Падеж на ценната книга	Формат на датата по ISO 8601 (ГГГГ-ММ-ДД)
92	Юрисдикция на емитента	Двубуквен код на държавата (код на държава по ISO 3166-1 alpha-2)
93	ИКПС на емитента	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака.
94	Вид обезпечение	„GOVS“ — държавни ценни книжа „SUNS“ — ценни книжа на наднационални организации и агенции „FIDE“ — дългови ценни книжа (включително покрити облигации), емитирани от банки и други финансови институции „NFID“ — корпоративни дългови ценни книжа (включително покрити облигации), емитирани от нефинансови институции „SEPR“ — секюритизирани продукти (включително ценни книжа, гарантирани с вземания, ценни книжа, обезпечени с ипотека върху търговски имот, обезпечени с активи търговски ценни книжа) „MEQU“ — капиталови инструменти, включени в основен борсов индекс (включително конвертируеми облигации) „OEQU“ — други капиталови инструменти (включително конвертируеми облигации) „OTHR“ — други активи (включително дялове във взаимни фондове)
95	Възможност за повторно използване на обезпечението	„true“ „false“
Поле 96 се попълва, когато е използвана кошница от обезпечения. Когато е налично, подробното разпределение на обезпеченията по СФЦК, сключени срещу пул от обезпечения, се посочва в полета 75—94.		
96	Идентификационен код на кошницата от обезпечения	ISIN код по ISO 6166, 12 буквено-цифрови знака „NTAV“
97	Код на портфейла	52 буквено-цифрови знака, включително четири специални знака: -‘ _. В началото и в края на кода не могат да се използват специални знаци. Не може да се оставя разстояние.
98	Вид действие	„NEWT“ — ново „MODI“ — изменение „VALU“ — оценка „COLU“ — актуализиране на обезпечението „EROR“ — грешка „CORR“ — корекция

№	Поле	Формат
		„ETRM“ — прекратяване/предсрочно прекратяване „POSC“ — компонент на позицията
99	Равнище	„TCTN“ — сделка/трансакции „PSTN“ — позиция

Таблица 3

Данни за маржина

№	Поле	Формат
1	Дата и час на доклада	Формат на датата съгласно ISO 8601. Формат на часа съгласно координираното универсално време (UTC) — ГГГГ-ММ-ДДТчч:мм:ссZ
2	Дата на събитието	Формат на датата по ISO 8601 (ГГГГ-ММ-ДД)
3	Субект, който подава доклада	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака.
4	Докладващ контрагент	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака.
5	Субект, отговарящ за доклада	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака.
6	Друг контрагент	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака.
7	Код на портфейла	52 буквено-цифрови знака, включително четири специални знака: -_. В началото и в края на кода не могат да се използват специални знаци. Не може да се оставя разстояние.
8	Предоставен първоначален маржин	До 18 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Обозначава се с точка, ако бъде попълнен.
9	Валута на предоставения първоначален маржин	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака.
10	Предоставен вариационен маржин	До 18 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Обозначава се с точка, ако бъде попълнен.
11	Валута на предоставения вариационен маржин	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака.
12	Получен първоначален маржин	До 18 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Обозначава се с точка, ако бъде попълнен.
13	Валута на получения първоначален маржин	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака.
14	Получен вариационен маржин	До 18 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Обозначава се с точка, ако бъде попълнен.

№	Поле	Формат
15	Валута на получения вариационен маржин	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака.
16	Излишък по предоставеното обезпечение	До 18 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Обозначава се с точка, ако бъде попълнен.
17	Валута на излишъка по предоставеното обезпечение	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака.
18	Излишък по полученото обезпечение	До 18 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Обозначава се с точка, ако бъде попълнен.
19	Валута на излишъка по полученото обезпечение	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака.
20	Вид действие	„NEWT“ — ново „MARU“ — актуализиране на маржина „EROR“ — грешка „CORR“ — корекция

Таблица 4

Данни за повторно използваните обезпечения, реинвестираните парични средства и източниците на финансиране

№	Поле	Формат
1	Дата и час на доклада	Формат на датата съгласно ISO 8601. Формат на часа съгласно координираното универсално време (UTC) — ГГГГ-ММ-ДДТчч:мм:ссZ
2	Дата на събитието	Формат на датата по ISO 8601 (ГГГГ-ММ-ДД)
3	Субект, който подава доклада	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака.
4	Докладващ контрагент	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака.
5	Субект, отговарящ за доклада	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака.
Поле 6 се повтаря и попълва за всеки компонент на обезпечението.		
6	Вид на компонента на обезпечението	„SECU“ — ценни книжа „CASH“ — парични средства
Полета 7, 8, 9 и 10 се повтарят и попълват за всяка ценна книга.		
7	Компонент на обезпечението	ISIN код по ISO 6166, 12 буквено-цифрови знака
8	Стойност на повторно използваното обезпечение	До 18 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Обозначава се с точка, ако бъде попълнен.
9	Очаквана стойност на повторно използваното обезпечение	До 18 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Обозначава се с точка, ако бъде попълнен.

№	Поле	Формат
10	Валута на повторно използваното обезпечение	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака.
11	Процент по реинвестицията	До 11 цифрови знака, в т.ч. до 10 цифри след десетичния знак, представено в процентно изражение, при което 100 % се изразява като „100“.
Полета 12, 13 и 14 се повтарят и попълват за всяка инвестиция, при която паричното обезпечение е реинвестирано, и във всяка валута.		
12	Вид на реинвестираните парични средства	„MMFT“ — регистриран фонд на паричния пазар „OCMP“ — друг пул от обединени активи „REPM“ — пазара на репо сделки „SDPU“ — пряка покупка на ценни книжа „OTHR“ — друго
13	Стойност на реинвестираните парични средства	До 18 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Обозначава се с точка, ако бъде попълнен.
14	Валута на реинвестираните парични средства	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака.
При маржин заемни сделки контрагентът повтаря и попълва полета 15, 16 и 17 за всеки източник на финансиране, като предоставената в тези полета информация е на равнище дружество.		
15	Източници на финансиране	„REPO“ — репо сделки или сделки за покупка с условие за последваща продажба „SECL“ — парично обезпечение от предоставяне в заем на ценни книжа „FREE“ — свободни кредити „CSHS“ — постъпления от къси продажби на клиенти „BSHS“ — постъпления от къси продажби на брокери „UBOR“ — необезпечени заеми „OTHR“ — други
16	Пазарна стойност на източниците на финансиране	До 18 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако не може да се посочи, пропорционален размер.
17	Валута на източниците на финансиране	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака.
18	Вид действие	„NEWT“ — ново „REUU“ — актуализиране на повторното използване „EROR“ — грешка „CORR“ — корекция

Таблица 5

Класификация на стоките

Основен продукт	Подпродукт	Допълнителен подпродукт
„AGRI“ — селско стопанство	„GROS“ — зърнени и маслодайни култури	„FWHT“ — фуражна пшеница „SOYB“ — соя „CORN“ — царевица „RPSD“ — рапица „RICE“ — ориз „OTHR“ — други

Основен продукт	Подпродукт	Допълнителен подпродукт
	„SOFT“ — нетрайни продукти	„CCOA“ — какао „ROBU“ — кафе „Робуста“ „WHSG“ — бяла захар „BRWN“ — нерафинирана захар „OTHR“ — други
	„POTA“ — картофи	
	„OOLI“ — маслиново масло	„LAMP“ — маслиново масло за осветление „OTHR“ — други
	„DIRY“ — млечни продукти	
	„FRST“ — горскостопански продукти	
	„SEAF“ — морски дарове	
	„LSTK“ — добитък	
	„GRIN“ — зърнено-житни продукти	„MWHT“ — мелничарско брашно „OTHR“ — други
	„OTHR“ — други	
„NRGY“ — енергия	„ELEC“ — електроенергия	„BSLD“ — базов (дневен) товар „FITR“ — финансови права за пренос „PKLD“ — върхово натоварване „OFFP“ — извънвърхово „OTHR“ — други
	„NGAS“ — природен газ	„GASP“ — GASPOOL „LNGG“ — втечнен природен газ „*NBP*G“ — National Balancing Point (*NBP*) „NCGG“ — NetConnect Germany (NCG) „TTFG“ — TTF „OTHR“ — други
	„OILP“ — нефт	„BAKK“ — Bakken „BDSL“ — биодизел „BRNT“ — „Брент“ „BRNX“ — „Брент NX“ „CNDA“ — канадски „COND“ — кондензат „DSEL“ — дизел „DUBA“ — Дубай „ESPO“ — ESPO „ETHA“ — етанол „FUEL“ — гориво „FOIL“ — мазут „GOIL“ — газьол

Основен продукт	Подпродукт	Допълнителен подпродукт
		„GSLN“ — бензин „HEAT“ — мазут за отопление „JTFL“ — гориво за реактивни двигатели „KERO“ — керосин „LLSO“ — Light Louisiana Sweet (LLS) „MARS“ — Mars „NAPH“ – нафта „NGLO“ — течни въглеводороди от природен газ „TAPI“ — Tapis „URAL“ — Урал „WTIO“ — WTI „OTHR“ — други
	„COAL“ — въглища „INRG“ — Inter Energy „RNNG“ — възобновяема енергия „LGHT“ — леки дестилати „DIST“ — дестилати „OTHR“ — други	
„ENVR“ — околна среда	„EMIS“ — емисии	„CERE“ — CER „ERUE“ — ERU „EUAE“ — EUA „EUAA“ — EUAA „OTHR“ — други
	„WTHR“ — време „CRBR“ — свързани с въглерода „OTHR“ — други	
„FRGT“ — товарен превоз	„WETF“ — продукти в наливно състояние	„TNKR“ — танкери „OTHR“ — други
	„DRYF“ — в насипно състояние	„DBCR“ — транспортни средства за превоз на насипни товари „OTHR“ — други
	„CSHP“ — кораби-контейнери	
	„OTHR“ — други	
„FRTL“ — торове	„AMMO“ — амоняк „DAPH“ — DAP (диамониев фосфат) „PTSH“ — поташ „SLPH“ — сяра „UREA“ — карбамид „UAAN“ — UAN (карбамид и амониев нитрат) „OTHR“ — други	

Основен продукт	Подпродукт	Допълнителен подпродукт
„INDP“ — промишлени продукти	„CSTR“ — строителство	
	„MFTG“ — преработвателна промишленост	
„METL“ — метали	„NPRM“ — нескъпоценни метали	„ALUM“ — алуминий
		„ALUA“ — алуминиеви сплави
		„CBLT“ — кобалт
		„COPR“ — мед
		„IRON“ — желязна руда
		„LEAD“ — олово
		„MOLY“ — молибден
		„NASC“ — North American Special Aluminium Alloy Contract (NASAAC)
		„NICK“ — никел
		„STEL“ — стомана
		„TINN“ — калай
		„ZINC“ — цинк
		„OTHR“ — други
	„PRME“ — скъпоценни метали	„GOLD“ — злато
		„SLVR“ — сребро
		„PTNM“ — платина
		„PLDM“ — паладий
		„OTHR“ — други
„MCEX“ — различни екзотични стоки		
„PAPR“ — хартия	„CBRD“ — велпапе	
	„NSPT“ — вестникарска хартия	
	„PULP“ — хартиена маса	
	„RCVP“ — рециклирана хартия	
	„OTHR“ — други	
„POLY“ — полипропилен	„PLST“ — пластмаса	
	„OTHR“ — други	
„INFL“ — инфлация		
„OEST“ — официална икономическа статистика		
„OTHC“ — Друго C10, както е определено в таблица 10.1, раздел 10 от приложение III към Делегиран регламент (ЕС) 2017/583 на Комисията ([1]).		
„OTHR“ — други		

([1]) Делегиран регламент (ЕС) 2017/583 на Комисията от 14 юли 2016 г. за допълване на Регламент (ЕС) № 600/2014 на Европейския парламент и на Съвета относно пазарите на финансови инструменти по отношение на регулаторните технически стандарти за изискванията за прозрачност, засягащи местата на търговия и инвестиционните посредници, във връзка с облигациите, структурираните финансови продукти, квотите за емисии и дериватите (ОВ L 87, 31.3.2017 г., стр. 229).

ПРИЛОЖЕНИЕ II

Приложението към Регламент за изпълнение (ЕС) № 1247/2012 се заменя със следното:

„*ПРИЛОЖЕНИЕ*

Таблица 1

Данни за контрагентите

	Поле	Формат
	Страни по договора	
1	Дата и час на отчета	Формат на датата съгласно ISO 8601. Формат на часа съгласно координираното универсално време (UTC) — ГГГГ-ММ-ДДТчч:мм:ссZ
2	Идентификационен код на отчитащия се контрагент	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака
3	Вид на идентификационния код на другия контрагент	„ИКПС“ за идентификационния код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442 „КК“ за клиентски код
4	Идентификационен код на другия контрагент	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака. Клиентски код (до 50 буквено-цифрови знака)
5	Държава на другия контрагент	Двубуквен код на държавата по ISO 3166
6	Корпоративен сектор на отчитащия се контрагент	Таксономия на финансовите контрагенти: A = застрахователно предприятие, лицензирано в съответствие с Директива 2009/138/ЕО на Европейския парламент и на Съвета ([1]); C = кредитна институция, лицензирана в съответствие с Директива 2013/36/ЕС на Европейския парламент и на Съвета ([2]) F = инвестиционен посредник, получил разрешително в съответствие с Директива 2004/39/ЕО на Европейския парламент и на Съвета ([3]) I = застрахователно предприятие, лицензирано в съответствие с Директива 2009/138/ЕО L = алтернативен инвестиционен фонд, управляван от лица, управляващи алтернативни инвестиционни фондове (ЛУАИФ), получили разрешение или регистрирани в съответствие с Директива 2011/61/ЕС на Европейския парламент и на Съвета ([4]) O = институция за професионално пенсионно осигуряване по смисъла на член 6, буква а) от Директива 2003/41/ЕО на Европейския парламент и на Съвета ([5]) R = презастрахователно предприятие, лицензирано в съответствие с Директива 2009/138/ЕО U = предприятие за колективно инвестиране в прехвърлими ценни книжа (ПКИПЦК) и неговото управляващо дружество, лицензирано в съответствие с Директива 2009/65/ЕО на Европейския парламент и на Съвета ([6]) Таксономия за нефинансови контрагенти. Следните категории отговарят на основните раздели на статистическата класификация на икономическите дейности в Европейската общност (NACE), както е посочено в Регламент (ЕО) № 1893/2006 на Европейския парламент и на Съвета ([7]) 1 = Селско, горско и рибно стопанство 2 = Добивна промишленост 3 = Преработваща промишленост 4 = Производство и разпределение на електрическа и топлинна енергия и на газообразни горива

	Поле	Формат
		5 = Доставяне на води, канализационни услуги, управление на отпадъци и възстановяване 6 = Строителство 7 = Търговия; ремонт на автомобили и мотоциклети 8 = Транспорт, складиране и пощи 9 = Хотелиерство и ресторантьорство 10 = Създаване и разпространение на информация и творчески продукти; далекосъобщения 11 = Финансови и застрахователни дейности 12 = Операции с недвижими имоти 13 = Професионални дейности и научни изследвания 14 = Административни и спомагателни дейности 15 = Държавна администрация и отбрана; задължително социално осигуряване 16 = Образование 17 = Хуманно здравеопазване и социална работа 18 = Култура, спорт и развлечения 19 = Други дейности 20 = Дейности на домакинствата като работодатели; недиференцирани дейности на домакинства по производство на стоки и услуги за собствено потребление 21 = Дейности на екстериториални организации и служби Когато се отчита повече от една дейност, кодовете следва да се изброят съобразно поредност, съответстваща на относителното значение на съответните дейности, като се разделят със знак „-“. За ЦК и други видове контрагенти в съответствие с член 1, параграф 5 от Регламент (ЕС) № 648/2012 полето следва да се остави празно
7	Естество на отчитащия се контрагент	F = финансов контрагент N = нефинансов контрагент C = централен контрагент O = Друг
8	Идентификационен код на брокера	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака
9	Идентификационен код на отчитащия се субект	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака
10	Идентификационен код на клиринговия член	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака
11	Вид на идентификационния код на ползващото се лице	„ИКПС“ за идентификационния код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442 „КК“ за клиентски код
12	Идентификационен код на ползващото се лице	Идентификационен код на правния субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака или клиентски код с до 50 буквено-цифрови знака в случаите, в които клиентът не отговаря на изискванията за получаване на идентификационен код на правния субект
13	Качество, в което лицето търгува	P = за собствена сметка A = посредник
14	Роля на контрагента	B = купувач S = продавач Попълва се в съответствие с член 3а

	Поле	Формат
15	Пряка връзка с търговската дейност или с финансовото управление	Y = да N = не
16	Клирингов праг	Y = над прага N = под прага
17	Стойност на договора	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка. Ако бъде попълнен отрицателен знак, той не се брои като цифров знак
18	Валута на стойността	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
19	Дата и час на оценката	Формат на датата съгласно ISO 8601. Формат на часа съгласно координираното универсално време (UTC) — ГГГГ-ММ-ДДТчч:мм:ссZ
20	Вид на оценката	M = пазарна оценка O = оценка по модел C = оценка на ЦК
21	Обезпеченост	U = необезпечен PC = частично обезпечен OC = едностранно обезпечен FC = напълно обезпечен Попълва се в съответствие с член 3б
22	Портфейл от обезпечения	Y = да N = не
23	Код на портфейла от обезпечения	До 52 буквено-цифрови знака, включително четири специални знака:„. - _“ В началото и в края на кода не могат да се използват специални знаци. Не може да се оставя разстояние
24	Предоставен първоначален маржин	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка
25	Валута на предоставения първоначален маржин	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
26	Предоставен вариационен маржин	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка
27	Валута на предоставените вариационни маржини	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
28	Получен първоначален маржин	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка
29	Валута на получения първоначален маржин	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака

	Поле	Формат
30	Получен вариационен маржин	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка
31	Валута на получените вариационни маржини	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
32	Излишък по предоставеното обезпечение	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка
33	Валута на излишъка по предоставеното обезпечение	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
34	Излишък по полученото обезпечение	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка
35	Валута на излишъка по полученото обезпечение	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака

(1) Директива 2009/138/ЕО на Европейския парламент и на Съвета от 25 ноември 2009 г. относно започването и упражняването на застрахователна и презастрахователна дейност (Платежоспособност II) (ОВ L 335, 17.12.2009 г., стр. 1).

(2) Директива 2013/36/ЕС на Европейския парламент и на Съвета от 26 юни 2013 г. относно достъпа до осъществяването на дейност от кредитните институции и относно пруденциалния надзор върху кредитните институции и инвестиционните посредници, за изменение на Директива 2002/87/ЕО и за отмяна на директиви 2006/48/ЕО и 2006/49/ЕО (ОВ L 176, 27.6.2013 г., стр. 338).

(3) Директива 2004/39/ЕО на Европейския парламент и на Съвета от 21 април 2004 г. относно пазарите на финансови инструменти, за изменение на Директиви 85/611/ЕИО и 93/6/ЕИО на Съвета и Директива 2000/12/ЕО на Европейския парламент и на Съвета и за отмяна на Директива 93/22/ЕИО на Съвета (ОВ L 145, 30.4.2004 г., стр. 1).

(4) Директива 2011/61/ЕС на Европейския парламент и на Съвета от 8 юни 2011 г. относно лицата, управляващи алтернативни инвестиционни фондове, и за изменение на директиви 2003/41/ЕО и 2009/65/ЕО и на регламенти (ЕО) № 1060/2009 и (ЕС) № 1095/2010 (ОВ L 174, 1.7.2011 г., стр. 1).

(5) Директива 2003/41/ЕО на Европейския парламент и на Съвета от 3 юни 2003 г. относно дейностите и надзора на институциите за професионално пенсионно осигуряване (ОВ L 235, 23.9.2003 г., стр. 10).

(6) Директива 2009/65/ЕО на Европейския парламент и на Съвета от 13 юли 2009 г. относно координирането на законовите, подзаконовите и административните разпоредби относно предприятията за колективно инвестиране в прехвърлими ценни книжа (ПКИПЦК) (ОВ L 302, 17.11.2009 г., стр. 32).

(7) Регламент (ЕО) № 1893/2006 на Европейския парламент и на Съвета от 20 декември 2006 г. за установяване на статистическа класификация на икономическите дейности NACE Rev. 2 и за изменение на Регламент (ЕИО) № 3037/90 на Съвета, както и на някои ЕО Регламенти относно специфичните статистически области (ОВ L 393, 30.12.2006 г., стр. 1).

Таблица 2

Общи данни

	Поле	Формат	Приложими видове договори за деривати
	Раздел 2а — Вид на договора		Всички договори
1	Вид договор	CD = финансови договори за разлики FR = форуърдни лихвени споразумения FU = фючърс FW = форуърд OP = опция SB = финансово залагане въз основа на спред SW = суап ST = суапция OT = друг	

	Поле	Формат	Приложими видове договори за деривати
2	Клас на активите	CO = стоки и квоти за емисии CR = кредит CU = валута EQ = капиталов инструмент IR = лихвен процент	
	Раздел 2б — Информация за договора		Всички договори
3	Вид класификация на продукта	C = CFI код	
4	Класификация на продукта	CFI код по ISO 10692, 6 буквени знака	
5	Вид идентификация на продукта	Да се посочи съответната идентификация: I = ISIN код A = AII код	
6	Идентификационни данни на продукта	За идентификационен код на продукта тип I: ISIN код по ISO 6166, 12 буквено-цифрови знака За идентификационен код на продукта тип A: пълния AII код	
7	Вид идентификация на базовия актив	I = ISIN код A = AII код B = кошница X = индекс	
8	Идентификация на базовия актив	За идентификация на базовия актив от вида I: ISIN код по ISO 6166, 12 буквено-цифрови знака За идентификационен код на базовия актив тип A: пълния AII код За идентификационен код на базовия актив тип B: идентификационни кодове на всички отделни компоненти чрез ISIN по ISO 6166 или чрез пълния AII код. Идентификационните кодове на отделните компоненти трябва да бъдат разделени с тире „-“. За идентификация на базовия актив от вида X: ISIN код по ISO 6166, ако има такъв, в противен случай — пълно наименование на индекса, определено от лицето, предоставящо индекса	
9	Условна валута 1	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака	
10	Условна валута 2	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака	
11	Валута на доставката	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака	
	Раздел 2в — Подробни данни за трансакцията		Всички договори
12	Идентификационен код на трансакцията	До 52 буквено-цифрови знака, включително четири специални знака:„. - _.“ В началото и в края на кода не могат да се използват специални знаци. Не може да се оставя разстояние	

	Поле	Формат	Приложими видове договори за деривати
13	Номер за проследяване на отчета	Поле с максимум 52 буквено-цифрови знака	
14	Идентификационен код на компонент при комплексна търговия	Поле с максимум 35 буквено-цифрови знака	
15	Място на изпълнение	Идентификационен код на пазара (MIC) по ISO 10383 с 4 буквено-цифрови знака в съответствие с член 4, буква б)	
16	Компресиране	Y = договорът е резултат от компресиране N = договорът не е резултат от компресиране	
17	Цена/процент	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка. Ако бъде попълнен отрицателен знак, той не се брои като цифров знак. Когато цената на упражняване се отчита като процентна стойност, тя се следва да се представи в процентно изражение, при което 100 % се изразява като „100“	
18	Изражение на цената	U = единици P = процент Y = доходност	
19	Валута на цената	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака	
20	Условна стойност	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка. Ако бъде попълнен отрицателен знак, той не се брои като цифров знак	
21	Множител на цената	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка	
22	Количество	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка	
23	Предварително плащане	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Когато плащането е извършено, а не получено, следва да се използва отрицателен знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка. Ако бъде попълнен отрицателен знак, той не се брои като цифров знак	

	Поле	Формат	Приложими видове договори за деривати
24	Вид на доставката	C = парично плащане P = физическа доставка O = по избор на контрагента или когато се определя от трета страна	
25	Дата и час на изпълнението	Формат на датата съгласно ISO 8601. Формат на часа съгласно координираното универсално време (UTC) — ГГГГ-ММ-ДДТчч:мм:ссZ	
26	Дата на влизане в сила	Формат на датата по ISO 8601 (ГГГГ-ММ-ДД)	
27	Падеж	Формат на датата по ISO 8601 (ГГГГ-ММ-ДД)	
28	Дата на прекратяване	Формат на датата по ISO 8601 (ГГГГ-ММ-ДД)	
29	Дата на сетълмент	Формат на датата по ISO 8601 (ГГГГ-ММ-ДД)	
30	Вид на рамковия договор	Свободен текст от максимум 50 знака, в който се посочва заглавието на използвания рамков договор, ако има такъв	
31	Версия на рамковия договор	Формат на датата по ISO 8601 (ГГГГ).	
	Раздел 2г — Ограничаване/отчитане на риска		Всички договори
32	Дата и час на потвърждението	Формат на датата съгласно ISO 8601. Формат на часа съгласно координираното универсално време (UTC) — ГГГГ-ММ-ДДТчч:мм:ссZ	
33	Вид на потвърждението	Y = потвърдено не по електронен път N = непотвърдено E = потвърдено по електронен път	
	Раздел 2д — Клиринг		Всички договори
34	Задължение за клиринг	Y = да N = не	
35	Извършен клиринг	Y = да N = не	
36	Дата и час на клиринга	Формат на датата съгласно ISO 8601. Формат на часа съгласно координираното универсално време (UTC) — ГГГГ-ММ-ДДТчч:мм:ссZ	
37	ЦК	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442 Код с 20 буквено-цифрови знака	
38	Вътрешногрупова трансакция	Y = да N = не	
	Раздел 2е — Лихвени проценти		Деривати върху лихвени проценти
39	Фиксиран лихвен процент на компонент 1	До 10 цифрови знака, включително цифрите след десетичния знак, представено в процентно изражение, при което 100 % се изразява като „100“.	

	Поле	Формат	Приложими видове договори за деривати
		Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка. Ако бъде попълнен отрицателен знак, той не се брои като цифров знак	
40	Фиксиран лихвен процент на компонент 2	До 10 цифрови знака, включително цифрите след десетичния знак, представено в процентно изражение, при което 100 % се изразява като „100“. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка. Ако бъде попълнен отрицателен знак, той не се брои като цифров знак	
41	Брой дни с фиксиран лихвен процент за компонент 1	Числител/знаменател, като както числителят, така и знаменателят са съставени от цифрови знаци или буквения израз „действителен брой дни“, например 30/360 или действителен брой дни/365	
42	Брой дни с фиксиран лихвен процент за компонент 2	Числител/знаменател, като както числителят, така и знаменателят са съставени от цифрови знаци или буквения израз „действителен брой дни“, например 30/360 или действителен брой дни/365	
43	Периодичност на плащанията с фиксиран лихвен процент по компонент 1 — период	Времеви период, използван за обозначаване на периодичността на плащанията между контрагентите, като се прилагат следните съкращения: Y = година M = месец W = седмица D = ден	
44	Периодичност на плащанията с фиксиран лихвен процент по компонент 1 — множител	Множител — цяло число, на времевия период, използван за обозначаване на периодичността на плащанията между контрагентите До 3 цифрови знака	
45	Периодичност на плащанията с фиксиран лихвен процент по компонент 2 — период	Времеви период, използван за обозначаване на периодичността на плащанията между контрагентите, като се прилагат следните съкращения: Y = година M = месец W = седмица D = ден	
46	Периодичност на плащанията с фиксиран лихвен процент по компонент 2 — множител	Множител — цяло число, на времевия период, използван за обозначаване на периодичността на плащанията между контрагентите. До 3 цифрови знака	
47	Периодичност на плащанията с плаващ лихвен процент по компонент 1 — период	Времеви период, използван за обозначаване на периодичността на плащанията между контрагентите, като се прилагат следните съкращения: Y = година M = месец W = седмица D = ден	
48	Периодичност на плащанията с плаващ лихвен процент по компонент 1 — множител	Множител — цяло число, на времевия период, използван за обозначаване на периодичността на плащанията между контрагентите. До 3 цифрови знака	

	Поле	Формат	Приложими видове договори за деривати
49	Периодичност на плащанията с плаващ лихвен процент по компонент 2 — период	Времеви период, използван за обозначаване на периодичността на плащанията между контрагентите, като се прилагат следните съкращения: Y = година M = месец W = седмица D = ден	
50	Периодичност на плащанията с плаващ лихвен процент по компонент 2 — множител	Множител — цяло число, на времевия период, използван за обозначаване на периодичността на плащанията между контрагентите. До 3 цифрови знака	
51	Периодичност на преразглеждането на плаващия лихвен процент по компонент 1 — период	Времеви период, използван за обозначаване на периодичността на преразглеждане на плаващия лихвен процент от контрагентите, като се прилагат следните съкращения: Y = година M = месец W = седмица D = ден	
52	Периодичност на преразглеждане на плащанията с плаващ лихвен процент по компонент 1 — множител	Множител — цяло число, на времевия период, използван за обозначаване на периодичността на преразглеждане на плаващия лихвен процент от контрагентите. До 3 цифрови знака	
53	Периодичност на преразглеждането на плаващия лихвен процент по компонент 2 — период	Времеви период, използван за обозначаване на периодичността на преразглеждане на плаващия лихвен процент от контрагентите, като се прилагат следните съкращения: Y = година M = месец W = седмица D = ден	
54	Периодичност на преразглеждане на плащанията с плаващ лихвен процент по компонент 2 — множител	Множител — цяло число, на времевия период, използван за обозначаване на периодичността на преразглеждане на плаващия лихвен процент от контрагентите. До 3 цифрови знака	
55	Плаващ лихвен процент по компонент 1	Название на индекса, от който зависи плаващият лихвен процент „EONA“ — EONIA „EONS“ — EONIA SWAP „EURI“ — EURIBOR „EUUS“ — EURODOLLAR „EUCH“ — EuroSwiss „GCFR“ — GCF REPO „ISDA“ — ISDAFIX „LIBI“ — LIBID „LIBO“ — LIBOR „MAAA“ — Muni AAA „PFAN“ — Pfandbriefe „TIBO“ — TIBOR „STBO“ — STIBOR „BBSW“ — BBSW	

	Поле	Формат	Приложими видове договори за деривати
		„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 Или до 25 буквено-цифрови знака, ако референтният лихвен процент не фигурира в списъка по-горе	
56	Периодичност на референтния период с плаващ лихвен процент по компонент 1 — период	Времеви период, използван за обозначаване на референтния период, като се прилагат следните съкращения: Y = година M = месец W = седмица D = ден	
57	Периодичност на референтния период с плаващ лихвен процент по компонент 1 — множител	Множител — цяло число, на времевия период, използван за обозначаване на референтния период. До 3 цифрови знака	
58	Плаващ лихвен процент по компонент 2	Название на индекса, от който зависи плаващият лихвен процент „EONA“ — EONIA „EONS“ — EONIA SWAP „EURI“ — EURIBOR „EUUS“ — EURODOLLAR „EUCH“ — EuroSwiss „GCFR“ — GCF REPO „ISDA“ — ISDAFIX „LIBI“ — LIBID „LIBO“ — LIBOR „MAAA“ — Muni AAA „PFAN“ — Pfandbriefe „TIBO“ — TIBOR „STBO“ — STIBOR „BBSW“ — BBSW „JIBA“ — JIBAR „BUBO“ — BUBOR „CDOR“ — CDOR „CIBO“ — CIBOR „MOSP“ — MOSPRIM „NIBO“ — NIBOR „PRBO“ — PRIBOR	

	Поле	Формат	Приложими видове договори за деривати
		„TLBO“ — TELBOR „WIBO“ — WIBOR „TREA“ — Treasury „SWAP“ — SWAP „FUSW“ — Future SWAP Или до 25 буквено-цифрови знака, ако референтният лихвен процент не фигурира в списъка по-горе	
59	Периодичност на референтния период с плаващ лихвен процент по компонент 2 — период	Времеви период, използван за обозначаване на референтния период, като се прилагат следните съкращения: Y = година M = месец W = седмица D = ден	
60	Периодичност на референтния период с плаващ лихвен процент по компонент 2 — множител	Множител — цяло число, на времевия период, използван за обозначаване на референтния период. До 3 цифрови знака	
	Раздел 2ж — Чуждестранна валута		Валутни деривати
61	Валута на доставката 2	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака	
62	Валутен курс 1	До 10 цифрови знака, включително цифрите след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка. Ако бъде попълнен отрицателен знак, той не се брои като цифров знак	
63	Форуърден валутен курс	До 10 цифрови знака, включително десетични числа. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка. Ако бъде попълнен отрицателен знак, той не се брои като цифров знак	
64	База на валутния курс	Двата кода на валутите по ISO 4217, разделени с „/“. Първият код на валутата обозначава базовата валута, а вторият код — валутата на котиране	
	Раздел 2з — Стоки и квоти за емисии		Стокови деривати и деривати върху квоти за емисии
	Общи данни		
65	Категория на стоката	AG = селскостопански продукти EN = енергийни продукти	

	Поле	Формат	Приложими видове договори за деривати
		FR = превозвани товари ME = метали IN = индекс EV = продукти, свързани с околната среда EX = екзотични продукти OT = друг	
66	Подробна информация за вида на стоката	*Селскостопански стоки* GO = зърнени и маслодайни култури DA = мляко и млечни продукти LI = селскостопански животни FO = горскостопанска продукция SO = други селскостопански продукти като кафе, какао, захар и т.н. (softs) SF = морски дарове OT = друг *Енергийни продукти* OI = нефт NG = природен газ CO = въглища EL = електроенергия IE = спредове между енергийни продукти (inter-energy) OT = друг *Товари* DR = сухи WT = мокри OT = други *Метали* PR = скъпоценни метали NP = нескъпоценни метали *Околна среда* WE = време EM = емисии OT = други	
	Енергийни продукти		
67	Място или зона на доставката	Код по системата за идентифициране на енергийните продукти (EIC код), 16 буквено-цифрови знака. Повтарящо се поле	
68	Точка на взаимно свързване	Код по системата за идентифициране на енергийните продукти (EIC код), 16 буквено-цифрови знака	
69	Вид на натоварването	BL = базов (дневен) товар PL = върхов товар OP = извънвърхов товар BH = почасови блокове SH = форма GD = газоден OT = други	

	Поле	Формат	Приложими видове договори за деривати
	Полета 70—77 се повтарят.		
70	Интервали на товара	чч:ммZ	
71	Начална дата и час на доставката	Формат на датата съгласно ISO 8601. Формат на часа съгласно координираното универсално време (UTC) — ГГГГ-ММ-ДДТчч:мм:ссZ	
72	Крайна дата и час на доставката	Формат на датата съгласно ISO 8601. Формат на часа съгласно координираното универсално време (UTC) — ГГГГ-ММ-ДДТчч:мм:ссZ	
73	Продължителност	N = минути H = час D = ден W = седмица M = месец T = тримесечие S = сезон Г = година O = друго	
74	Дни от седмицата	WD = работни дни WN = уикенд MO = понеделник TU = вторник WE = сряда TH = четвъртък FR = петък SA = събота SU = неделя Могат да се посочат няколко стойности, разделени с „/“	
75	Капацитет за доставка	До 20 цифрови знака, включително цифрите след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка. Ако бъде попълнен отрицателен знак, той не се брои като цифров знак	
76	Мерна единица на количеството	KW KWh/h KWh/ден MW MWh/h MWh/ден GW GWh/h GWh/ден	

	Поле	Формат	Приложими видове договори за деривати
		Therm/ден KTherm/ден MTherm/ден cm/ден mcm/ден	
77	Цена за количества за времеви интервали	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка. Ако бъде попълнен отрицателен знак, той не се брои като цифров знак	
	Раздел 2и — Опции		Договори, съдържащи опция
78	Вид на опцията	P = опция за продажба (пут опция) C = опция за покупка (кол опция) C = опция за покупка (кол опция) O = когато не може да се определи дали опцията е кол или пут	
79	Тип на опцията според начина на упражняването ѝ	A = американска B = бермудска E = европейска S = азиатска Може да се попълни повече от една стойност	
80	Цена на упражняване (максимална/ минимална)	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка. Ако бъде попълнен отрицателен знак, той не се брои като цифров знак. Когато цената на упражняване се отчита като процентна стойност, тя се следва да се представи в процентно изражение, при което 100 % се изразява като „100“	
81	Означение на цената на упражняване	U = единици P = процент Y = доходност	
82	Падеж на базовия актив	Формат на датата по ISO 8601 (ГГГГ-ММ-ДД)	
	Раздел 2й — Кредитни деривати		
83	Ранг	SNDB = Първостепенен дълг, като например първостепенен необезпечен дълг (корпоративен/финансов сектор), държавни валутни дългови инструменти (държавно управление),	

	Поле	Формат	Приложими видове договори за деривати
		SBOD = Подчинен дълг, като например подчинен дълг или дълг от по-нисък втори ред (банки), второстепенен подчинен дълг или дълг от по-висок втори ред (банки), OTHR = Друг вид, като например привилегировани акции или капитал от първи ред (банки), или други кредитни деривати	
84	Референтен субект	Двубуквен код на държавата по ISO 3166 или ISO 3166-2 — 2-буквен код на държавата, следван от тире „–“ и подразделение на кода на държавата с до 3 буквено-цифрови символа или Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака	
85	Честота на плащанията	MNTH = месечно QURT = тримесечно MIAN = два пъти годишно YEAR = годишно	
86	Основа за изчисляване	Числител/знаменател, като както числителят, така и знаменателят са съставени от цифрови знаци или буквения израз „действителен брой дни“, например 30/360 или действителен брой дни/365	
87	Серия	Поле за цяло число с максимум 5 цифрови знака	
88	Версия	Поле за цяло число с максимум 5 цифрови знака	
89	Коефициент на индекса	До 10 цифрови знака, включително десетични числа. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка	
90	Траншове	T = на траншове U = не е на траншове	
91	Начална точка на загуба	До 10 цифрови знака, включително цифрите след десетичния знак, изразени като десетична дроб между 0 и 1. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка	
92	Крайна точка на загуба	До 10 цифрови знака, включително цифрите след десетичния знак, изразени като десетична дроб между 0 и 1. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка	
	Раздел 2к — Изменения на договора		
93	Вид действие	N = ново M = изменение	

	Поле	Формат	Приложими видове договори за деривати
		E = грешка C = предсрочно прекратяване R = корекция Z = компресиране V = актуализиране на оценката P = компонент на позицията	
94	Равнище	T = сделка P = позиция“	