

ДЕЛЕГИРАН РЕГЛАМЕНТ (ЕС) 2017/585 НА КОМИСИЯТА**от 14 юли 2016 година**

за допълване на Регламент (ЕС) № 600/2014 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на регулаторните технически стандарти за определяне на стандартите и форматите за референтните данни за финансовите инструменти и техническите мерки във връзка с процедурите, които трябва да бъдат прилагани от Европейския орган за ценни книжа и пазари и компетентните органи

(текст от значение за ЕИП)

ЕВРОПЕЙСКАТА КОМИСИЯ,

като взе предвид Договора за функционирането на Европейския съюз,

като взе предвид Регламент (ЕС) № 600/2014 на Европейския парламент и на Съвета от 15 май 2014 г. относно пазарите на финансови инструменти и за изменение на Регламент (ЕС) № 648/2012 ⁽¹⁾, и по-специално член 27, параграф 3, трета алинея от него,

като има предвид, че:

- (1) За целите на ефективното наблюдение на пазара от страна на компетентните органи референтните данни за финансовите инструменти следва да бъдат докладвани в единен формат и в съответствие с хармонизирани стандарти.
- (2) Докладването и публикуването на референтни данни в електронна, машинночетима форма и формат с възможност за изтегляне улеснява ефективното използване на данните и техния обмен.
- (3) Бързото получаване на референтни данни по отношение на всички финансови инструменти, допуснати до търговия или търгувани на място на търговия или чрез систематичен участник, дава възможност на компетентните органи и на Европейския орган за ценни книжа и пазари (ESMA) да осигурят качеството на данните и ефективно наблюдение на пазара и по този начин допринасят за налагането на лоялни пазарни отношения.
- (4) За да се гарантира, че местата на търговия и систематичните участници подават пълни и точни референтни данни и че компетентните органи са в състояние реално и своевременно да получават и използват тези данни, следва да бъдат определени подходящи срокове за подаване. Необходимо е да се осигури достатъчно време преди публикуването за установяване на неточности или пропуски при подаването. С цел да се гарантира, че подадените референтни данни отразяват съответната информация, докладвана в съответствие с член 26 от Регламент (ЕС) № 600/2014, компетентните органи следва да използват референтните данни по отношение на даден ден за потвърждаване и обмен на докладите за изпълнените в същия ден сделки.
- (5) В съответствие с член 27, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 600/2014 лицата, които изпращат и получават референтни данни, трябва да осигурят ефективното получаване, ефикасния обмен и качеството на данните и съгласуваността им със съответните отчети за сделки, предвидени в член 26 от същия регламент. Поради това местата на търговия и систематичните участници следва да предоставят пълни и точни референтни данни и следва незабавно да информират компетентните органи за установените пропуски или неточности във вече подадените данни. Те също така следва да поддържат подходящи системи и механизми за контрол, осигуряващи точно, пълно и своевременно предоставяне на референтни данни.
- (6) С оглед на ефективното използване и обмен на референтните данни и за да се гарантира, че референтните данни са съвместими със съответните данни, представени в отчетите за сделките, при идентифициране на финансовите инструменти и юридическите лица, включени в референтните данни, места на търговия и систематичните участници трябва да използват общопризнати стандарти. По-специално, с оглед осигуряване на съгласуването на референтните данни със съответните отчети за сделките, местата на търговия и систематичните участници следва да гарантират, че в докладваните данни са извлечени и включени международните идентификационни номера на ценни книжа в съответствие с ISO 6166, отнасящи се до докладваните финансови инструменти.
- (7) С оглед на последователността и за да се гарантира гладкото функциониране на финансовите пазари, е необходимо разпоредбите, определени в настоящия регламент, и разпоредбите, установени в Регламент (ЕС) № 600/2014, да се прилагат от една и съща дата.

⁽¹⁾ OBL 173, 12.6.2014 г., стр. 84.

- (8) Настоящият регламент се основава на проектите на регулаторни технически стандарти, предадени на Комисията от ESMA.
- (9) ESMA проведе открити обществени консултации по проектите на регулаторни технически стандарти, въз основа на които е изготвен настоящият регламент, анализира потенциалните разходи и ползи и поиска становище от Групата на участниците от сектора на ценните книжа и пазарите, създадена с член 37 от Регламент (ЕС) № 1095/2010 на Европейския парламент и на Съвета ⁽¹⁾,

ПРИЕ НАСТОЯЩИЯ РЕГЛАМЕНТ:

Член 1

Съдържание, стандарти, форми и формати на референтните данни

Местата на търговия и систематичните участници предоставят на компетентните органи всички сведения за референтните данни за финансовите инструменти („референтните данни“), посочени в таблица 3 от приложението, които се отнасят за съответния финансов инструмент. Всички предоставени сведения се представят съобразно определените в таблица 3 от приложението стандарти и формати, в електронна и машинночетима форма и според общ образец XML съгласно методиката ISO 20022.

Член 2

Срокове за предоставянето на референтни данни на компетентните органи

1. Не по-късно от 21:00 ч. централноевропейско време на всеки ден, в който са отворени за търговия, местата на търговия и систематичните участници предоставят на съответния им компетентен орган референтни данни за всички финансови инструменти, които са допуснати до търговия или се търгуват, включително когато нарежданията или котировките са подадени чрез тяхната система, преди 18:00 ч. централноевропейско време на същия ден.
2. Ако даден финансов инструмент е допуснат до търговия или се търгува, включително когато нареждане или котировка е подадено за първи път, след 18:00 ч. централноевропейско време на деня, в който мястото на търговия или систематичният участник е отворен за търговия, референтните данни за съответния финансов инструмент се предоставят до 21:00 ч. централноевропейско време на следващия ден, в който мястото на търговия или систематичният участник е отворен за търговия.

Член 3

Идентифициране на финансовите инструменти и юридическите лица

1. Преди да започне търговията с финансов инструмент на място на търговия или чрез систематичен участник, мястото на търговия или съответният систематичен участник получава международния идентификационен номер на ценни книжа по ISO 6166 („ISIN“) на финансовия инструмент.
2. Местата на търговия и систематичните участници гарантират, че идентификационните кодове на правните субекти, включени в предоставените референтни данни, са в съответствие със стандарт ISO 17442:2012, отнасят се до съответния емитент и са включени в глобалната система за идентификационни кодове на правни субекти, поддържана от централното оперативното звено, назначено от Регулаторния надзорен комитет на ИКПС.

Член 4

Процедури за осигуряване на ефективното получаване на референтните данни

1. Компетентните органи наблюдават и оценяват пълнотата на референтните данни, които получават от място на търговия или систематичен участник, както и съответствието на тези данни със стандартите и форматите, определени в таблица 3 от приложението.

⁽¹⁾ 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).

2. След като получат референтни данни за всеки ден, в който местата на търговия и систематичните участници са отворени за търговия, компетентните органи уведомяват местата на търговия и систематичните участници за всеки пропуск в данните и за всяко неизпълнение на задължението за предоставяне на референтни данни преди сроковете, посочени в член 2.
3. ESMA наблюдава и оценява пълнотата на референтните данни, които получава от компетентните органи, както и съответствието на тези данни със стандартите и форматите, определени в таблица 3 от приложението.
4. След като получи референтни данни от компетентните органи, ESMA ги уведомява за всеки пропуск в данните и за всяко неизпълнение на задължението за предоставяне на референтни данни преди сроковете, посочени в член 7, параграф 1.

Член 5

Процедури за осигуряване на качеството на референтните данни

Компетентните органи извършват оценки на качеството на съдържанието и точността на референтните данни, получени съгласно член 27, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 600/2014, най-малко веднъж на тримесечие.

Член 6

Методи и процедури за предаване на референтните данни

1. Местата на търговия и систематичните участници гарантират, че предоставят пълни и точни референтни данни на съответните компетентни органи съгласно членове 1 и 3.
2. Местата на търговия и систематичните участници въвеждат методи и процедури, които им позволяват да установят непълните или неточните референтни данни, които вече са подадени. Когато разкрие, че подадените референтни данни са непълни или неточни, мястото на търговия или систематичният участник незабавно уведомява за това съответния му компетентен орган и без излишно забавяне предава на компетентния орган необходимите пълни и точни референтни данни.

Член 7

Процедури за ефикасен обмен и публикуване на референтните данни

1. Компетентните органи предават на ESMA пълни и точни референтни данни ежедневно и не по-късно от 23:59 ч. централноевропейско време, като използват защитен канал за електронна комуникация, създаден за тази цел между компетентните органи и ESMA.
2. На деня, следващ получаването на референтните данни в съответствие с параграф 1, ESMA консолидира получените от всеки компетентен орган данни.
3. ESMA предоставя на всички компетентни органи достъп до консолидираните данни до 08:00 ч. централноевропейско време на деня, следващ тяхното получаване, като използва посочения в параграф 1 защитен канал за електронна комуникация.
4. Компетентните органи използват консолидираните данни по отношение на произволен ден, за да потвърдят отчетите за сделките, изпълнени в същия ден и докладвани в съответствие с член 26 от Регламент (ЕС) № 600/2014.
5. Всеки компетентен орган използва консолидираните данни за даден ден за обмена на отчетите за сделките, предоставени на този ден, в съответствие с член 26, параграф 1, втора алинея от Регламент (ЕС) № 600/2014.
6. ESMA публикува референтните данни в електронна и машинночетима форма с възможност за изтегляне.

Член 8

Влизане в сила и прилагане

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

Настоящият регламент се прилага от датата, посочена в член 55, втора алинея от Регламент (ЕС) № 600/2014.

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

Съставено в Брюксел на 14 юли 2016 година.

За Комисията
Председател
Jean-Claude JUNCKER

ПРИЛОЖЕНИЕ

Таблица 1

Легенда за таблица 3

ОЗНАЧЕНИЕ	ВИД ДАННИ	ОПРЕДЕЛЕНИЕ
{ALPHANUM-n}	До n буквено-цифрови символа	Поле за свободен текст.
{CFI_CODE}	6 символа	Код за класифициране на финансовите инструменти по ISO 10962.
{COUNTRYCODE_2}	2 буквено-цифрови символа	Двубуквен код на държавата (код на държава по ISO 3166-1 alpha-2).
{CURRENCYCODE_3}	3 буквено-цифрови символа	Трибуквен код на валутата (код на валута по ISO 4217).
{DATE_TIME_FORMAT}	Формат на датата и часа по ISO 8601	<p>— Датата и часът са в следния формат: YYYY-MM-DDThh:mm:ss.dddddZ.</p> <p>— „YYYY“ е годината;</p> <p>— „MM“ е месецът;</p> <p>— „DD“ е денят;</p> <p>— „T“ — означава, че се използва буквата „T“</p> <p>— „hh“ е часът;</p> <p>— „mm“ е минутата;</p> <p>— „ss.ddddd“ е секундата и частицата от секунда;</p> <p>— Z е координираното универсално време (UTC).</p> <p>Датите и часовете се докладват по UTC.</p>
{DATEFORMAT}	Формат за представяне на дата по ISO 8601	Датите се попълват в следния формат: YYYY-MM-DD.
{DECIMAL-n/m}	Десетично число с общо до n цифри, от които до m цифри могат да бъдат в дробната част	<p>Цифрово поле както за положителни, така и за отрицателни стойности.</p> <p>— десетичният разделител е „.“ (точка);</p> <p>— пред отрицателните стойности се поставя „-“ (минус);</p> <p>— стойностите се закръгляват и не се съкращават.</p>
{INDEX}	4 буквени символа	<p>„EONA“ — EONIA</p> <p>„EONS“ — EONIA SWAP</p> <p>„EURI“ — EURIBOR</p> <p>„EUUS“ — EURODOLLAR</p> <p>„EUCH“ — EuroSwiss</p> <p>„GCFR“ — GCF REPO</p> <p>„ISDA“ — ISDAFIX</p> <p>„LIBI“ — LIBID</p> <p>„LIBO“ — LIBOR</p> <p>„MAAA“ — Muni AAA</p> <p>„PFAN“ — Pfandbriefe</p> <p>„TIBO“ — TIBOR</p> <p>„STBO“ — STIBOR</p> <p>„BBSW“ — BBSW</p> <p>„JIBA“ — JIBAR</p> <p>„BUBO“ — BUBOR</p>

ОЗНАЧЕНИЕ	ВИД ДАННИ	ОПРЕДЕЛЕНИЕ
		„CDOR“ — CDOR „CIBO“ — CIBOR „MOSP“ — MOSPRIM „NIBO“ — NIBOR „PRBO“ — PRIBOR „TLBO“ — TELBOR „WIBO“ — WIBOR „TREA“ — съкровищни бонове „SWAP“ — суап „FUSW“ — фючърсен суап (Future SWAP)
{INTEGER-n}	Цяло число до общо n знака	Цифрово поле както за положителни, така и за отрицателни цели стойности.
{ISIN}	12 буквено-цифрови символа	ISIN код по ISO 6166.
{LEI}	20 буквено-цифрови символа	Идентификационен код на правния субект по ISO 17442.
{MIC}	4 буквено-цифрови символа	Идентификационен код на пазара по ISO 10383.
{FISN}	35 буквено-цифрови символа	Код FISN (съкратено наименование на финансов инструмент) по ISO 18774.

Таблица 2

Класификация на стоковите деривати и дериватите върху квоти за емисии за таблица 3 (полета 35—37)

Основен продукт	Подпродукт	Допълнителен подпродукт
„AGRI“ — селско стопанство	„GROS“ — маслодайни семена и плодове	„FWHT“ — фуражна пшеница „SOYB“ — соя „CORN“ — царевица „RPSD“ — рапица „RICE“ — ориз „OTHR“ — други
	„SOFT“ — нетрайни продукти	„CCOA“ — какао „ROBU“ — кафе „Робуста“ „WHSG“ — бяла захар „BRWN“ — нерафинирана захар „OTHR“ — други
	„POTA“ — картофи	
	„OOLI“ — маслиново масло	„LAMP“ — маслиново масло за осветление
	„DIRY“ — мляко и млечни продукти	
	„FRST“ — горскостопански продукти	

Основен продукт	Подпродукт	Допълнителен подпродукт
	„SEAF“ — риба и морски дарове	
	„LSTK“ — селскостопански животни	
	„GRIN“ — зърнено-житни продукти	„MWHТ“ — хлебна пшеница
„NRGY“ — енергийни продукти	„ELEC“ — електроенергия	„BSLD“ — базово натоварване „FITR“ — финансови права за пренос „PKLD“ — върхово натоварване „OFFP“ — извънвърхово „OTHR“ — други
	„NGAS“ — природен газ	„GASP“ — GASPOOL „LNGG“ — LNG „NBPG“ — NBP „NCGG“ — NCG „TTFG“ — TTF
	„OILP“ — нефт	„BAKK“ — Bakken „BDSL“ — биодизел „BRNT“ — Brent „BRNX“ — Brent NX „CNDA“ — канадски „COND“ — кондензат „DSEL“ — дизел „DUBA“ — Дубай „ESPO“ — ESPO „ETHA“ — етанол „FUEL“ — гориво „FOIL“ — мазут „GOIL“ — газьол „GSLN“ — бензин „HEAT“ — мазут за отопление „JTFL“ — гориво за реактивни двигатели „KERO“ — керосин „LLSO“ — Light Louisiana Sweet (LLS) „MARS“ — Mars „NAPH“ — нафта „NGLO“ — NGL „TAPI“ — Tapis „URAL“ — Урал „WTIO“ — WTI
	„COAL“ — въглища „INRG“ — Inter Energy „RNNG“ — възобновяема енергия „LGHT“ — леки дестилати „DIST“ — дестилати	

Основен продукт	Подпродукт	Допълнителен подпродукт
„ENVR“ — околна среда	„EMIS“ — емисии	„CERE“ — CER „ERUE“ — ERU „EUAЕ“ — EUA „EUAA“ — EUAA „OTHR“ — други
	„WTHR“ — време „CRBR“ — свързани с въглерода	
„FRGT“ — товарен превоз	„WETF“ — в наливно състояние	„TNKR“ — танкери
	„DRYF“ — в насипно състояние	„DBCR“ — кораби за насипни товари
	„CSHP“ — контейнеровози	
„FRTL“ — торове	„AMMO“ — амоняк „DAPH“ — DAP (диамониев фосфат) „PTSH“ — поташ „SLPH“ — сяра „UREA“ — карбамид „UAAN“ — UAN (карбамид и амониев нитрат)	
„INDP“ — промишлени продукти	„CSTR“ — строителство „MFTG“ — преработвателна промишленост	
„METL“ — метали	„NPRM“ — нескъпоценни метали	„ALUM“ — алуминий „ALUA“ — алуминиеви сплави „CBLT“ — кобалт „COPR“ — мед „IRON“ — желязна руда „LEAD“ — олово „MOLY“ — молибден „NASC“ — North American Special Aluminium Alloy Contract (NASAAC) „NICK“ — никел „STEL“ — стомана „TINN“ — калай „ZINC“ — цинк „OTHR“ — други
	„PRME“ — скъпоценни метали	„GOLD“ — злато „SLVR“ — сребро „PTNM“ — платина „PLDM“ — паладий „OTHR“ — други

Основен продукт	Подпродукт	Допълнителен подпродукт
„MCEX“ — различни екзотични стоки		
„PAPR“ — хартия	„CBRD“ — велпапе „NSPT“ — вестникарска хартия „PULP“ — хартиена маса „RCVP“ — рециклирана хартия	
„POLY“ — полипропилен	„PLST“ — пластмаса	
„INFL“ — инфлация		
„OEST“ — официална икономическа статистика		
„OTHC“ — Друго C10, както е определено в таблица 10.1, раздел 10 от приложение III към Делегиран регламент (ЕС) 2017/583 на Комисията ⁽¹⁾ .		
„OTHR“ — други		

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

Таблица 3

Елементи, които се докладват като референтни данни за финансовите инструменти

№	ПОЛЕ	ДОКЛАДВАНИ ДАННИ	ЗАДЪЛЖИТЕЛНИ СТАНДАРТИ И ФОРМАТИ ЗА ЦЕЛИТЕ НА ДОКЛАДВАНЕТО
Полета с общи данни			
1	Идентификационен код на инструмента	Код, използван за идентифициране на финансовия инструмент.	{ISIN}
2	Пълно наименование на инструмента	Пълно наименование на финансовия инструмент.	{ALPHANUM-350}
3	Класификация на инструмента	Таксономия, използвана за класифициране на финансовия инструмент. Необходимо е да се предостави пълен и точен CFI код.	{CFI_CODE}
4	Обозначаване за стоков дериват или дериват върху квоти за емисии	Обозначава се дали финансовият инструмент попада в обхвата на определението за стоков дериват съгласно член 2, параграф 1, точка 30 от Регламент (ЕС) № 600/2014, или е дериват, свързан с квотите за емисии, посочен в раздел В, точка 4 от приложение I към Директива 2014/65/ЕС.	„true“ — да „false“ — не
Полета относно емитента			
5	Идентификационни данни на емитента или оператора на мястото на търговия	ИКПС (Идентификационен код на правен субект) на емитента или оператора на мястото на търговия.	{LEI}

№	ПОЛЕ	ДОКЛАДВАНИ ДАННИ	ЗАДЪЛЖИТЕЛНИ СТАНДАРТИ И ФОРМАТИ ЗА ЦЕЛИТЕ НА ДОКЛАДВАНЕТО
---	------	------------------	--

Полета относно мястото на търговия

6	Място на търговия	MIC сегмент за мястото на търговия или систематичен участник, ако има такъв, в противен случай — оперативен MIC.	{MIC}
7	Съкратено наименование на финансовия инструмент	Съкратено наименование на финансовия инструмент по ISO 18774.	{FISN}
8	Заявление от страна на емитента за допускане до търговия	Посочва се дали емитентът на финансовия инструмент е заявил, или одобрил търговията или допускането до търговия на финансовия си инструмент на място на търговия.	„true“ — да „false“ — не
9	Дата на одобрението на допускането до търговия	Дата и час на одобряване от емитента на допускането до търговия или на търговията на финансовите му инструменти на дадено място на търговия.	{DATE_TIME_FORMAT}
10	Дата на заявлението за допускане до търговия	Дата и час на заявлението за допускане до търговия на мястото на търговия.	{DATE_TIME_FORMAT}
11	Дата на допускане до търговия или първа дата на търговия	Дата и час на допускането до търговия на мястото на търговия или дата и час на първоначалната търговия с инструмента или на първоначалното нареждане или котировка, получени от страна на мястото на търговия.	{DATE_TIME_FORMAT}
12	Дата на прекратяване	Когато е приложимо, дата и час на прекратяване на търговията с финансовия инструмент или на допускането му до търговия на мястото на търговия.	{DATE_TIME_FORMAT}

Полета относно условните стойности

13	Условна валута 1	Валута, в която е деноминирана условната стойност. При договор за дериват върху лихвен процент или върху валута това е условната валута на компонент 1 или валута 1 на валутната двойка. При суапции, по които базовият суап е в една валута, това е условната валута на базовия суап. При суапции, по които базовият инструмент е в множество валути, това е условната валута на компонент 1 на суапа.	{CURRENCYCODE_3}
----	------------------	---	------------------

Полета относно облигациите или другите форми на секюритизиран дълг

14	Обща номинална стойност на емитираните инструменти	Обща номинална стойност на емитираните инструменти в парично изражение.	{DECIMAL-18/5}
15	Падеж	Дата на падежа на финансовия инструмент. Полето се отнася за дългови инструменти с определен падеж.	{DATEFORMAT}
16	Валута на номиналната стойност	Валута на номиналната стойност за дългови инструменти.	{CURRENCYCODE_3}
17	Номинална стойност на единица/минимална търгувана стойност	Номинална стойност на всеки от инструментите. Ако стойността не е известна, се попълва минималната търгувана стойност.	{DECIMAL-18/5}

№	ПОЛЕ	ДОКЛАДВАНИ ДАННИ	ЗАДЪЛЖИТЕЛНИ СТАНДАРТИ И ФОРМАТИ ЗА ЦЕЛИТЕ НА ДОКЛАДВАНЕТО
18	Фиксиран лихвен процент	Фиксираната норма на възвръщаемост по даден държан до падежа дългов инструмент, изразена като процент.	{DECIMAL-11/10} Изразено като процент (напр. 7,0 означава 7 %; 0,3 означава 0,3 %)
19	Идентификационни данни на индекса/референтната стойност на облигации с плаващ лихвен процент	Попълва се, ако има такива идентификационни данни.	{ISIN}
20	Наименование на индекса/референтната стойност на облигации с плаващ лихвен процент	Ако няма идентификационни данни, се попълва наименованието на индекса.	{INDEX} Или {ALPHANUM-25} — ако индексът не фигурира в списъка {INDEX}
21	Срок на индекса/референтната стойност на облигации с плаващ лихвен процент	Срок на индекса/референтната стойност на облигации с плаващ лихвен процент. Срокуът се изразява в дни, седмици, месеци или години.	{INTEGER-3}+„DAYS“ — дни {INTEGER-3}+„WEEK“ — седмици {INTEGER-3}+„MNTH“ — месеци {INTEGER-3}+„YEAR“ — години
22	Спред в базисни пунктове на индекса/референтната стойност на облигации с плаващ лихвен процент	Брой базисни пунктове над или под индекса, използван за изчисляване на цената.	{INTEGER-5}
23	Ранг на облигацията	Посочете вида облигация: първостепенен дълг, тип „мецанин“, подчинен или второстепенен дълг.	„SNDB“ — първостепенен дълг „MZZD“ — дълг „мецанин“ „SBOD“ — подчинен дълг „JUND“ — второстепенен дълг

Полеза относно дериватите и секюритизираните деривати

24	Падеж	Падеж на финансов инструмент. Полеза се отнася за деривати с определен падеж.	{DATEFORMAT}
25	Множител на цената	Брой на единиците от базовия инструмент, представени с един дериватен договор. При фючърси или опции върху индекси се посочва стойността на един пункт на индекса. При финансови залагания въз основа на спред (spread bets) се посочва движението на цената на базовия инструмент, на който се основава залагането.	{DECIMAL-18/17}
26	Код на базовия инструмент	Посочва се ISIN кодът на базовия инструмент. За американски или глобални депозитарни разписки и други подобни инструменти се посочва ISIN кодът на финансовия инструмент, на който се основават разглежданите финансови инструменти. За конвертируеми облигации се посочва ISIN кодът на инструмента, за който конвертируемите облигации могат да бъдат заменени. За деривати или други инструменти с базов инструмент се посочва ISIN кодът на този базов инструмент, ако той е допуснат до търговия или се търгува на място на търговия. Когато базовият инструмент е дивидент под формата на акции, се посочва кодът на инструмента на съответния дял, даващ право на тези дивиденди.	{ISIN}

№	ПОЛЕ	ДОКЛАДВАНИ ДАННИ	ЗАДЪЛЖИТЕЛНИ СТАНДАРТИ И ФОРМАТИ ЗА ЦЕЛИТЕ НА ДОКЛАДВАНЕТО
		<p>При суапове за кредитно неизпълнение се посочва ISIN кодът на референтното задължение.</p> <p>Ако базовият инструмент е индекс и има ISIN код, се посочва ISIN кодът на този индекс.</p> <p>Когато базовият инструмент е кошница от инструменти, се посочват ISIN кодовете на всеки от включените в кошницата инструменти, ако те са допуснати до търговия или се търгуват на място на търговия. Полета 26 и 27 се докладват толкова пъти, колкото е необходимо, за да се изброят всички инструменти в кошницата.</p>	
27	Емитент	В случай че в инструмента е посочен емитент, а не един отделен инструмент, се посочва ИКПС на емитента.	{LEI}
28	Наименование на базовия индекс	Ако базовият инструмент е индекс, се посочва наименованието на индекса.	{INDEX} Или {ALPHANUM-25} — ако индексът не фигурира в списъка {INDEX}
29	Срок на базовия индекс	Ако базовият инструмент е индекс, се посочва срокът на индекса.	{INTEGER-3}+„DAYS“ — дни {INTEGER-3}+„WEEK“ — седмици {INTEGER-3}+„MNTN“ — месеци {INTEGER-3}+„YEAR“ — години
30	Вид на опцията	<p>Посочва се дали дериватният договор е за покупка (с право да се закупи определен базов актив), или за продажба (с право да се продаде определен базов актив) или дали определянето на това дали е за покупка, или за продажба може да се извърши към момента на упражняването. При суапции видът на опцията е:</p> <ul style="list-style-type: none"> — „за продажба“ — при суапция на получателя, при която купувачът има право да сключи суап като получател по фиксирана цена. — „за покупка“ — при суапция на платеща, при която купувачът има право да сключи суап като платец по фиксирана цена. <p>При горни и долни граници:</p> <ul style="list-style-type: none"> — „за продажба“, ако има долна граница. — „за покупка“, ако има горна граница. Полетата се отнасят само за деривати, които са опции или варианти. 	„PUTO“ — пут „CALL“ — кол „OTHR“ — ако не може да се определи дали опцията е пут или кол
31	Цена на упражняване	<p>Предварително определена цена, по която притежателят ще трябва да купи или да продаде базовия инструмент, или указване, че цената не може да бъде определена към момента на упражняването.</p> <p>Полето се отнася за опции или варианти, при които цената на упражняване може да бъде определена към момента на упражняването.</p> <p>Когато цената не е налична към падения момент, но предстои да бъде определена, стойността е „PNDG“.</p> <p>Когато попълването на цената на упражняване не е приложимо, полето се оставя празно.</p>	{DECIMAL-18/13}, ако цената се изразява като парична стойност {DECIMAL-11/10}, ако цената се изразява като процент или норма на възвръщаемост {DECIMAL-18/17}, ако цената се изразява като базови пунктове „PNDG“, ако цената не е налична
32	Валута на цената на упражняване	Валута на цената на упражняване.	{CURRENCYCODE_3}

№	ПОЛЕ	ДОКЛАДВАНИ ДАННИ	ЗАДЪЛЖИТЕЛНИ СТАНДАРТИ И ФОРМАТИ ЗА ЦЕЛИТЕ НА ДОКЛАДВАНЕТО
33	Видове опции според датата на упражняване	Посочва се дали опцията може да бъде упражнена само на определена дата (европейски и азиатски тип), на поредица предварително определени дати (бермудски тип) или по всяко време през срока на договора (американски тип). Това поле се отнася само за опциите, вариантите и удостоверенията за права.	„EURO“ — европейски „AMER“ — американски „ASIA“ — азиатски „BERM“ — бермудски „OTHR“ — всякакъв друг вид
34	Вид на доставката	Посочва се дали задълженията по договора за финансовия инструмент се изпълняват чрез физическа доставка, или чрез плащане с парични средства. Когато видът на доставката не може да бъде определен към момента на упражняването, се попълва стойност „OPTL“. Това поле се отнася само за деривати.	„PHYS“ — уреждане с физическа доставка „CASH“ — уреждане с парично плащане „OPTN“ — по избор на контрагента или определено от трета страна

Стокови деривати и деривати върху квоти за емисии

35	Основен продукт	Основният продукт за класа базови активи съгласно включената в таблицата класификация на стоковите деривати и дериватите върху квоти за емисии.	Посочват се само стойностите в колона „Основен продукт“ на класификационната таблица на стоковите деривати.
36	Подпродукт	Подпродуктът за класа базови активи съгласно включената в таблицата класификация на стоковите деривати и дериватите върху квоти за емисии. За това поле е необходим основен продукт.	Посочват се само стойностите в колона „Подпродукт“ на класификационната таблица на стоковите деривати.
37	Допълнителен подпродукт	Допълнителният подпродукт за класа базови активи съгласно включената в таблицата класификация на стоковите деривати и дериватите върху квоти за емисии. За това поле е необходим подпродукт.	Посочват се само стойностите в колона „Допълнителен подпродукт“ на класификационната таблица на стоковите деривати.
38	Вид на сделката	Видът на сделката, определен от мястото на търговия.	„FUTR“ — фючърси „OPTN“ — опции „TAPO“ — TAPOS „SWAP“ — суапове „MINI“ — Minis „OTCT“ — извънборсови „ORIT“ — Outright „CRCK“ — Crack „DIFF“ — Differential „OTHR“ — други
39	Вид на окончателната цена	Видът на окончателната цена, определена от мястото на търговия.	„ARGM“ — Argus/McCloskey „BLTC“ — Baltic „EXOF“ — Exchange „GBCL“ — GlobalCOAL „IHSM“ — IHS McCloskey „PLAT“ — Platts „OTHR“ — други

№	ПОЛЕ	ДОКЛАДВАНИ ДАННИ	ЗАДЪЛЖИТЕЛНИ СТАНДАРТИ И ФОРМАТИ ЗА ЦЕЛИТЕ НА ДОКЛАДВАНЕТО
---	------	------------------	--

Деривати върху лихвени проценти

— Полетата в този раздел се попълват само за инструменти, чийто базов инструмент е нефинансов инструмент с характеристики на лихвен процент

40	Референтен лихвен процент	Наименование на референтния лихвен процент.	{INDEX} Или {ALPHANUM-25}— ако референтният лихвен процент не фигурира в списъка {INDEX}
41	Срок на договора (лихвен процент)	Ако класът на актива е лихвен процент, в това поле се попълва срокът на договора. Срокът се изразява в дни, седмици, месеци или години.	{INTEGER-3}+„DAYS“ — дни {INTEGER-3}+„WEEK“ — седмици {INTEGER-3}+„MNTH“ — месеци {INTEGER-3}+„YEAR“ — години
42	Условна валута 2	При суапове в множество валути или кръстосани валутни суапове — валутата, в която е деноминиран компонент 2 на договора. За суапции, при които базовият суап е в множество валути — валутата, в която е деноминиран компонент 2 на суапа.	{CURRENCYCODE_3}
43	Фиксиран лихвен процент на компонент 1	Посочва се използваният фиксиран лихвен процент на компонент 1, ако е приложимо.	{DECIMAL -11/10} Изразено като процент (напр. 7,0 означава 7 %; 0,3 означава 0,3 %)
44	Фиксиран лихвен процент на компонент 2	Посочва се използваният фиксиран лихвен процент на компонент 2, ако е приложимо.	{DECIMAL -11/10} Изразено като процент (напр. 7,0 означава 7 %; 0,3 означава 0,3 %)
45	Плаващ лихвен процент на компонент 2	Посочва се използваният лихвен процент, ако е приложимо.	{INDEX} Или {ALPHANUM-25}— ако референтният лихвен процент не фигурира в списъка {INDEX}
46	Срок на договора (компонент 2, лихвен процент)	Посочва се референтният период на лихвения процент, който е определен на предварително фиксирани интервали спрямо пазарния референтен лихвен процент. Срокът се изразява в дни, седмици, месеци или години.	{INTEGER-3}+„DAYS“ — дни {INTEGER-3}+„WEEK“ — седмици {INTEGER-3}+„MNTH“ — месеци {INTEGER-3}+„YEAR“ — години

Деривати върху валути

— Полетата в този раздел се попълват само за инструменти, чийто базов инструмент е нефинансов инструмент с характеристики на обменен валутен курс.

47	Условна валута 2	В полето следва да се попълни базовата валута 2 от валутната двойка (валута 1 ще се попълни в поле 13 относно условна валута 1)	{CURRENCYCODE_3}
48	Вид обменен курс	Вид на базовата валута.	„FXCR“ — кръстосани курсове „FXEM“ — курсове на нововъзникващи валутни пазари „FXMJ“ — курсове на основните валути