KOMISIJOS ĮGYVENDINIMO REGLAMENTAS (ES) 2017/105

2016 m. spalio 19 d.

kuriuo iš dalies keičiamas Įgyvendinimo reglamentas (ES) Nr. 1247/2012, kuriuo nustatomi pranešimų apie sandorius, teikiamų sandorių duomenų saugykloms pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (ES) Nr. 648/2012 dėl ne biržos išvestinių finansinių priemonių, pagrindinių sandorio šalių ir sandorių duomenų saugyklų, formato ir dažnumo techniniai įgyvendinimo standartai

(Tekstas svarbus EEE)

EUROPOS KOMISIJA,

atsižvelgdama į Sutartį dėl Europos Sąjungos veikimo,

atsižvelgdama į 2012 m. liepos 4 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (ES) Nr. 648/2012 dėl ne biržos išvestinių finansinių priemonių, pagrindinių sandorio šalių ir sandorių duomenų saugyklų ([1]), ypač į jo 9 straipsnio 6 dalį,

kadangi:

(1) Komisijos įgyvendinimo reglamentu (ES) Nr. 1247/2012 ([2]) numatomas laikinų subjekto identifikatorių naudojimas, jei nėra juridinio asmens identifikatoriaus. Pastaruoju metu atsirado infrastruktūra, sudaranti sąlygas subjektams priskirti juridinio asmens identifikatorius, o rinkos dalyviai įprato naudoti tokius juridinio asmens identifikatorius. Todėl dabar juridinio asmens identifikatoriai turėtų būti vienintelė leistina juridinių asmenų identifikavimo priemonė;

(2) nustatyti, ar pranešimą teikianti sandorio šalis yra pirkėjas, ar pardavėjas, itin sudėtinga apsikeitimo sandorių išvestinių finansinių priemonių sutarčių atveju, nes tokios sutartys apima apsikeitimą finansinėmis priemonėmis tarp šalių. Todėl siekiant užtikrinti, kad būtų tiksliai ir nuosekliai nustatoma, kas yra pardavėjai ir kas yra pirkėjai apsikeitimo sandorių išvestinių finansinių priemonių sutarčių atveju, reikėtų nustatyti konkrečias taisykles;

(3) siekiant nustatyti realias sandorio šalių pozicijas, kompetentingoms institucijoms reikia išsamios ir tikslios informacijos apie įkaitą, kuriuo tos sandorio šalys apsikeičia. Taigi, reikėtų nustatyti konkrečias taisykles, kuriomis būtų užtikrinamas nuoseklus požiūris į pranešimą apie tam tikros išvestinių finansinių priemonių sutarties ar portfelio užtikrinimą įkaitu;

(4) tikslus išvestinių finansinių priemonių klasifikavimas ir identifikavimas labai svarbus norint veiksmingai naudoti duomenis ir prasmingai agreguoti įvairių sandorių duomenų saugyklų duomenis, todėl jis padeda siekti Finansinio stabilumo tarybos tikslų, nustatytų 2014 m. rugsėjo 19 d. paskelbtoje Ne biržos išvestinių finansinių priemonių sandorių duomenų saugyklų duomenų agregavimo galimybių studijoje ([3]). Todėl reikėtų iš dalies pakeisti pranešimų teikimo reikalavimus, susijusius su išvestinių finansinių priemonių klasifikavimu ir identifikavimu, kad visa ši informacija būtų prieinama kompetentingoms institucijoms;

(5) siekiant sudaryti sąlygas pranešti apie naujų rūšių išvestinių finansinių priemonių sutartis, kurios dėl finansinių inovacijų tapo prieinamos ir kuriomis dažnai prekiaujama, į išvestinių finansinių priemonių sutarčių klasių sąrašą reikėtų įtraukti pasirinkimo sandorius dėl apsikeitimo sandorių (angl. *swaptions*) ir skirtumo lažybas (angl. *spreadbets*). Žvelgiant plačiau ir turint omenyje vykstančias finansines inovacijas, dėl kurių atsiranda naujų rūšių išvestinių finansinių priemonių sutarčių, svarbu užtikrinti, kad apie bet kurių naujų rūšių išvestinių finansinių priemonių sutartis, nepatenkančias į esamą klasifikaciją, vis tiek būtų pranešama. Todėl tikslinga išvestinių finansinių priemonių sutarčių rūšių klasifikacijoje palikti kategoriją „kita“;

(6) jei dvi sandorio šalys nesutaria, kuri iš jų iki numatyto pranešimų teikimo termino turėtų sugeneruoti unikalų sandorio identifikatorių, gali būti neįmanoma teisingai identifikuoti ir susieti du pranešimus, susijusius su tuo pačiu sandoriu. Todėl būtina nustatyti unikalių sandorio identifikatorių sugeneravimo kriterijus, kad tas pats sandoris nebūtų užskaitomas du kartus;

([1]) OL L 201, 2012 7 27, p. 1.
([2]) 2012 m. gruodžio 19 d. Komisijos įgyvendinimo reglamentas (ES) Nr. 1247/2012, kuriuo nustatomi pranešimų apie sandorius, teikiamų sandorių duomenų saugykloms pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (ES) Nr. 648/2012 dėl ne biržos išvestinių finansinių priemonių, pagrindinių sandorio šalių ir sandorių duomenų saugyklų, formato ir dažnumo techniniai įgyvendinimo standartai (OL L 352, 2012 12 21, p. 20).
([3]) http://www.fsb.org/wp-content/uploads/r_140919.pdf.

(7) sandorio šalims gali būti gana sunku gauti visą svarbią informaciją, susijusią su sandoriais, kurie nutraukti iki pranešimų teikimo pradžios datos. Turint omenyje tai, kad dėl to sudėtinga pranešti apie nutrauktus sandorius ir kad dėl tokių sandorių sisteminė rizika nedidėja, pranešimo apie nutrauktus sandorius laikotarpis turėtų būti pratęstas nuo 3 iki 5 metų nuo pranešimų teikimo pradžios datos;

(8) siekiant užtikrinti visišką duomenų, pateiktų sandorių duomenų saugykloms, suderinimą ir kartu jų nuoseklų interpretavimą ir agregavimą, reikėtų paaiškinti teikiant pranešimus apie sandorius taikytinus standartus ir formatus. Taip pat tikslinga iš dalies pakeisti pranešimų teikimo reikalavimus dėl duomenų formatų. Todėl sandorio šalims ir sandorių duomenų saugykloms reikėtų suteikti pakankamai laiko imtis visų veiksmų, būtinų siekiant laikytis iš dalies pakeistų reikalavimų;

(9) todėl Įgyvendinimo reglamentas (ES) Nr. 1247/2012 turėtų būti atitinkamai iš dalies pakeistas;

(10) šis reglamentas grindžiamas Europos vertybinių popierių ir rinkų institucijos (EVPRI) Komisijai pateiktais techninių įgyvendinimo standartų projektais;

(11) pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 1095/2010 ([1]) 15 straipsnį EVPRI surengė atviras viešas konsultacijas dėl tokių techninių įgyvendinimo standartų projektų, išnagrinėjo galimas susijusias sąnaudas ir naudą ir paprašė, kad to reglamento 37 straipsnyje nurodyta Vertybinių popierių ir rinkų suinteresuotųjų subjektų grupė pateiktų savo nuomonę,

PRIĖMĖ ŠĮ REGLAMENTĄ:

1 straipsnis

Įgyvendinimo reglamentas (ES) Nr. 1247/2012 iš dalies keičiamas taip:

1) 3 straipsnis pakeičiamas taip:

„3 straipsnis

Sandorio šalių ir kitų subjektų identifikavimas

Pranešime naudojamas juridinio asmens identifikatorius, siekiant identifikuoti:

a) naudos gavėją, kuris yra juridinis asmuo;

b) maklerio įmonę;

c) pagrindinę sandorio šalį;

d) tarpuskaitos narį;

e) sandorio šalį, kuri yra juridinis asmuo;

f) pranešimą teikiantį subjektą.“

2) Įterpiami šie 3a ir 3b straipsniai:

„3a straipsnis

Sandorio šalies pobūdis

1. Priedo 1 lentelės 14 laukelyje nurodytos išvestinių finansinių priemonių sutarties sandorio šalies pobūdis yra nustatomas pagal 2–10 dalis.

2. Pasirinkimo sandorių ir pasirinkimo sandorių dėl apsikeitimo sandorių atveju sandorio šalis, turinti teisę vykdyti pasirinkimo sandorį, yra identifikuojama kaip pirkėjas, o sandorio šalis, kuri parduoda pasirinkimo sandorį ir gauna priedą, yra identifikuojama kaip pardavėjas.

([1]) 2010 m. lapkričio 24 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 1095/2010, kuriuo įsteigiama Europos priežiūros institucija (Europos vertybinių popierių ir rinkų institucija) ir iš dalies keičiamas Sprendimas Nr. 716/2009/EB bei panaikinamas Komisijos sprendimas 2009/77/EB (OL L 331, 2010 12 15, p. 84).

3. Ateities ir išankstinių sandorių atveju, išskyrus su valiutomis susijusius ateities ir išankstinius sandorius, sandorio šalis, perkanti priemonę, yra identifikuojama kaip pirkėjas, o sandorio šalis, parduodanti priemonę, yra identifikuojama kaip pardavėjas.

4. Su vertybiniais popieriais susijusių apsikeitimo sandorių atveju sandorio šalis, kuriai tenka pagrindinio vertybinio popieriaus kainos kitimo rizika ir kuri gauna vertybinio popieriaus sumą, yra identifikuojama kaip pirkėjas, o sandorio šalis, sumokanti vertybinio popieriaus sumą, yra identifikuojama kaip pardavėjas.

5. Su palūkanų normomis arba infliacijos indeksais susijusių apsikeitimo sandorių atveju sandorio šalis, mokanti fiksuotąją normą, yra identifikuojama kaip pirkėjas, o sandorio šalis, gaunanti fiksuotąją normą, yra identifikuojama kaip pardavėjas. Valiutų pozicijų apsikeitimo sandorių atveju sandorio šalis, kuri moka pirkimo ir pardavimo kainų skirtumą, yra identifikuojama kaip pirkėjas, o sandorio šalis, kuri tą skirtumą gauna, yra identifikuojama kaip pardavėjas.

6. Skirtingų valiutų apsikeitimo sandorių ir apsikeitimo bei išankstinių sandorių, susijusių su valiutomis, atveju sandorio šalis, gaunanti valiutą, kurios kodas abėcėlės tvarka pagal Tarptautinės standartizacijos organizacijos (ISO 4217) standartą yra pirmas, yra identifikuojama kaip pirkėjas, o sandorio šalis, pateikianti tą valiutą, yra identifikuojama kaip pardavėjas.

7. Su dividendais susijusių apsikeitimo sandorių atveju sandorio šalis, gaunanti lygiaverčius faktinius dividendų mokėjimus, yra identifikuojama kaip pirkėjas, o sandorio šalis, mokanti dividendus ir gaunanti fiksuotąją normą, yra identifikuojama kaip pardavėjas.

8. Išskyrus pasirinkimo sandorius ir pasirinkimo sandorius dėl apsikeitimo sandorių, kredito rizikos perleidimo išvestinių finansinių priemonių atveju sandorio šalis, perkanti apsaugą, yra identifikuojama kaip pirkėjas, o sandorio šalis, parduodanti apsaugą, yra identifikuojama kaip pardavėjas.

9. Su biržos prekėmis susijusių išvestinių finansinių priemonių sandorių atveju sandorio šalis, gaunanti pranešime nurodytą biržos prekę, yra identifikuojama kaip pirkėjas, o sandorio šalis, pateikianti šią biržos prekę, yra identifikuojama kaip pardavėjas.

10. Išankstinių palūkanų normų sandorių atveju sandorio šalis, mokanti fiksuotąją normą, yra identifikuojama kaip pirkėjas, o sandorio šalis, gaunanti fiksuotąją normą, yra identifikuojama kaip pardavėjas.

3b straipsnis

Užtikrinimas įkaitu

1. Pranešimą teikianti sandorio šalis priedo 1 lentelės 21 laukelyje nurodyto išvestinių finansinių priemonių sutarties sandorio užtikrinimo įkaitu rūšį identifikuoja pagal 2–5 dalis.

2. Jei sandorio šalių susitarimo dėl įkaito nėra arba sandorio šalių susitarime dėl įkaito nustatyta, kad pranešimą teikianti sandorio šalis dėl išvestinių finansinių priemonių sutarties nepateikia nei pradinės, nei kintamosios garantinės įmokos, išvestinių finansinių priemonių sutarties užtikrinimo įkaitu rūšis identifikuojama kaip neužtikrinta.

3. Jei sandorio šalių susitarime dėl įkaito nustatyta, kad pranešimą teikianti sandorio šalis dėl išvestinių finansinių priemonių sutarties reguliariai pateikia tik kintamąsias garantines įmokas, išvestinių finansinių priemonių sutarties užtikrinimo įkaitu rūšis identifikuojama kaip iš dalies užtikrinta.

4. Jei sandorio šalių susitarime dėl įkaito nustatyta, kad pranešimą teikianti sandorio šalis dėl išvestinių finansinių priemonių sutarties pateikia pradinę garantinę įmoką ir reguliariai pateikia kintamąsias garantines įmokas ir kad kita sandorio šalis arba pateikia tik kintamąsias garantines įmokas, arba nepateikia jokių garantinių įmokų, išvestinių finansinių priemonių sutarties užtikrinimo įkaitu rūšis identifikuojama kaip užtikrinta viena kryptimi.

5. Jei sandorio šalių susitarime dėl įkaito nustatyta, kad abi sandorio šalys dėl išvestinių finansinių priemonių sutarties pateikia pradinę garantinę įmoką ir reguliariai pateikia kintamąsias garantines įmokas, išvestinių finansinių priemonių sutarties užtikrinimo įkaitu rūšis identifikuojama kaip visiškai užtikrinta.“

3) 4 straipsnis pakeičiamas taip:

„4 straipsnis

Išvestinių finansinių priemonių nurodymas, identifikavimas ir klasifikavimas

1. Pranešime išvestinė finansinė priemonė nurodoma remiantis sutarties rūšimi ir turto klase pagal 2 ir 3 dalis.

2. Išvestinė finansinė priemonė priedo 2 lentelės 1 laukelyje nurodoma kaip vienos iš toliau nurodytų sutarčių rūšių išvestinė finansinė priemonė:

a) finansinė sutartis dėl kainų skirtumų;

b) išankstinis palūkanų normų sandoris;

c) išankstinis sandoris;

d) ateities sandoris;

e) pasirinkimo sandoris;

f) skirtumo lažybos;

g) apsikeitimo sandoris;

h) pasirinkimo sandoris dėl apsikeitimo sandorių;

i) kita.

3. Išvestinė finansinė priemonė priedo 2 lentelės 2 laukelyje nurodoma kaip vienos iš toliau nurodytų turto klasių išvestinė finansinė priemonė:

a) biržos prekės ir apyvartiniai taršos leidimai;

b) kreditas;

c) valiuta;

d) akcijos;

e) palūkanų norma.

4. Jei išvestinės finansinės priemonės nepriklauso vienai iš 3 dalyje nurodytų turto klasių, sandorio šalys pranešime nurodo turto klasę, kuri panašiausia į išvestinę finansinę priemonę. Abi sandorio šalys nurodo tą pačią turto klasę.

5. Išvestinė finansinė priemonė priedo 2 lentelės 6 laukelyje identifikuojama naudojant toliau nurodytus elementus, jei jie yra:

a) atitinkamai tarptautinį vertybinių popierių identifikavimo numerį (ISIN kodą) pagal ISO 6166 standartą arba alternatyvaus priemonės identifikavimo (AII) kodą iki deleguotojo akto, kurį Komisija priėmė pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 600/2014 (*) 27 straipsnio 3 dalį, taikymo pradžios datos;

b) ISIN kodą nuo deleguotojo akto, kurį Komisija priėmė pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 27 straipsnio 3 dalį, taikymo pradžios datos.

Naudojant AII kodą, pateikiamas visas AII kodas.

6. 5 dalyje nurodytas visas AII kodas yra toliau nurodytų šešių elementų junginys:

a) prekybos vietos, kurioje prekiaujama išvestine finansine priemone, ISO 10383 rinkos identifikavimo kodas (MIC), nurodomas naudojant 4 raidinius skaitinius ženklus;

b) prekybos vietos priskirtas unikalus kodas, kuris skirtas konkrečiai pagrindinei finansinei priemonei ir atsiskaitymo rūšiai bei kitoms sutarties savybėms ir kuris nurodomas naudojant iki 12 raidinių skaitinių ženklų;

c) vienas ženklas, rodantis, ar finansinė priemonė yra pasirinkimo, ar ateities sandoris, nurodant „O“, kai tai yra pasirinkimo sandoris, ir „F“, kai tai yra ateities sandoris;

d) vienas ženklas, rodantis, ar pasirinkimo sandoris yra pardavimo, ar pirkimo pasirinkimo sandoris, nurodant „P“, kai tai yra pardavimo pasirinkimo sandoris, ir „C“, kai tai yra pirkimo pasirinkimo sandoris; jei finansinė priemonė identifikuojama kaip ateities sandoris pagal c punktą, ji nurodoma kaip „F“;

e) išvestinių finansinių priemonių sutarties vykdymo arba išpirkimo data, nurodyta naudojant ISO 8601 YYYY-MM-DD standartą;

f) pasirinkimo sandorio vykdymo kaina, nurodyta naudojant iki 19 skaitmenų, įskaitant ne daugiau kaip penkis skaitmenis po kablelio, be priekinių ar galinių nulių. Dešimtainės trupmenos skirtukas yra taškas. Neleidžiama įrašyti neigiamų verčių. Jei finansinė priemonė yra ateities sandoris, vykdymo kainos vietoje įrašomas nulis.

7. Priedo 2 lentelės 4 laukelyje išvestinės finansinės priemonės klasifikacija nurodoma naudojant ISO 10692 finansinių priemonių klasifikavimo (CFI) kodą, jei tai produktai, identifikuojami naudojant ISO 6166 ISIN kodą arba AII kodą.

8. Išvestinių finansinių priemonių, kurios neturi ISO 6166 ISIN kodo arba AII kodo, klasifikacija nurodoma naudojant priskirtą kodą. Tas kodas yra:

a) unikalus;

b) neutralus;

c) patikimas;

d) atviro šaltinio;

e) išplečiamas;

f) prieinamas;

g) gaunamas už pagrįstą kainą;

h) reglamentuojamas pagal tinkamą valdymo sistemą.

9. Kol 8 dalyje nurodytą kodą patvirtins EVPRI, išvestinių finansinių priemonių, kurios neturi ISO 6166 ISIN kodo arba AII kodo, klasifikacija nurodoma naudojant ISO 10692 CFI kodą.

(*) 2014 m. gegužės 15 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 600/2014 dėl finansinių priemonių rinkų, kuriuo iš dalies keičiamas Reglamentas (ES) Nr. 648/2012 (OL L 173, 2014 6 12, p. 84).“

4) Įterpiami šie 4a ir 4b straipsniai:

„4a straipsnis

Unikalus sandorio identifikatorius

1. Pranešimas identifikuojamas arba naudojant EVPRI patvirtintą pasaulinį unikalų sandorio identifikatorių arba, jei jo nėra, sandorio šalių sutartą unikalų sandorio identifikatorių.

2. Jei sandorio šalys nesusitaria, kuris subjektas atsakingas už unikalaus sandorio identifikatoriaus, kuris turi būti priskirtas pranešimui, sugeneravimą, sandorio šalys nustato, kuris subjektas atsakingas už unikalaus sandorio identifikatoriaus sugeneravimą, pagal šiuos kriterijus:

a) sandorių, kurie vykdomi ir kurių tarpuskaita vykdoma centralizuotai, atveju unikalų sandorio identifikatorių tarpuskaitos nariui tarpuskaitos momentu sugeneruoja pagrindinė sandorio šalis. Tarpuskaitos narys savo sandorio šaliai sugeneruoja dar vieną unikalų sandorio identifikatorių;

b) sandorių, kurie vykdomi centralizuotai, bet kurių tarpuskaita nėra vykdoma centralizuotai, atveju unikalų sandorio identifikatorių savo nariui sugeneruoja įvykdymo prekybos vieta;

c) sandorių, kurie tvirtinami ir kurių tarpuskaita vykdoma centralizuotai, atveju unikalų sandorio identifikatorių tarpuskaitos nariui tarpuskaitos momentu sugeneruoja pagrindinė sandorio šalis. Tarpuskaitos narys savo sandorio šaliai sugeneruoja dar vieną unikalų sandorio identifikatorių;

d) sandorių, kurie elektroninėmis priemonėmis tvirtinami centralizuotai, bet kurių tarpuskaita nėra vykdoma centralizuotai, atveju unikalų sandorio identifikatorių patvirtinimo metu sugeneruoja sandorio patvirtinimo sistema;

e) visų kitų sandorių, kurie nėra nurodyti a–d punktuose, atveju taikomos šios sąlygos:

i) jei finansų sandorio šalys prekiauja su ne finansų sandorio šalimis, unikalų sandorio identifikatorių sugeneruoja finansų sandorio šalys;

ii) jei tarpuskaitos ribą viršijančios ne finansų sandorio šalys prekiauja su tarpuskaitos ribos nesiekiančiomis ne finansų sandorio šalimis, unikalų sandorio identifikatorių sugeneruoja tos ne finansų sandorio šalys, kurios viršija tarpuskaitos ribą;

iii) visų kitų sandorių, kurie nėra nurodyti i–ii papunkčiuose, atveju unikalų sandorio identifikatorių sugeneruoja pardavėjas.

3. Sandorio šalis, kuri sugeneruoja unikalų sandorio identifikatorių, tą unikalų sandorio identifikatorių laiku praneša kitai sandorio šaliai, kad ši galėtų įvykdyti savo prievolę teikti pranešimus.

4b straipsnis

Įvykdymo vieta

Išvestinių finansinių priemonių sutarties įvykdymo vieta priedo 2 lentelės 15 laukelyje identifikuojama taip:

a) iki deleguotojo akto, kurį Komisija priėmė pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 27 straipsnio 3 dalį, taikymo pradžios datos:

i) Sąjungoje esančios įvykdymo vietos atveju – ISO 10383 rinkos identifikavimo kodas (MIC), paskelbtas EVPRI interneto svetainėje esančiame registre, sukurtame remiantis informacija, kurią kompetentingos institucijos teikia pagal Komisijos reglamento (EB) Nr. 1287/2006 (*) 13 straipsnio 2 dalį;

ii) ne Sąjungoje esančios įvykdymo vietos atveju – ISO 10383 rinkos identifikavimo kodas (MIC), įtrauktas į MIC kodų sąrašą, kurį tvarko ir atnaujina ISO ir kuris skelbiamas ISO interneto svetainėje;

b) nuo deleguotojo akto, kurį Komisija priėmė pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 27 straipsnio 3 dalį, taikymo pradžios datos – ISO 10383 MIC kodas.

(*) 2006 m. rugpjūčio 10 d. Komisijos reglamentas (EB) Nr. 1287/2006, įgyvendinantis Europos Parlamento ir Tarybos direktyvą 2004/39/EB dėl investicinėms įmonėms taikomų apskaitos dokumentų tvarkymo reikalavimų, informacijos apie sandorius pateikimo, rinkos skaidrumo, leidimų prekiauti finansinėmis priemonėmis ir toje direktyvoje apibrėžtų sąlygų (OL L 241, 2006 9 2, p. 1).“

5) 5 straipsnio 4 dalis pakeičiama taip:

„4. Sandorių duomenų saugyklai per penkerius metus nuo konkrečios išvestinių finansinių priemonių klasės pranešimų teikimo pradžios datos pranešama apie tą datą jau užbaigtas šias išvestinių finansinių priemonių sutartis:

a) išvestinių finansinių priemonių sutartis, kurios buvo sudarytos iki 2012 m. rugpjūčio 16 d. ir 2012 m. rugpjūčio 16 d. vis dar buvo neužbaigtos;

b) išvestinių finansinių priemonių sutartis, kurios buvo sudarytos 2012 m. rugpjūčio 16 d. ar vėliau.“

6) Priedas pakeičiamas šio reglamento priedo tekstu.

2 straipsnis

Šis reglamentas įsigalioja dvidešimtą dieną po jo paskelbimo *Europos Sąjungos oficialiajame leidinyje*.

Jis taikomas nuo 2017 m. lapkričio 1 d., išskyrus 1 straipsnio 5 punktą, kuris taikomas nuo įsigaliojimo datos.

Šis reglamentas privalomas visas ir tiesiogiai taikomas visose valstybėse narėse.

Priimta Briuselyje 2016 m. spalio 19 d.

Komisijos vardu
Pirmininkas
Jean-Claude JUNCKER

PRIEDAS

„PRIEDAS

1 lentelė

Sandorio šalių duomenys

	Laukelis	Formatas
	Sutarties šalys	
1	Pranešimo laiko žyma	ISO 8601 datos formatas ir suderintojo pasaulinio laiko (UTC) laiko formatas YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ
2	Pranešimą teikiančios sandorio šalies identifikatorius	ISO 17442 juridinio asmens identifikatorius (LEI), 20 raidinių skaitinių ženklų kodas.
3	Kitos sandorio šalies identifikatoriaus rūšis	„LEI“, kai teikiamas ISO 17442 juridinio asmens identifikatorius (LEI) „CLC“, kai teikiamas kliento kodas
4	Kitos sandorio šalies identifikatorius	ISO 17442 juridinio asmens identifikatorius (LEI), 20 raidinių skaitinių ženklų kodas. Kliento kodas (iki 50 raidinių skaitinių ženklų).
5	Kitos sandorio šalies valstybė	ISO 3166 šalies kodas iš 2 ženklų
6	Pranešimą teikiančios sandorio šalies įmonių sektorius	Finansų sandorio šalių taksonomija: A = draudimo įmonė, kuriai suteiktas veiklos leidimas pagal Europos Parlamento ir Tarybos direktyvą 2009/138/EB ([1]) C = kredito įstaiga, kuriai suteiktas veiklos leidimas pagal Europos Parlamento ir Tarybos direktyvą 2013/36/ES ([2]) F = investicinė įmonė, kuriai suteiktas veiklos leidimas pagal Europos Parlamento ir Tarybos direktyvą 2004/39/EB ([3]) I = draudimo įmonė, kuriai suteiktas veiklos leidimas pagal Direktyvą 2009/138/EB L = alternatyvaus investavimo fondas, valdomas alternatyvaus investavimo fondų valdytojų, kuriems veiklos leidimai suteikti arba kurie registruoti pagal Europos Parlamento ir Tarybos direktyvą 2011/61/ES ([4]) O = įstaiga, atsakinga už profesinių pensijų skyrimą, kaip apibrėžta Europos Parlamento ir Tarybos direktyvos 2003/41/EB ([5]) 6 straipsnio a punkte R = perdraudimo įmonė, kuriai suteiktas veiklos leidimas pagal Direktyvą 2009/138/EB U = kolektyvinio investavimo į perleidžiamuosius vertybinius popierius subjektas (KIPVPS) ir jo valdymo įmonė, kuriems suteiktas veiklos leidimas pagal Europos Parlamento ir Tarybos direktyvą 2009/65/EB ([6]) Ne finansų sandorio šalių taksonomija. Toliau nurodytos kategorijos atitinka pagrindines Europos bendrijos statistinio ekonominės veiklos rūšių klasifikatoriaus (NACE), kaip apibrėžta Europos Parlamento ir Tarybos reglamente (EB) Nr. 1893/2006 ([7]), sekcijas. 1 = žemės ūkis, miškininkystė ir žuvininkystė 2 = kasyba ir karjerų eksploatavimas 3 = apdirbamoji gamyba 4 = elektros, dujų, garo tiekimas ir oro kondicionavimas

	Laukelis	Formatas
		5 = vandens tiekimas, nuotekų valymas, atliekų tvarkymas ir regeneravimas 6 = statyba 7 = didmeninė ir mažmeninė prekyba; variklinių transporto priemonių ir motociklų remontas 8 = transportas ir saugojimas 9 = apgyvendinimo ir maitinimo paslaugų veikla 10 = informacija ir ryšiai 11 = finansinė ir draudimo veikla 12 = nekilnojamojo turto operacijos 13 = profesinė, mokslinė ir techninė veikla 14 = administracinė ir aptarnavimo veikla 15 = viešasis valdymas ir gynyba; privalomasis socialinis draudimas 16 = švietimas 17 = žmonių sveikatos priežiūra ir socialinis darbas 18 = meninė, pramoginė ir poilsio organizavimo veikla 19 = kita aptarnavimo veikla 20 = namų ūkių, samdančių darbininkus, veikla; namų ūkių veikla, susijusi su savoms reikmėms tenkinti skirtų nediferencijuojamų gaminių gamyba ir paslaugų teikimu 21 = ekstrateritorinių organizacijų ir įstaigų veikla Jei pranešimas apima daugiau nei vienos rūšies veiklą, kodai išvardijami atitinkamos veiklos santykinės svarbos tvarka, juos atskiriant brūkšneliu „-“. Laukelis paliekamas tuščias, kai tai yra pagrindinės sandorio šalys ir kitos sandorio šalys pagal Reglamento (ES) Nr. 648/2012 1 straipsnio 5 dalį.
7	Pranešimą teikiančios sandorio šalies pobūdis	F = finansų sandorio šalis N = ne finansų sandorio šalis C = pagrindinė sandorio šalis O = kita
8	Maklerio identifikatorius	ISO 17442 juridinio asmens identifikatorius (LEI), 20 raidinių skaitinių ženklų kodas.
9	Pranešimą teikiančio subjekto identifikatorius	ISO 17442 juridinio asmens identifikatorius (LEI), 20 raidinių skaitinių ženklų kodas.
10	Tarpuskaitos nario identifikatorius	ISO 17442 juridinio asmens identifikatorius (LEI), 20 raidinių skaitinių ženklų kodas.
11	Naudos gavėjo identifikatoriaus rūšis	„LEI“, kai teikiamas ISO 17442 juridinio asmens identifikatorius (LEI) „CLC“, kai teikiamas kliento kodas
12	Naudos gavėjo identifikatorius	ISO 17442 juridinio asmens identifikatorius (LEI) (20 raidinių skaitinių ženklų) arba kliento kodas (iki 50 raidinių skaitmeninių ženklų), jei klientas negali turėti juridinio asmens identifikatoriaus.

	Laukelis	Formatas
13	Prekybos įgaliojimai	P = savo sąskaita ir savo ar kliento vardu A = kliento vardu ir kliento sąskaita
14	Sandorio šalies pobūdis	B = pirkėjas S = pardavėjas Pildoma pagal 3a straipsnį.
15	Tiesioginė sąsaja su komercine veikla ar iždo finansavimo veikla	Y = taip N = ne
16	Tarpuskaitos riba	Y = viršijama N = nesiekiama
17	Sutarties vertė	Iki 20 skaitmenų, įskaitant skaičius po kablelio. Trupmenos žymuo skaitmeniu nėra laikomas. Jei yra, tai turi būti taškas. Minusas, jei yra, skaitmeniu nėra laikomas.
18	Vertės valiuta	ISO 4217 valiutos kodas, 3 raidiniai ženklai.
19	Vertinimo laiko žyma	ISO 8601 data UTC laiko formatu YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ
20	Vertinimo rūšis	M = vertinimas pagal rinkos kainą O = vertinimas pagal modelį C = pagrindinės sandorio šalies vertinimas
21	Užtikrinimas įkaitu	U = neužtikrinta PC = iš dalies užtikrinta OC = užtikrinta viena kryptimi FC = visiškai užtikrinta Pildoma pagal 3b straipsnį.
22	Įkaitas portfelio lygmeniu	Y = taip N = ne
23	Įkaito portfelio kodas	Iki 52 raidinių skaitinių ženklų, įskaitant keturis specialiuosius ženklus:„. - _“ Specialiųjų ženklų neleidžiama įrašyti kodo pradžioje ir pabaigoje. Neleidžiama įdėti tarpų.
24	Pateikta pradinė garantinė įmoka	Iki 20 skaitmenų, įskaitant skaičius po kablelio. Trupmenos žymuo skaitmeniu nėra laikomas. Jei yra, tai turi būti taškas.
25	Pateiktos pradinės garantinės įmokos valiuta	ISO 4217 valiutos kodas, 3 raidiniai ženklai.

	Laukelis	Formatas
26	Pateikta kintamoji garantinė įmoka	Iki 20 skaitmenų, įskaitant skaičius po kablelio. Trupmenos žymuo skaitmeniu nėra laikomas. Jei yra, tai turi būti taškas.
27	Pateiktos kintamosios garantinės įmokos valiuta	ISO 4217 valiutos kodas, 3 raidiniai ženklai.
28	Gauta pradinė garantinė įmoka	Iki 20 skaitmenų, įskaitant skaičius po kablelio. Trupmenos žymuo skaitmeniu nėra laikomas. Jei yra, tai turi būti taškas.
29	Gautos pradinės garantinės įmokos valiuta	ISO 4217 valiutos kodas, 3 raidiniai ženklai.
30	Gauta kintamoji garantinė įmoka	Iki 20 skaitmenų, įskaitant skaičius po kablelio. Trupmenos žymuo skaitmeniu nėra laikomas. Jei yra, tai turi būti taškas.
31	Gautos kintamosios garantinės įmokos valiuta	ISO 4217 valiutos kodas, 3 raidiniai ženklai.
32	Pateiktas įkaito perviršis	Iki 20 skaitmenų, įskaitant skaičius po kablelio. Trupmenos žymuo skaitmeniu nėra laikomas. Jei yra, tai turi būti taškas.
33	Pateikto įkaito perviršio valiuta	ISO 4217 valiutos kodas, 3 raidiniai ženklai.
34	Gautas įkaito perviršis	Iki 20 skaitmenų, įskaitant skaičius po kablelio. Trupmenos žymuo skaitmeniu nėra laikomas. Jei yra, tai turi būti taškas.
35	Gauto įkaito perviršio valiuta	ISO 4217 valiutos kodas, 3 raidiniai ženklai.

(1) 2009 m. lapkričio 25 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2009/138/EB dėl draudimo ir perdraudimo veiklos pradėjimo ir jos vykdymo (Mokumas II) (OL L 335, 2009 12 17, p. 1).

(2) 2013 m. birželio 26 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2013/36/ES dėl galimybės verstis kredito įstaigų veikla ir dėl riziką ribojančios kredito įstaigų ir investicinių įmonių priežiūros, kuria iš dalies keičiama Direktyva 2002/87/EB ir panaikinamos direktyvos 2006/48/EB bei 2006/49/EB (OL L 176, 2013 6 27, p. 338).

(3) 2004 m. balandžio 21 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2004/39/EB dėl finansinių priemonių rinkų, iš dalies keičianti Tarybos direktyvas 85/611/EEB, 93/6/EEB ir Europos Parlamento ir Tarybos direktyvą 2000/12/EB bei panaikinanti Tarybos direktyvą 93/22/EEB (OL L 145, 2004 4 30, p. 1).

(4) 2011 m. birželio 8 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2011/61/ES dėl alternatyvaus investavimo fondų valdytojų, kuria iš dalies keičiami direktyvos 2003/41/EB ir 2009/65/EB bei reglamentai (EB) Nr. 1060/2009 ir (ES) Nr. 1095/2010 (OL L 174, 2011 7 1, p. 1).

(5) 2003 m. birželio 3 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2003/41/EB dėl įstaigų, atsakingų už profesinių pensijų skyrimą, veiklos ir priežiūros (OL L 235, 2003 9 23, p. 10).

(6) 2009 m. liepos 13 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2009/65/EB dėl įstatymų ir kitų teisės aktų, susijusių su kolektyvinio investavimo į perleidžiamus vertybinius popierius subjektais (KIPVPS), derinimo (OL L 302, 2009 11 17, p. 32).

(7) 2006 m. gruodžio 20 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (EB) Nr. 1893/2006, nustatantis statistinį ekonominės veiklos rūšių klasifikatorių NACE 2 red. ir iš dalies keičiantis Tarybos reglamentą (EEB) Nr. 3037/90 bei tam tikrus EB reglamentus dėl konkrečių statistikos sričių (OL L 393, 2006 12 30, p. 1).

2 lentelė

Bendri duomenys

	Laukelis	Formatas	Taikomos išvestinių finansinių priemonių sutarčių rūšys
	2a skirsnis. Sutarties rūšis		**Visos sutartys**
1	Sutarties rūšis	CD = finansinės sutartys dėl kainų skirtumų FR = išankstiniai palūkanų normų sandoriai FU = ateities sandoriai FW = išankstiniai sandoriai OP = pasirinkimo sandoriai SB = skirtumo lažybos SW = apsikeitimo sandoriai ST = pasirinkimo sandoriai dėl apsikeitimo sandorių OT = kita	
2	Turto klasė	CO = biržos prekės ir apyvartiniai taršos leidimai; CR = kreditas CU = valiuta EQ = akcijos IR = palūkanų norma	
	2b skirsnis. Informacija apie sutartį		**Visos sutartys**
3	Produkto klasifikacijos rūšis	C = CFI U = UPI	
4	Produkto klasifikacija	ISO 10692 CFI kodas iš 6 raidinių ženklų Patvirtintas UPI kodas	
5	Produkto identifikatoriaus rūšis	Nurodyti taikomą identifikatorių: I = ISIN A = AII	
6	Produkto identifikatorius	I rūšies produkto identifikatoriaus atveju: ISO 6166 ISIN kodas iš 12 raidinių skaitinių ženklų A rūšies produkto identifikatoriaus atveju: visas AII kodas pagal 4 straipsnio 8 dalį.	

	Laukelis	Formatas	Taikomos išvestinių finansinių priemonių sutarčių rūšys
7	Pagrindinės priemonės identifikatoriaus rūšis	I = ISIN A = AII U = UPI B = krepšelis X = indeksas	
8	Pagrindinės priemonės identifikatorius	I rūšies pagrindinės priemonės identifikatoriaus atveju: ISO 6166 ISIN kodas iš 12 raidinių skaitinių ženklų A rūšies pagrindinės priemonės identifikatoriaus atveju: visas AII kodas pagal 4 straipsnio 8 dalį. U rūšies pagrindinės priemonės identifikatoriaus atveju: UPI kodas B rūšies pagrindinės priemonės identifikatoriaus atveju: visų atskirų komponentų identifikatoriai pateikiant ISO 6166 ISIN kodą arba visą AII kodą pagal 4 straipsnio 8 dalį. Atskirų komponentų identifikatoriai atskiriami brūkšneliu „-“. X rūšies pagrindinės priemonės identifikatoriaus atveju: jei yra, ISO 6166 ISIN kodas, o jei ne, indekso teikėjo priskirtas nesutrumpintas indekso pavadinimas.	
9	1 tariamosios sumos valiuta	ISO 4217 valiutos kodas, 3 raidiniai ženklai.	
10	2 tariamosios sumos valiuta	ISO 4217 valiutos kodas, 3 raidiniai ženklai.	
11	Pristatymo valiuta	ISO 4217 valiutos kodas, 3 raidiniai ženklai.	
	2c skirsnis. Išsami informacija apie sandorį		**Visos sutartys**
12	Sandorio identifikatorius	Kol atsiras pasauliniai UTI kodai, iki 52 raidinių skaitinių ženklų kodas, įskaitant keturis specialiuosius ženklus:„. - _“ Specialiųjų ženklų neleidžiama įrašyti kodo pradžioje ir pabaigoje. Neleidžiama įdėti tarpų.	
13	Pranešimo sekimo numeris	52 raidinių skaitinių ženklų laukelis.	
14	Sudėtinių sandorių komponentų identifikatorius	Iki 35 raidinių skaitinių ženklų laukelis.	
15	Įvykdymo vieta	ISO 10383 rinkos identifikavimo kodas (MIC), 4 raidiniai skaitiniai ženklai pagal 4 straipsnio b punktą.	

	Laukelis	Formatas	Taikomos išvestinių finansinių priemonių sutarčių rūšys
16	Portfelio suspaudimas	Y = sutartis atsiranda dėl portfelio suspaudimo N = sutartis atsiranda ne dėl portfelio suspaudimo	
17	Kaina/norma	Iki 20 skaitmenų, įskaitant skaičius po kablelio. Trupmenos žymuo skaitmeniu nėra laikomas. Jei yra, tai turi būti taškas. Minusas, jei yra, skaitmeniu nėra laikomas. Kai kaina nurodoma procentine verte, ji turėtų būti išreikšta procentais, t. y. 100 % vertę atitinka „100“.	
18	Kainos žymėjimas	U = vienetai P = procentinė dalis Y = pajamingumas	
19	Kainos valiuta	ISO 4217 valiutos kodas, 3 raidiniai ženklai.	
20	Tariamoji suma	Iki 20 skaitmenų, įskaitant skaičius po kablelio. Trupmenos žymuo skaitmeniu nėra laikomas. Jei yra, tai turi būti taškas. Minusas, jei yra, skaitmeniu nėra laikomas.	
21	Kainos daugiklis	Iki 20 skaitmenų, įskaitant skaičius po kablelio. Trupmenos žymuo skaitmeniu nėra laikomas. Jei yra, tai turi būti taškas.	
22	Kiekis	Iki 20 skaitmenų, įskaitant skaičius po kablelio. Trupmenos žymuo skaitmeniu nėra laikomas. Jei yra, tai turi būti taškas.	
23	Išankstinis mokėjimas	Iki 20 skaitmenų, įskaitant skaičius po kablelio. Minusas naudojamas parodyti, kad mokėjimas atliktas, o ne gautas. Trupmenos žymuo skaitmeniu nėra laikomas. Jei yra, tai turi būti taškas. Minusas, jei yra, skaitmeniu nėra laikomas.	

	Laukelis	Formatas	Taikomos išvestinių finansinių priemonių sutarčių rūšys
24	Pristatymo rūšis	C = pinigai P = fizinis O = pasirenka sandorio šalis arba nustato trečioji šalis	
25	Įvykdymo laiko žyma	ISO 8601 data UTC laiko formatu YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ	
26	Įsigaliojimo data	ISO 8601 data formatu YYYY-MM-DD	
27	Termino pabaigos data	ISO 8601 data formatu YYYY-MM-DD	
28	Užbaigimo data	ISO 8601 data formatu YYYY-MM-DD	
29	Atsiskaitymo data	ISO 8601 data formatu YYYY-MM-DD	
30	Pagrindinio susitarimo rūšis	Laisvos formos iki 50 ženklų tekstas, nurodant pagrindinio susitarimo pavadinimą, jei yra.	
31	Pagrindinio susitarimo versija	ISO 8601 data formatu YYYY	
	2d skirsnis. Rizikos mažinimas/Pranešimas		**Visos sutartys**
32	Patvirtinimo laiko žyma	ISO 8601 data UTC laiko formatu YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ	
33	Patvirtinimo būdas	Y = patvirtinta neelektroniškai N = nepatvirtinta E = patvirtinta elektroniškai	
	2e skirsnis. Tarpuskaita		**Visos sutartys**
34	Tarpuskaitos prievolė	Y = taip N = ne	
35	Tarpuskaita atlikta	Y = taip N = ne	
36	Tarpuskaitos laiko žyma	ISO 8601 data UTC laiko formatu YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ	
37	Pagrindinė sandorio šalis	ISO 17442 juridinio asmens identifikatorius (LEI) 20 raidinių skaitinių ženklų kodas	

	Laukelis	Formatas	Taikomos išvestinių finansinių priemonių sutarčių rūšys
38	Grupės vidaus sandoris	Y = taip N = ne	
	2f skirsnis. Palūkanų normos		**Palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės**
39	1 sandorio dalies fiksuotoji norma	Iki 10 skaitmenų, įskaitant skaičius po kablelio, išreikšta procentais, t. y. 100 % vertę atitinka „100“. Trupmenos žymuo skaitmeniu nėra laikomas. Jei yra, tai turi būti taškas. Minusas, jei yra, skaitmeniu nėra laikomas.	
40	2 sandorio dalies fiksuotoji norma	Iki 10 skaitmenų, įskaitant skaičius po kablelio, išreikšta procentais, t. y. 100 % vertę atitinka „100“. Trupmenos žymuo skaitmeniu nėra laikomas. Jei yra, tai turi būti taškas. Minusas, jei yra, skaitmeniu nėra laikomas.	
41	1 sandorio dalies fiksuotosios normos dienų skaičius	Skaitiklis/vardiklis, kai ir skaitiklis, ir vardiklis yra skaitmenys arba žodis „Actual“ (faktinis), pvz., „30/360“ arba „Actual/365“.	
42	2 sandorio dalies fiksuotosios normos dienų skaičius	Skaitiklis/vardiklis, kai ir skaitiklis, ir vardiklis yra skaitmenys arba žodis „Actual“ (faktinis), pvz., „30/360“ arba „Actual/365“.	
43	1 sandorio dalies fiksuotosios normos mokėjimo dažnumas – laikotarpis	Laikotarpis, kuriuo apibūdinama, kaip dažnai sandorio šalys apsikeičia mokėjimais, taikant šias santrumpas: Y = metai M = mėnuo W = savaitė D = diena	

	Laukelis	Formatas	Taikomos išvestinių finansinių priemonių sutarčių rūšys
44	1 sandorio dalies fiksuotosios normos mokėjimo dažnumas – daugiklis	Laikotarpio, kuriuo apibūdinama, kaip dažnai sandorio šalys apsikeičia mokėjimais, sveikasis daugiklis. Iki 3 skaitmenų.	
45	2 sandorio dalies fiksuotosios normos mokėjimo dažnumas – laikotarpis	Laikotarpis, kuriuo apibūdinama, kaip dažnai sandorio šalys apsikeičia mokėjimais, taikant šias santrumpas: Y = metai M = mėnuo W = savaitė D = diena	
46	2 sandorio dalies fiksuotosios normos mokėjimo dažnumas – daugiklis	Laikotarpio, kuriuo apibūdinama, kaip dažnai sandorio šalys apsikeičia mokėjimais, sveikasis daugiklis. Iki 3 skaitmenų.	
47	1 sandorio dalies kintamosios normos mokėjimo dažnumas – laikotarpis	Laikotarpis, kuriuo apibūdinama, kaip dažnai sandorio šalys apsikeičia mokėjimais, taikant šias santrumpas: Y = metai M = mėnuo W = savaitė D = diena	
48	1 sandorio dalies kintamosios normos mokėjimo dažnumas – daugiklis	Laikotarpio, kuriuo apibūdinama, kaip dažnai sandorio šalys apsikeičia mokėjimais, sveikasis daugiklis. Iki 3 skaitmenų.	
49	2 sandorio dalies kintamosios normos mokėjimo dažnumas – laikotarpis	Laikotarpis, kuriuo apibūdinama, kaip dažnai sandorio šalys apsikeičia mokėjimais, taikant šias santrumpas: Y = metai M = mėnuo W = savaitė D = diena	
50	2 sandorio dalies kintamosios normos mokėjimo dažnumas – daugiklis	Laikotarpio, kuriuo apibūdinama, kaip dažnai sandorio šalys apsikeičia mokėjimais, sveikasis daugiklis. Iki 3 skaitmenų.	

	Laukelis	Formatas	Taikomos išvestinių finansinių priemonių sutarčių rūšys
51	1 sandorio dalies kintamosios normos perskaičiavimo dažnumas – laikotarpis	Laikotarpis, kuriuo apibūdinama, kaip dažnai sandorio šalys perskaičiuoja kintamąją normą, taikant šias santrumpas: Y = metai M = mėnuo W = savaitė D = diena	
52	1 sandorio dalies kintamosios normos perskaičiavimo dažnumas – daugiklis	Laikotarpio, kuriuo apibūdinama, kaip dažnai sandorio šalys perskaičiuoja kintamąją normą, sveikasis daugiklis. Iki 3 skaitmenų.	
53	2 sandorio dalies kintamosios normos perskaičiavimo dažnumas – laikotarpis	Laikotarpis, kuriuo apibūdinama, kaip dažnai sandorio šalys perskaičiuoja kintamąją normą, taikant šias santrumpas: Y = metai M = mėnuo W = savaitė D = diena	
54	2 sandorio dalies kintamosios normos perskaičiavimo dažnumas – daugiklis	Laikotarpio, kuriuo apibūdinama, kaip dažnai sandorio šalys perskaičiuoja kintamąją normą, sveikasis daugiklis. Iki 3 skaitmenų.	
55	1 sandorio dalies kintamoji norma	Kintamosios normos indekso pavadinimas EONA – EONIA EONS – EONIA SWAP EURI – EURIBOR EUUS – euro ir dolerio keitimo kursas EUCH – euro ir Šveicarijos franko keitimo kursas GCFR – GCF REPO ISDA – ISDAFIX LIBI – LIBID LIBO – LIBOR MAAA – „Muni AAA“ PFAN – hipotekos obligacijos (*Pfandbriefe*) TIBO – TIBOR STBO – STIBOR BBSW – BBSW JIBA – JIBAR BUBO – BUBOR	

	Laukelis	Formatas	Taikomos išvestinių finansinių priemonių sutarčių rūšys
		CDOR – CDOR CIBO – CIBOR MOSP – MOSPRIM NIBO – NIBOR PRBO – PRIBOR TLBO – TELBOR WIBO – WIBOR TREA – iždas SWAP – apsikeitimo sandoris FUSW – ateities apsikeitimo sandoris arba iki 25 raidinių skaitinių ženklų, jei orientacinė norma neįtraukta į pirmiau esantį sąrašą.	
56	1 sandorio dalies kintamosios normos bazinis laikotarpis – laikotarpis	Laikotarpis, kuriuo apibūdinamas bazinis laikotarpis, taikant šias santrumpas: Y = metai M = mėnuo W = savaitė D = diena	
57	1 sandorio dalies kintamosios normos bazinis laikotarpis – daugiklis	Laikotarpio, kuriuo apibūdinamas bazinis laikotarpis, sveikasis daugiklis. Iki 3 skaitmenų.	
58	2 sandorio dalies kintamoji norma	Kintamosios normos indekso pavadinimas EONA – EONIA EONS – EONIA SWAP EURI – EURIBOR EUUS – euro ir dolerio keitimo kursas EUCH – euro ir Šveicarijos franko keitimo kursas GCFR – GCF REPO ISDA – ISDAFIX LIBI – LIBID LIBO – LIBOR MAAA – „Muni AAA“ PFAN – hipotekos obligacijos (*Pfandbriefe*) TIBO – TIBOR STBO – STIBOR BBSW – BBSW JIBA – JIBAR BUBO – BUBOR CDOR – CDOR CIBO – CIBOR MOSP – MOSPRIM	

	Laukelis	Formatas	Taikomos išvestinių finansinių priemonių sutarčių rūšys
		NIBO – NIBOR PRBO – PRIBOR TLBO – TELBOR WIBO – WIBOR TREA – iždas SWAP – apsikeitimo sandoris FUSW – ateities apsikeitimo sandoris arba iki 25 raidinių skaitinių ženklų, jei orientacinė norma neįtraukta į pirmiau esantį sąrašą.	
59	2 sandorio dalies kintamosios normos bazinis laikotarpis – laikotarpis	Laikotarpis, kuriuo apibūdinamas bazinis laikotarpis, taikant šias santrumpas: Y = metai M = mėnuo W = savaitė D = diena	
60	2 sandorio dalies kintamosios normos bazinis laikotarpis – daugiklis	Laikotarpio, kuriuo apibūdinamas bazinis laikotarpis, sveikasis daugiklis. Iki 3 skaitmenų.	
	2g skirsnis. Valiutų keitimas		**Valiutų išvestinės finansinės priemonės**
61	2 pristatymo valiuta	ISO 4217 valiutos kodas, 3 raidiniai ženklai.	
62	1 valiutos kursas	Iki 10 skaitmenų, įskaitant skaičius po kablelio. Trupmenos žymuo skaitmeniu nėra laikomas. Jei yra, tai turi būti taškas. Minusas, jei yra, skaitmeniu nėra laikomas.	
63	Išankstinis valiutos kursas	Iki 10 skaitmenų, įskaitant skaičius po kablelio. Trupmenos žymuo skaitmeniu nėra laikomas. Jei yra, tai turi būti taškas. Minusas, jei yra, skaitmeniu nėra laikomas.	

	Laukelis	Formatas	Taikomos išvestinių finansinių priemonių sutarčių rūšys
64	Valiutos kurso pagrindas	Du ISO 4217 valiutos kodai, atskirti pasviruoju brūkšniu „/“. Pirmasis valiutos kodas rodo bazinę valiutą, o antrasis valiutos kodas – kotiruotės valiutą.	
	2h skirsnis. Biržos prekės ir apyvartiniai taršos leidimai		**Biržos prekių ir apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės**
	Bendroji informacija		
65	Biržos prekių kategorijos	AG = žemės ūkis EN = energija FR = kroviniai ME = metalai IN = indeksas EV = aplinka EX = sudėtingos OT = kita	
66	Specialios biržos prekių kategorijos	Žemės ūkis GO = grūdai, aliejingosios sėklos DA = pieno gaminiai LI = gyvuliai FO = miško ūkis SO = neperdirbti produktai SF = jūros gėrybės OT = kita Energija OI = nafta NG = gamtinės dujos CO = anglis EL = elektros energija IE = kelių formų energija OT = kita Kroviniai DR = birieji kroviniai WT = skystieji kroviniai OT = kita Metalai PR = taurieji NP = netaurieji Aplinka WE = klimato reiškiniai EM = išmetamieji teršalai OT = kita	

	Laukelis	Formatas	Taikomos išvestinių finansinių priemonių sutarčių rūšys
	Energija		
67	Pristatymo vieta arba zona	EIC kodas, 16 raidinių skaitinių ženklų kodas. Pasikartojantis laukelis.	
68	Sujungimo taškas	EIC kodas, 16 raidinių skaitinių ženklų kodas.	
69	Apkrovos rūšis	BL = bazinė apkrova PL = piko apkrova OP = ne piko apkrova BH = valanda/apkrovos laikotarpio valandos SH = pritaikyta sutartis GD = dujų tiekimo para OT = kita	
	Pasikartojantis 70–77 laukelių skirsnis		
70	Apkrovos tiekimo intervalai	hh:mmZ	
71	Pristatymo pradžios data ir laikas	ISO 8601 data UTC laiko formatu YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ	
72	Pristatymo pabaigos data ir laikas	ISO 8601 data UTS laiko formatu YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ	
73	Trukmė	N = minutės H = valanda D = diena W = savaitė M = mėnuo Q = ketvirtis S = sezonas Y = metinis O = kita	
74	Savaitės dienos	WD = darbo dienos WN = savaitgalis MO = pirmadienis TU = antradienis WE = trečiadienis TH = ketvirtadienis FR = penktadienis SA = šeštadienis SU = sekmadienis Galima įrašyti kelias vertes, jas atskiriant pasviruoju brūkšniu „/“.	

	Laukelis	Formatas	Taikomos išvestinių finansinių priemonių sutarčių rūšys
75	Tiekimo pajėgumas	Iki 20 skaitmenų, įskaitant skaičius po kablelio. Trupmenos žymuo skaitmeniu nėra laikomas. Jei yra, tai turi būti taškas. Minusas, jei yra, skaitmeniu nėra laikomas.	
76	Kiekio vienetas	KW KWh/h KWh/d MW MWh/h MWh/d GW GWh/h GWh/d Therm/d KTherm/d MTherm/d cm/d mcm/d	
77	Kaina už kiekį per laiko intervalą	Iki 20 skaitmenų, įskaitant skaičius po kablelio. Trupmenos žymuo skaitmeniu nėra laikomas. Jei yra, tai turi būti taškas. Minusas, jei yra, skaitmeniu nėra laikomas.	
	2i skirsnis. Pasirinkimo sandoriai		**Sutartys, kuriose numatytas pasirinkimo sandoris**
78	Pasirinkimo sandorio rūšis	P = pardavimo C = pirkimo O = kai neįmanoma nustatyti, ar sandoris pirkimo, ar pardavimo	
79	Pasirinkimo sandorio vykdymo būdas	A = amerikietiškas B = Bermudų E = europietiškas S = azijietiškas Galima įrašyti kelias vertes.	

	Laukelis	Formatas	Taikomos išvestinių finansinių priemonių sutarčių rūšys
80	Vykdymo kaina (viršutinė/apatinė riba)	Iki 20 skaitmenų, įskaitant skaičius po kablelio. Trupmenos žymuo skaitmeniu nėra laikomas. Jei yra, tai turi būti taškas. Minusas, jei yra, skaitmeniu nėra laikomas. Kai vykdymo kaina nurodoma procentine verte, ji turėtų būti išreikšta procentais, t. y. 100 % vertę atitinka „100“.	
81	Vykdymo kainos žymėjimas	U = vienetai P = procentinė dalis Y = pajamingumas	
82	Pagrindinės priemonės termino pabaigos data	ISO 8601 data formatu YYYY-MM-DD	
	2j skirsnis. Kredito išvestinės finansinės priemonės		
83	Pirmumas	SNDB = pirmaeilė skola, pvz., pirmaeilė neužtikrinta skola (įmonių/finansų įstaigų), valstybės skola užsienio valiuta (valdžios sektorius), SBOD = subordinuotoji skola, pvz., subordinuotoji arba žemesniojo 2 lygio skola (bankai), antraeilė subordinuotoji arba aukštesniojo 2 lygio skola (bankai), OTHR = kita, pvz., privilegijuotosios akcijos arba 1 lygio kapitalas (bankai) arba kitos kredito išvestinės finansinės priemonės	
84	Referencinis subjektas	ISO 3166 šalies kodas iš 2 ženklų arba ISO 3166–2 – dviraidis valstybės kodas, po jo – brūkšnelis „-“ ir ne daugiau nei 3 raidinių skaitinių simbolių smulkesnių valstybės vienetų kodas, arba ISO 17442 juridinio asmens identifikatorius (LEI), 20 raidinių skaitinių ženklų kodas.	
85	Mokėjimų dažnumas	MNTH = kas mėnesį QURT = kas ketvirtį MIAN = kartą per pusmetį YEAR = kartą per metus	
86	Skaičiavimo pagrindas	Skaitiklis/vardiklis, kai ir skaitiklis, ir vardiklis yra skaitmenys arba žodis „Actual“ (faktinis), pvz., „30/360“ arba „Actual/365“.	

	Laukelis	Formatas	Taikomos išvestinių finansinių priemonių sutarčių rūšys
87	Serija	Iki 5 ženklų sveikojo skaičiaus laukelis.	
88	Versija	Iki 5 ženklų sveikojo skaičiaus laukelis.	
89	Indekso koeficientas	Iki 10 skaitmenų, įskaitant skaičius po kablelio. Trupmenos žymuo skaitmeniu nėra laikomas. Jei yra, tai turi būti taškas.	
90	Segmentas	T = segmentuota U = nesegmentuota	
91	Nuostolių priskyrimo riba	Iki 10 skaitmenų, įskaitant skaičius po kablelio, išreikšta dešimtaine trupmena nuo 0 iki 1. Trupmenos žymuo skaitmeniu nėra laikomas. Jei yra, tai turi būti taškas.	
92	Nuostolių atskyrimo riba	Iki 10 skaitmenų, įskaitant skaičius po kablelio, išreikšta dešimtaine trupmena nuo 0 iki 1. Trupmenos žymuo skaitmeniu nėra laikomas. Jei yra, tai turi būti taškas.	
	2k skirsnis. Sutarties pakeitimai		
93	Veiksmo rūšis	N = nauja M = pakeitimas E = klaida C = pirmalaikis nutraukimas R = pataisymas Z = portfelio suspaudimas V = vertinimo atnaujinimas P = pozicijos komponentas	
94	Lygmuo	T = sandoris P = pozicija“	