ДЕЛЕГИРАН РЕГЛАМЕНТ (ЕС) 2019/358 НА КОМИСИЯТА

от 13 декември 2018 година

за допълнение на Регламент (ЕС) 2015/2365 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на регулаторните технически стандарти относно събирането, проверката, обобщаването, сравняването и публикуването на данни за сделките за финансиране с ценни книжа (СФЦК) от регистрите на трансакции

(текст от значение за ЕИП)

ЕВРОПЕЙСКАТА КОМИСИЯ,

като взе предвид Договора за функционирането на Европейския съюз,

като взе предвид Регламент (ЕС) 2015/2365 на Европейския парламент и на Съвета от 25 ноември 2015 г. относно прозрачността при сделките за финансиране с ценни книжа и при повторното използване, и за изменение на Регламент (ЕС) № 648/2012 ([1]), и по-специално член 5, параграф 7, буква а) и член 12, параграф 3, букви а) и б) от него,

като има предвид, че:

(1) За да се уверяват във високото качество на докладваните им данни за СФЦК, регистрите на трансакции следва да проверяват идентификационните данни на подаващите доклади образувания, логическата последователност, в която се докладват данните за СФЦК, както и изчерпателността и точността на тези данни за СФЦК.

(2) По същата причина регистрите на трансакции следва да равняват данните от всеки получен доклад за СФЦК. Този процес следва да бъде стандартизиран, за да могат регистрите на трансакции да извършват равняването по последователен начин и да се намали вероятността данните за СФЦК да не бъдат равнени. Поради особеностите на технологичните системи, използвани от подаващите доклади образувания, е възможно обаче някои от данните за СФЦК да не са тъждествени. Следователно е необходимо да бъдат прилагани определени допустими отклонения, така че незначителните различия в докладваните данни за СФЦК да не възпрепятстват органите да анализират тези данни с подходящата гаранционна вероятност.

(3) Може да се очаква, че с течение на времето образуванията ще докладват все по-качествено, както от гледна точка на намаление на броя на отхвърлените доклади, така и от гледна точка на равнението на данните в докладите. Все пак на образуванията следва да се предостави достатъчно време, за да се адаптират към изискванията за докладване, най-вече с оглед да се избегне натрупването на неравнени сделки непосредствено след като задължението за докладване започне да се прилага. Поради това е целесъобразно първоначално да бъдат равнявани само данните от ограничен брой полета.

(4) Подаващите доклади образувания и по целесъобразност образуванията, отговорни за докладването, следва да могат да следят дали спазват своите задължения за докладване по Регламент (ЕС) 2015/2365. Следователно те следва да имат ежедневен достъп до определена информация във връзка с тези доклади, включително резултатите от проверката на тези доклади и напредъка по равняването на докладваните данни. Ето защо е необходимо да се уточни информацията, която регистърът на трансакции следва да предоставя на тези образувания в края на всеки работен ден.

(5) За по-голяма достоверност на данните за СФЦК прекият и незабавен достъп, предвиден в член 12, параграф 2 от Регламент (ЕС) 2015/2365, следва да бъде осигурен по хармонизиран и последователен начин. С оглед стандартизиране на докладването, свеждане до минимум на разходите за сектора и осигуряване на съпоставимост и последователно обобщаване на данните между регистрите на трансакции е целесъобразно за всички изходящи доклади и за обмена на данни да се използват образци във формат XML и да се следва методика, широко използвана във финансовия сектор.

(6) Достъпът до данни на ниво позиция относно експозициите между два контрагента е от основно значение, за да могат образуванията, посочени в член 12, параграф 2 от Регламент (ЕС) 2015/2365, да определят потенциалните източници на системни или несистемни рискове за финансовата стабилност.

(7) За да се осигури необходимото равнище на прозрачност за обществеността по отношение на СФЦК, използваните за обобщаване на данните за позициите критерии следва да позволят на широката общественост да разбере начина, по който функционират пазарите на СФЦК, без да се застраши поверителността на данните, докладвани на

([1]) ОВ L 337, 23.12.2015 г., стр. 1.

регистрите на трансакции. Нивото на подробност на обобщените данни за позициите, публикувани от регистрите на трансакции съгласно член 12, параграф 1 от Регламент (ЕС) 2015/2365, и честотата на публикуването им следва да бъдат определени по начин, основаващ се на съответната нормативна уредба на договорите за деривати, установена с Регламент (ЕС) № 648/2012 на Европейския парламент и на Съвета ([2]).

(8) Настоящият регламент се основава на проектите за регулаторни технически стандарти, предоставени на Комисията от Европейския орган за ценни книжа и пазари (ЕОЦКП) съгласно процедурата по член 10 от Регламент (ЕО) № 1095/2010 на Европейския парламент и на Съвета ([3]).

(9) Разпоредбите в настоящия регламент установяват оперативните стандарти за събиране, обобщаване и сравняване на данни от регистрите на трансакции, както и процедурите, които регистрите на трансакции трябва да прилагат за проверка на изчерпателността и точността на докладваните им данни за СФЦК. За да се гарантира съгласуваност между тези разпоредби и да се осигури възможност за цялостен поглед за регистрите на трансакции, е желателно съответните регулаторни технически стандарти да бъдат включени в един регламент.

(10) ЕОЦКП проведе открити обществени консултации по тези проекти на регулаторни технически стандарти, анализира свързаните с тях потенциални разходи и ползи и поиска становището на Групата на участниците от сектора на ценните книжа и пазарите към ЕОЦКП, създадена в съответствие с член 37 от Регламент (ЕО) № 1095/2010,

ПРИЕ НАСТОЯЩИЯ РЕГЛАМЕНТ:

Член 1

Проверка на докладите за СФЦК от страна на регистрите на трансакции

1. Регистърът на трансакции проверява всеки от следните елементи в получен доклад за СФЦК:

а) идентификационните данни на подаващото доклада образувание съгласно посоченото в поле 2 на таблица 1 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2019/363 на Комисията ([4]);

б) съответствието на образеца във формат XML, използван за докладването на СФЦК, с методиката по ISO 20022 съгласно Регламент за изпълнение (ЕС) 2019/363;

в) дали подаващото доклада образувание, ако е различно от докладващия контрагент съгласно посоченото в поле 3 на таблица 1 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2019/363, е надлежно оправомощено да докладва от името на докладващия контрагент, освен в предвидения по член 4, параграф 3 от Регламент (ЕС) 2015/2365 случай;

г) дали същият доклад за СФЦК не е бил подаден преди това;

д) дали доклад за СФЦК с вид действие „Изменение“ се отнася за подаден преди това доклад за СФЦК;

е) дали доклад за СФЦК с вид действие „Изменение“ не се отнася за СФЦК, която е била докладвана като отменена;

ж) дали докладът за СФЦК не включва вид действие „Ново“ по отношение на СФЦК, която вече е била докладвана;

з) дали докладът за СФЦК не включва вид действие „Компонент на позицията“ по отношение на СФЦК, която вече е била докладвана;

([2]) Регламент (ЕС) № 648/2012 на Европейския парламент и на Съвета на 4 юли 2012 г. относно извънборсовите деривати, централните контрагенти и регистрите на трансакции (ОВ L 201, 27.7.2012 г., стр. 1)

([3]) Регламент (ЕС) № 1095/2010 на Европейския парламент и на Съвета от 24 ноември 2010 г. за създаване на Европейски надзорен орган (Европейски орган за ценни книжа и пазари), за изменение на Решение № 716/2009/ЕО и за отмяна на Решение 2009/77/ЕО на Комисията (ОВ L 331, 15.12.2010 г., стр. 84).

([4]) Регламент за изпълнение (ЕС) 2019/363 на Комисията от 13 декември 2018 г. за установяване на технически стандарти за изпълнение по отношение на формàта и честотата на докладите с данни за сделките за финансиране с ценни книжа (СФЦК) пред регистрите на трансакции в съответствие с Регламент (ЕС) 2015/2365 на Европейския парламент и на Съвета и за изменение на Регламент за изпълнение (ЕС) № 1247/2012 на Комисията по отношение на използването на кодове за докладването на договори за деривати (вж. страница 85 от настоящия брой на Официален вестник).

и) дали докладът за СФЦК няма за цел да измени данните на подаващото доклада образувание, на докладващия контрагент и на другия контрагент по вече докладвана СФЦК;

й) дали докладът за СФЦК няма за цел да измени съществуващ доклад за СФЦК, като определя по-късен вальор от докладвания падеж на СФЦК;

к) точността и изчерпателността на доклада за СФЦК.

2. Регистърът на трансакции проверява дали информацията за обезпечението е била докладвана в полета 73—96 на таблица 2 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2019/363 за СФЦК, за които в поле 72 „Знак за необезпечена сделка по предоставяне в заем на ценни книжа“ е посочено „невярно“. Регистърът на трансакции уведомява в съответствие с член 3 от настоящия регламент подаващото доклада образувание, докладващия контрагент, както и по целесъобразност образуването, отговорно за докладването, за резултатите от проверката.

3. Регистърът на трансакции отхвърля доклад за СФЦК, който не отговаря на някое от посочените в параграф 1 изисквания, и го отнася към една от категориите на отхвърляне, посочени в таблица 2 от приложение I към настоящия регламент.

4. В рамките на шестдесет минути, след като е получил доклад за СФЦК, регистърът на трансакции предоставя на подаващото доклада образувание, на докладващия контрагент, както и по целесъобразност на образуването, отговорно за докладването, подробна информация относно резултатите от посочената в параграф 1 проверка на данните. Регистърът на трансакции предоставя тези резултати във формат XML по образец, разработен в съответствие с методиката по ISO 20022. В съответните случаи резултатите включват конкретните причини за отхвърлянето на доклада за СФЦК в съответствие с параграф 3.

Член 2

Равняване на данните от регистрите на трансакции

1. Регистърът на трансакции се стреми чрез посочените в параграф 2 стъпки да равни докладваните данни за СФЦК, при условие че е изпълнено всяко едно от следните условия:

а) регистърът на трансакции е завършил проверките, посочени в член 1, параграфи 1 и 2;

б) и двамата контрагенти по СФЦК имат задължение за докладване;

в) регистърът на трансакции не е получил последващ доклад с вид действие „Грешка“ по отношение на докладваната СФЦК.

2. Когато са изпълнени всички условия по параграф 1, регистърът на трансакции предприема следните стъпки, като същевременно използва последната докладвана стойност за всяко от полетата в таблица 1 от приложение I към настоящия регламент:

а) регистърът на трансакции, получил доклад за СФЦК, проверява дали е получил съответния доклад за СФЦК от другия контрагент, или от негово име;

б) регистърът на трансакции, който не е получил съответния доклад за СФЦК, посочен в буква а), се опитва да установи кой е регистърът на трансакции, който е получил съответния доклад за СФЦК, като съобщава на всички регистрирани регистри на трансакции стойностите на следните полета за докладваната СФЦК: „Уникален идентификационен код на сделката“, „Докладващ контрагент“, „Друг контрагент“ и „Вид на рамковия договор“;

в) регистър на трансакции, който установи, че друг регистър на трансакции е получил съответния доклад за СФЦК, посочен в буква а), обменя с този регистър на трансакции данните за докладваната СФЦК във формат XML по образец, разработен в съответствие с методиката по ISO 20022;

г) при спазване на разпоредбите на буква д) регистърът на трансакции третира докладвана СФЦК като равнена, когато данните за тази СФЦК отговарят на данните от съответния доклад за СФЦК, посочен в буква а) от настоящия параграф;

д) регистърът на трансакции се стреми да равни поотделно полетата, свързани с данните за заема, и полета, свързани с данните за обезпечението, на докладваната СФЦК в съответствие с допустимите отклонения и съответните дати на прилагане, посочени в таблица 1 от приложение I към настоящия регламент;

е) впоследствие регистърът на трансакции определя стойности за различните категории на равнение за всяка докладвана СФЦК, както е посочено в таблица 3 от приложение I към настоящия регламент;

ж) регистърът на трансакции изпълнява определените в букви а) — е) от настоящия параграф стъпки във възможно най-кратък срок, но не предприема никакви стъпки след 18:00 ч. по координирано универсално време (UTC) в даден работен ден;

з) регистър на трансакции, който не може да равни докладвана СФЦК, се стреми да равни данните за докладваната СФЦК на следващия работен ден. Регистърът на трансакции преустановява усилията по равняване на докладвана СФЦК, след като са изминали тридесет календарни дни от отчетения падеж на СФЦК или след като регистърът на трансакции е получил отнасящ се за нея доклад с вид действие „Прекратяване“ или „Компонент на позицията“.

3. В края на всеки работен ден всеки регистър на трансакции потвърждава общия брой на равнените от него докладвани СФЦК пред всеки друг регистър на трансакции, с който е извършвал такова равнение.

4. Не по-късно от шестдесет минути след приключването на процедурата по равняване съгласно параграф 2, буква ж) регистърът на трансакции предоставя на подаващото доклада образувание, на докладващия контрагент, както и по целесъобразност на образуването, отговорно за докладването, резултатите от извършената от регистъра на трансакции процедура на равняване на докладваните СФЦК. Регистърът на трансакции предоставя тези резултати във формат XML по образец, разработен в съответствие с методиката по ISO 20022, включително информация за полетата, които не са били равнени.

Член 3

Механизми за реагиране в края на деня

До края на всеки работен ден регистърът на трансакции предоставя на подаващото доклада образувание, на докладващия контрагент, както и по целесъобразност на образуването, отговорно за докладването, следната информация относно съответните СФЦК във формат XML по образец, разработен в съответствие с методиката по ISO 20022:

а) докладваните през този ден СФЦК;

б) най-актуалните данни за СФЦК, чийто падеж не е настъпил или за които не са били подадени доклади с вид действие „Грешка“, „Прекратяване“ или „Компонент на позицията“;

в) уникалните идентификационни кодове на сделката (UTI) на СФЦК, за които в поле 72 на таблица 2 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2019/363 е посочено „невярно“ и все още не е докладвана информация относно обезпечението в полета 73—96 от същата таблица;

г) докладите за СФЦК, които са били отхвърлени през този ден;

д) състоянието от гледна точка на равнението на всички докладвани СФЦК, с изключение на тези СФЦК, които са прекратени или за които са получени доклади за СФЦК с вид действие „Прекратяване“ или „Компонент на позицията“ преди повече от месец от този работен ден.

Член 4

Достъп до данните за СФЦК

Регистрите на трансакции предоставят на образуванията, изброени в член 12, параграф 2 от Регламент (ЕС) 2015/2365, пряк и незабавен достъп, включително когато е налице делегиране по член 28 от Регламент (ЕС) № 1095/2010, до данните за СФЦК в електронен и машинночитаем вид в съответствие с Делегиран регламент (ЕС) 2019/357 на Комисията ([5]).

За целите на първа алинея регистрите на трансакции използват формат XML по образец, разработен в съответствие с методиката по ISO 20022.

([5]) Делегиран регламент (ЕС) 2019/357 на Комисията от 13 декември 2018 г. за допълнение на Регламент (ЕС) 2015/2365 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на регулаторните технически стандарти относно достъпа до съхраняваните в регистрите на трансакции данни за сделките за финансиране с ценни книжа (вж. страница 22 от настоящия брой на Официален вестник).

Член 5

Изчисляване на данните на ниво позиция и достъп до тях

1. Регистърът на трансакции изчислява данните на ниво позиция за експозициите между контрагенти по заеми и обезпечения. Данните на ниво позиция се изчисляват въз основа на следните критерии:

а) стойностите за различните категории на равнение съгласно таблица 3 от приложение I към настоящия регламент;

б) вида на СФЦК;

в) сектора на контрагентите;

г) състоянието от гледна точка на клиринга;

д) сключването на или извън място на търговия;

е) вида на обезпечението;

ж) валутата на паричното рамо;

з) падежната група;

и) групата според процентите за намаляване на стойността на обезпечението;

й) регистрите на трансакции, на които другият контрагент е докладвал данни за СФЦК.

2. Регистрите на трансакции гарантират, че образуванията, изброени в член 12, параграф 2 от Регламент (ЕС) 2015/2365, имат достъп до данните на ниво позиция в съответствие с достъпа до данните, определени в Делегиран регламент (ЕС) 2019/357.

3. Данните на ниво позиция по параграф 1 се предоставят в електронен и машинночитаем вид, във формат XML, по образец, разработен в съответствие с методиката по ISO 20022.

4. Достъпът по параграф 2 се предоставя във възможно най-кратък срок и не по-късно от работния ден след получаването на доклада за СФЦК съгласно член 4, параграф 1 от Регламент (ЕС) 2015/2365.

5. Регистрите на трансакции предоставят на образуванията, изброени в член 12, параграф 2 от Регламент (ЕС) 2015/2365, достъп до обобщените данни в съответствие с достъпа до данните, определени в Делегиран регламент (ЕС) 2019/357 и изчислени в съответствие с общоприетите стандарти и процедури за глобално събиране и обобщаване на данни за СФЦК.

Член 6

Изчисляване на обобщените данни за позициите с цел публикуване

1. Регистърът на трансакции обобщава данните за позициите в съответствие с критериите, посочени в параграфи 2 и 3, по отношение на следните стойности:

а) размера на главницата по репо споразумения, сделките за покупка с условие за последваща продажба и сделките за продажба с условие за последващо обратно изкупуване, обобщения обем на ценните книжа или стоките, предоставени или получени в заем, и размера на маржин заемите;

б) броя на уникалните идентификационни кодове на сделката, отнасящи се до съответната СФЦК;

в) пазарната стойност на обезпечението.

2. Регистърът на трансакции обобщава данните за позициите за всички СФЦК, докладвани с вид действие „Ново“ между събота, 00:00:00 UTC, и петък, 23:59:59 UTC, въз основа на следните критерии и съответните стойности, посочени в таблица 1 от приложение II към настоящия регламент:

а) местоположението на докладващия контрагент или – според случая – на съответния клон;

б) местоположението на другия контрагент или – според случая – на съответния клон;

в) вида на СФЦК;

г) състоянието от гледна точка на равнението на СФЦК съгласно посоченото в таблица 3 от приложение I към настоящия регламент;

д) вида на мястото, на което е била сключена СФЦК;

е) дали СФЦК е преминала клиринг, или не;

ж) метода, чрез който е било прехвърлено обезпечението;

з) всеки референтен индекс, използван при СФЦК, търгувана на място на изпълнение, различно от „XXXX“, когато общата номинална сума, докладвана на регистъра на трансакции по индекса, е по-голяма от 5 милиарда евро и когато има най-малко шест различни контрагента, които са докладвали съответните СФЦК на регистъра на трансакции.

3. Регистърът на трансакции обобщава данните за позициите за всички СФЦК, чийто падеж не е настъпил или за които не са били подадени доклади с вид действие „Грешка“, „Прекратяване“ или „Компонент на позицията“ до петък, 23:59:59 UTC, въз основа на следните критерии и съответните стойности, посочени в таблица 1 от приложение II към настоящия регламент:

а) местоположението на докладващия контрагент или – според случая – на съответния клон;

б) местоположението на другия контрагент или – според случая – на съответния клон;

в) вида на СФЦК;

г) състоянието от гледна точка на равнението на СФЦК съгласно посоченото в таблица 3 от приложение I към настоящия регламент;

д) вида на мястото, на което е била сключена СФЦК;

е) дали СФЦК е преминала клиринг, или не;

ж) метода, чрез който е било прехвърлено обезпечението;

з) всеки референтен индекс, използван при СФЦК, търгувана на място на изпълнение, различно от „XXXX“, когато общата номинална сума, докладвана на регистъра на трансакции по индекса, е по-голяма от 5 милиарда евро и когато има най-малко шест различни контрагента, които са докладвали съответните СФЦК на регистъра на трансакции.

4. Регистърът на трансакции въвежда процедури за установяване на необичайните стойности при обобщените данни за позициите.

5. Регистърът на трансакции въвежда процедури за извършване и съобщаване на корекции на обобщените данни за позициите, включително такива, които произтичат от доклади с вид действие „Грешка“, както и за публикуване на първоначалните и коригираните обобщавания на данни.

Член 7

Публикуване на обобщените данни за позициите

1. Регистърът на трансакции публикува на своя уебсайт обобщените данни за позициите, изчислени в съответствие с член 6, всяка седмица и най-късно във вторник на обяд за СФЦК, докладвани до 23:59:59 UTC в предходния петък.

2. Регистърът на трансакции публикува всички обобщени данни за позициите в евро, като използва обменните курсове, публикувани на уебсайта на ЕЦБ в предхождащия публикуването на тези данни петък.

3. Регистърът на трансакции осигурява публикуването на обобщените данни за позициите в табличен формат, позволяващ изтеглянето на данните, съгласно посоченото в приложение II към настоящия регламент.

4. Обобщените данни за позициите, които регистърът на трансакции е публикувал на своя уебсайт, остават на този уебсайт за най-малко 104 седмици.

Член 8

Влизане в сила

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

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

Съставено в Брюксел на 13 декември 2018 година.

За Комисията

Председател

Jean-Claude JUNCKER

ПРИЛОЖЕНИЕ I

Таблица 1

Полета, допустими отклонения и начална дата на равнението

Таблица	Раздел	Поле	Отклонение	Начална дата, посочена във:
Данни за контрагента	Не е приложимо	Докладващ контрагент	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за контрагента	Не е приложимо	Роля на контрагента	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за контрагента	Не е приложимо	Друг контрагент	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Уникален идентификационен код на сделката (UTI)	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Вид на СФЦК	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Извършен клиринг	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Дата и час на клиринга	Един час	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Заем	ЦК	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Място на търговия	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Вид на рамковия договор	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Дата и час на изпълнението	Един час	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Вальор (начална дата)	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Падеж (крайна дата)	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Дата на прекратяване	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Минимален срок за предизвестие	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Заем	Най-ранна дата за обратно изискване или прекратяване	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Заем	Индикатор за общо обезпечение	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца

Таблица	Раздел	Поле	Отклонение	Начална дата, посочена във:
Данни за сделката	Заем	Индикатор за доставка по стойност (Delivery By Value - DBV)	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Заем	Използван метод за предоставяне на обезпечението	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Безсрочна	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Възможности за прекратяване	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Заем	Фиксиран лихвен процент	До третата цифра след десетичната запетая	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Правило за отчитане на дните	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Плаващ лихвен процент	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Референтен период на плаващия лихвен процент — период	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Референтен период на плаващия лихвен процент — множител	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Заем	Периодичност (честота) на плащанията с плаващ лихвен процент — период	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Заем	Периодичност на плащанията с плаващ лихвен процент — множител	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Заем	Периодичност на преразглеждането на плаващия лихвен процент — период	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Периодичност на преразглеждането на плаващия лихвен процент — множител	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Спред	До третата цифра след десетичната запетая	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Парична стойност на маржин заема	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Валута на маржин заема	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365

Таблица	Раздел	Поле	Отклонение	Начална дата, посочена във:
Данни за сделката	Заем	Коригиран лихвен процент	До третата цифра след десетичната запетая	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Заем	Дата на лихвения процент	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Заем	Размер на главницата на вальора	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Размер на главницата на падежа	0,0005 %	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Валута на главницата	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Вид на актива	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Идентификационен код на ценната книга	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Класификация на ценната книга	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Основен продукт	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Заем	Подпродукт	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Заем	Допълнителен подпродукт	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Заем	Количество или номинална стойност	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Мерна единица	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Заем	Валута на номиналната стойност	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Цена на ценната книга или стоката	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Заем	Валута на цената	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Заем	Качество на ценната книга	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Падеж на ценната книга	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365

Таблица	Раздел	Поле	Отклонение	Начална дата, посочена във:
Данни за сделката	Заем	Юрисдикция на емитента	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	ИКПС на емитента	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Вид на ценната книга	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Стойност на заема	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Заем	Пазарна стойност	0,0005 %	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Заем	Фиксиран процент на възнаграждението (rebate)	До третата цифра след десетичната запетая	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Плаващ процент на възнаграждението	До третата цифра след десетичната запетая	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Референтен период на плаващия процент на възнаграждението — период	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Заем	Референтен период на плаващия процент на възнаграждението — множител	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Заем	Периодичност на плащанията с плаващ процент на възнаграждението — период	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Заем	Периодичност на плащанията с плаващ процент на възнаграждението — множител	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Заем	Периодичност на преразглеждането на плаващия процент на възнаграждението — период	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Заем	Периодичност на преразглеждането на плаващия процент на възнаграждението — множител	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Заем	Спред на процента на възнаграждението	До третата цифра след десетичната запетая	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Заем	Такса за заемането	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365

Таблица	Раздел	Поле	Отклонение	Начална дата, посочена във:
Данни за сделката	Заем	Договорености за изключителни права за достъп до заемните средства	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Заем	Непогасен маржин заем	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Основна валута на непогасения маржин заем	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Пазарна стойност на късата позиция	0,0005 %	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Обезпечение	Знак за необезпечена сделка по предоставяне в заем на ценни книжа (SL)	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Обезпечение	Обезпечаване на нетна експозиция	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Обезпечение	Вальор на обезпечението	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Обезпечение	Вид на компонента на обезпечението	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Обезпечение	Стойност на паричното обезпечение	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Обезпечение	Валута на паричното обезпечение	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Обезпечение	Идентификация на ценната книга, използвана като обезпечение	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Обезпечение	Класификация на ценната книга, използвана като обезпечение	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Обезпечение	Основен продукт	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Обезпечение	Подпродукт	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Обезпечение	Допълнителен подпродукт	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка iv) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Обезпечение	Количество или номинална стойност на обезпечението	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Обезпечение	Мерни единици на обезпечението	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца

Таблица	Раздел	Поле	Отклонение	Начална дата, посочена във:
Данни за сделката	Обезпечение	Валута на номиналната стойност на обезпечението	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Обезпечение	Валута на цената	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Обезпечение	Единична цена	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Обезпечение	Пазарна стойност на обезпечението	0,0005 %	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365 + 24 месеца
Данни за сделката	Обезпечение	Процентно намаление или допълнително обезпечение	До третата цифра след десетичната запетая	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Обезпечение	Качество на обезпечението	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Обезпечение	Падеж на ценната книга	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Обезпечение	Юрисдикция на емитента	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Обезпечение	ИКПС на емитента	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Обезпечение	Вид обезпечение	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Обезпечение	Възможност за повторно използване на обезпечението	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Обезпечение	Идентификационен код на кошницата от обезпечения	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365
Данни за сделката	Заем	Равнище	Не	Член 33, параграф 2, буква а), подточка i) от Регламент (ЕС) 2015/2365

Таблица 2

Причини за отхвърляне на доклад за СФЦК

Категории на отхвърляне	Причина
Схема	— СФЦК е била отхвърлена поради неотговаряща на изискванията схема
Разрешение	— СФЦК е била отхвърлена, тъй като подаващото доклада образувание не е получило разрешение да докладва от името на докладващия контрагент
Логическа	— СФЦК е била отхвърлена, тъй като видът действие за СФЦК не е логически верен
Дейност	— СФЦК е била отхвърлена, тъй като не отговаря на едно или повече от изискванията за утвърждаване на съдържанието.

Таблица 3

Резултати от процедурата по равнение

Категории на равнение	Стойности за равнение
Вид докладване	Едностранно/Двустранно
Изискване за докладване за двамата контрагенти	Да/Не
Състояние от гледна точка на съчетаването	Съчетани/Несъчетани
Състояние от гледна точка на равнението на заема	Равнени/Неравнени
Състояние от гледна точка на равнението на обезпечението	Равнени/Неравнени
Допълнителни изменения	Да/Не

ПРИЛОЖЕНИЕ II

Таблица 1

Публични данни

Таблица А. Обобщаване

Дата	РТ	Вид обобщаване	Вид място	Местоположение на докладващия контрагент	Местоположение на другия контрагент	Равнение	Вид СФЦК	Извършен клиринг	Метод за прехвърляне на обезпечението	Референтни индекси [1]	Общ размер на отпуснатите назаем суми	Общ брой на сделките	Обща стойност на обезпечението
20161007	ЕС РТ	Докладвано	XXXX	ЕИП	ЕИП	Двустранно, равнен заем, неравнено обезпечение	Репо сделка	Да	TTCA (споразумение за финансово обезпечение с прехвърлително действие)		…		…
…	…	Предстоящо	XOFF	Извън ЕИП	Извън ЕИП	Двустранно, равнен заем, равнено обезпечение	Сделка за покупка с условие за последваща продажба/сделка за продажба с условие за последващо обратно изкупуване	Не	SICA (споразумение за финансово обезпечение с предоставяне на залог)		…		…
…	…	…	идентификационен код на пазара — ЕИП	…	…	Едностранно ЕИП, равнен заем, равнено обезпечение	Предоставяне и получаване в заем на ценни книжа или стоки	…	SIUR (споразумение за финансово обезпечение с предоставяне на залог с право на използване)		…		…
…	…	…	идентификационен код на пазара — извън ЕИП	…	…	…	Маржин заем	…			…		…
…	…	…	…	…	…	…	…	…	…	…	…	…	…

[1] Вписват се съответните индекси, включени в поле 25 на таблица 2 „Данни за заема и обезпечението“ от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2019/363.