

NAŘÍZENÍ KOMISE V PŘENESENÉ PRAVOMOCI (EU) 2017/585**ze dne 14. července 2016,**

kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014, pokud jde o regulační technické normy pro standardy a formáty referenčních údajů o finančních nástrojích a technická opatření ve vztahu k mechanismům, které mají Evropský orgán pro cenné papíry a trhy a příslušné orgány vytvořit

(Text s významem pro EHP)

EVROPSKÁ KOMISE,

s ohledem na Smlouvu o fungování Evropské unie,

s ohledem na nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014 ze dne 15. května 2014 o trzích finančních nástrojů a o změně nařízení (EU) č. 648/2012 ⁽¹⁾, a zejména na čl. 27 odst. 3 třetí pododstavec uvedeného nařízení.

vzhledem k těmto důvodům:

- (1) Pro účely účinného sledování trhu ze strany příslušných orgánů by referenční údaje u finančních nástrojů měly být oznamovány v jednotném formátu a podle jednotných standardů.
- (2) Oznamování a zveřejňování referenčních údajů v elektronickém, strojově čitelném formátu a ve stáhnutelné formě usnadňuje efektivní využívání a výměnu těchto údajů.
- (3) Pokud příslušné orgány a Evropský orgán pro cenné papíry a trhy (orgán ESMA) obdrží referenční údaje pro všechny finanční nástroje, které jsou přijaty k obchodování nebo které jsou obchodovány v obchodním systému nebo prostřednictvím systematického internalizátora, neprodleně, může zajistit kvalitu údajů a účinný monitoring trhu, a tím přispívat k integritě trhu.
- (4) K zajištění toho, aby obchodní systémy a systematické internalizátory předložily úplné a přesné údaje a aby příslušné orgány mohly tyto údaje skutečně obdržet a včas použít, by měly být stanoveny vhodné lhůty pro předkládání. Měla by být poskytnuta dostatečná doba pro kontrolu přesnosti a úplnosti údajů před zveřejněním. K zajištění toho, aby předložené referenční údaje byly v souladu s odpovídajícími informacemi ohlášenými podle článku 26 nařízení (EU) č. 600/2014, by referenční údaje pro daný den měly být použity příslušnými orgány pro ověřování a výměnu hlášení o transakcích provedených v týž den.
- (5) Podle čl. 27 odst. 2 nařízení (EU) č. 600/2014 odesílatelé a příjemci referenčních údajů musí zajistit skutečné obdržení, účinnou výměnu a kvalitu údajů a vhodnost těchto údajů k příslušným hlášením o transakcích podle článku 26 uvedeného nařízení. Obchodní systémy a systematické internalizátory by proto měly poskytovat úplné a přesné referenční údaje a měly by neprodleně informovat příslušné orgány o zjištěné neúplnosti nebo nepřesnosti údajů, které již byly poskytnuty. Za účelem přesného, úplného a včasného poskytování referenčních údajů by měly rovněž udržovat odpovídající systémy a kontroly.
- (6) Pro účely efektivního využívání a efektivní výměny referenčních údajů a k zajištění toho, aby referenční údaje byly v souladu s odpovídajícími údaji podle hlášení o obchodech, musejí obchodní systémy a systematické internalizátory při identifikaci finančních nástrojů a právnických osob, které mají být zahrnuty do referenčních údajů, vycházet z jednotných uznávaných standardů. Zejména v zájmu zajištění toho, aby referenční údaje byly spárovány s odpovídajícími hlášeními o obchodech, by obchodní systémy a systematické internalizátory měly zajistit, aby byly obdrženy a do ohlašovaných údajů zařazeny kódy mezinárodního identifikačního čísla cenných papírů v souladu s normou ISO 6166 týkající se ohlášených finančních nástrojů.
- (7) V zájmu konzistentnosti a k zajištění hladkého fungování finančních trhů je nezbytné, aby se ustanovení tohoto nařízení a ustanovení nařízení (EU) č. 600/2014 použila od stejného data.

⁽¹⁾ Úř. věst. L 173, 12.6.2014, s. 84.

- (8) Toto nařízení vychází z návrhů regulačních technických norem předložených Komisi orgánem ESMA.
- (9) Orgán ESMA uspořádal otevřené veřejné konzultace k návrhům regulačních technických norem, z nichž toto nařízení vychází, zanalyzoval potenciální související náklady a přínosy a vyžádal si stanovisko skupiny subjektů působících v oblasti cenných papírů a trhů zřízené článkem 37 nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 1095/2010⁽¹⁾,

PŘIJALA TOTO NAŘÍZENÍ:

Článek 1

Obsah, standardy, forma a formát referenčních údajů

Obchodní systémy a systematické internalizátory poskytnou příslušným orgánům veškeré náležitosti referenčních údajů o finančním nástroji („referenční údaje“) uvedené v tabulce 3 přílohy, které se týkají dotyčného finančního nástroje. Veškeré poskytované údaje se předkládají v souladu se standardy a formáty uvedenými v tabulce 3 přílohy v elektronické a strojově čitelné formě a ve společném vzoru XML v souladu s metodikou ISO 20022.

Článek 2

Lhůty pro poskytnutí referenčních údajů příslušným orgánům

1. Obchodní systémy a systematické internalizátory poskytnou příslušnému orgánu nejpozději ve 21:00 hodin SEČ každý den, kdy jsou otevřeny pro obchodování, referenční údaje pro všechny finanční nástroje, které jsou přijaty k obchodování nebo které jsou obchodovány, včetně případů, kdy jsou prostřednictvím jejich systémů před 18:00 SEČ uvedeného dne podány příkazy nebo navrženy kotace.
2. Pokud je finanční nástroj přijat k obchodování nebo obchodován, včetně případů, kdy je příkaz podán nebo kotace navržena poprvé, po 18:00 hodin SEČ v den, kdy obchodní systém nebo systematický internalizátor jsou otevřeny pro obchodování, referenční údaje týkající se finančního nástroje musí být předloženy do 21:00 hodin SEČ následujícího dne, v němž obchodní systém nebo systematický internalizátor jsou otevřeny pro obchodování.

Článek 3

Identifikace finančních nástrojů a právnických osob

1. Před zahájením obchodování s určitým finančním nástrojem v rámci obchodního systému nebo systematického internalizátora obdrží dotyčný obchodní systém nebo systematický internalizátor kód „mezinárodního identifikačního čísla cenných papírů (ISIN)“ podle ISO 6166 pro daný finanční nástroj.
2. Obchodní systémy a systematické internalizátory zajistí, aby identifikační kódy právnických osob zahrnuté do poskytnutých referenčních údajů byly v souladu s ISO 17442:2012, týkaly se dotyčného emitenta a byly uvedeny v globální databázi identifikačních kódů právnických osob spravované centrální provozní jednotkou jmenovanou Výborem pro regulatorní dohled nad identifikačními kódy právnických osob.

Článek 4

Mechanismy k zajištění toho, aby referenční údaje byly skutečně doručeny

1. Příslušné orgány musí sledovat a posuzovat úplnost referenčních údajů, které obdrží od obchodního systému nebo systematického internalizátora, a soulad uvedených údajů se standardy a formáty upřesněnými v tabulce 3 přílohy.

⁽¹⁾ Nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 1095/2010 ze dne 24. listopadu 2010 o zřízení Evropského orgánu dohledu (Evropského orgánu pro cenné papíry a trhy), o změně rozhodnutí č. 716/2009/ES a o zrušení rozhodnutí Komise 2009/77/ES (Úř. věst. L 331, 15.12.2010, s. 84).

2. Po obdržení referenčních údajů za každý den, kdy obchodní systémy a systematické internalizátory jsou otevřeny pro obchodování, nahlásí příslušné orgány obchodním systémům a systematickým internalizátorům případnou neúplnost uvedených údajů, jakož i nedodání referenčních údajů ve lhůtách stanovených v článku 2.
3. Orgán ESMA musí sledovat a posuzovat úplnost referenčních údajů, které obdrží od příslušných orgánů, a soulad těchto údajů se standardy a formáty upřesněnými v tabulce 3 přílohy.
4. Po obdržení referenčních údajů od příslušných orgánů jim orgán ESMA nahlásí případnou neúplnost uvedených údajů, jakož i nedodání referenčních údajů ve lhůtách stanovených v čl. 7 odst. 1.

Článek 5

Mechanismy k zajištění kvality referenčních údajů

Příslušné orgány nejméně jednou za čtvrt roku provedou hodnocení kvality, pokud jde o obsah a přesnost referenčních údajů obdržených podle čl. 27 odst. 1 nařízení (EU) č. 600/2014.

Článek 6

Metody a mechanismy pro dodání referenčních údajů

1. Obchodní systémy a systematické internalizátory zajistí, aby poskytovaly úplné a přesné referenční údaje svým příslušným orgánům podle článků 1 a 3.
2. Obchodní systémy a systematické internalizátory zavedou metody a mechanismy, jež jim umožní označit dříve předložené referenční údaje za neúplné či nepřesné. Obchodní systém nebo systematický internalizátor, které odhalí, že předložené referenční údaje jsou neúplné či nepřesné, neprodleně vyrozumí svůj příslušný orgán a bez zbytečných odkladů předloží tomuto příslušnému orgánu úplné a správné relevantní referenční údaje.

Článek 7

Mechanismy pro efektivní výměnu a zveřejňování referenčních údajů

1. Příslušné orgány předají úplné a přesné referenční údaje orgánu ESMA každý den nejpozději ve 23:59 hodin SEČ prostřednictvím zabezpečeného elektronického komunikačního kanálu pro tento účel mezi příslušnými orgány a orgánem ESMA.
2. Dnem následujícím po dni obdržení referenčních údajů v souladu s odstavcem 1 provede orgán ESMA konsolidaci údajů obdržených od každého příslušného orgánu.
3. Orgán ESMA zpřístupní konsolidované údaje všem příslušným orgánům do 8:00 hodin SEČ dne následujícího po dni jejich doručení prostřednictvím zabezpečeného elektronického komunikačního kanálu podle odstavce 1.
4. Příslušné orgány využívají konsolidované údaje pro daný den k ověření hlášení o obchodech ve vztahu k obchodům provedeným v uvedený den a ohlášeným podle článku 26 nařízení (EU) č. 600/2014.
5. Každý příslušný orgán použije konsolidované údaje pro daný den k výměně hlášení o obchodech předložených uvedeného dne v souladu s čl. 26 odst. 1 druhým pododstavcem nařízení (EU) č. 600/2014.
6. Orgán ESMA zveřejní referenční údaje v elektronické, stáhnutelné a strojově čitelné podobě.

Článek 8

Vstup v platnost a použitelnost

Toto nařízení vstupuje v platnost dvacátým dnem po vyhlášení v *Úředním věstníku Evropské unie*.

Toto nařízení se použije ode dne uvedeného v čl. 55 druhém pododstavci nařízení (EU) č. 600/2014.

Je závazné v celém rozsahu a přímo použitelné ve všech členských státech.

V Bruselu dne 14. července 2016.

Za Komisi
předseda
Jean-Claude JUNCKER

PŘÍLOHA

Tabulka 1

Legenda k tabulce 3

SYMBOL	DRUH ÚDAJŮ	DEFINICE
{ALPHANUM-n}	Až n alfanumerických znaků	Volný text
{CFI_CODE}	6 znaků	Kód ISO 10962 klasifikace finančních nástrojů
{COUNTRYCODE_2}	2 alfanumerické znaky	Kód země ze dvou písmen podle kódu země ISO 3166-1 alpha-2
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumerické znaky	Kód měny ze tří písmen podle kódů měn ISO 4217
{DATE_TIME_FORMAT}	Formát data a času podle ISO 8601	— Datum a čas v následujícím formátu: RRRR-MM-DDThh:mm:ss.dddZ. — „RRRR“ představuje rok; — „MM“ měsíc; — „DD“ den; — „T“ znamená, že se má použít písmeno „T“ (time/čas) — „hh“ představuje hodinu; — „mm“ minutu; — „ss.ddd“ představuje sekundu a zlomek sekundy; — Z je čas UTC (koordinovaný světový čas). Data a časy se uvádějí v UTC.
{DATEFORMAT}	Formát data podle ISO 8601	Formátování dat: RRRR-MM-DD
{DECIMAL-n/m}	Celkem až nmístné desetinné číslo, z toho až m míst mohou být zlomky	Numerické pole pro kladné i záporné hodnoty. — desetinný oddělovač je „.“ (tečka); — před zápornými čísly je znaménko „-“ (minus); — hodnoty jsou zaokrouhleny a nezkráceny.
{INDEX}	4 alfabtické znaky	„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

SYMBOL	DRUH ÚDAJŮ	DEFINICE
		„CDOR“ – CDOR „CIBO“ – CIBOR „MOSP“ – MOSPRIM „NIBO“ – NIBOR „PRBO“ – PRIBOR „TLBO“ – TELBOR „WIBO“ – WIBOR „TREA“ – Státní pokladniční poukázky „SWAP“ – Swapy „FUSW“ – Termínované swapy
{INTEGER-n}	Celé číslo celkem až nmístné	Numerické pole pro kladné i záporné celé hodnoty
{ISIN}	12 alfanumerických znaků	Kód ISIN ve smyslu normy ISO 6166
{LEI}	20 alfanumerických znaků	Identifikátor právnické osoby ve smyslu normy ISO 17442
{MIC}	4 alfanumerické znaky	Identifikační kód trhu ve smyslu normy ISO 10383
{FISN}	35 alfanumerických znaků	Kód FISN ve smyslu normy ISO 18774

Tabulka 2

Klasifikace komoditních derivátů a derivátů emisních povolenek pro tabulku 3 (pole 35 až 37)

Základní produkt	Podprodukt	Další podprodukt
„AGRI“ – zemědělský	„GROS“ – zrna a olejnatá semena	„FWHT“ – krmná pšenice „SOYB“ – sójové boby „CORN“ – kukuřice „RPSD“ – semena řepky „RICE“ – rýže „OTHR“ – jiné
	„SOFT“ – netrvanlivé	„CCOA“ – kakao „ROBU“ – káva Robusta „WHSG“ – bílý cukr „BRWN“ – surový cukr „OTHR“ – jiné
	„POTA“ – brambory	
	„OOLI“ – olivový olej	„LAMP“ – lampantový
	„DIRY“ – mléčné výrobky	
	„FRST“ – lesnictví	

Základní produkt	Podprodukt	Další podprodukt
	„SEAF“ – potraviny mořského původu	
	„LSTK“ – hospodářská zvířata	
	„GRIN“ – obilí	„MWHT“ – pšenice na mletí
„NRGY“ – energie	„ELEC“ – elektřina	„BSLD“ – základní zatížení „FITR“ – finanční přenosová práva „PKLD“ – špičkové zatížení „OFFP“ – mimo špičku „OTHR“ – jiné
	„NGAS“ – zemní plyn	„GASP“ – GASPOOL „LNGG“ – LNG „NBPG“ – NBP „NCGG“ – NCG „TTFG“ – TTF
	„OILP“ – ropa	„BAKK“ – Bakken „BDSL“ – bionafta „BRNT“ – Brent „BRNX“ – Brent NX „CNDA“ – kanadská „COND“ – kondenzát „DSEL“ – motorová nafta „DUBA“ – Dubai „ESPO“ – ESPO „ETHA“ – ethanol „FUEL“ – palivo „FOIL“ – palivový olej „GOIL“ – plynový olej „GSLN“ – benzin „HEAT“ – topný olej „JTFL“ – tryskové palivo „KERO“ – kerosen „LLSO“ – Light Louisiana Sweet (LLS) „MARS“ – Mars „NAPH“ – nafta „NGLO“ – NGL „TAPI“ – Tapis „URAL“ – Urals „WTIO“ – WTI
	„COAL“ – uhlí „INRG“ – kombinovaná energie „RNNG“ – energie z obnovitelných zdrojů „LGHT“ – lehké frakce „DIST“ – destiláty	

Základní produkt	Podprodukt	Další podprodukt
„ENVR“ – environmentální	„EMIS“ – emise	„CERE“ – CER „ERUE“ – ERU „EUA“ – EUA „EUAA“ – EUAA „OTHR“ – jiné
	„WTHR“ – počasí „CRBR“ – související s uhlíkem	
„FRGT“ – „náklad“	„WETF“ – vlhký	„TNKR“ – tankery
	„DRYF“ – suchý	„DBCR“ – lodě přepravující volně ložený suchý náklad
	„CSHP“ – kontejnerové lodě	
„FRTL“ – „hnojivo“	„AMMO“ – amoniak „DAPH“ – DAP (hydrogenfosforečnan amonný) „PTSH“ – potaš „SLPH“ – síra „UREA“ – močovina „UAAN“ – UAN (močovina a dusičnan amonný)	
„INDP“ – průmyslové výrobky	„CSTR“ – stavebnictví „MFTG“ – výroba	
„METL“ – kovy	„NPRM“ – jiné než vzácné	„ALUM“ – hliník „ALUA“ – hliníková slitina „CBLT“ – kobalt „COPR“ – měď „IRON“ – železná ruda „LEAD“ – olovo „MOLY“ – molybden „NASC“ – NASAAC „NICK“ – nikl „STEL“ – ocel „TINN“ – cín „ZINC“ – zinek „OTHR“ – jiné
	„PRME“ – vzácné	„GOLD“ – zlato „SLVR“ – stříbro „PTNM“ – platina „PLDM“ – palladium „OTHR“ – jiné

Základní produkt	Podprodukt	Další podprodukt
„MCEX“ – vicekomoditní exotické		
„PAPR“ – papír	„CBRD“ – bednová lepenka „NSPT“ – novinový papír „PULP“ – buničina „RCVP“ – sběrný papír	
„POLY“ – polypropylen	„PLST“ – umělá hmota	
„INFL“ – inflace		
„OEST“ – oficiální ekonomické statistiky		
„OTHC“ – jiné C10 definované v tabulce 10.1 oddílu 10 přílohy III nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/583 ⁽¹⁾		
„OTHR“ – jiné		

⁽¹⁾ Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/583 ze dne 14. července 2016, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014, pokud jde o regulační technické normy týkající se požadavků na transparentnost obchodní systémy a investiční podniky v souvislosti s dluhopisy, strukturovanými finančními produkty, povolenkami na emise a deriváty (viz strana 229 v tomto čísle Úředního věstníku).

Tabulka 3

Údaje, které se mají oznamovat jako referenční údaje o finančním nástroji

Č.	POLE	OBSAH, KTERÝ MÁ BÝT OZNÁMEN	FORMÁTY A STRANDARDY PRO PODÁVÁNÍ ZPRÁV
Obecná pole			
1	Identifikační kód nástroje	Kód použitý k identifikaci finančního nástroje.	{ISIN}
2	Plný název nástroje	Plný název finančního nástroje.	{ALPHANUM-350}
3	Klasifikace nástroje	Taxonomie použitá ke klasifikaci finančního nástroje. Poskytne se úplný a přesný kód klasifikace finančního nástroje (CFI).	{CFI_CODE}
4	Ukazatel s deriváty komodit nebo emisních povolenek na emise	Informace o tom, zda finanční nástroj spadá do definice komoditního derivátu podle čl. 2 odst. 1 bodu 30 nařízení (EU) č. 600/2014, nebo je derivátem týkajícím se emisních povolenek uvedených v oddíle C bodu 4 přílohy I směrnice 2014/65/EU.	„true“ – Ano „false“ – Ne
Pole týkající se emitenta			
5	Identifikátor emitenta nebo provozovatele obchodního systému	Identifikátor LEI emitenta nebo provozovatele obchodního systému.	{LEI}

Č.	POLE	OBSAH, KTERÝ MÁ BÝT OZNÁMEN	FORMÁTY A STRANDARDY PRO PODÁVÁNÍ ZPRÁV
----	------	-----------------------------	---

Pole týkající se obchodního systému

6	Obchodní systém	Segment MIC pro obchodní systém nebo systematický internalizátor, je-li k dispozici, který jinak MIC provozuje.	{MIC}
7	Zkrácený název finančního nástroje	Zkrácený název finančního nástroje v souladu s normou ISO 18774.	{FISN}
8	Žádost emitenta o přijetí k obchodování	Zda emitent finančního nástroje požádal o obchodování se svým finančním nástrojem nebo o jeho přijetí k obchodování v obchodním systému nebo takové obchodování či přijetí schválil.	„true“ – Ano „false“ – Ne
9	Datum schválení přijetí k obchodování	Datum a čas, kdy emitent schválil přijetí svých finančních nástrojů k obchodování nebo obchodování s těmito nástroji v obchodním systému.	{DATE_TIME_FORMAT}
10	Datum žádosti o přijetí k obchodování	Datum a čas žádosti o přijetí k obchodování v obchodním systému.	{DATE_TIME_FORMAT}
11	Datum přijetí k obchodování nebo datum prvního obchodu	Datum a čas přijetí k obchodování v obchodním systému nebo datum a čas, kdy byl nástroj poprvé obchodován nebo kdy byl obchodním systémem poprvé obdržen příkaz nebo kotace.	{DATE_TIME_FORMAT}
12	Datum ukončení	Pokud jsou k dispozici, datum a čas, kdy se s finančním nástrojem přestane obchodovat nebo přestane být přijat k obchodování v obchodním systému.	{DATE_TIME_FORMAT}

Pole týkající se jmenovité měny

13	Jmenovitá měna 1	Měna, v níž je denominována jmenovitá částka. V případě úrokových či měnových derivátů jde o jmenovitou měnu komponenty 1 nebo měny 1 v páru měn. V případě swapce, kdy je podkladový swap tvořen jedinou měnou, jde o jmenovitou měnu podkladového swapu. U swapcí, kde je podkladový swap tvořen více měnami, jde o jmenovitou měnu komponenty 1 swapu.	{CURRENCYCODE_3}
----	------------------	--	------------------

Pole týkající se dluhopisů či jiných forem dluhových cenných papírů

14	Celková emitovaná jmenovitá částka	Celková emitovaná jmenovitá částka v peněžní hodnotě.	{DECIMAL-18/5}
15	Datum splatnosti	Datum splatnosti finančního nástroje. Toto pole se vztahuje na dluhové nástroje s definovanou splatností.	{DATEFORMAT}
16	Měna jmenovité hodnoty	Měna jmenovité hodnoty pro dluhové nástroje.	{CURRENCYCODE_3}
17	Jmenovitá hodnota na jednotku/minimální obchodovaná hodnota	Jmenovitá hodnota každého nástroje. Není-li k dispozici, vyplní se minimální obchodovaná hodnota.	{DECIMAL-18/5}

Č.	POLE	OBSAH, KTERÝ MÁ BÝT OZNÁMEN	FORMÁTY A STRANDARDY PRO PODÁVÁNÍ ZPRÁV
18	Pevná sazba	Pevná procentní sazba návratnosti dluhového nástroje, je-li držen do data splatnosti, vyjádřená jako procentní podíl.	{DECIMAL-11/10} Vyjádřeno v procentech (například 7,0 znamená 7 % a 0,3 znamená 0,3 %)
19	Identifikátor indexu/referenční hodnoty dluhopisu s pohyblivou úrokovou sazbou	Pokud identifikátor existuje.	{ISIN}
20	Název indexu/referenční hodnoty dluhopisu s pohyblivou úrokovou sazbou	Pokud identifikátor neexistuje, název indexu.	{INDEX} nebo {ALPHANUM-25} – pokud není název indexu zahrnut do seznamu {INDEX}
21	Doba trvání indexu/referenční hodnoty dluhopisu s pohyblivou úrokovou sazbou	Doba trvání indexu/referenční hodnoty dluhopisu s pohyblivou úrokovou sazbou Doba se vyjádří v dnech, týdnech, měsících nebo letech.	{INTEGER-3}+„DAYS“ – dny {INTEGER-3}+ „WEEK“ – týdny {INTEGER-3}+ „MNTN“ – měsíce {INTEGER-3}+ „YEAR“ – roky
22	Rozpětí bazických bodů indexu/referenční hodnoty dluhopisu s pohyblivou úrokovou sazbou.	Počet bazických bodů nad indexem nebo pod ním, použitý k výpočtu ceny	{INTEGER-5}
23	Seniorita dluhu	Uřčete typ dluhopisu: prioritní dluh, mezaninový dluh, podřízený dluh nebo podřízený dluh typu „junior“.	„SNDB“ – přednostní dluh „MZZD“ – mezaninový dluh „SBOD“ – podřízený dluh „JUND“ – podřízený dluh typu junior

Pole týkající se derivátů a sekuritizovaných derivátů

24	Datum konce platnosti	Datum konce platnosti finančního nástroje. Pole se vztahuje pouze na deriváty s definovanou dobou platnosti.	{DATEFORMAT}
25	Cenový multiplikátor	Počet jednotek podkladového nástroje reprezentovaného jednou derivátovou smlouvou. U futures nebo opce na indexu částku na jeden indexový bod. U sázek na spready pohyb ceny podkladového nástroje, na němž je sázka na spready založena.	{DECIMAL-18/17}
26	Kód podkladového nástroje	Kód ISIN podkladového nástroje. U nástrojů ADR, GDR a obdobných nástrojů kód ISIN finančního nástroje, na němž jsou tyto nástroje založeny. U konvertibilních dluhopisů kód ISIN nástroje, na nějž lze dluhopis převést. U derivátů nebo jiných nástrojů, které mají podkladový nástroj, kód ISIN podkladového nástroje, je-li podkladový nástroj přijat k obchodování nebo obchodován v obchodním systému. Je-li podkladový nástroj akciová dividenda, pak kód ISIN související akcie, která opravňuje podkladovou dividendu.	{ISIN}

Č.	POLE	OBSAH, KTERÝ MÁ BÝT OZNÁMEN	FORMÁTY A STRANDARDY PRO PODÁVÁNÍ ZPRÁV
		U swapů úvěrového selhání se uvede kód ISIN referenčního závazku. V případě, že podkladovým nástrojem je index a má kód ISIN, kód ISIN tohoto indexu. Je-li podkladovým nástrojem koš, uveďte kódy ISIN každé složky koše, který je přijat k obchodování nebo obchodován v obchodním systému. Pole 26 a 27 se vykazují tolikrát, kolikrát je to nezbytné k uvedení všech nástrojů v koši.	
27	Podkladový emitent	V případě, že nástroj odkazuje na emitenta spíše než na jeden jediný nástroj, kód LEI emitenta.	{LEI}
28	Název podkladového indexu	V případě, že je podkladovým nástrojem index, název indexu.	{INDEX} nebo {ALPHANUM-25} – pokud není název indexu zahrnut do seznamu {INDEX}
29	Doba trvání podkladového indexu	V případě, že je podkladovým nástrojem index, doba trvání indexu.	{INTEGER-3}+„DAYS“ – dny {INTEGER-3}+ „WEEK“ – týdny {INTEGER-3}+ „MNTH“ – měsíce {INTEGER-3}+ „YEAR“ – roky
30	Typ opce	Údaj, zda je derivátová smlouva kupní opce (právo na nákup konkrétního podkladového aktiva) nebo prodejní opce (právo na prodej konkrétního podkladového aktiva) nebo zda v době realizace nelze určit, zda je o prodejní či kupní opci. V případě swapce půjde o: – „prodejní“ v případě swapce příjemce, v níž má kupující právo vstoupit do swapu jako příjemce s pevnou sazbou, – „kupní“ v případě swapce plátce, v níž má kupující právo vstoupit do swapu jako plátce s pevnou sazbou. V případě horních a spodních mezních hodnot půjde o: – „prodejní“ v případě spodní mezní hodnoty. – „kupní“ v případě horní mezní hodnoty. Pole se vztahuje na deriváty, které jsou opce nebo warranty.	„PUTO“ – Prodejní opce „CALL“ – Kupní opce „OTHR“ – nelze-li určit druh opce (kupní či prodejní)
31	Realizační cena	Předem stanovená cena, za kterou bude muset držitel koupit nebo prodat podkladový nástroj, nebo údaje, že cenu nelze v době realizace určit. Pole se vztahuje pouze na opce nebo warranty v případech, kdy lze realizační cenu určit v době realizace. Pokud cena není právě k dispozici, ale čeká se na její určení, hodnota bude „PNDG“. Není-li realizační cena použitelná, pole se nevyplní.	{DECIMAL-18/13} pokud je cena vyjádřena peněžní hodnotou {DECIMAL-11/10} pokud je cena vyjádřena procentním podílem nebo výnosem {DECIMAL-18/17} pokud je cena vyjádřena v bazických bodech „PNDG“ pokud cena není k dispozici
32	Měna realizační ceny	Měna realizační ceny.	{CURRENCYCODE_3}

Č.	POLE	OBSAH, KTERÝ MÁ BÝT OZNÁMEN	FORMÁTY A STANDARDSY PRO PODÁVÁNÍ ZPRÁV
33	Realizace opce	Údaj, zda lze opci realizovat pouze k pevně stanovenému datu (evropský a asijský styl), sérii předem stanovených dat (bermudský styl) nebo kdykoli během trvání smlouvy (americký styl). Pole se vztahuje pouze na opce, warranty a potvrzení nároku.	„EURO“ – Evropská opce „AMER“ – Americká opce „ASIA“ – Asijská opce „BERM“ – Bermudská opce „OTHR“ – Opce jiného typu
34	Druh dodání	Údaj, zda je finanční nástroj urovnán fyzicky nebo v hotovosti. Nelze-li druh dodání v době realizace určit, hodnota je „OPTL“. Toto pole je použitelné pouze pro deriváty.	„PHYS“ – vypořádáno fyzicky „CASH“ – vypořádáno v hotovosti „OPTN“ – na volbě protistrany nebo určeno třetí stranou

Komoditní deriváty a deriváty emisních povolenek

35	Základní produkt	Základní produkt pro třídu podkladových aktiv, uvedený v klasifikaci komodit a tabulce derivátů emisních povolenek.	Jsou povoleny pouze hodnoty ve sloupci „Základní produkt“ v tabulce s klasifikací komoditních derivátů.
36	Podprodukt	Podprodukt pro třídu podkladových aktiv, uvedený v klasifikaci komodit a tabulce derivátů emisních povolenek. Pole vyžaduje základní produkt.	Jsou povoleny pouze hodnoty ve sloupci „Podprodukt“ v tabulce s klasifikací komoditních derivátů.
37	Další podprodukt	Další podprodukt pro třídu podkladových aktiv, uvedený v klasifikaci komodit a tabulce derivátů emisních povolenek. Pole vyžaduje podprodukt.	Jsou povoleny pouze hodnoty ve sloupci „Další podprodukt“ v tabulce s klasifikací komoditních derivátů.
38	Druh transakce	Druh transakce upřesněný obchodním systémem	„FUTR“ – Futures „OPTN“ – Opce „TAPO“ – TAPOS „SWAP“ – Swapy „MINI“ – Minifutures „OTCT“ – OTC deriváty „ORIT“ – Outright (přímá transakce) „CRCK“ – Crack „DIFF“ – Differential „OTHR“ – jiné
39	Druh konečné ceny	Druh konečné ceny upřesněný obchodním systémem	„ARGM“ – Argus/McCloskey „BLTC“ – Baltic „EXOF“ – Exchange „GBCL“ – GlobalCOAL „IHSM“ – IHS McCloskey „PLAT“ – Platts „OTHR“ – jiné

Č.	POLE	OBSAH, KTERÝ MÁ BÝT OZNÁMEN	FORMÁTY A STANDARDSY PRO PODÁVÁNÍ ZPRÁV
Úrokové deriváty			
— Pole v tomto oddíle se vyplní pouze u nástrojů, jejichž podkladovým nástrojem je nefinanční nástroj ve formě úrokové sazby.			
40	Referenční sazba	Název referenční sazby	{INDEX} nebo {ALPHANUM-25} – pokud není referenční sazba zahrnuta do seznamu {INDEX}
41	Doba trvání smlouvy o úrokové sazbě	Jsou-li třídou aktiv úrokové sazby, toto pole uvádí dobu trvání smlouvy. Doba se vyjádří v dnech, týdnech, měsících nebo letech.	{INTEGER-3}+„DAYS“ – dny {INTEGER-3}+ „WEEK“ – týdny {INTEGER-3}+ „MNTH“ – měsíce {INTEGER-3}+ „YEAR“ – roky
42	Jmenovitá měna 2	V případě swapů více měn nebo křížových měnových swapů měna, v níž je denominována komponenta 2 smlouvy. U swapů, jejichž podkladový swap tvoří více měn, měna, v níž je denominována komponenta 2 swapu.	{CURRENCYCODE_3}
43	Pevná sazba komponenty 1	Případně údaj o použité pevné sazbě komponenty 1.	{DECIMAL -11/10} Vyjádřeno v procentech (například 7,0 znamená 7 % a 0,3 znamená 0,3 %)
44	Pevná sazba komponenty 2	Případně údaj o použité pevné sazbě komponenty 2	{DECIMAL -11/10} Vyjádřeno v procentech (například 7,0 znamená 7 % a 0,3 znamená 0,3 %)
45	Pohyblivá sazba komponenty 2	Případně údaj o použité úrokové sazbě.	{INDEX} nebo {ALPHANUM-25} – pokud není referenční sazba zahrnuta do seznamu {INDEX}
46	Doba trvání smlouvy o úrokové sazbě u komponenty 2	Údaj o referenčním období úrokové sazby, která je stanovena v předem určených intervalech odkazem na tržní referenční sazbu. Doba se vyjádří v dnech, týdnech, měsících nebo letech.	{INTEGER-3}+„DAYS“ – dny {INTEGER-3}+ „WEEK“ – týdny {INTEGER-3}+ „MNTH“ – měsíce {INTEGER-3}+ „YEAR“ – roky

Měnové deriváty

— Pole v tomto oddíle se vyplní pouze u nástrojů, jejichž podkladovým nástrojem je nefinanční nástroj ve formě cizí měny.

47	Jmenovitá měna 2	Pole se vyplní podkladovou měnou 2 měnového páru (měna jedna se vyplní v poli 13 pro jmenovitou měnu 1).	{CURRENCYCODE_3}
48	Druh podkladové měny (FX Type)	Druh podkladové měny	„FXCR“ – křížové měnové kurzy „FXEM“ – rozvíjející se měnové trhy „FXMJ“ – FX Majors