Този текст служи само за информационни цели и няма правно действие. Институциите на Съюза не носят отговорност за неговото съдържание. Автентичните версии на съответните актове, включително техните преамбюли, са версиите, публикувани в Официален вестник на Европейския съюз и налични в EUR-Lex. Тези официални текстове са пряко достъпни чрез връзките, публикувани в настоящия документ

►**B** **РЕГЛАМЕНТ ЗА ИЗПЪЛНЕНИЕ (ЕС) 2022/1860 НА КОМИСИЯТА**

от 10 юни 2022 година

за определяне на технически стандарти за изпълнение за прилагането на Регламент (ЕС) № 648/2012 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на стандартите, форматите, честотата, както и методите и механизмите за отчитане

(текст от значение за ЕИП)

(ОВ L 262, 7.10.2022 г., стр. 68)

Поправен със:

►**C1** Поправка, ОВ L 304, 24.11.2022 г., стр. 102 (2022/1860)

►**C2** Поправка, ОВ L 125, 11.5.2023 г., стр. 59 (2022/1860)

▼B

РЕГЛАМЕНТ ЗА ИЗПЪЛНЕНИЕ (ЕС) 2022/1860 НА КОМИСИЯТА

от 10 юни 2022 година

за определяне на технически стандарти за изпълнение за прилагането на Регламент (ЕС) № 648/2012 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на стандартите, форматите, честотата, както и методите и механизмите за отчитане

(текст от значение за ЕИП)

Член 1

Стандарти за данни и формати на отчетите за деривати

Данните за договор за деривати, които трябва да бъдат отчитани съгласно член 9 от Регламент (ЕС) № 648/2012, се предоставят в съответствие със стандартите и форматите, установени в таблици 1, 2 и 3 от приложението към настоящия регламент, и в общ електронен и машинночетим формат и според общ образец във формат XML съгласно методиката по ISO 20022.

Член 2

Честота на отчетите

1. Всички отчети за данните за даден дериват, посочен в член 1 от Делегиран регламент (ЕС) 2022/1855 на Комисията ([1]), се предоставят в хронологичния ред, в който са настъпили събитията, свързани с информацията, която трябва да се отчете.

2. Даден централен контрагент (ЦК), финансов контрагент или нефинансов контрагент, както е посочено в член 10 от Регламент (ЕС) № 648/2012, който е контрагент по дериват, или субектът, отговорен за отчитането, отчита всяка промяна на данните за деривата, свързани с обезпечението, в полета 1 — 29 в таблица 3 от приложението към Делегиран регламент (ЕС) 2022/1855 с вид на действието „Актуализация на маржин“, във вида на данните към края на всеки ден, когато:

а) дериватът не е с настъпил падеж и не е бил предмет на отчет с вид действие „Прекратяване“, „Грешка“ или „Компонент на позиция“, както е посочено в поле 151 от таблица 2 на приложението; или

б) дериватът е бил обект на отчет с вид действие „Възстановяване“, който не е последван от друг отчет с вид действие „Прекратяване“ или „Грешка“, както е посочено в поле 151 от таблица 2 от приложението.

([1]) Делегиран регламент (ЕС) 2022/1855 на Комисията от 10 юни 2022 година за допълнение на Регламент (ЕС) № 648/2012 на Европейския парламент и на Съвета във връзка с регулаторните технически стандарти за определяне на минималните данни, отчитани пред регистрите на трансакции, и вида на използваните отчети (вж. страница 1 от настоящия брой на Официален вестник)

▼B

3. Контрагент по дериват, посочен в параграф 2, точки а) и б), който е ЦК, финансов контрагент или нефинансов контрагент, както е посочено в член 10 от Регламент (ЕС) № 648/2012, или субектът, отговорен за отчитането, отчита оценката на договора в края на деня по пазарна стойност или по модел в полета 21—25 от таблица 2 в приложението към Делегиран регламент (ЕС) 2022/1855 с вид на действието „Актуализация на оценката“, във вида на оценката към края на всеки ден.

Член 3

Идентифициране на контрагентите и други субекти

1. Във всеки отчет се използва идентификационен код на правния субект (ИКПС) съгласно стандарт ISO 17442, за идентифициране на:

а) посредник;

б) централен контрагент;

в) клирингов член;

г) контрагент, който е правен субект;

д) подаващ отчета субект;

е) субект, който отговаря за отчитането;

ж) доставчик на услуги за намаляване на риска след сключване на сделката.

2. Контрагент 1 по дериват, както е посочено в поле 4 от таблица 1 от приложението към Делегиран регламент (ЕС) 2022/1855, и субектът, отговорен за отчитането, гарантират, че референтните данни, свързани с неговия ИКПС по ISO 17442, се подновяват съгласно условията на някое от акредитираните местни оперативни звена на световната система за ИКПС, когато се отчита сключването или промяната на договор за дериват съгласно член 9 от Регламент (ЕС) № 648/2012.

Член 4

Посока на деривата

1. Ролята на контрагента по договора за деривати, посочен в полета 17—19 на таблица 1 от приложението, се определя към момента на сключване на деривата ►C1 в съответствие с параграфи 2—13 ◄.

2. При опции и суапции контрагентът, който има право да упражни опцията, се определя като купувач, а контрагентът, който продава опцията и получава премия — като продавач.

3. При валутни форуърди контрагент 1 се определя или като платец, или като получател за първото рамо на сделката и обратното — за второто рамо. Контрагент 2 попълва полета 18 и 19 в таблица 1 със стойности, противоположни на тези на контрагент 1.

▼B

4. При суапове, свързани с валути, при които се извършва многократна размяна на валути, всеки контрагент и за двете рамена на сделката се определя или като платец, или като получател на рамото въз основа на размяната на валути, която се извършва най-близо до датата на изтичане.

5. При форуърди, различни от валутни форуърди, и при фючърси контрагентът, купуващ инструмента, се определя като купувач, а контрагентът, продаващ инструмента — като продавач.

6. При финансови договори за разлика и финансови залагания въз основа на спред контрагентът, който заема къса позиция по договора, се определя като продавач, а контрагентът, който заема дълга позиция по договора, се определя като купувач.

7. При суапове, свързани с дивиденти, контрагентът, който получава еквивалентните дивидентни плащания, се определя като купувач, а контрагентът, който плаща еквивалентните дивидентни плащания се определя като продавач.

8. При суапове, свързани с ценни книжа, различни от суапове, свързани с дивиденти, контрагент 1 се определя или като платец, или като получател за първото рамо, и обратното — за второто рамо. Контрагент 2 попълва полета 18 и 19 в таблица 1 със стойности, противоположни на тези на контрагент 1.

9. При суапове, свързани с лихвени проценти или инфлационни индекси, включително кръстосани валутни суапове, контрагент 1 се определя или като платец, или като получател за рамо 1, и обратното — за рамо 2. Контрагент 2 попълва полета 18 и 19 в таблица 1 със стойности, противоположни на тези на контрагент 1.

10. С изключение на опциите и суапциите, при дериватите за прехвърляне на кредитен риск контрагентът, купуващ защита, се определя като купувач, а контрагентът, продаващ защита — като продавач.

11. При стокови суапове контрагент 1 се определя или като платец, или като получател за първото рамо и обратното — за второто рамо. Контрагент 2 попълва полета 18 и 19 в таблица 1 със стойности, противоположни на тези на контрагент 1.

12. При форуърдни лихвени споразумения контрагент 1 се определя или като платец, или като получател за първото рамо на сделката и обратното — за второто рамо. Контрагент 2 попълва полета 18 и 19 в таблица 1 със стойности, противоположни на тези на контрагент 1.

13. При деривати, свързани с вариация, променливост и корелация, контрагентът, който печели от увеличението на цената на базовия актив, се определя като купувач, а контрагентът, който печели от намалението на цената на базовия актив, се определя като продавач.

▼B

Член 5

Обезпеченост

Отчитащият се контрагент определя вида на обезпечеността на договора за дериват или портфейла от деривати, посочен в поле 11 на таблица 3 от приложението, както следва:

а) като „необезпечен“, когато между контрагентите не е сключено споразумение за обезпечение или когато споразумението за обезпечение между контрагентите предвижда, че контрагентите не предоставят нито първоначален маржин, нито вариационен маржин по отношение на деривата или портфейла от деривати.

б) като „частично обезпечен: само контрагент 1“, когато споразумението за обезпечение между контрагентите предвижда, че отчитащият се контрагент предоставя редовно само вариационни маржини, а другият контрагент не предоставя никакъв маржин по отношение на деривата или портфейла от деривати;

в) като „частично обезпечен: само контрагент 2“, когато споразумението за обезпечение между контрагентите предвижда, че другият контрагент предоставя редовно само вариационен маржин, а отчитащият се контрагент не предоставя никакъв маржин по отношение на деривата или портфейла от деривати;

г) като „частично обезпечен“, когато споразумението за обезпечение между контрагентите предвижда, че и двамата контрагенти предоставят редовно само вариационен маржин по отношение на деривата или портфейла от деривати;

д) като „едностранно обезпечен: само контрагент 1“, когато споразумението за обезпечение между контрагентите предвижда, че отчитащият се контрагент предоставя първоначалния маржин и редовно предоставя вариационни маржини, а другият контрагент не предоставя никакви маржини по отношение на деривата или портфейла от деривати;

е) като „едностранно обезпечен: само контрагент 2“, когато споразумението за обезпечение между контрагентите предвижда, че другият контрагент предоставя първоначалния маржин и редовно предоставя вариационни маржини, а отчитащият се контрагент не предоставя никакви маржини по отношение на деривата или портфейла от деривати;

ж) като „едностранно/частично обезпечен: контрагент 1“, когато споразумението за обезпечение между контрагентите предвижда, че отчитащият се контрагент предоставя първоначалния маржин и редовно предоставя вариационен маржин, а другият контрагент редовно предоставя само вариационен маржин по отношение на деривата или портфейла от деривати;

з) като „едностранно/частично обезпечен: контрагент 2“, когато споразумението за обезпечение между контрагентите предвижда, че другият контрагент предоставя първоначалния маржин и редовно предоставя вариационен маржин, а отчитащият се контрагент редовно предоставя само вариационен маржин по отношение на деривата или портфейла от деривати

▼B

и) като „напълно обезпечен“, когато споразумението за обезпечение между контрагентите предвижда, че и двамата контрагенти предоставят първоначален маржин и редовно предоставят вариационни маржини по отношение на деривата или портфейла от деривати.

Член 6

Определяне, идентифициране и класифициране на деривати

1. В отчета дериватът се определя от гледна точка на вида договор и класа активи в съответствие с полета 10 и 11 на таблица 2 от приложението.

Когато дериватите не принадлежат към един от класовете деривати, посочени в поле 11 на таблица 2 от приложението, в отчета се посочва класът активи, който най-много наподобява деривата. И двамата контрагенти посочват един и същ клас активи.

2. Даден дериват се идентифицира в поле 7 на таблица 2 от приложението, като се използва международният идентификационен номер на ценни книжа (ISIN) по стандарт ISO 6166, в някой от следните случаи:

а) дериватът е допуснат до търговия или се търгува на място за търговия;

б) дериватът се търгува на систематичен участник, а базовият му инструмент е допуснат до търговия или се търгува на място за търговия, или е индекс или кошница, съставени от инструменти, търгувани на място за търговия.

3. Дериват, различен от деривата, посочен в параграф 2, се идентифицира в поле 8 на таблица 2 от приложението, като се използва единният идентификационен код на продукта (UPI) по стандарт ISO 4914.

4. Отчитащият се контрагент класифицира деривата в поле 9 на таблица 2 от приложението, като използва код за класификация на финансовите инструменти (CFI) по стандарт ISO 10962.

Член 7

Единен идентификационен код на сделката

1. Контрагентите отчитат дериватите като използват кода UTI, генериран в съответствие с параграфи 2, 3 и 5.

2. Дериватът, отчетен на ниво сделка или позиция, се идентифицира, като в поле 1 от таблица 2 от приложението се използва Единен идентификационен код на сделката (UTI) по ISO 23897. Кодът UTI се състои от ИКПС на субекта, който е генерирал този UTI, последван от код, съдържащ до 32 знака, който е уникален на ниво генериращ субект.

3. Контрагентът определя субекта, отговорен за генерирането на UTI в съответствие със следното:

▼B

а) за деривати, за които е извършен клиринг, различни от деривати между двама ЦК, UTI се генерира в момента на клиринга от ЦК за клиринговия член. Клиринговият член генерира различен UTI за своя контрагент за сделка, по която ЦК не е контрагент;

б) за деривати, които се изпълняват централно, но не преминават през централен клиринг, UTI се генерира от мястото на изпълнение за неговия член;

в) за деривати, различни от посочените в букви а) и б), когато някой от контрагентите подлежи на изискванията за отчитане в трета държава, UTI се генерира съгласно правилата на юрисдикцията на контрагента, който първи трябва да спази тези изисквания за отчитане.

Когато контрагентът, за който се изисква отчитане съгласно член 9 от Регламент (ЕС) № 648/2012, трябва да изпълни първо изискванията за отчитане, субектът, отговорен за генерирането на UTI, е, както следва:

i) за деривати, които са били потвърдени централно по електронен път — платформата за потвърждаване на сделки в момента на потвърждаването;

ii) за всички останали деривати контрагентите се споразумяват относно субекта, отговорен за генерирането на UTI. Когато контрагентите не успеят да се споразумеят, за генерирането отговаря контрагентът, чийто ИКПС е на първо място при подреждането на идентификационните кодове на контрагентите с обратна последователност на знаците на идентификационния код.

Когато приложимото законодателство на съответната трета държава предвижда същия краен срок за отчитане като този, приложим за контрагента, за който се прилага задължение за отчетност съгласно член 9 от Регламент (ЕС) № 648/2012 по силата на член 9, параграф 1, първа алинея от Регламент (ЕС) № 648/2012, контрагентите се споразумяват за субекта, отговорен за генерирането на UTI.

Когато контрагентите не успеят да се споразумеят и дериватът е потвърден централно по електронен път, UTI се генерира от платформата за потвърждаване на сделки в момента на потвърждаването.

Ако UTI не може да бъде генериран от платформата за потвърждаване на сделки в момента на потвърждаването и данните за деривата трябва да бъдат отчетени пред един-единствен регистър на трансакции, този регистър на трансакции отговаря за генерирането на UTI.

Ако UTI не може да бъде генериран от регистъра на трансакции, пред който са отчетени данните за деривата, за генерирането му отговаря контрагентът, чийто ИКПС е на първо място при подреждането на идентификационните кодове на контрагентите с обратна последователност на знаците на идентификационния код.

▼B

г) за деривати, различни от посочените в букви а), б) и в), които са били потвърдени централно по електронен път, UTI се генерира от платформата за потвърждаване на сделки в момента на потвърждаването;

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

i) когато финансови контрагенти сключват деривати с нефинансови контрагенти, UTI се генерира от финансовите контрагенти;

ii) когато нефинансови контрагенти, надхвърлили клиринговия праг, сключват деривати с нефинансови контрагенти, намиращи се под клиринговия праг, UTI се генерира от надхвърлилите клиринговия праг нефинансови контрагенти;

iii) за всички останали деривати, различни от посочените в подточки i) и ii), контрагентите се споразумяват за субекта, отговорен за генерирането на UTI. Когато контрагентите не успеят да се споразумеят, за генерирането отговаря контрагентът, чийто ИКПС е на първо място при подреждането на идентификационните кодове на контрагентите с обратна последователност на знаците на идентификационния код.

4. Контрагентът, който генерира UTI, съобщава UTI на другия контрагент своевременно и не по-късно от 10:00 ч. координирано универсално време на работния ден, следващ датата на сключване на деривата.

5. Независимо от разпоредбите на параграф 3 генерирането на UTI може да бъде делегирано на субект, различен от този, определен в съответствие с параграф 3. Субектът, който генерира UTI, трябва да спазва изискванията, посочени в параграфи 2 и 4.

Член 8

Отчитане на промени в ИКПС и актуализиране на идентификационния код съобразно ИКПС

1. Когато контрагентът, идентифициран съгласно член 3 в отчет за деривати, претърпи събитие на корпоративно преструктуриране, което води до промяна на неговия ИКПС, този контрагент или контрагентът, за когото се отнася новият ИКПС, или субектът, отговорен за отчитането от името на някой от тези контрагенти съгласно член 9, параграфи 1а—1г от Регламент (ЕС) № 648/2012, или субектът, на когото някой от контрагентите е делегирал отчитането съгласно член 9, параграф 1е от Регламент (ЕС) № 648/2012, уведомява регистъра на трансакции, пред който контрагентът, претърпял събитие на корпоративно преструктуриране, е отчитал своите деривати, за промяната и изисква актуализация на ИКПС в съответните деривати, посочени в член 2, параграф 2, букви а) и б), на датата на събитието на корпоративно преструктуриране, водещо до промяна на ИКПС, или на договорите, отчетени след тази дата.

▼B

2. Когато е възможно, искането за актуализиране на идентификационния код в дериватите, посочени в член 2, параграф 2, букви а) и б), се подава най-малко 30 календарни дни преди събитието на корпоративно преструктуриране, което води до промяна на ИКПС. Ако субектът, посочен в параграф 1, не може да предостави тази информация на регистъра на трансакции 30 календарни дни преди събитието на корпоративно преструктуриране, което води до промяна на ИКПС, той уведомява регистъра на трансакции във възможно най-кратък срок.

3. Искането, посочено в параграф 1, съдържа най-малко следното:

а) ИКПС на всеки от контрагентите, участващи в събитието на корпоративно преструктуриране;

б) ИКПС на новия контрагент;

в) датата, на която се извършва или е извършена промяна на ИКПС;

г) UTI на съответните деривати, в случай че събитието на корпоративно преструктуриране засяга само подгрупа от деривати, посочени в член 2, параграф 2, букви а) и б);

д) доказателства, че събитието на корпоративно преструктуриране е настъпило или предстои да настъпи, при спазване на разпоредбите относно публичното оповестяване на вътрешна информация в член 17 от Регламент (ЕС) № 596/2014.

4. Когато даден контрагент уведоми по погрешка регистъра на трансакции за промяна в своя ИКПС, той следва процедурата за искане на актуализация на своя ИКПС в съответствие с параграфи 1, 2 и 3.

5. Когато контрагент, който преди това е бил идентифициран с идентификационен код, различен от ИКПС, получи ИКПС, се прилагат процедурите по параграфи 1, 2 и 3.

6. Когато промяната в ИКПС се отнася до контрагент, установен в трета държава, неговият отчитащ се контрагент, установен в Съюза, или субектът, отговорен за отчитането съгласно член 9, параграфи 1а—1г от Регламент (ЕС) № 648/2012, или субектът, на който отчитащият се контрагент, установен в Съюза, е делегирал отчитането, започва процедурата по параграфи 1, 2 и 3.

7. Когато контрагент, установен в трета държава, който преди това е бил идентифициран с идентификационен код, различен от ИКПС, получи ИКПС, всеки отчитащ се контрагент, установен в Съюза, засегнат от тази промяна, или субектът, отговорен за отчитането съгласно член 9, параграфи 1а—1г от Регламент (ЕС) № 648/2012, или субектът, на когото отчитащият се контрагент, установен в Съюза, е делегирал отчитането, отправя искане за актуализиране на идентификационния код на контрагента, установен в трета държава, до съответния регистър на трансакции.

▼B

8. Когато промяната в ИКПС се отнася до субект, посочен в член 3, параграф 1, букви а), б), в), д) или ж), който не е контрагент по деривата, контрагент 1 или субектът, отговорен за отчитането, потвърждава пред регистъра на трансакции UTI на съответните деривати, посочени в член 2, параграф 2, букви а) и б). Когато контрагент 1 и субектът, отговорен за отчитането, не потвърдят пред регистъра на трансакции UTI на дериватите, посочени в член 2, параграф 2, букви а) и б), засегнати от промяната в ИКПС, контрагент 1 или субектът, отговорен за отчитането, актуализират ИКПС на съответния субект във всички отчети, отнасящи се до съответните деривати, посочени в член 2, параграф 2, букви а) и б), като изпращат отчет с вид действие „Промяна“.

Член 9

Методи и механизми за отчитане

1. Лицето, отговорно за отчитането, уведомява своя компетентен орган и, ако е различен, компетентния орган на отчитащия се контрагент за всеки от следните случаи:

а) всяко неправилно отчитане, причинено от недостатъци в системите за отчитане, които биха засегнали значителен брой отчети,

б) всяка пречка пред отчитането, която възпрепятства подаващия отчета субект да изпрати отчетите на регистъра на трансакции в срока, посочен в член 9, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 648/2012,

в) всеки значителен проблем, водещ до грешки в отчитането, които не биха довели до отхвърляне от регистъра на трансакции в съответствие с Делегиран регламент (ЕС) 2022/1858 на Комисията ([2]).

Субектът, отговорен за отчитането, незабавно уведомява за всички тези случаи, веднага щом узнае за тях.

В уведомлението се посочват най-малко видът на грешката или пропуска, датата на възникване, обхватът на засегнатите отчети, причините за грешките или пропуските, предприетите стъпки за разрешаване на проблема и срока за разрешаване на проблема и за корекции.

2. Когато единствено финансовият контрагент е отговорен и носи правното задължение за отчитането на данните за договорите за извънборсови деривати от името на нефинансов контрагент съгласно член 9, параграф 1а от Регламент (ЕС) № 648/2012, той въвежда следните механизми:

([2]) Делегиран регламент (ЕС) 2022/1858 на Комисията от 10 юни 2022 г. за допълнение на Регламент (ЕС) № 648/2012 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на регулаторните технически стандарти за определяне на процедурите за съгласуване на данните между регистрите на трансакции и процедурите, прилагани от регистъра на трансакции при проверката на спазването на изискванията за отчетност от страна на отчитащия се контрагент или подаващия отчета субект и при проверката на изчерпателността и верността на отчитаните данни (вж. страница 46 от настоящия брой на Официален вестник).

▼B

а) механизми за своевременно предоставяне от страна на нефинансовия контрагент на следните данни за договорите за извънборсови деривати, които не може разумно да се очаква, че финансовият контрагент ще притежава, и когато те не са известни на този финансов контрагент:

i) идентификационен код на брокера, както е посочено в поле 15 на таблица 1 от приложението;

ii) клирингов член, както е посочено в поле 16 на таблица 1 от приложението;

iii) пряко свързан с търговска дейност или финансово управление, както е посочено в поле 20 на таблица 1 от приложението;

б) механизми за своевременно информиране на финансовия контрагент от нефинансовия контрагент за всяка промяна в неговите правни задължения съгласно член 10, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 648/2012;

в) механизми за надлежно подновяване от нефинансовия контрагент на неговия ИКПС в съответствие с условията на някое от акредитираните местни оперативни звена на световната система за ИКПС;

г) механизми за своевременно уведомяване на финансовия контрагент от нефинансовия контрагент за решението му да започне или да прекрати отчитането на данните за договорите за извънборсови деривати, сключени с финансовия контрагент. Тези механизми гарантират най-малкото, че уведомяването се извършва в писмена форма или по друг равностоен начин по електронен път най-малко 10 работни дни преди датата, на която нефинансовият контрагент иска да започне или да прекрати отчитането.

3. Контрагентите, субектите, отговорни за отчитането, и субектите, подаващи отчетите, според случая, разполагат с механизми, които гарантират, че ще бъде взета предвид обратната връзка относно проблемите при съгласуването, предоставена съгласно член 3 от Делегиран регламент (ЕС) 2022/1858.

▼C2

Член 10

Дата, до която договорите за деривати следва да бъдат отчетени

Контрагентът по дериват, който отговаря на условията, посочени в член 2, параграф 2, буква а) или б) на 29 април 2024 г., или субектът, отговорен за отчитането, отчита всички данни за този дериват, изисквани в съответствие с приложението, като подава отчет с вид събитие „Актуализация“ в срок от 180 календарни дни от 29 април 2024 г., освен ако не е подал отчет с вид действие „Промяна“ или „Корекция“ за този дериват в рамките на този период.

▼B

Член 11

Отмяна

Регламент за изпълнение (ЕС) № 1247/2012 се отменя.

Позоваванията на отменения регламент се считат за позовавания на настоящия регламент.

Член 12

Влизане в сила и прилагане

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

Той се прилага от 29 април 2024 година.

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

▼B

ПРИЛОЖЕНИЕ

Таблица 1

	Раздел	Поле	Формат
1	Страни по деривата	Дата и час на отчета	Дата съгласно ISO 8601 във формат на координираното универсално време (UTC) ГГГГ-ММ-ДДТчч:мм:ссZ
2	Страни по деривата	Идентификационен код на подаващия отчета субект	Идентификационен код на правния субект (ИКПС) по ISO 17442, 20 буквено-цифрени знака, който е включен в данните за ИКПС, публикувани от Световната фондация за ИКПС.
3	Страни по деривата	Субект, отговорен за отчитането	Идентификационен код на правния субект (ИКПС) по ISO 17442, 20 буквено-цифрени знака, който е включен в данните за ИКПС, публикувани от Световната фондация за ИКПС. ИКПС трябва да бъде надлежно подновен в съответствие с условията на някое от акредитираните местни оперативни звена на Световната система за идентификационен код на правния субект.
4	Страни по деривата	Контрагент 1 (Отчитащ се контрагент)	Идентификационен код на правния субект (ИКПС) по ISO 17442, 20 буквено-цифрени знака, който е включен в данните за ИКПС, публикувани от Световната фондация за ИКПС. ИКПС трябва да бъде надлежно подновен в съответствие с условията на някое от акредитираните местни оперативни звена на Световната система за идентификационен код на правния субект.
5	Страни по деривата	Естество на контрагент 1	F = финансов контрагент N = нефинансов контрагент C = централен контрагент O = друг
6	Страни по деривата	Корпоративен сектор на контрагент 1	Таксономия на финансовите контрагенти: „INVF“ — инвестиционен посредник, лицензиран в съответствие с Директива 2014/65/ЕС на Европейския парламент и на Съвета ([1]); „CDTI“ — кредитна институция, лицензирана в съответствие с Директива 2013/36/ЕС на Европейския парламент и на Съвета ([2]); „INUN“ — застрахователно предприятие или презастрахователно предприятие, лицензирано в съответствие с Директива 2009/138/ЕО на Европейския парламент и на Съвета ([3]); „UCIT“ — ПКИПЦК и, когато е приложимо, неговото управляващо дружество, лицензирано в съответствие с Директива 2009/65/ЕО на Европейския парламент и на Съвета ([4]), ако това ПКИПЦК не е създадено изключително с цел обслужване на един или повече планове за покупка на акции от служители; „ORPI“ — институция за професионално пенсионно осигуряване (ИППО) съгласно определението в член 6, точка 1 от Директива (ЕС) 2016/2341 на Европейския парламент и на Съвета ([5]);

▼B

	Раздел	Поле	Формат
			„AIFD“ — алтернативен инвестиционен фонд (АИФ) съгласно определението в член 4, параграф 1, буква а) от Директива 2011/61/ЕС на Европейския парламент и на Съвета ([6]), който е или установен в Съюза, или управляван от лице, управляващо алтернативен инвестиционен фонд (ЛУАИФ), получило разрешение или регистрирано в съответствие с посочената Директива, освен ако този АИФ не е създаден изключително с цел обслужване на един или повече планове за покупка на акции от служители или освен ако този АИФ не е предприятие със специална цел — секюритизация по член 2, параграф 3, буква ж) от Директива 2011/61/ЕС и, когато е приложимо, неговото ЛУАИФ, установено в Съюза; „CSDS“ — централен депозитар на ценни книжа, лицензиран в съответствие с Регламент (ЕС) № 909/2014 на Европейския парламент и на Съвета ([7]); Таксономия за нефинансови контрагенти. Следните категории отговарят на основните сектори на класификацията NACE, както е установена в Регламент (ЕО) № 1893/2006 на Европейския парламент и на Съвета ([8]): „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 и складиране; „I“ — Хотелиерство и ресторантьорство; „J“ — Информация и комуникация; „K“ — Финансови и застрахователни дейности; „L“ — Операции с недвижими имоти; „M“ — Професионални и технически дейности и научни изследвания; „N“ — Административни и спомагателни дейности; „O“ — Публична администрация и отбрана; задължителна социална сигурност; „P“ — Образование; „Q“ — Човешко здравеопазване и социални дейности; „R“ — Култура, спорт и развлечения; „S“ — Други дейности;

▼B

	Раздел	Поле	Формат
			„T“ — Дейности на домакинства като работодатели; недиференцирани дейности на домакинства като производители на стоки — и услуги — за собствено потребление; „U“ — 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. За ЦК и други видове контрагенти в съответствие с член 1, параграф 5 от Регламент (ЕС) № 648/2012 ([9]) полето следва да се остави празно.
7	Страни по деривата	Клирингов праг за контрагент 1	Булева стойност: TRUE = над прага FALSE = под прага
8	Страни по деривата	Вид на идентификационния код на контрагент 2	Булева стойност: — TRUE — FALSE, за физически лица, които действат като частни лица, които не отговарят на условията за издаване на ИКПС съгласно Изявлението на Регулаторния надзорен комитет относно физическите лица, действащи като стопански субекти, от 20 септември 2015 г. (изявлението на РНК).
9	Страни по деривата	Контрагент 2	— Идентификационен код на правния субект (ИКПС) по ISO 17442, 20 буквено-цифрени знака, който е включен в данните за ИКПС, публикувани от Световната фондация за ИКПС или код с до 72 буквено-цифрени знака за физически лица, действащи в качеството си на частни лица, които не отговарят на условията за издаване на ИКПС съгласно изявлението на РНК. Кодът, идентифициращ физическо лице, се състои от ИКПС на контрагент 1, последван от единен идентификационен код, определен и поддържан последователно от контрагент 1 за това физическо лице/тези физически лица за целите на регулаторната отчетност.
10	Страни по деривата	Държава на контрагент 2	Код на държавата по ISO 3166 — двубуквен код на държавата
11	Страни по деривата	Естество на контрагент 2	F = финансов контрагент N = нефинансов контрагент C = централен контрагент O = друг

▼B

	Раздел	Поле	Формат
12	Страни по деривата	Корпоративен сектор на контрагент 2	Таксономия на финансовите контрагенти: „INVF“ — инвестиционен посредник, лицензиран в съответствие с Директива 2014/65/ЕС; „CDTI“ — кредитна институция, лицензирана в съответствие с Директива 2013/36/ЕС; „INUN“ — застрахователно предприятие или презастрахователно предприятие, лицензирано в съответствие с Директива 2009/138/ЕО; „UCIT“ — ПКИПЦК и, когато е приложимо, неговото управляващо дружество, лицензирано в съответствие с Директива 2009/65/ЕО, ако това ПКИПЦК не е създадено изключително с цел обслужване на един или повече планове за покупка на акции от служители; „ORPI“ — институция за професионално пенсионно осигуряване (ИППО) съгласно определението в член 6, точка 1 от Директива (ЕС) 2016/2341; „AIFD“ — алтернативен инвестиционен фонд (АИФ) съгласно определението в член 4, параграф 1, буква а) от Директива 2011/61/ЕС, който е или установен в Съюза, или управляван от лице, управляващо алтернативен инвестиционен фонд (ЛУАИФ), получило разрешение или регистрирано в съответствие с посочената Директива, освен ако този АИФ не е създаден изключително с цел обслужване на един или повече планове за покупка на акции от служители или освен ако този АИФ не е предприятие със специална цел дейности по секюритизация по член 2, параграф 3, буква ж) от Директива 2011/61/ЕС и, когато е приложимо, неговото ЛУАИФ, установено в Съюза; „CSDS“ — централен депозитар на ценни книжа, лицензиран в съответствие с Регламент (ЕС) № 909/2014; Таксономия за нефинансови контрагенти. Следните категории отговарят на основните сектори на класификацията NACE, както е установена в Регламент (ЕО) № 1893/2006: „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 и складиране; „I“ — Хотелиерство и ресторантьорство; „J“ — Информация и комуникация; „K“ — Финансови и застрахователни дейности;

▼B

	Раздел	Поле	Формат
			„L“ — Операции с недвижими имоти; „M“ — Професионални и технически дейности и научни изследвания; „N“ — Административни и спомагателни дейности; „O“ — Публична администрация и отбрана; задължителна социална сигурност; „P“ — Образование; „Q“ — Човешко здравеопазване и социални дейности; „R“ — Култура, спорт и развлечения; „S“ — Други дейности; „T“ — Дейности на домакинства като работодатели; недиференцирани дейности на домакинства като производители на стоки — и услуги — за собствено потребление; „U“ — 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. За ЦК и други видове контрагенти в съответствие с член 1, параграф 5 от Регламент (ЕС) № 648/2012 полето следва да се остави празно.
13	Страни по деривата	Клирингов праг за контрагент 2	Булева стойност: TRUE = над прага FALSE = под прага
14	Страни по деривата	Задължение на контрагент 2 за отчитане	Булева стойност: — TRUE, ако контрагент 2 има задължение за отчитане — FALSE, ако контрагент 2 няма задължение за отчитане
15	Страни по деривата	Идентификационен код на брокера	Идентификационен код на правния субект (ИКПС) по ISO 17442, 20 буквено-цифрени знака, който е включен в данните за ИКПС, публикувани от Световната фондация за ИКПС.
16	Страни по деривата	Клирингов член	Идентификационен код на правния субект (ИКПС) по ISO 17442, 20 буквено-цифрени знака, който е включен в данните за ИКПС, публикувани от Световната фондация за ИКПС.
17	Страни по деривата	Посока	4 буквени знака: BYER = купувач SLLR = продавач Попълва се в съответствие с член 4 от настоящия регламент.

▼B

	Раздел	Поле	Формат
18	Страни по деривата	Посока на рамо 1	4 буквени знака: MAKE = платец TAKE = получател Попълва се в съответствие с член 4 от настоящия регламент.
19	Страни по деривата	Посока на рамо 2	4 буквени знака: MAKE = платец TAKE = получател Попълва се в съответствие с член 4 от настоящия регламент.
20	Страни по деривата	Пряка връзка с търговската дейност или с финансовото управление	Булева стойност: TRUE = Да FALSE = Не

([1]) Директива 2014/65/ЕС на Европейския парламент и на Съвета от 15 май 2014 г. относно пазарите на финансови инструменти и за изменение на Директива 2002/92/ЕО и на Директива 2011/61/ЕС (ОВ L 173, 12.6.2014 г., стр. 349).
([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 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).
([4]) 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).
([5]) Директива (ЕС) 2016/2341 на Европейския парламент и на Съвета от 14 декември 2016 г. относно дейностите и надзора на институциите за професионално пенсионно осигуряване (ИППО) (ОВ L 354, 23.12.2016 г., стр. 37).
([6]) 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).
([7]) 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, както и за изменение на директиви 98/26/ЕО и 2014/65/ЕС и Регламент (ЕС) № 236/2012 (ОВ L 257 28.8.2014 г., стр. 1).
([8]) 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).
([9]) 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).

Таблица 2

	Раздел	Поле	Формат
1	Раздел 2а — Идентификационни кодове и връзки	UTI	UTI по ISO 23897. До 52 буквено-цифрени знака — разрешени са само главните букви A—Z и цифрите 0—9
2	Раздел 2а — Идентификационни кодове и връзки	Номер за проследяване на отчета	Поле с максимум 52 буквено-цифрени знака
3	Раздел 2а — Идентификационни кодове и връзки	Предишен UTI (за връзки между сделки — „една към една“ и „една към много“)	До 52 буквено-цифрени знака — разрешени са само главните букви A—Z и цифрите 0—9

▼B

	Раздел	Поле	Формат
4	Раздел 2а — Идентификационни кодове и връзки	UTI на следваща позиция	До 52 буквено-цифрени знака — разрешени са само главните букви A—Z и цифрите 0—9
5	Раздел 2а — Идентификационни кодове и връзки	Идентификационен код на намаляването на риска след сключване на сделките (PTRR)	До 52 буквено-цифрени знака — разрешени са само главните букви A—Z и цифрите 0—9. Първите 20 знака представляват ИКПС на доставчика на услуги за компресиране
6	Раздел 2а — Идентификационни кодове и връзки	Идентификационен код на пакета	До 35 буквено-цифрени знака.
7	Раздел 2б — Информация за договора	Международен идентификационен номер на ценните книжа (ISIN)	ISIN код по ISO 6166, 12 буквено-цифрени знака
8	Раздел 2б — Информация за договора	Единен идентификационен код на продукта (UPI)	UPI по ISO 4914, 12 буквено-цифрени знака
9	Раздел 2б — Информация за договора	Класифициране на продуктите	CFI код по ISO 10962 от 6 буквени знака
10	Раздел 2б — Информация за договора	Вид договор	CFDS = финансови договори за разлики FRAS = форуърдни лихвени споразумения FUTR = фючърси FW = форуърди OPTN = опция SPDB = финансово залагане въз основа на спред SWAP = суап SWPT = суапция OTHR = други
11	Раздел 2б — Информация за договора	Клас на активите	COMM = стоки и квоти за емисии CRDT = кредит CURR = валута EQUI = акция INTR = лихвен процент
12	Раздел 2б — Информация за договора	Дериват на база на криптоактиви	Булева стойност: — TRUE — за деривати на база на криптоактиви — FALSE — за други деривати
13	Раздел 2б — Информация за договора	Вид идентификация на базовия актив	1 буквен знак: I = ISIN код B = кошница X = индекс

▼B

	Раздел	Поле	Формат
14	Раздел 2б — Информация за договора	Идентификация на базовия актив	За идентификация на базов актив от вида I: ISIN код по ISO 6166, 12 буквено-цифрени знака За идентификация на базов актив от вида X: ISIN код по ISO 6166, ако има такъв, 12 буквено-цифрени знака
15	Раздел 2б — Информация за договора	Обозначение за базовия индекс	Посочване на индекса, от който зависи плаващият лихвен процент 4 буквени знака: ESTR = €STR SONA = SONIA SOFR = SOFR 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 EFFR = Effective Federal Funds Rate OBFR = Overnight Bank Funding Rate CZNA = CZEONIA
16	Раздел 2б — Информация за договора	Наименование на базовия индекс	До 50 буквено-цифрени знака Разрешени са специални символи, ако те са част от пълното наименование на индекса.

▼B

	Раздел	Поле	Формат
17	Раздел 2б — Информация за договора	Код на индивидуална кошница	До 72 буквено-цифрени знака, състоящи се от ИКПС на лицето, структурирало кошницата, следван от до 52 буквено-цифрени знака.
18	Раздел 2б — Информация за договора	Идентификационен код на елементите на кошницата	За идентификация на базов актив тип B: Всички отделни компоненти се определят на база на ISIN кода по ISO 6166
19	Раздел 2б — Информация за договора	Валута 1 на сетълмент	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
20	Раздел 2б — Информация за договора	Валута 2 на сетълмент	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
21	Раздел 2в — Оценка	Оценъчна стойност	Положителна и отрицателна стойност, до 25 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Ако стойността е по-дълга от пет цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. 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.
22	Раздел 2в — Оценка	Валута на оценката	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
23	Раздел 2в — Оценка	Дата и час на оценката	Формат на датата съгласно ISO 8601. Формат на часа съгласно UTC ГГГГ-ММ-ДДТчч:мм:ссZ
24	Раздел 2в — Оценка	Метод за оценка на стойността	4 буквени знака: MTMA = пазарна оценка MTMO = оценка по модел CCPV = оценка на ЦК.
25	Раздел 2в — Оценка	Делта	До 25 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Ако стойността е по-дълга от пет цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка. Разрешена е всяка стойност между -1 и 1 (включително -1 и 1).
26	Раздел 2г — Обезпечение	Обозначение за портфейла от обезпечения	Булева стойност: TRUE = обезпечен на база портфейл FALSE = не е част от портфейл
27	Раздел 2г — Обезпечение	Код на портфейла от обезпечения	До 52 буквено-цифрени знака. Не са разрешени специални знаци.
28	Раздел 2д — Ограничаване/ отчитане на риска	Дата и час на потвърждението	Формат на датата съгласно ISO 8601. Формат на часа съгласно UTC ГГГГ-ММ-ДДТчч:мм:ссZ

▼B

	Раздел	Поле	Формат
29	Раздел 2д — Ограничаване/ отчитане на риска	Потвърден	4 буквени знака: — NCNF = непотвърден — ECNF = електронен — YCNF = неелектронен
30	Раздел 2е — Клиринг	Задължение за клиринг	TRUE = договорът принадлежи към клас извънборсови деривати, които подлежат на задължителен клиринг, и двамата контрагенти по договора подлежат на задължението за клиринг. FLSE = договорът принадлежи към клас извънборсови деривати, които подлежат на задължителен клиринг, но или един, или и двамата контрагенти по договора не подлежат на задължението за клиринг. или стойност UKWN — договорът не принадлежи към клас извънборсови деривати, които подлежат на задължителен клиринг
31	Раздел 2е — Клиринг	Извършен клиринг	1 буквен знак: Y = да, извършен е централен клиринг, за бета и гама сделки. N = не, не е извършен централен клиринг.
32	Раздел 2е — Клиринг	Дата и час на клиринга	Формат на датата съгласно ISO 8601. Формат на часа съгласно UTC ГГГГ-ММ-ДДТчч:мм:ссZ
33	Раздел 2е — Клиринг	Централен контрагент	Идентификационен код на правния субект (ИКПС) по ISO 17442, 20 буквено-цифрени знака, който е включен в данните за ИКПС, публикувани от Световната фондация за ИКПС.
34	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Вид на рамковото споразумение	4 буквени знака: ISDA — ISDA CDEA — FIA-ISDA Cleared Derivatives Execution Agreement (Споразумение на FIA-ISDA за изпълнение на деривати с извършен клиринг) EUMA — European Master Agreement (Европейско рамково споразумение) FPCA — Professional Client Agreement (Споразумение на FOA за професионални клиенти) FMAT — FBF Master Agreement relating to transactions on forward financial instruments (Рамково споразумение на FBF за сделки върху форуърдни финансови инструменти) DERV — Deutscher Rahmenvertrag für Finanztermingeschäfte (DRV) CMOP — Contrato Marco de Operaciones Financieras (Рамков договор за финансови операции) CHMA — Swiss Master Agreement (Швейцарско рамково споразумение) IDMA — Islamic Derivative Master Agreement (Рамково споразумение за ислямски деривати) EFMA — EFET Master Agreement — (Рамково споразумение на EFET)

▼B

	Раздел	Поле	Формат
			GMRA — GMRA GMSL — GMSLA BIAG — двустранно споразумение или OTHR (други), ако видът на рамковото споразумение не фигурира в списъка по-горе
35	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Друг вид рамково споразумение	До 50 буквено-цифрени знака
36	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Версия на рамковото споразумение	Дата по ISO 8601 във формат ГГГГ
37	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Вътрешногрупова сделка	Булева стойност: TRUE = договорът е сключен като вътрешногрупова сделка FALSE = договорът не е сключен като вътрешногрупова сделка
38	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	PTRR	Булева стойност: TRUE = договорът е резултат от PTRR събитие FALSE = договорът не е резултат от PTRR събитие
39	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Вид PTRR техника	4 буквени знака: PWOS — Компресиране на портфейла без доставчик на услуги — трета страна PWAS — Компресиране на портфейла с доставчик на услуги — трета страна или ЦК PRBM — Ребалансиране на портфейла/Управление на маржина OTHR — други
40	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Доставчик на PTRR услуги	Идентификационен код на правния субект (ИКПС) по ISO 17442, 20 буквено-цифрени знака, който е включен в данните за ИКПС, публикувани от Световната фондация за ИКПС.
41	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Място на изпълнение	Идентификационен код на пазара (MIC) по ISO 10383, 4 буквено-цифрени знака
42	Раздел 2в — Подробни данни за сделката	Дата и час на изпълнението	Формат на датата съгласно ISO 8601. Формат на часа съгласно UTC ГГГГ-ММ-ДДТчч:мм:ссZ
43	Раздел 2в — Подробни данни за сделката	Дата на влизане в сила	Формат на датата съгласно ISO 8601 и UTC — ГГГГ-ММ-ДД.
44	Раздел 2в — Подробни данни за сделката	Дата на изтичане	Формат на датата съгласно ISO 8601 и UTC — ГГГГ-ММ-ДД.

▼B

	Раздел	Поле	Формат
45	Раздел 2в — Подробни данни за сделката	Дата на предсрочно прекратяване	Формат на датата съгласно ISO 8601 и UTC — ГГГГ-ММ-ДД.
46	Раздел 2в — Подробни данни за сделката	Крайна договорна дата за сетълмент	Формат на датата съгласно ISO 8601 и UTC — ГГГГ-ММ-ДД.
47	Раздел 2в — Подробни данни за сделката	Вид на доставката	4 буквени знака: CASH = уреждане с парични средства PHYS = уреждане с физическа доставка OPTL = по избор на контрагента или определено от трета страна
48	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Цена	— Ако цената е изразена като парична стойност — всяка стойност до 18 цифрови знака, в т.ч. до 13 цифри след десетичния знак. Ако стойността е по-дълга от 13 цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. — Ако цената е изразена като процент — всяка стойност до 11 цифрови знака, в т.ч. до 10 цифри след десетичния знак, изразена като процент (напр. 2,57 вместо 2,57 %). Ако стойността е по-дълга от 10 цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. 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.
49	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Валута на цената	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
	Полета 50—52 са повторяеми и се попълват при деривати, включващи графици за изменение на цената.		
50	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Некоригирана дата на влизане в сила на цената	Формат на датата съгласно ISO 8601 и UTC — ГГГГ-ММ-ДД.
51	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Некоригирана крайна дата на цената	Формат на датата съгласно ISO 8601 и UTC — ГГГГ-ММ-ДД.
52	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Цена в сила между некоригираната дата на влизане в сила и крайната дата	— Ако цената е изразена като парична стойност — всяка стойност до 18 цифрови знака, в т.ч. до 13 цифри след десетичния знак. Ако стойността е по-дълга от 13 цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре.

▼B

	Раздел	Поле	Формат
			— Ако цената е изразена като процент — всяка стойност до 11 цифрови знака, в т.ч. до 10 цифри след десетичния знак, изразена като процент (напр. 2,57 вместо 2,57 %). Ако стойността е по-дълга от 10 цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. 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.
53	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Цена на пакетна сделка	— Ако цената по пакетна сделка е изразена като парична стойност — всяка стойност до 18 цифрови знака, в т.ч. до 13 цифри след десетичния знак. Ако стойността е по-дълга от 13 цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. — Ако цената по пакетна сделка е изразена като процент — всяка стойност до 11 цифрови знака, в т.ч. до 10 цифри след десетичния знак, изразена като процент (напр. 2,57 вместо 2,57 %). Ако стойността е по-дълга от 10 цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. 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.
54	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Валута на цената на пакетна сделка	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
55	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Условна стойност на рамо 1	Всяка стойност, по-голяма или равна на нула, до 25 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Ако стойността е по-дълга от пет цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка.
56	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Условна валута 1	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
	Полета 57—59 са повторяеми и се попълват при деривати, включващи графици за изменение на условната стойност.		

▼B

	Раздел	Поле	Формат
57	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Дата на влизане в сила на условната стойност на рамо 1	Формат на датата съгласно ISO 8601 и UTC — ГГГГ-ММ-ДД.
58	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Крайна дата на условната стойност на рамо 1	Формат на датата съгласно ISO 8601 и UTC — ГГГГ-ММ-ДД.
59	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Условна стойност в сила на свързаната дата на влизане в сила на рамо 1	Всяка стойност, по-голяма или равна на нула, до 25 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Ако стойността е по-дълга от пет цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка.
60	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Общо условно количество по рамо 1	Всяка стойност, по-голяма или равна на нула, до 25 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Ако стойността е по-дълга от пет цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка.
	Полета 61—63 са повторяеми и се попълват при деривати, включващи графици за изменение на условното количество		
61	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Дата на влизане в сила на условното количество по рамо 1	Формат на датата съгласно ISO 8601 и UTC — ГГГГ-ММ-ДД.
62	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Крайна дата на условното количество по рамо 1	Формат на датата съгласно ISO 8601 и UTC — ГГГГ-ММ-ДД.
63	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Условно количество в сила на свързаната дата на влизане в сила на рамо 1	Всяка стойност, по-голяма или равна на нула, до 25 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Ако стойността е по-дълга от пет цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка.

▼B

	Раздел	Поле	Формат
64	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Условна стойност на рамо 2	Всяка стойност, по-голяма или равна на нула, до 25 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Ако стойността е по-дълга от пет цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка.
65	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Условна валута 2	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
	Полета 66—68 са повторяеми и се попълват при деривати, включващи графици на изменение на условната стойност		
66	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Дата на влизане в сила на условната стойност на рамо 2	Формат на датата съгласно ISO 8601 и UTC — ГГГГ-ММ-ДД.
67	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Крайна дата на условната стойност на рамо 2	Формат на датата съгласно ISO 8601 и UTC — ГГГГ-ММ-ДД.
68	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Условна стойност в сила на свързаната дата на влизане в сила на рамо 2	Всяка стойност, по-голяма или равна на нула, до 25 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Ако стойността е по-дълга от пет цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка.
69	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Общо условно количество по рамо 2	Всяка стойност, по-голяма или равна на нула, до 25 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Ако стойността е по-дълга от пет цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка.
	Полета 70—72 са повторяеми и се попълват при деривати, включващи графици за изменение на условното количество		

▼B

	Раздел	Поле	Формат
70	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Дата на влизане в сила на условното количество по рамо 2	Формат на датата съгласно ISO 8601 и UTC — ГГГГ-ММ-ДД.
71	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Крайна дата на условното количество по рамо 2	Формат на датата съгласно ISO 8601 и UTC — ГГГГ-ММ-ДД.
72	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Условно количество в сила на свързаната дата на влизане в сила на рамо 2	Всяка стойност, по-голяма или равна на нула, до 25 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Ако стойността е по-дълга от пет цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка.
	Част от полета 73—78 е повторяема.		
73	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Вид на друго плащане	4 буквени знака: UFRO = Предварително плащане, т.е. първоначалното плащане, извършено от един от контрагентите, за да се приведе сделката към справедлива стойност или поради други обстоятелства, които може да бъдат причина за извънпазарна сделка. UWIN = закриване или пълно прекратяване на позицията, т.е. окончателното плащане по сетълмента, извършено при приключване на сделката преди крайната ѝ дата; Плащания, които може да са резултат от пълното прекратяване на дериватната(ите) сделка(и) PEXH = Размяна на главница, т.е. размяна на условни стойности за кръстосани валутни суапове
74	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Сума на друго плащане	До 25 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Ако стойността е по-дълга от пет цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка. Разрешена е всяка стойност, по-голяма или равна на нула.
75	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Валута на друго плащане	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
76	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Дата на друго плащане	Формат на датата съгласно ISO 8601 и UTC — ГГГГ-ММ-ДД.

▼B

	Раздел	Поле	Формат
77	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Платец по друго плащане	— Идентификационен код на правния субект (ИКПС) по ISO 17442, 20 буквено-цифрени знака, който е включен в данните за ИКПС, публикувани от Световната фондация за ИКПС или код с до 72 буквено-цифрени знака за физически лица, действащи в качеството си на частни лица, които не отговарят на условията за издаване на ИКПС съгласно изявлението на РНК. Кодът, идентифициращ физическо лице, се състои от ИКПС на контрагент 1, последван от единен идентификационен код, определен и поддържан последователно от контрагент 1 за това физическо лице/тези физически лица за целите на регулаторната отчетност.
78	Раздел 2ж — Подробни данни за сделката	Получател на друго плащане	— Идентификационен код на правния субект (ИКПС) по ISO 17442, 20 буквено-цифрени знака, който е включен в данните за ИКПС, публикувани от Световната фондация за ИКПС или код с до 72 буквено-цифрени знака за физически лица, действащи в качеството си на частни лица, които не отговарят на условията за издаване на ИКПС съгласно изявлението на РНК. Кодът, идентифициращ физическо лице, се състои от ИКПС на контрагент 1, последван от единен идентификационен код, определен и поддържан последователно от контрагент 1 за това физическо лице/тези физически лица за целите на регулаторната отчетност.
79	Раздел 2з — Лихвени проценти	Фиксиран лихвен процент по рамо 1 или купон	Положителни и отрицателни стойности, до 11 цифрови знака, в т.ч. до 10 цифри след десетичния знак, изразени като процент (напр. 2,57 вместо 2,57 %). 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.
80	Раздел 2з — Лихвени проценти	Конвенция за отчитане на дните за фиксирания лихвен процент или купона по рамо 1	4 буквено-цифрени знака: A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule

▼B

	Раздел	Поле	Формат
			A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364 A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = Narrative
81	Раздел 2з — Лихвени проценти	Периодичност на плащанията на фиксирания лихвен процент или купона по рамо 1	4 буквени знака: DAIL = дневно WEEK = седмично MNTH = месечно YEAR = годишно ADHO = *ad hoc*, което се прилага, когато плащанията са нередовни. EXPI = плащане на падежа
82	Раздел 2з — Лихвени проценти	Множител на периодичността на плащанията на фиксирания лихвен процент или на купона по рамо 1	Всяка целочислена стойност, по-голяма или равна на нула, до 3 цифрови знака
83	Раздел 2з — Лихвени проценти	Идентификационен код на плаващия лихвен процент по рамо 1	Ако плаващият лихвен процент има ISIN, кодът ISIN за този лихвен процент.
84	Раздел 2з — Лихвени проценти	Обозначение за плаващия лихвен процент по рамо 1	Посочване на индекса, от който зависи плаващият лихвен процент 4 буквени знака: ESTR = €STR SONA = SONIA SOFR = SOFR 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

▼B

	Раздел	Поле	Формат
			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 EFFR = Effective Federal Funds Rate OBFR = Overnight Bank Funding Rate CZNA = CZEONIA
85	Раздел 2з — Лихвени проценти	Наименование на плаващия лихвен процент по рамо 1	До 50 буквено-цифрени знака Разрешени са специални символи, ако те са част от пълното наименование на индекса.
86	Раздел 2з — Лихвени проценти	Конвенция за отчитане на дните за плаващ лихвен процент по рамо 1	4 буквено-цифрени знака A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364

▼B

	Раздел	Поле	Формат
			A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = Narrative
87	Раздел 2з — Лихвени проценти	Периодичност на плащанията на плаващ лихвен процент по рамо 1	4 буквени знака: DAIL = дневно WEEK = седмично MNTH = месечно YEAR = годишно ADHO = *ad hoc*, което се прилага, когато плащанията са нередовни. EXPI = плащане на падежа
88	Раздел 2з — Лихвени проценти	Множител на периодичността на плащанията на плаващия лихвен процент по рамо 1	Всяка целочислена стойност, по-голяма или равна на нула, до 3 цифрови знака
89	Раздел 2з — Лихвени проценти	Референтен период на плаващия лихвен процент по рамо 1 — период	4 буквени знака: DAIL = дневно WEEK = седмично MNTH = месечно YEAR = годишно ADHO = *ad hoc*, което се прилага, когато плащанията са нередовни. EXPI = плащане на падежа
90	Раздел 2з — Лихвени проценти	Множител на референтния период на плаващия лихвен процент по рамо 1	Всяка целочислена стойност, по-голяма или равна на нула, до 3 цифрови знака
91	Раздел 2з — Лихвени проценти	Периодичност на преразглеждането на плаващия лихвен процент по рамо 1	4 буквени знака: DAIL = дневно WEEK = седмично MNTH = месечно YEAR = годишно ADHO = *ad hoc*, което се прилага, когато плащанията са нередовни. EXPI = плащане на падежа
92	Раздел 2з — Лихвени проценти	Множител на периодичността на преразглеждане на плаващия лихвен процент по рамо 1	Всяка целочислена стойност, по-голяма или равна на нула, до 3 цифрови знака

▼B

	Раздел	Поле	Формат
93	Раздел 2з — Лихвени проценти	Спред по рамо 1	— Ако спредът е изразен като парична стойност — всяка стойност до 18 цифрови знака, в т.ч. до 13 цифри след десетичния знак. — Ако спредът е изразен като процент — всяка стойност до 11 цифрови знака, в т.ч. до 10 цифри след десетичния знак, изразена като процент (напр. 2,57 вместо 2,57 %). — Ако спредът е изразен в базисни пунктове — всяка целочислена стойност до 5 цифрови знака, изразена в базисни пунктове (напр. 257 вместо 2,57 %).
94	Раздел 2з — Лихвени проценти	Валута на спреда по рамо 1	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
95	Раздел 2з — Лихвени проценти	Фиксиран лихвен процент по рамо 2	Положителни и отрицателни стойности, до 11 цифрови знака, в т.ч. до 10 цифри след десетичния знак, изразени като процент (напр. 2,57 вместо 2,57 %). 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.
96	Раздел 2з — Лихвени проценти	Конвенция за отчитане на дните за фиксиран лихвен процент по рамо 2	4 буквено-цифрени знака A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364 A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = Narrative

▼B

	Раздел	Поле	Формат
97	Раздел 2з — Лихвени проценти	Периодичност на плащанията на фиксиран лихвен процент по рамо 2	4 буквени знака: DAIL = дневно WEEK = седмично MNTH = месечно YEAR = годишно ADHO = *ad hoc*, което се прилага, когато плащанията са нередовни. EXPI = плащане на падежа
98	Раздел 2з — Лихвени проценти	Множител на периодичността на плащанията на фиксирания лихвен процент по рамо 2	Всяка целочислена стойност, по-голяма или равна на нула, до 3 цифрови знака
99	Раздел 2з — Лихвени проценти	Идентификационен код на плаващия лихвен процент по рамо 2	Ако плаващият лихвен процент има ISIN, кодът ISIN за този лихвен процент.
100	Раздел 2з — Лихвени проценти	Обозначение за плаващия лихвен процент по рамо 2	Посочване на индекса, от който зависи плаващият лихвен процент 4 буквени знака: ESTR = €STR SONA = SONIA SOFR = SOFR 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

▼B

	Раздел	Поле	Формат
			WIBO = WIBOR TREA = Treasury SWAP = SWAP FUSW = Future SWAP EFFR = Effective Federal Funds Rate OBFR = Overnight Bank Funding Rate CZNA = CZEONIA
101	Раздел 2з — Лихвени проценти	Наименование на плаващия лихвен процент по рамо 2	До 50 буквено-цифрени знака Разрешени са специални символи, ако те са част от пълното наименование на индекса.
102	Раздел 2з — Лихвени проценти	Конвенция за отчитане на дните за плаващия лихвен процент по рамо 2	4 буквено-цифрени знака A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364 A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = Narrative
103	Раздел 2з — Лихвени проценти	Периодичност на плащанията на плаващия лихвен процент по рамо 2	4 буквени знака: DAIL = дневно WEEK = седмично MNTH = месечно YEAR = годишно ADHO = *ad hoc*, което се прилага, когато плащанията са нередовни. EXPI = плащане на падежа

▼B

	Раздел	Поле	Формат
104	Раздел 2з — Лихвени проценти	Множител на периодичността на плащанията на плаващия лихвен процент по рамо 2	Всяка целочислена стойност, по-голяма или равна на нула, до 3 цифрови знака
105	Раздел 2з — Лихвени проценти	Референтен период на плаващия лихвен процент по рамо 2 — период	4 буквени знака: DAIL = дневно WEEK = седмично MNTH = месечно YEAR = годишно ADHO = *ad hoc*, което се прилага, когато плащанията са нередовни. EXPI = плащане на падежа
106	Раздел 2з — Лихвени проценти	Множител на референтния период на плаващия лихвен процент по рамо 2	Всяка целочислена стойност, по-голяма или равна на нула, до 3 цифрови знака
107	Раздел 2з — Лихвени проценти	Периодичност на преразглеждането на плаващия лихвен процент по рамо 2	4 буквени знака: DAIL = дневно WEEK = седмично MNTH = месечно YEAR = годишно ADHO = *ad hoc*, което се прилага, когато плащанията са нередовни. EXPI = плащане на падежа
108	Раздел 2з — Лихвени проценти	Множител на периодичността на преразглеждане на плаващия лихвен процент по рамо 2	Всяка целочислена стойност, по-голяма или равна на нула, до 3 цифрови знака
109	Раздел 2з — Лихвени проценти	Спред по рамо 2	— Ако спредът е изразен като парична стойност — всяка стойност до 18 цифрови знака, в т.ч. до 13 цифри след десетичния знак. — Ако спредът е изразен като процент — всяка стойност до 11 цифрови знака, в т.ч. до 10 цифри след десетичния знак, изразена като процент (напр. 2,57 вместо 2,57 %). — Ако спредът е изразен в базисни пунктове — всяка целочислена стойност до 5 цифрови знака, изразена в базисни пунктове (напр. 257 вместо 2,57 %).
110	Раздел 2з — Лихвени проценти	Валута на спреда по рамо 2	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака

▼B

	Раздел	Поле	Формат
111	Раздел 2з — Лихвени проценти	Спред на пакетна сделка	— Ако спредът по пакетна сделка е изразен като парична стойност — положителна и отрицателна стойност до 18 цифрови знака, в т.ч. до 13 цифри след десетичния знак. Ако стойността е по-дълга от 13 цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. — Ако спредът по пакетна сделка е изразен като процент — положителна и отрицателна стойност до 11 цифрови знака, в т.ч. до 10 цифри след десетичния знак, изразена като процент (напр. 2,57 вместо 2,57 %). Ако стойността е по-дълга от 10 цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. — Ако спредът по пакетна сделка е изразен в базисни пунктове — всяка целочислена стойност до 5 цифрови знака, изразена в базисни пунктове (напр. 257 вместо 2,57 %). 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.
112	Раздел 2з — Лихвени проценти	Валута на спреда на пакетна сделка	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
113	Раздел 2и — Чуждестранна валута	Валутен курс 1	Всяка стойност, по-голяма от нула, до 18 цифри, в т.ч. до 13 цифри след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка.
114	Раздел 2и — Чуждестранна валута	Форуърден валутен курс	Всяка стойност, по-голяма от нула, до 18 цифри, в т.ч. до 13 цифри след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка.
115	Раздел 2и — Чуждестранна валута	База на валутния курс	7 знака, представляващи два кода на валути по ISO 4217, разделени от “/” без ограничения в подреждането на валутните двойки. Първият код на валутата обозначава единицата от базовата валута, а вторият код — котираната валута.
116	Раздел 2й — Стоки и квоти за емисии (Общо)	Основен продукт	Допускат се само стойностите от колона „Основен продукт“ на класификационната таблица на стоковите деривати.
117	Раздел 2й — Стоки и квоти за емисии (Общо)	Подпродукт	Допускат се само стойностите от колона „Подпродукт“ на класификационната таблица на стоковите деривати.

▼B

	Раздел	Поле	Формат
118	Раздел 2й — Стоки и квоти за емисии (Общо)	Допълнителен подпродукт	Допускат се само стойностите от колона „Допълнителен подпродукт“ на класификационната таблица на стоковите деривати.
119	Раздел 2к — Стоки и квоти за емисии (Енергийни продукти)	Място или зона на доставката	Код по системата за идентифициране на енергийните продукти (EIC код), 16 буквено-цифрени знака Повтарящо се поле.
120	Раздел 2к — Стоки и квоти за емисии (Енергийни продукти)	Точка на взаимно свързване	Код по системата за идентифициране на енергийните продукти (EIC код), 16 буквено-цифрени знака
121	Раздел 2к — Стоки и квоти за емисии (Енергийни продукти)	Вид на товара	BSLD = базов товар PKLD = върхов товар OFFP = извънвърхов товар HABH = час/почасови блокове SHPD = времеви профил GASD = газоден OTHR = други
	Част от полета 122—131 е повторяема.		
122	Раздел 2к — Стоки и квоти за емисии (Енергийни продукти)	Начален момент на интервала на доставка	чч:мм:ссZ
123	Раздел 2к — Стоки и квоти за емисии (Енергийни продукти)	Краен момент на интервала на доставка	чч:мм:ссZ
124	Раздел 2к — Стоки и квоти за емисии (Енергийни продукти)	Начална дата на доставка	Формат на датата съгласно ISO 8601 — ГГГГ-ММ-ДД.
125	Раздел 2к — Стоки и квоти за емисии (Енергийни продукти)	Крайна дата на доставка	Формат на датата съгласно ISO 8601 — ГГГГ-ММ-ДД.
126	Раздел 2к — Стоки и квоти за емисии (Енергийни продукти)	Продължителност	MNUT = минути HOUR = час DASD = ден WEEK = седмица MNTH = месец QURT = тримесечие SEAS = сезон YEAR = годишен OTHR = други

▼B

	Раздел	Поле	Формат
127	Раздел 2к — Стоки и квоти за емисии (Енергийни продукти)	Дни от седмицата	WDAY = работни дни WEND = уикенд MOND = понеделник TUED = вторник WEDD = сряда THUD = четвъртък FRID = петък SATD = събота SUND = неделя XBHL — без официалните неработни дни IBHL — включително официалните неработни дни Разрешени са повече от една стойности
128	Раздел 2к — Стоки и квоти за емисии (Енергийни продукти)	Капацитет за доставка	До 20 цифри, 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.
129	Раздел 2к — Стоки и квоти за емисии (Енергийни продукти)	Мерна единица на количеството	KWAT = KW KWHH = KWh/h KWHD = KWh/d MWAT = MW MWHH = MWh/h MWHD = MWh/d GWAT = GW GWHH = GWh/h GWHD = GWh/d THMD = Therm/d KTMD = Ktherm/d MTMD = Mtherm/d CMPD = cm/d MCMD = mcm/d BTUD = Btu/d MBTD = MMBtu/d MJDD = MJ/d HMJD = 100MJ/d MMJD = MMJ/d GJDD = GJ/d
130	Раздел 2к — Стоки и квоти за емисии (Енергийни продукти)	Цена за количество 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.

▼B

	Раздел	Поле	Формат
131	Раздел 2к — Стоки и квоти за емисии (Енергийни продукти)	Валута на цената за количество за времеви интервали	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
132	Раздел 2л — Опции	Вид на опцията	4 буквени знака: PUTO = пут опция (опция за продажба) CALL = кол опция (опция за покупка) OTHR = когато не може да се определи дали опцията е кол или пут
133	Раздел 2л — Опции	Тип на опцията	4 буквени знака: AMER = американска BERM = бермудска EURO = европейска
134	Раздел 2л — Опции	Цена на упражняване	— Ако цената на упражняване е изразена като парична стойност: всяка стойност до 18 цифрови знака, в т.ч. до 13 цифри след десетичния знак (напр. 6,39 USD, изразено като 6,39), за опции върху акции, стокови опции, валутни опции и подобни продукти. Ако стойността е по-дълга от 13 цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. — Ако цената на упражняване е изразена като процент: всяка стойност до 11 числови знака, в т.ч. до 10 цифри след десетичния знак, изразена като процент (напр. 2,1 вместо 2,1 %), за лихвени опции, лихвени и кредитни суапции, котирани чрез спред, и подобни продукти. 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.
	Полета 135—137 са повторяеми и се попълват при деривати, включващи графици за изменение на цената на упражняване.		
135	Раздел 2л — Опции	Дата на влизане в сила на цената на упражняване	Формат на датата съгласно ISO 8601 и UTC — ГГГГ-ММ-ДД.
136	Раздел 2л — Опции	Крайна дата на цената на упражняване	Формат на датата съгласно ISO 8601 и UTC — ГГГГ-ММ-ДД.

▼B

	Раздел	Поле	Формат
137	Раздел 2л — Опции	Цена на упражняване в сила на свързаната дата на влизане в сила	— Ако цената на упражняване е изразена като парична стойност: всяка стойност до 18 цифрови знака, в т.ч. до 13 цифри след десетичния знак (напр. 6,39 USD, изразено като 6,39), за опции върху акции, стокови опции, валутни опции и подобни продукти. Ако стойността е по-дълга от 13 цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. — Ако цената на упражняване е изразена като процент: всяка стойност до 11 числови знака, в т.ч. до 10 цифри след десетичния знак, изразена като процент (напр. 2,1 вместо 2,1 %), за лихвени опции, лихвени и кредитни суапции, котирани чрез спред, и подобни продукти. 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.
138	Раздел 2л — Опции	Валута/валутна двойка на цената на упражняване	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака или Валутни опции 7 знака, представляващи два кода на валути по ISO 4217, разделени от “/” без ограничения в подреждането на валутните двойки. Първият код на валутата обозначава базовата валута, а вторият код — котираната валута.
139	Раздел 2л — Опции	Размер на опционната премия	Всяка стойност, по-голяма или равна на нула, до 25 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Ако стойността е по-дълга от пет цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка.
140	Раздел 2л — Опции	Валута на опционната премия	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
141	Раздел 2л — Опции	Дата на плащане на опционната премия	Формат на датата съгласно ISO 8601 и UTC — ГГГГ-ММ-ДД.
142	Раздел 2и — Опции	Падеж на базовия актив	Формат на датата съгласно ISO 8601 и UTC — ГГГГ-ММ-ДД.

▼B

	Раздел	Поле	Формат
143	Раздел 2м — Кредитни деривати	Ранг	4 буквени знака: SNDB = Първостепенен дълг, като например първостепенен необезпечен дълг (корпоративен/ финансов сектор), държавни валутни дългови инструменти (сектор държавно управление), 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.
144	Раздел 2м — Кредитни деривати	Референтен субект	Код на държавата по ISO 3166 — двубуквен код на държавата или Код на държавата по ISO 3166-2 — двубуквен код на държавата, следван от тире „—“ и подразделение на кода на държавата с до 3 буквено-цифрени знака или Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442, 20 буквено-цифрени знака.
145	Раздел 2м — Кредитни деривати	Серия	Поле за цяло число с максимум 5 цифрови знака
146	Раздел 2м — Кредитни деривати	Версия	Поле за цяло число с максимум 5 цифрови знака
147	Раздел 2м — Кредитни деривати	Коефициент на индекса	Всяка стойност до 11 цифрови знака, в т.ч. до 10 цифри след десетичния знак, изразена като десетична дроб (например 0,05 вместо 5 %) между 0 и 1 (включително 0 и 1). Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка.
148	Раздел 2м — Кредитни деривати	Транш	Булева стойност: TRUE = на траншове FALSE = не е на траншове
149	Раздел 2м — Кредитни деривати	Начална точка на загуба по CDS индекс (индекс на суапове за кредитни деривати)	Всяка стойност до 11 цифрови знака, в т.ч. до 10 цифри след десетичния знак, изразена като десетична дроб (например 0,05 вместо 5 %) между 0 и 1 (включително 0 и 1). Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка.
150	Раздел 2м — Кредитни деривати	Крайна точка на загуба по CDS индекс (индекс на суапове за кредитни деривати)	Всяка стойност до 11 цифрови знака, в т.ч. до 10 цифри след десетичния знак, изразена като десетична дроб (например 0,05 вместо 5 %) между 0 и 1 (включително 0 и 1). Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка.

▼B

	Раздел	Поле	Формат
151	Раздел 2н — Промени в деривата	Вид действие	4 буквени знака: NEWT = нов MODI = промяна CORR = корекция TERM = прекратяване EROR = грешка REVI = възстановяване VALU = оценка POSC = компонент на позиция
152	Раздел 2н — Промени в деривата	Вид събитие	4 буквени знака: TRAD = сделка NOVA = встъпване COMP = PTRR ETRM = предсрочно прекратяване CLRG = клиринг EXER = упражняване ALOC = разпределяне CREV = кредитно събитие CORP = корпоративно събитие INCP = включване в позиция UPDT = актуализация
153	Раздел 2н — Промени в деривата	Дата на събитието	Формат на датата съгласно ISO 8601 и UTC — ГГГГ-ММ-ДД.
154	Раздел 2н — Промени в деривата	Равнище	4 буквени знака: TCTN = сделка PSTN = позиция

Таблица 3

	Раздел	Поле	Формат
1	Страни по деривата	Дата и час на отчета	Дата съгласно ISO 8601 във формат на координираното универсално време (UTC) ГГГГ-ММ-ДДТчч:мм:ссZ
2	Страни по деривата	Идентификационен код на подаващия отчета субект	Идентификационен код на правния субект (ИКПС) по ISO 17442, 20 буквено-цифрени знака, който е включен в данните за ИКПС, публикувани от Световната фондация за ИКПС.
3	Страни по деривата	Субект, отговорен за отчитането	Идентификационен код на правния субект (ИКПС) по ISO 17442, 20 буквено-цифрени знака, който е включен в данните за ИКПС, публикувани от Световната фондация за ИКПС. ИКПС трябва да бъде надлежно подновен в съответствие с условията на някое от акредитираните местни оперативни звена на Световната система за идентификационен код на правния субект.

▼B

	Раздел	Поле	Формат
4	Страни по деривата	Контрагент 1 (Отчитащ се контрагент)	Идентификационен код на правния субект (ИКПС) по ISO 17442, 20 буквено-цифрени знака, който е включен в данните за ИКПС, публикувани от Световната фондация за ИКПС. ИКПС трябва да бъде надлежно подновен в съответствие с условията на някое от акредитираните местни оперативни звена на Световната система за идентификационен код на правния субект.
5	Страни по деривата	Вид на идентификационния код на контрагент 2	Булева стойност: — TRUE — FALSE, за физически лица, които действат като частни лица, които не отговарят на условията за издаване на ИКПС съгласно изявлението на РНК.
6	Страни по деривата	Контрагент 2	— Идентификационен код на правния субект (ИКПС) по ISO 17442, 20 буквено-цифрени знака, който е включен в данните за ИКПС, публикувани от Световната фондация за ИКПС или код с до 72 буквено-цифрени знака за физически лица, действащи в качеството си на частни лица, които не отговарят на условията за издаване на ИКПС съгласно изявлението на РНК. Кодът, идентифициращ физическо лице, се състои от ИКПС на контрагент 1, последван от единен идентификационен код, определен и поддържан последователно от контрагент 1 за това физическо лице/тези физически лица за целите на регулаторната отчетност.
7	Обезпечение	Дата и час на обезпечението	Формат на датата съгласно ISO 8601. Формат на часа съгласно UTC ГГГГ-ММ-ДДТчч:мм:ссZ
8	Обезпечение	Обозначение за портфейла от обезпечения	Булева стойност: TRUE = обезпечен на база портфейл FALSE = не е част от портфейл
9	Обезпечение	Код на портфейла от обезпечения	До 52 буквено-цифрени знака. Не са разрешени специални знаци.
10	Обезпечение	UTI	До 52 буквено-цифрени знака — разрешени са само главните букви A—Z и цифрите 0—9
11	Обезпечение	Категория на обезпеченост	4 буквени знака: UNCL = необезпечен PRC1 = частично обезпечен: само контрагент 1 PRC2 = частично обезпечен: само контрагент 2 PRCL = частично обезпечен OWC1 = едностранно обезпечен: само контрагент 1

▼B

	Раздел	Поле	Формат
			OWC2 = едностранно обезпечен: само контрагент 2 OWP1 = едностранно/частично обезпечен: контрагент 1 OWP2 = едностранно/частично обезпечен: контрагент 2 FLCL = напълно обезпечен Попълва се в съответствие с член 5 от настоящия регламент.
12	Обезпечение	Първоначален маржин, предоставен от контрагент 1 (преди процентното намаление)	Всяка стойност, по-голяма или равна на нула, до 25 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Ако стойността е по-дълга от пет цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка.
13	Обезпечение	Първоначален маржин, предоставен от контрагент 1 (след процентното намаление)	Всяка стойност, по-голяма или равна на нула, до 25 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Ако стойността е по-дълга от пет цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка.
14	Обезпечение	Валута на предоставения първоначален маржин	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
15	Обезпечение	Вариационен маржин, предоставен от контрагент 1 (преди процентното намаление)	Всяка стойност, по-голяма или равна на нула, до 25 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Ако стойността е по-дълга от пет цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка.
16	Обезпечение	Вариационен маржин, предоставен от контрагент 1 (след процентното намаление)	Всяка стойност, по-голяма или равна на нула, до 25 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Ако стойността е по-дълга от пет цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка.
17	Обезпечение	Валута на предоставените вариационни маржини	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака

▼B

	Раздел	Поле	Формат
18	Обезпечение	Свръхобезпечение, предоставено от контрагент 1	Всяка стойност, по-голяма или равна на нула, до 25 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Ако стойността е по-дълга от пет цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка.
19	Обезпечение	Валута на предоставеното свръхобезпечение	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
20	Обезпечение	Първоначален маржин, събран от контрагент 1 (преди процентното намаление)	Всяка стойност, по-голяма или равна на нула, до 25 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Ако стойността е по-дълга от пет цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка.
21	Обезпечение	Първоначален маржин, събран от контрагент 1 (след процентното намаление)	Всяка стойност, по-голяма или равна на нула, до 25 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Ако стойността е по-дълга от пет цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка.
22	Обезпечение	Валута на събрания първоначален маржин	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
23	Обезпечение	Вариационен маржин, събран от контрагент 1 (преди процентното намаление)	Всяка стойност, по-голяма или равна на нула, до 25 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Ако стойността е по-дълга от пет цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка.
24	Обезпечение	Вариационен маржин, събран от контрагент 1 (след процентното намаление)	Всяка стойност, по-голяма или равна на нула, до 25 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Ако стойността е по-дълга от пет цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка.

▼B

	Раздел	Поле	Формат
25	Обезпечение	Валута на събрания вариационен маржин	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
26	Обезпечение	Свръхобезпечение, събрано от контрагент 1	Всяка стойност, по-голяма или равна на нула, до 25 цифрови знака, в т.ч. до 5 цифри след десетичния знак. Ако стойността е по-дълга от пет цифри след десетичния знак, отчитащите се контрагенти я закръглят нагоре. Десетичният знак не се брои като цифров знак. Ако е попълнен, се обозначава с точка.
27	Обезпечение	Валута на събраното свръхобезпечение	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
28	Обезпечение	Вид действие	MARU — актуализиране на маржина CORR — корекция
29	Обезпечение	Дата на събитието	Формат на датата съгласно ISO 8601 и UTC — ГГГГ-ММ-ДД.

Таблица 4

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
	„SOFT“ — нетрайни продукти	„CCOA“ — какао „ROBU“ — кафе, сорт 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	

▼B

Основен продукт	Подпродукт	Допълнителен подпродукт
	„SEAF“ — морски дарове	
	„LSTK“ — добитък	
	„GRIN“ — зърнено-житни продукти	„MWHT“ — мелничарско брашно „OTHR“ — други
	„OTHR“ — други	
„NRGY“ — енергийни продукти	„ELEC“ — електроенергия	„BSLD“ — базов товар „FITR“ — финансови права за пренос „PKLD“ — върхов товар „OFFP“ — извънвърхов товар „OTHR“ — други
	„NGAS“ — природен газ	„GASP“ — GASPOOL „LNGG“ — втечнен природен газ „NBPG“ — National Balancing Point (NBP) „NCGG“ — NetConnect Germany (NCG) „TTFG“ — „Title Transfer Facility“ (TTF) „OTHR“ — други
	„OILP“ — нефт	„BAKK“ — Bakken „BDSL“ — биодизел „BRNT“ — нефт, сорт Брент „BRNX“ — нефт, сорт Брент NX „CNDA“ — канадски „COND“ — кондензат „DSEL“ — дизел „DUBA“ — Дубай „ESPO“ — ESPO „ETHA“ — етанол „FUEL“ — гориво „FOIL“ — мазут „GOIL“ — газьол „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“ — нефт, сорт West Texas Intermediate (WTI) „OTHR“ — други

▼B

Основен продукт	Подпродукт	Допълнителен подпродукт
	„COAL“ — въглища „INRG“ — спредове между енергийни продукти (inter-energy) „RNNG“ — възобновяема енергия „LGHT“ — леки дестилати „DIST“ — дестилати „OTHR“ — други	
„ENVR“ — околна среда	„EMIS“ — емисии	„CERE“ — CER (сертифицирана единица редуцирани емисии) „ERUE“ — ERU (единица намаление на емисии) „EUAE“ — EUA (емисионна квота) „EUAA“ — EUA (квота за авиационни емисии) „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	
„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

▼B

Основен продукт	Подпродукт	Допълнителен подпродукт
		„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“ — други деривати C10, както е определено в таблица 10.1 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).