

PROVÁDĚCÍ NAŘÍZENÍ KOMISE (EU) 2019/363**ze dne 13. prosince 2018,**

kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o formát a četnost zpráv s podrobnými údaji o obchodech zajišťujících financování (SFT) registrům obchodních údajů v souladu s nařízením Evropského parlamentu a Rady (EU) 2015/2365, a kterým se mění prováděcí nařízení Komise (EU) č. 1247/2012, pokud jde o použití kódů pro vykazování při vykazování derivátových smluv

(Text s významem pro EHP)

EVROPSKÁ KOMISE,

s ohledem na nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) 2015/2365 ze dne 25. listopadu 2015 o transparentnosti obchodů zajišťujících financování a opětovného použití a o změně nařízení (EU) č. 648/2012 ⁽¹⁾, a zejména na čl. 4 odst. 10 uvedeného nařízení,

s ohledem na nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 648/2012 ze dne 4. července 2012 o OTC derivátech, ústředních protistranách a registrech obchodních údajů ⁽²⁾, a zejména na čl. 9 odst. 6 uvedeného nařízení,

vzhledem k těmto důvodům:

- (1) Podrobné údaje, které smluvní strany obchodů zajišťujících financování („SFT“) oznamují registrům obchodních údajů nebo Evropskému orgánu pro cenné papíry a trhy („orgán ESMA“), by měly být předkládány v harmonizovaném formátu, aby se usnadnilo shromažďování údajů, jejich slučování a srovnávání mezi registry obchodních údajů. V zájmu minimalizace nákladů pro vykazující smluvní strany by měl být formát pro SFT co nejkonzistentnější s formátem předepsaným pro oznamování derivátových smluv podle článku 9 nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 648/2012. Toto nařízení proto stanoví formát pro každou z oblastí, která má být vykazována, a standardizuje zprávu odkazem na normu ISO, která je ve finančním odvětví široce používána.
- (2) Jelikož je nyní plně zaveden globální identifikační kód právnické osoby (LEI), měla by každá smluvní strana SFT k identifikaci právnické osoby ve zprávě používat pouze uvedený systém. Aby smluvní strana používala systém LEI efektivně, měla by zajistit, aby referenční údaje týkající se jejího LEI byly obnovovány v souladu s podmínkami akreditovaného emitenta LEI (místní provozní jednotka). V současné době se vyvíjí rozšíření celosvětového systému LEI s cílem identifikovat pobočky právnických osob. Než bude toto rozšíření dokončeno a považováno za vhodné pro účely podávání zpráv o SFT a toto nařízení odpovídajícím způsobem změněno, měl by být k identifikaci pobočky smluvní strany používán kód ISO země, ve které se pobočka, jejímž prostřednictvím je obchod SFT uzavírán, nachází.
- (3) Vyvíjí se také globální jedinečný identifikační kód obchodníka („UTI“) pro účely identifikace SFT. Než bude tento globální systém UTI dokončen a považován za vhodný pro účely podávání zpráv o SFT a toto nařízení odpovídajícím způsobem změněno, měl by být k identifikaci SFT používán UTI, na němž se smluvní strany dohodly.
- (4) Článek 4a prováděcího nařízení Komise (EU) č. 1247/2012 ⁽³⁾ obsahuje postup pro určení subjektu příslušného pro vytvoření UTI, pokud jde o vykazování derivátových smluv u situací, kdy se smluvní strany na subjektu příslušném pro vytvoření UTI nedohodnou. Aby se zajistila soudržnost mezi vykazováním derivátových smluv a SFT, měl by být zaveden podobný postup pro smluvní strany, které podávají zprávu o SFT.

⁽¹⁾ Úř. věst. L 337, 23.12.2015, s. 1.

⁽²⁾ Úř. věst. L 201, 27.7.2012, s. 1.

⁽³⁾ Prováděcí nařízení Komise (EU) č. 1247/2012 ze dne 19. prosince 2012, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o formát a četnost vykazování obchodů do registrů obchodních údajů podle nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 648/2012 o OTC derivátech, ústředních protistranách a registrech obchodních údajů (Úř. věst. L 352, 21.12.2012, s. 20).

- (5) V současné době neexistuje pro určení toho, na které straně stojí smluvní strana v SFT, žádný společný tržní postup. Proto by měla být stanovena zvláštní pravidla pro zajištění přesné a jednotné identifikace poskytovatele zajištění a příjemce zajištění u SFT.
- (6) Pro jediný SFT lze předložit několik zpráv, například pokud SFT dozná více po sobě následujících změn. Aby bylo zajištěno, že každá zpráva týkající se SFT a každý SFT jako celek budou správně pochopeny, měly by být zprávy předkládány v chronologickém pořadí, ve kterém k oznamovaným událostem došlo.
- (7) V zájmu zmenšení zátěže při vykazování změny některých hodnot, a zejména podrobných údajů o hodnotě zajištění, poskytnuté nebo obdržené marže a o opětovném použití zajištění, měly by být tyto údaje vykazovány ve stavu na konci každého dne pouze tehdy, pokud se liší od dříve oznámených údajů.
- (8) Podrobné údaje o nesplaceném maržovém úvěru by měly být vykazovány ve stavu na konci každého dne, pokud je v základní měně čistý hotovostní debet nebo pokud je tržní hodnota krátké pozice smluvní strany kladná.
- (9) Tržní hodnota půjčených nebo vypůjčených cenných papírů by měla být vykazována ve stavu na konci každého dne. Podobně platí, že pokud smluvní strany vykazují tržní hodnotu zajištění, měly by tak učinit ve stavu na konci každého dne.
- (10) Toto nařízení vychází z návrhů prováděcích technických norem předložených Komisi orgánem ESMA v souladu s postupem uvedeným v článku 15 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) ⁽⁴⁾.
- (11) Orgán ESMA uskutečnil o návrzích prováděcích technických norem otevřenou veřejnou konzultaci, analyzoval možné související náklady a přínosy a požádal o stanovisko skupinu subjektů působících v oblasti cenných papírů a trhů zřízenou podle článku 37 nařízení (EU) č. 1095/2010.
- (12) Stejně jako u podávání zpráv o SFT jsou doposud vyvíjeny některé identifikační a jiné kódy, které se mají používat při vykazování derivátových smluv. Než budou tyto identifikační a jiné kódy k dispozici, posouzeny za vhodné pro účely podávání zpráv a prováděcí nařízení (EU) č. 1247/2012 bude odpovídajícím způsobem změněno, stanoví uvedené nařízení používání kódu klasifikace finančních nástrojů (CFI) podle normy ISO 10692 ke klasifikaci derivátů, u nichž není k dispozici kód ISIN podle normy ISO 6166 ani alternativní identifikační kód nástroje (AII), a používání specifického identifikačního kódu obchodu, na němž se smluvní strany dohodly, k identifikaci derivátové zprávy. K zajištění právní jistoty, pokud jde o vhodný postup pro změnu požadavků na vykazování derivátových smluv, a požadované míry jednotnosti mezi vykazováním derivátů a SFT by prováděcí nařízení (EU) č. 1247/2012 mělo odkazovat pouze na požadavky, které v současnosti pro dané zprávy platí.
- (13) Prováděcí nařízení (EU) č. 1247/2012 by proto mělo být odpovídajícím způsobem změněno,

PŘIJALA TOTO NAŘÍZENÍ:

Článek 1

Standardy a formáty údajů pro zprávy o SFT

Podrobné údaje o SFT ve zprávě, která má být předložena podle čl. 4 odst. 1 nařízení (EU) 2015/2365, musí být poskytnuty v souladu s normami a formáty uvedenými v tabulkách 1 až 5 přílohy I. Uvedená zpráva se předkládá v obvyklé elektronické a strojově čitelné formě a ve společné šabloně XML v souladu s metodikou ISO 20022.

⁽⁴⁾ Úř. věst. L 331, 15.12.2010, s. 84.

Článek 2

Identifikace smluvních stran a ostatních subjektů

1. Ve zprávě uvedené v článku 1 se použije identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 s cílem identifikovat:
 - a) oprávněnou osobu, která je právnickou osobou;
 - b) makléře;
 - c) ústřední smluvní stranu povolenou v souladu s nařízením (EU) č. 648/2012;
 - d) člena clearingového systému;
 - e) zprostředkovatele půjčky;
 - f) účastníka centrálního depozitáře cenných papírů;
 - g) smluvní stranu, která je právnickou osobou;
 - h) trojstranného zástupce/zprostředkovatele trojstranného repa;
 - i) subjekt předkládající zprávu;
 - j) emitenta cenného papíru, který byl půjčen, vypůjčen nebo poskytnut jako zajištění při SFT.
2. Smluvní strana SFT zajistí, aby byly referenční údaje týkající se LEI podle normy ISO 17442 obnoveny v souladu s podmínkami některé z akreditovaných místních provozních jednotek celosvětového systému LEI.
3. Pokud je SFT uzavřen pobočkou smluvní strany, použije se za účelem identifikace dané pobočky smluvní strany ve zprávě uvedené v článku 1 kód uvedený v poli 7 a v poli 8 tabulky 1 v příloze I.

Článek 3

Specifický identifikační kód obchodu

1. Zpráva se identifikuje specifickým identifikačním kódem obchodu („UTI“), na němž se smluvní strany dohodly, ve formátu stanoveném v poli 1 tabulky 2 přílohy I.
2. Nedohodnou-li se smluvní strany na subjektu odpovědném za vytvoření UTI obchodu, který má být zprávě přidělen, určí smluvní strany subjekt odpovědný za vytvoření UTI v souladu s těmito ustanoveními:
 - a) u ústředně prováděných obchodů zajišťujících financování s ústředním clearingem vytvoří UTI obchodu v okamžiku clearing u ústřední smluvní strana za člena clearingového systému. Další UTI obchodu vytvoří člen clearingového systému za svou smluvní stranu;
 - b) u ústředně prováděných obchodů zajišťujících financování, avšak bez ústředně prováděného clearing u vytvoří UTI obchodu obchodní systém, kde byl obchod proveden, za svého člena;
 - c) u ústředně potvrzených obchodů zajišťujících financování s ústředním clearingem vytvoří UTI obchodu ústřední smluvní strana za člena clearingového systému v okamžiku clearing u. Další UTI obchodu vytvoří člen clearingového systému za svou smluvní stranu;
 - d) u obchodů zajišťujících financování, které byly ústředně potvrzeny elektronicky, avšak u nichž nebyl proveden ústřední clearing, vytvoří UTI obchodu platforma potvrzení obchodu v okamžiku potvrzení;
 - e) u veškerých jiných obchodů zajišťujících financování, než které jsou uvedeny v písmenech a) až d), se použijí tato ustanovení:
 - i) uzavírají-li finanční smluvní strany obchod zajišťující financování s nefinančními smluvními stranami, vytvoří UTI obchodu finanční smluvní strany;
 - ii) v případě všech jiných půjček či výpůjček cenných papírů, než které jsou uvedeny v bodě i), vytvoří UTI poskytovatel zajištění uvedený v článku 4;

- iii) u veškerých jiných SFT, než které jsou uvedeny v bodech i) a ii), vytvoří UTI příjemce zajištění uvedený v článku 4.
3. Smluvní strana vytvářející UTI obchodu oznámí uvedený UTI obchodu druhé smluvní straně včas, aby tato mohla splnit svou vykazovací povinnost.

Článek 4

Postavení smluvní strany

1. Postavení smluvní strany v SFT uvedené v poli 9 tabulky 1 přílohy I se určí v souladu s odstavci 2 až 4.
2. V případě repo obchodů, koupě se současným sjednáním zpětného prodeje a prodeje se současným sjednáním zpětné koupě smluvní strana, která kupuje cenné papíry, komodity nebo zaručená práva týkající se vlastnictví cenných papírů nebo komodit při zahajovací čili spotové složce obchodu a souhlasí s tím, že je prodá za stanovenou cenu k určitému budoucímu datu v uzavírací neboli forwardové složce obchodu, je identifikována jako příjemce zajištění v poli 9 tabulky 1 v příloze I. Smluvní strana, která tyto cenné papíry, komodity nebo zaručená práva prodává, je identifikována jako poskytovatel zajištění v poli 9 tabulky 1 přílohy I.
3. V případě výpůjček cenných papírů nebo komodit a půjček cenných papírů nebo komodit je smluvní strana, která cenné papíry nebo komodity půjčuje za podmínky, že vypůjčitel vrátí k určitému budoucímu datu nebo na žádost převodce rovnocenné cenné papíry nebo komodity, identifikována jako příjemce zajištění v poli 9 tabulky 1 v příloze I. Smluvní strana, která si tyto cenné papíry nebo komodity vypůjčí, je identifikována jako poskytovatel zajištění v poli 9 tabulky 1 přílohy I.
4. V případě maržových obchodů je dlužník, tj. smluvní strana, které je úvěr poskytnut výměnou za zajištění, identifikován jako poskytovatel zajištění v poli 9 tabulky 1 přílohy I. Poskytovatel úvěru, tj. smluvní strana, která poskytuje úvěr výměnou za zajištění, je identifikován jako příjemce zajištění v poli 9 tabulky 1 přílohy I.

Článek 5

Četnost zpráv o SFT

1. Všechny zprávy s podrobnými údaji o SFT podle čl. 1 odst. 2 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2019/356 ⁽³⁾ se poskytují chronologicky v pořadí, v jakém k oznámeným událostem došlo.
2. Smluvní strana maržového obchodu vykáže podrobné údaje o nesplaceném maržovém úvěru ve stavu na konci každého dne, pokud je v základní měně čistý hotovostní debet nebo pokud je tržní hodnota krátké pozice smluvní strany kladná.
3. Smluvní strana nesplaceného SFT vykáže každou změnu podrobných údajů týkajících se údajů o zajištění v polích 75 až 94 tabulky 2 přílohy I s druhem činnosti „aktualizace zajištění“. Smluvní strana oznámí tyto pozměněné podrobné údaje ve stavu ke konci každého dne, dokud neoznámí ukončení SFT, nebo dokud neoznámí transakci SFT s druhem činnosti „chyba“, nebo dokud SFT nedosáhne data splatnosti, přičemž se použije dřívější datum.
4. Smluvní strana nesplaceného SFT vykáže každou změnu tržní hodnoty půjčených nebo vypůjčených cenných papírů ke konci dne v poli 57 tabulky 2 přílohy I s druhem činnosti „aktualizace ocenění“. Smluvní strana oznámí uvedenou pozměněnou tržní hodnotu ve stavu ke konci každého dne, dokud neoznámí ukončení SFT, nebo dokud neoznámí transakci SFT s druhem činnosti „chyba“, nebo dokud SFT nedosáhne data splatnosti.

⁽³⁾ Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2019/356 ze dne 13. prosince 2018, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) 2015/2365, pokud jde o regulační technické normy blíže určující podrobné údaje o obchodech zajišťujících financování (SFT), jež mají být oznamovány registrům obchodních údajů (viz strana 1 v tomto čísle Úředního věstníku).

5. Smluvní strana oznámí každou změnu celkové výše složené či přijaté marže za všechny SFT, u nichž byl proveden clearing, ve stavu ke konci dne v polích 8 až 19 tabulky 3 přílohy I s druhem činnosti „aktualizace marže“ poté, co poprvé oznámí celkovou složenou nebo přijatou marži s druhem činnosti „nové“.

6. Smluvní strana oznámí každou změnu hodnoty opětovně použitého zajištění, reinvestované hotovosti a zdrojů financování s druhem činnosti „aktualizace opětovného použití“ ve stavu ke konci dne v polích 8 až 14 tabulky 4 přílohy I poté, co vykáže příslušné hodnoty s druhem činnosti „nové“.

Článek 6

Změny prováděcího nařízení (EU) č. 1247/2012

Prováděcí nařízení (EU) č. 1247/2012 se mění takto:

1) Článek 4 se mění takto:

a) odstavec 7 se nahrazuje tímto:

„Derivát se klasifikuje v poli 4 tabulky 2 přílohy použitím kódu klasifikace finančních nástrojů (CFI) podle normy ISO 10692.“;

b) odstavce 8 a 9 se zrušují.

2) V článku 4a se odstavec 1 nahrazuje tímto:

„1. Zpráva je identifikována specifickým identifikačním kódem obchodu, na němž se dohodly protistrany.“

3) Příloha se nahrazuje zněním podle přílohy II tohoto nařízení.

Článek 7

Vstup v platnost

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

Toto nařízení je závazné v celém rozsahu a přímo použitelné ve všech členských státech.

V Bruselu dne 13. prosince 2018.

Za Komisi

předseda

Jean-Claude JUNKER

PŘÍLOHA I

Formáty, které mají být použity pro zprávy s podrobnými údaji o obchodech zajišťujících financování, jak je uvedeno v čl. 4 odst. 1 a 5 nařízení (EU) 2015/2365

Tabulka 1

Údaje o smluvní straně

Číslo	Pole	Formát
1	Časové razítko podání zprávy	Datum podle normy ISO 8601 a ve formátu koordinovaného světového času (UTC), tj. RRRR-MM-DDThh:mm:ssZ
2	Subjekt podávající zprávu	Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 o 20 alfanumerických znacích
3	Vykazující smluvní strana	Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 o 20 alfanumerických znacích
4	Povaha vykazující smluvní strany	F – finanční smluvní strana N – nefinanční smluvní strana
5	Odvětví vykazující smluvní strany	Taxonomie pro finanční smluvní strany: „CDTI“ – úvěrová instituce s povolením podle směrnice Evropského parlamentu a Rady 2013/36/EU ⁽¹⁾ nebo nařízení Rady (EU) č. 1024/2013 ⁽²⁾ nebo subjekt z třetí země, který by musel mít povolení nebo registraci v souladu s uvedeným právním aktem „INVF“ – investiční podnik s povolením podle směrnice Evropského parlamentu a Rady 2014/65/EU ⁽³⁾ nebo subjekt z třetí země, který by musel mít povolení nebo registraci v souladu s uvedeným právním aktem „INUN“ – pojišťovna s povolením podle směrnice Evropského parlamentu a Rady 2009/138/ES ⁽⁴⁾ („Solventnost II“) nebo subjekt z třetí země, který by musel mít povolení nebo registraci v souladu s uvedeným právním aktem „AIFD“ – AIF spravovaný správcem alternativních investičních fondů s povolením nebo registrací podle směrnice Evropského parlamentu a Rady 2011/61/EU ⁽⁵⁾ nebo subjekt z třetí země, který by musel mít povolení nebo registraci v souladu s uvedeným právním aktem „ORPI“ – instituce zaměstnaneckého penzijního pojištění s povolením nebo registrací podle směrnice Evropského parlamentu a Rady 2003/41/ES ⁽⁶⁾ nebo subjekt z třetí země, který by musel mít povolení nebo registraci v souladu s uvedeným právním aktem „CCPS“ – ústřední protistrana s povolením podle nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 648/2012 ⁽⁷⁾ nebo subjekt z třetí země, který by musel mít povolení nebo registraci v souladu s uvedeným právním aktem „REIN“ – zajišťovna s povolením podle směrnice „Solventnost II“ nebo subjekt z třetí země, který by musel mít povolení nebo registraci v souladu s uvedeným právním aktem „CSDS“ – centrální depozitář cenných papírů s povolením podle nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 909/2014 ⁽⁸⁾ nebo subjekt z třetí země, který by musel mít povolení nebo registraci v souladu s uvedeným právním aktem „UCIT“ – SKIPCP a jeho správcovská společnost s povolením podle směrnice Evropského parlamentu a Rady 2009/65/ES ⁽⁹⁾ nebo subjekt z třetí země, který by musel mít povolení nebo registraci v souladu s uvedeným právním aktem

Číslo	Pole	Formát
		Taxonomie pro nefinanční smluvní strany Následující kategorie odpovídají hlavním oddílům statistické klasifikace ekonomických činností v Evropském společenství (NACE), jak je vymezena v nařízení Evropského parlamentu a Rady (ES) č. 1893/2006 ⁽¹⁰⁾ A – Zemědělství, lesnictví a rybářství B – Těžba a dobývání C – Zpracovatelský průmysl D – Dodávky elektřiny, plynu, páry a klimatizovaného vzduchu E – Zásobování vodou, činnosti související s odpadními vodami, odpady a sanacemi F – Stavebnictví G – Velkoobchod a maloobchod; opravy a údržba motorových vozidel H – Doprava a skladování I – Ubytování, stravování a pohostinství J – Informační a komunikační technologie K – Finanční a pojišťovací činnosti L – Činnosti v oblasti nemovitostí M – Odborné, vědecké a technické činnosti N – Administrativní a podpůrné činnosti O – Veřejná správa a obrana; povinné sociální zabezpečení P – Vzdělávání Q – Zdravotní a sociální péče R – Kulturní, zábavní a rekreační činnosti S – Ostatní činnosti T – Činnosti domácností jako zaměstnavatelů, činnosti domácností produkujících blíže neurčené výrobky a služby pro vlastní potřebu U – Činnosti exteritoriálních organizací a orgánů
6	Dodatečná klasifikace odvětví	„ETFT“ – ETF „MMFT“ – MMF „REIT“ – REIT „OTHR“ – jiné
7	Pobočka vykazující smluvní strany	Kód země podle ISO 3166-1 alpha-2 o dvou abecedních znacích.
8	Pobočka jiné smluvní strany	Kód země podle ISO 3166-1 alpha-2 o dvou abecedních znacích.
9	Postavení smluvní strany	„TAKE“ – příjemce zajištění „GIVE“ – poskytovatel zajištění
10	Subjekt odpovědný za zprávu	Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 o 20 alfanumerických znacích
11	Druhá smluvní strana	Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 o 20 alfanumerických znacích Kód klienta (maximálně 50 alfanumerických znaků).
12	Země druhé smluvní strany	Kód země podle ISO 3166-1 alpha-2 o dvou abecedních znacích.

Číslo	Pole	Formát
13	Oprávněná osoba	Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 o 20 alfanumerických znacích Kód klienta (maximálně 50 alfanumerických znaků).
14	Trojstranný zástupce	Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 o 20 alfanumerických znacích
15	Makléř	Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 o 20 alfanumerických znacích
16	Člen clearingového systému	Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 o 20 alfanumerických znacích
17	Účastník nebo nepřímý účastník centrálního depozitáře cenných papírů („centrální depozitář“)	Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 o 20 alfanumerických znacích
18	Zprostředkovatel půjčky	Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 o 20 alfanumerických znacích

(1) Směrnice Evropského parlamentu a Rady 2013/36/EU ze dne 26. června 2013 o přístupu k činnosti úvěrových institucí a o obezřetnostním dohledu nad úvěrovými institucemi a investičními podniky (Úř. věst. L 176, 27.6.2013, s. 338).

(2) Nařízení Rady (EU) č. 1024/2013 ze dne 15. října 2013, kterým se Evropské centrální bance svěřují zvláštní úkoly týkající se politik, které se vztahují k obezřetnostnímu dohledu nad úvěrovými institucemi (Úř. věst. L 287, 29.10.2013, s. 63).

(3) Směrnice Evropského parlamentu a Rady 2014/65/EU ze dne 15. května 2014 o trzích finančních nástrojů (Úř. věst. L 173, 12.6.2014, s. 349).

(4) Směrnice Evropského parlamentu a Rady 2009/138/ES ze dne 25. listopadu 2009 o přístupu k pojišťovací a zajišťovací činnosti a jejím výkonu (Solventnost II) (Úř. věst. L 335, 17.12.2009, s. 1).

(5) Směrnice Evropského parlamentu a Rady 2011/61/EU ze dne 8. června 2011 o správcích alternativních investičních fondů (Úř. věst. L 174, 1.7.2011, s. 1).

(6) Směrnice Evropského parlamentu a Rady 2003/41/ES ze dne 3. června 2003 o činnostech institucí zaměstnaneckého penzijního pojištění a dohledu nad nimi (Úř. věst. L 235, 23.9.2003, s. 10).

(7) Nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 648/2012 ze dne 4. července 2012 o OTC derivátech, ústředních protistranách a registrech obchodních údajů (Úř. věst. L 201, 27.7.2012, s. 1).

(8) Nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 909/2014 ze dne 23. července 2014 o zlepšení vypořádání obchodů s cennými papíry v Evropské unii a centrálních depozitářích cenných papírů (Úř. věst. L 257, 28.8.2014, s. 1).

(9) Směrnice Evropského parlamentu a Rady 2009/65/ES ze dne 13. července 2009 o koordinaci právních a správních předpisů týkajících se subjektů kolektivního investování do převoditelných cenných papírů (SKIPCP) (Úř. věst. L 302, 17.11.2009, s. 32).

(10) Nařízení Evropského parlamentu a Rady (ES) č. 1893/2006 ze dne 20. prosince 2006, kterým se zavádí statistická klasifikace ekonomických činností NACE Revize 2 (Úř. věst. L 393, 30.12.2006, s. 1).

Tabulka 2

Údaje o úvěru a zajištění

Číslo	Pole	Formát
1	Specifický identifikační kód obchodu (UTI)	Kód o maximálně 52 alfanumerických znacích včetně čtyř speciálních znaků: jsou povoleny pouze velká písmena A – Z včetně a číslice 0 – 9 včetně.
2	Pořadové číslo zprávy	Kód o maximálně 52 alfanumerických znacích včetně čtyř speciálních znaků: jsou povoleny pouze velká písmena A – Z včetně a číslice 0 – 9 včetně.
3	Datum události	Formát data podle ISO 8601 RRRR-MM-DD
4	Druh SFT	„SLEB“ – půjčky nebo výpůjčky cenných papírů nebo komodit „SBSC“ – koupě se současným sjednáním zpětného prodeje nebo prodej se současným sjednáním zpětné koupě „REPO“ – repo obchod „MGLD“ – maržový obchod

Číslo	Pole	Formát
5	Clearing proveden	„Ano“ „Ne“
6	Časové razítko clearingů	Datum podle normy ISO 8601 a ve formátu koordinovaného světového času (UTC), tj. RRRR-MM-DDThh:mm:ssZ
7	Ústřední protistrana	Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 o 20 alfanumerických znacích
8	Obchodní systém	Identifikační kód trhu (MIC) podle normy ISO 10383 o čtyřech alfanumerických znacích. Pokud pro obchodní místo existují segmentové kódy MIC, použije se segmentový kód MIC.
9	Typ rámcové dohody	„MRAA“ – MRA „GMRA“ – GMRA „MSLA“ – MSLA „GMSL“ – GMSLA „ISDA“ – ISDA „DERP“ – Deutscher Rahmenvertrag für Wertpapierpensionsgeschäfte „CNBR“ – China Bond Repurchase Master Agreement „KRRR“ – Korea Financial Investment Association (KOFIA) Standard Repurchase Agreement „CARA“ – Investment Industry Regulatory Organization of Canada (IIROC) Repurchase/Reverse Repurchase Transaction Agreement „FRFB“ – Convention-Cadre Relative aux Operations de Pensions Livrees, „CHRA“ – Swiss Master Repurchase Agreement „DEMA“ – German Master Agreement „JPBR“ – Japanese Master Agreement on the Transaction with Repurchase Agreement of the Bonds „ESRA“ – Contrato Marco de compraventa y Reporto de valores „OSLA“ – Overseas Securities Lending Agreement (OSLA) „MEFI“ – Master Equity and Fixed Interest Stock Lending Agreement (MEFISLA) „GESL“ – Gilt Edged Stock Lending Agreement (GESLA) „KRSL“ – Korean Securities Lending Agreement (KOSLA) „DERD“ – Deutscher Rahmenvertrag für Wertpapierdarlehen „AUSL“ – Australian Masters Securities Lending Agreement (AMSLA) „JPBL“ – Japanese Master Agreement on Lending Transaction of Bonds „JPSL“ – Japanese Master Agreement on the Borrowing and Lending Transactions of Share Certificates „BIAG“ – bilateral agreement (dvoustranná dohoda) „CSDA“ – CSD bilateral agreement (dvoustranná dohoda mezi centrálními depozitáři cenných papírů) Nebo „OTHR“, pokud ve výše uvedeném výčtu není daný typ rámcové dohody zahrnut
10	Jiný typ rámcové dohody	Maximálně 50 alfanumerických znaků
11	Verze rámcové dohody	Datum podle normy ISO 8601 ve formátu RRRR
12	Časové razítko provedení	Datum podle normy ISO 8601 a ve formátu koordinovaného světového času (UTC), tj. RRRR-MM-DDThh:mm:ssZ
13	Datum valuty (datum zahájení)	Formát data podle ISO 8601 RRRR-MM-DD

Číslo	Pole	Formát
14	Datum splatnosti (datum dokončení)	Formát data podle ISO 8601 RRRR-MM-DD
15	Datum ukončení	Formát data podle ISO 8601 RRRR-MM-DD
16	Minimální výpovědní lhůta	Celočíselné pole s maximálně 3 znaky
17	Neranější datum, kdy je možno požadovat splacení	Formát data podle ISO 8601 RRRR-MM-DD
18	Ukazatel obecného zajištění	„SPEC“ – specifické zajištění „GENE“ – obecné zajištění
19	Ukazatel DBV („delivery by value“)	„Ano“ „Ne“
20	Metoda poskytnutí zajištění	„TTCA“ – dohoda o zajištění s převedením vlastnického práva „SICA“ – dohoda o finančním zajištění s poskytnutím jistoty „SIUR“ – dohoda o finančním zajištění s poskytnutím jistoty a užívacím právem
21	Doba neurčitá	„Ano“ „Ne“
22	Možnost volby ukončení	„EGRN“ – trvale otevřená „ETSB“ – lze prodloužit „NOAP“ – nepoužije se

V případě maržových obchodů se atributy uvedené v polích 23 – 34 opakují a vyplňují pro každou měnu použitou v maržovém obchodu.

23	Pevná sazba	Maximálně 11 číselných znaků včetně maximálně 10 desetinných míst vyjádřených jako procentní podíl, kde 100 % je vyjádřeno jako „100“. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.
24	Metoda počítání dní	Kód představující metodu počítání dní: „A001“ – IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule „A002“ – IC30365 „A003“ – IC30Actual „A004“ – Actual360 „A005“ – Actual365Fixed „A006“ – ActualActualICMA „A007“ – IC30E360orEuroBondBasismodel1 „A008“ – ActualActualISDA „A009“ – Actual365LorActuActubasisRule „A010“ – ActualActualAFB „A011“ – IC30360ICMAor30360basicrule „A012“ – IC30E2360orEurobondbasismodel2 „A013“ – IC30E3360orEurobondbasismodel3 „A014“ – Actual365NL nebo maximálně 35 alfanumerických znaků, pokud není metoda počítání dní zahrnuta do výše uvedeného seznamu

Číslo	Pole	Formát
25	Pohyblivá sazba	Kód představující index pohyblivé sazby „EONA“ – EONIA „EONS“ – EONIA SWAP „EURI“ – EURIBOR „EUUS“ – EURODOLLAR „EUCH“ – EuroSwiss „GCFR“ – GCF REPO „ISDA“ – ISDAFIX „LIBI“ – LIBID „LIBO“ – LIBOR „MAAA“ – Muni AAA „PFAN“ – Pfandbriefe „TIBO“ – TIBOR „STBO“ – STIBOR „BBSW“ – BBSW „JIBA“ – JIBAR „BUBO“ – BUBOR „CDOR“ – CDOR „CIBO“ – CIBOR „MOSP“ – MOSPRIM „NIBO“ – NIBOR „PRBO“ – PRIBOR „TLBO“ – TELBOR „WIBO“ – WIBOR „TREA“ – Státní pokladniční poukázky „SWAP“ – Swapy „FUSW“ – Termínované swapy nebo maximálně 25 alfanumerických znaků, pokud není referenční sazba zahrnuta do výše uvedeného seznamu
26	Referenční období pohyblivé sazby – období	Období popisující referenční období, přičemž se použijí tyto zkratky: „YEAR“ – rok „MNTH“ – měsíc „WEEK“ – týden „DAYS“ – den
27	Referenční období pohyblivé sazby – multiplikátor	Celočíselný multiplikátor období popisujícího referenční období pro pohyblivou sazbu. Maximálně 3 číselné znaky.
28	Četnost plateb pohyblivé sazby – období	Období, jež popisuje, jak často si smluvní strany navzájem platí, přičemž se použijí tyto zkratky: „YEAR“ – rok „MNTH“ – měsíc „WEEK“ – týden „DAYS“ – den
29	Četnost plateb pohyblivé sazby – multiplikátor	Celočíselný multiplikátor období popisujícího, jak často si smluvní strany navzájem platí. Maximálně 3 číselné znaky.

Číslo	Pole	Formát
30	Četnost znovunastavení pohyblivé sazby – období	Období, jež popisuje, jak často smluvní strany znovu nastavují pohyblivou repo sazbu, přičemž se použijí tyto zkratky: „YEAR“ – rok „MNTH“ – měsíc „WEEK“ – týden „DAYS“ – den
31	Četnost znovunastavení pohyblivé sazby – multiplikátor	Celočíselný multiplikátor období popisujícího, jak často smluvní strany znovu nastavují pohyblivou repo sazbu. Maximálně 3 číselné znaky.
32	Rozpětí	Maximálně 5 číselných znaků.
33	Množství měny použité k maržovým obchodům	Maximálně 18 číselných znaků včetně až 5 desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.
34	Měna maržových obchodů	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích.

Pole 35 – 36 se pro každou úpravu pohyblivé sazby vyplní znovu.

35	Upravená sazba	Maximálně 11 číselných znaků včetně maximálně 10 desetinných míst vyjádřených jako procentní podíl, kde 100 % je vyjádřeno jako „100“. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.
36	Datum účinnosti sazby	Formát data podle ISO 8601 RRRR-MM-DD
37	Částka jistiny k datu valuty	Maximálně 18 číselných znaků včetně až 5 desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.
38	Částka jistiny k datu splatnosti	Maximálně 18 číselných znaků včetně až 5 desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.
39	Měna částky jistiny	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích.
40	Druh aktiva	„SECU“ – cenné papíry „COMM“ – komodity
41	Identifikační kód cenného papíru	Kód ISIN o 12 alfanumerických znacích podle ISO 6166
42	Klasifikace cenného papíru	Kód klasifikace finančních nástrojů podle normy ISO 10692 o šesti abecedních znacích.

Pokud byla zapůjčena nebo vypůjčena komodita, uveďte se klasifikace této komodity v polích 43, 44 a 45.

43	Základní produkt	Jsou povoleny pouze hodnoty ve sloupci „Základní produkt“ v tabulce s klasifikací komoditních derivátů.
----	------------------	---

Číslo	Pole	Formát
44	Podprodukt	Jsou povoleny pouze hodnoty ve sloupci „Podprodukt“ v tabulce s klasifikací komoditních derivátů.
45	Další podprodukt	Jsou povoleny pouze hodnoty ve sloupci „Další podprodukt“ v tabulce s klasifikací komoditních derivátů.
46	Množství nebo nominální částka	Maximálně 18 číselných znaků včetně až 5 desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.
47	Měrná jednotka	„KILO“ – kilogram, „PIEC“ – piece (kus), „TONS“ – ton (tuna), „METR“ – metre (metr), „INCH“ – inch (palec), „YARD“ – yard, „GBGA“ – GBGallon (britský galon), „GRAM“ – gram, „CMET“ – centimetre (centimetr), „SMET“ – SquareMetre (metr čtvereční), „FOOT“ – foot (stopa), „MILE“ – mile (míle), „SQIN“ – SquareInch (palec čtvereční), „SQFO“ – SquareFoot (stopa čtvereční), „SQMI“ – SquareMile (míle čtvereční), „GBOU“ – GBounce (britská unce), „USOU“ – USOunce (americká unce), „GBPI“ – GBPint (britská pinta), „USPI“ – USPint (americká pinta), „GBQA“ – GBQuart (britský kvart), „USQA“ – USQuart (americký kvart), „USGA“ – USGallon (americký galon), „MMET“ – millimetre (milimetr), „KMET“ – kilometre (kilometr), „SQYA“ – SquareYard (yard čtvereční), „ACRE“ – acre (akr), „ARES“ – are (ar), „SMIL“ – SquareMillimetre (milimetr čtvereční), „SCMT“ – SquareCentimetre (centimetr čtvereční), „HECT“ – hectare (hektar), „SQKI“ – SquareKilometre (kilometr čtvereční), „MILI“ – MilliLitre (mililitr), „CELI“ – centilitre (centilitr), „LITR“ – litre (litr), „PUND“ – pound (libra), „ALOW“ – allowances (kvóty), „ACCY“ – AmountOfCurrency (částka měny), „BARL“ – barrels (barel), „BCUF“ – BillionCubicFeet (miliarda stop čtverečních), „BDFT“ – BoardFeet (desková stopa), „BUSL“ – bushels (bušel), „CEER“ – CertifiedEmissionsReduction (certifikované snížení emisí), „CLRT“ – ClimateReserveTonnes (tuna ušetřených emisí), „CBME“ – CubicMeters (metr krychlový), „DAYS“ – days (den), „DMET“ – DryMetricTons (suchá metrická tuna), „ENVC“ – EnvironmentalCredit (úvěr pro ekologické účely), „ENVO“ – EnvironmentalOffset (kompenzace pro ekologické účely), „HUWG“ – hundredweight, „KWDC“ – KilowattDayCapacity (kapacita v kilowattdnech), „KWHO“ – KilowattHours (kilowatthodiny), „KWHC“ – KilowattHoursCapacity (kapacita v kilowatthodinách), „KMOC“ – KilowattMinuteCapacity (kapacita v kilowattminutách), „KWMC“ – KilowattMonthCapacity (kapacita v kilowattměsících), „KWYC“ – KilowattYearCapacity (kapacita v kilowattletech), „MWDC“ – MegawattDayCapacity (kapacita v megawattdnech), „MWHO“ – MegawattHours (megawatthodina), „MWHC“ – MegawattHoursCapacity (kapacita v megawatthodinách), „MWMC“ – MegawattMinuteCapacity (kapacita v megawattminutách), „MMOC“ – MegawattMonthCapacity (kapacita v megawattměsících), „MWYC“ – MegawattYearCapacity (kapacita v megawattletech), „TONE“ – MetricTons (metrická tuna), „MIBA“ – MillionBarrels (milion barelů), „MBTU“ – OneMillionBTU (milion BTU), „OZTR“ – TroyOunces (trojská unce), „UCWT“ – USHundredweight (americká jednotka hmotnosti „hundredweight“), „IPNT“ – IndexPoint (indexový bod), „PWRD“ – PrincipalWithRelationToDebtInstrument (jistina ve vztahu k dluhovému nástroji), „DGEU“ – DieselGallonEquivalent (ekvivalent galonu nafty), „GGEU“ – GasolineGallonEquivalent (ekvivalent galonu benzínu), „TOCD“ – TonsOfCarbonDioxide (tuna oxidu uhličitého).
48	Měna nominální částky	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích.
49	Cena cenného papíru nebo komodity	Maximálně 18 číselných znaků včetně až 5 desetinných míst, je-li cena vyjádřena v jednotkách. Maximálně 11 číselných znaků včetně až 10 desetinných míst, je-li cena vyjádřena jako procentní podíl či výnos. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.
50	Měna, v níž je uvedena cena	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích.

Číslo	Pole	Formát
51	Kvalita cenného papíru	„INVG“ – investiční stupeň „NIVG“ – neinvestiční stupeň „NOTR“ – bez ratingu „NOAP“ – nepoužije se
52	Splatnost cenného papíru	Formát data podle ISO 8601 RRRR-MM-DD
53	Jurisdikce emitenta	Kód země podle ISO 3166-1 alpha-2 o dvou abecedních znacích.
54	LEI emitenta	Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 o 20 alfanumerických znacích
55	Druh cenného papíru	„GOVS“ – státní cenné papíry „SUNS“ – cenné papíry nadnárodních společností a cenné papíry agentur „FIDE“ – dluhové cenné papíry (včetně krytých dluhopisů) vydané bankami a jinými finančními institucemi „NFID“ – podnikové dluhové cenné papíry (včetně krytých dluhopisů) vydané nefinančními institucemi „SEPR“ – sekuritizované produkty (včetně CDO, CMBS, ABCP) „MEQU“ – akcie hlavního indexu (včetně konvertibilních dluhopisů) „OEQU“ – ostatní akcie (včetně konvertibilních dluhopisů) „OTHR“ – ostatní aktiva (včetně akcií ve vzájemných fondech)
56	Hodnota úvěru	Maximálně 18 číselných znaků včetně až 5 desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.
57	Tržní hodnota	Maximálně 18 číselných znaků včetně až 5 desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.
58	Pevná sazba slevy	Maximálně 11 číselných znaků včetně maximálně 10 desetinných míst vyjádřených jako procentní podíl, kde 100 % je vyjádřeno jako „100“. Znaménko mínus, je-li použito, se za číselný znak nepočítá.
59	Pohyblivá sazba slevy	Kód představující index pohyblivé sazby „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

Číslo	Pole	Formát
		„JIBA“ – JIBAR „BUBO“ – BUBOR „CDOR“ – CDOR „CIBO“ – CIBOR „MOSP“ – MOSPRIM „NIBO“ – NIBOR „PRBO“ – PRIBOR „TLBO“ – TELBOR „WIBO“ – WIBOR „TREA“ – Státní pokladniční poukázky „SWAP“ – Swapy „FUSW“ – Termínované swapy nebo maximálně 25 alfanumerických znaků, pokud není referenční sazba zahrnuta do výše uvedeného seznamu
60	Referenční období pohyblivé sazby slevy – období	Období popisující referenční období, přičemž se použijí tyto zkratky: „YEAR“ – rok „MNTH“ – měsíc „WEEK“ – týden „DAYS“ – den
61	Referenční období pohyblivé sazby slevy – multiplikátor	Celočíslný multiplikátor období popisujícího referenční období pro pohyblivou sazbu slevy. Maximálně 3 číselné znaky.
62	Četnost plateb pohyblivé sazby slevy – období	Období, jež popisuje, jak často si smluvní strany navzájem platí, přičemž se použijí tyto zkratky: „YEAR“ – rok „MNTH“ – měsíc „WEEK“ – týden „DAYS“ – den
63	Četnost plateb pohyblivé sazby slevy - multiplikátor	Celočíslný multiplikátor období popisujícího, jak často si smluvní strany navzájem platí. Maximálně 3 číselné znaky.
64	Četnost znovunastavení pohyblivé sazby slevy – období	Období, jež popisuje, jak často smluvní strany znovu nastavují pohyblivou sazbu slevy, přičemž se použijí tyto zkratky: „YEAR“ – rok „MNTH“ – měsíc „WEEK“ – týden „DAYS“ – den
65	Četnost znovunastavení pohyblivé sazby slevy – multiplikátor	Celočíslný multiplikátor období popisujícího, jak často smluvní strany znovu nastavují pohyblivou sazbu slevy. Maximálně 3 číselné znaky.
66	Spread sazby slevy	Maximálně 5 číselných znaků.
67	Poplatek za úvěr	Maximálně 11 číselných znaků včetně maximálně 10 desetinných míst vyjádřených jako procentní podíl, kde 100 % je vyjádřeno jako „100“.

Číslo	Pole	Formát
68	Výhradní dohody	„Ano“ „Ne“
69	Nesplacený maržový úvěr	Maximálně 18 číselných znaků včetně až 5 desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.
70	Základní měna nesplaceného maržového úvěru	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích.
71	Tržní hodnota krátkých pozic	Maximálně 18 číselných znaků včetně až 5 desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.

Údaje o zajištění

72	Označení nezajištěné půjčky cenných papírů	„Ano“ „Ne“
73	Zajištění čisté expozice	„Ano“ „Ne“
74	Datum valuty zajištění	Formát data podle ISO 8601 RRRR-MM-DD

Pokud bylo použito specifické zajištění, vyplní se případně pole 75 až 94 znovu pro každou složku zajištění.

75	Typ složky zajištění	„SECU“ – cenné papíry „COMM“ – komodity (pouze u rep, půjček a výpůjček cenných papírů a komodit a koupí se současným sjednáním zpětného prodeje) „CASH“ – hotovost
----	----------------------	---

Pokud byla jako zajištění použita hotovost, uveďte se to v polích 76 a 77.

76	Částka hotovostního zajištění	Maximálně 18 číselných znaků včetně až 5 desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.
77	Měna hotovostního zajištění	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích.
78	Identifikace cenného papíru užitého jako zajištění	Kód ISIN o 12 alfanumerických znacích podle ISO 6166
79	Klasifikace cenného papíru užitého jako zajištění	Kód klasifikace finančních nástrojů podle normy ISO 10692 o šesti abecedních znacích.

Číslo	Pole	Formát
Pokud byla jako zajištění použita komodita, uveďte se klasifikace této komodity v polích 80, 81 a 82.		
80	Základní produkt	Jsou povoleny pouze hodnoty ve sloupci „Základní produkt“ v tabulce s klasifikací komoditních derivátů.
81	Podprodukt	Jsou povoleny pouze hodnoty ve sloupci „Podprodukt“ v tabulce s klasifikací komoditních derivátů.
82	Další podprodukt	Jsou povoleny pouze hodnoty ve sloupci „Další podprodukt“ v tabulce s klasifikací komoditních derivátů.
83	Množství nebo nominální částka zajištění	Maximálně 18 číselných znaků včetně až 5 desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.
84	Měrná jednotka zajištění	„KILO“ – kilogram, „PIEC“ – piece (kus), „TONS“ – ton (tuna), „METR“ – metre (metr), „INCH“ – inch (palec), „YARD“ – yard, „GBGA“ – GBGallon (britský galon), „GRAM“ – gram, „CMET“ – centimetre (centimetr), „SMET“ – SquareMetre (metr čtvereční), „FOOT“ – foot (stopa), „MILE“ – mile (míle), „SQIN“ – SquareInch (palec čtvereční), „SQFO“ – SquareFoot (stopa čtvereční), „SQMI“ – SquareMile (míle čtvereční), „GBOU“ – GBounce (britská unce), „USOU“ – USOunce (americká unce), „GBPI“ – GBPint (britská pinta), „USPI“ – USPint (americká pinta), „GBQA“ – GBQuart (britský kvart), „USQA“ – USQuart (americký kvart), „USGA“ – USGallon (americký galon), „MMET“ – millimetre (milimetr), „KMET“ – kilometre (kilometr), „SQYA“ – SquareYard (yard čtvereční), „ACRE“ – acre (akr), „ARES“ – are (ar), „SMIL“ – SquareMillimetre (milimetr čtvereční), „SCMT“ – SquareCentimetre (centimetr čtvereční), „HECT“ – hectare (hektar), „SQKI“ – SquareKilometre (kilometr čtvereční), „MILI“ – MilliLitre (mililitr), „CELI“ – centilitre (centilitr), „LITR“ – litre (litr), „PUND“ – pound (libra), „ALOW“ – allowances (kvóty), „ACCY“ – AmountOfCurrency (částka měny), „BARL“ – barrels (barel), „BCUF“ – BillionCubicFeet (miliarda stop čtverečních), „BDFT“ – BoardFeet (desková stopa), „BUSL“ – bushels (bušel), „CEER“ – CertifiedEmissionsReduction (certifikované snížení emisí), „CLRT“ – ClimateReserveTonnes (tuna ušetřených emisí), „CBME“ – CubicMeters (metr krychlový), „DAYS“ – days (den), „DMET“ – DryMetricTons (suchá metrická tuna), „ENVC“ – EnvironmentalCredit (úvěr pro ekologické účely), „ENVO“ – EnvironmentalOffset (kompenzace pro ekologické účely), „HUWG“ – hundredweight, „KWDC“ – KilowattDayCapacity (kapacita v kilowatt dnech), „KWHO“ – KilowattHours (kilowatthodiny), „KWHC“ – KilowattHoursCapacity (kapacita v kilowatthodinách), „KMOC“ – KilowattMinuteCapacity (kapacita v kilowattminutách), „KWMC“ – KilowattMonthCapacity (kapacita v kilowattměsících), „KWYC“ – KilowattYearCapacity (kapacita v kilowattletech), „MWDC“ – MegawattDayCapacity (kapacita v megawatt dnech), „MWHO“ – MegawattHours (megawatthodina), „MWHC“ – MegawattHoursCapacity (kapacita v megawatthodinách), „MWMC“ – MegawattMinuteCapacity (kapacita v megawattminutách), „MMOC“ – MegawattMonthCapacity (kapacita v megawattměsících), „MWYC“ – MegawattYearCapacity (kapacita v megawattletech), „TONE“ – MetricTons (metrická tuna), „MIBA“ – MillionBarrels (milion barelů), „MBTU“ – OneMillionBTU (milion BTU), „OZTR“ – TroyOunces (trojská unce), „UCWT“ – USHundredweight (americká jednotka hmotnosti „hundredweight“), „IPNT“ – IndexPoint (indexový bod), „PWRD“ – PrincipalWithRelationToDebtInstrument (jistina ve vztahu k dluhovému nástroji), „DGEU“ – DieselGallonEquivalent (ekvivalent galonu nafty), „GGEU“ – GasolineGallonEquivalent (ekvivalent galonu benzínu), „TOCD“ – TonsOfCarbonDioxide (tuna oxidu uhličitého).
85	Měna nominální částky zajištění	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích.
86	Měna, v níž je uvedena cena	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích.
87	Cena za jednotku	Maximálně 18 číselných znaků včetně až 5 desetinných míst, je-li cena vyjádřena v jednotkách. Maximálně 11 číselných znaků včetně až 10 desetinných míst, je-li cena vyjádřena jako procentní podíl či výnos. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.

Číslo	Pole	Formát
88	Tržní hodnota zajištění	Maximálně 18 číselných znaků včetně až 5 desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.
89	Srážka nebo marže	Maximálně 11 číselných znaků včetně maximálně 10 desetinných míst vyjádřených jako procentní podíl, kde 100 % je vyjádřeno jako „100“. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.
90	Kvalita zajištění	„INVG“ – investiční stupeň „NIVG“ – neinvestiční stupeň „NOTR“ – bez ratingu „NOAP“ – nepoužije se
91	Datum splatnosti cenného papíru	Formát data podle ISO 8601 RRRR-MM-DD
92	Jurisdikce emitenta	Kód země podle ISO 3166-1 alpha-2 o dvou abecedních znacích.
93	LEI emitenta	Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 o 20 alfanumerických znacích
94	Druh zajištění	„GOVS“ – státní cenné papíry „SUNS“ – cenné papíry nadnárodních společností a cenné papíry agentur „FIDE“ – dluhové cenné papíry (včetně krytých dluhopisů) vydané bankami a jinými finančními institucemi „NFID“ – podnikové dluhové cenné papíry (včetně krytých dluhopisů) vydané nefinančními institucemi „SEPR“ – sekuritizované produkty (včetně CDO, CMBS, ABCP) „MEQU“ – akcie hlavního indexu (včetně konvertibilních dluhopisů) „OEUQ“ – ostatní akcie (včetně konvertibilních dluhopisů) „OTHR“ – ostatní aktiva (včetně akcií ve vzájemných fondech)
95	Možnost opětovného použití zajištění	„Ano“ „Ne“

Pokud je použit koš zajištění, uvede se to v poli 96. Podrobné přidělení zajištění u transakcí SFT prováděných oproti seskupení zajištění se případně uvede v polích 75 až 94.

96	Identifikační kód koše zajištění	Kód ISIN o 12 alfanumerických znacích podle ISO 6166 nebo „NTAV“ (čistá hodnota hmotných aktiv)
97	Kód portfolia	Kód o 52 alfanumerických znacích včetně čtyř speciálních znaků: - _ . Speciální znaky nejsou povoleny na začátku ani na konci kódu. Mezery nejsou povoleny.
98	Druh opatření	„NEWT“ – nové „MODI“ – změna „VALU“ – ocenění „COLU“ – aktualizace zajištění „EROR“ – chyba „CORR“ – oprava

Číslo	Pole	Formát
		„ETRM“ – ukončení/předčasné ukončení „POSC“ – složka pozice
99	Úroveň	„TCTN“ – transakce „PSTN“ – pozice

Tabulka 3
Údaje o marži

Číslo	Pole	Formát
1	Časové razítko podání zprávy	Datum podle normy ISO 8601 a ve formátu koordinovaného světového času (UTC), tj. RRRR-MM-DDThh:mm:ssZ
2	Datum události	Formát data podle ISO 8601 RRRR-MM-DD
3	Subjekt podávající zprávu	Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 o 20 alfanumerických znacích
4	Vykazující smluvní strana	Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 o 20 alfanumerických znacích
5	Subjekt odpovědný za zprávu	Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 o 20 alfanumerických znacích
6	Jiná smluvní strana	Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 o 20 alfanumerických znacích
7	Kód portfolia	Kód o 52 alfanumerických znacích včetně čtyř speciálních znaků: ‘- _’ Speciální znaky nejsou povoleny na začátku ani na konci kódu. Mezery nejsou povoleny.
8	Poskytnutá počáteční marže	Maximálně 18 číselných znaků včetně až 5 desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.
9	Měna poskytnuté počáteční marže	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích.
10	Poskytnutá variační marže	Maximálně 18 číselných znaků včetně až 5 desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.
11	Měna složené variační marže	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích.
12	Obdržená počáteční marže	Maximálně 18 číselných znaků včetně až 5 desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.
13	Měna obdržené počáteční marže	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích.
14	Obdržená variační marže	Maximálně 18 číselných znaků včetně až 5 desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.

Číslo	Pole	Formát
15	Měna obdržené variační marže	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích.
16	Poskytnuté nadměrné zajištění	Maximálně 18 číselných znaků včetně až 5 desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.
17	Měna poskytnutého nadměrného zajištění	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích.
18	Obdržené nadměrné zajištění	Maximálně 18 číselných znaků včetně až 5 desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.
19	Měna obdrženého nadměrného zajištění	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích.
20	Druh opatření	„NEWT“ – nové „MARU“ – aktualizace marže „EROR“ – chyba „CORR“ – oprava

Tabulka 4

Údaje o opakovaném použití, reinvestici hotovosti a zdrojích financování

Číslo	Pole	Formát
1	Časové razítko podání zprávy	Datum podle normy ISO 8601 a ve formátu UTC, tj. RRRR-MM-DDThh:mm:ssZ
2	Datum události	Formát data podle ISO 8601 RRRR-MM-DD
3	Subjekt podávající zprávu	Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 o 20 alfanumerických znacích
4	Vykazující smluvní strana	Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 o 20 alfanumerických znacích
5	Subjekt odpovědný za zprávu	Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 o 20 alfanumerických znacích

Pole 6 se pro každou složku zajištění vyplní znovu.

6	Typ složky zajištění	„SECU“ – cenné papíry „CASH“ – hotovost
---	----------------------	--

Pole 7, 8, 9 a 10 se pro každý cenný papír vyplní znovu.

7	Složka zajištění	Kód ISIN o 12 alfanumerických znacích podle ISO 6166
8	Hodnota opětovně použitého zajištění	Maximálně 18 číselných znaků včetně až 5 desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.
9	Odhadované opětovné použití zajištění	Maximálně 18 číselných znaků včetně až 5 desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.

Číslo	Pole	Formát
10	Měna opětovně použitého zajištění	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích.
11	Úroková sazba z reinvestic	Maximálně 11 číselných znaků včetně maximálně 10 desetinných míst vyjádřených jako procentní podíl, kde 100 % je vyjádřeno jako „100“.
Pokud bylo hotovostní zajištění reinvestováno, vyplní se pole 12, 13 a 14 znovu pro každou investici i každou měnu.		
12	Druh investice u reinvestované hotovosti	„MMFT“ – registrovaný fond peněžního trhu „OCMP“ – jiná smíšené uskupení „REPM“ – trh s repy „SDPU“ – přímý nákup cenných papírů „OTHR“ – jiné
13	Částka reinvestované hotovosti	Maximálně 18 číselných znaků včetně až 5 desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.
14	Měna reinvestované hotovosti	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích.
V případě maržových obchodů vyplní smluvní strana pole 15, 16 a 17 znovu pro každý zdroj financování a podá v těchto polích informace na úrovni subjektu.		
15	Zdroje financování	„REPO“ – repa nebo BSB (koupě se současným sjednáním zpětného prodeje) „SECL“ – hotovostní zajištění z půjčky cenných papírů „FREE“ – bezplatné kredity „CSHS“ – výnosy z klientských prodejů nakrátko „BSHS“ – výnosy z makléřských prodejů nakrátko „UBOR“ – nezabezpečené výpůjčky „OTHR“ – jiné
16	Tržní hodnota zdrojů financování	Maximálně 18 číselných znaků včetně až 5 desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud to není možné, uvádí se poměrná částka.
17	Měna zdrojů financování	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích.
18	Druh opatření	„NEWT“ – nové „REUU“ – aktualizace opětovného použití „EROR“ – chyba „CORR“ – oprava

Tabulka 5

Klasifikace komodit

Základní produkt	Podprodukt	Další podprodukt
„AGRI“ – zemědělský	„GROS“ – zrní, olejnatá semena	„FWHT“ – krmná pšenice „SOYB“ – sójové boby „CORN“ – kukuřice „RPSD“ – semena řepky „RICE“ – rýže „OTHR“ – jiné

Základní produkt	Podprodukt	Další podprodukt
	„SOFT“ – netrvanlivé	„CCOA“ – kakao „ROBU“ – káva Robusta „WHSG“ – bílý cukr „BRWN“ – surový cukr „OTHR“ – jiné
	„POTA“ – brambory	
	„OOLI“ – olivový olej	„LAMP“ – „lampantový“ „OTHR“ – jiné
	„DIRY“ – mléčné výrobky	
	„FRST“ – lesnictví	
	„SEAF“ – potraviny mořského původu	
	„LSTK“ – hospodářská zvířata	
	„GRIN“ – obilí	„MWHT“ – pšenice na mletí „OTHR“ – jiné
	„OTHR“ – jiné	
„NRGY“ – energie	„ELEC“ – elektřina	„BSLD“ – dodávka 24 hodin „FITR“ – finanční převodová práva „PKLD“ – dodávka ve špičce „OFFP“ – mimo špičku „OTHR“ – jiné
	„NGAS“ – zemní plyn	„GASP“ – GASPOOL „LNGG“ – LNG „NBPG“ – NBP „NCGG“ – NCG „TTFG“ – TTF „OTHR“ – jiné
	„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

Základní produkt	Podprodukt	Další podprodukt
		„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 „OTHR“ – jiné
	„COAL“ – uhlí „INRG“ – meziprodukt „RNNG“ – energie z obnovitelných zdrojů „LGHT“ – lehké frakce „DIST“ – destiláty „OTHR“ – jiné	
„ENVR“ – environmentální	„EMIS“ – emise	„CERE“ – jednotka certifikovaného snížení emisí (CER) „ERUE“ – jednotka snížení emisí (ERU) „EUAЕ“ – emisní kvóta (EUA) „EUAA“ – kvóta pro leteckou dopravu (EUAA) „OTHR“ – jiné
	„WTHR“ – počasí „CRBR“ – uhlíkové „OTHR“ – jiné	
„FRGT“ – „náklad“	„WETF“ – vlhký	„TNKR“ – tankery „OTHR“ – jiné
	„DRYF“ – suchý	„DBCR“ – lodě přepravující volně ložený suchý náklad „OTHR“ – jiné
	„CSHP“ – kontejnerové lodě	
	„OTHR“ – jiné	
„FRTL“ – „hnojivo“	„AMMO“ – amoniak „DAPH“ – DAP (hydrogenfosforečnan amonný) „PTSH“ – potaš „SLPH“ – síra „UREA“ – močovina „UAAN“ – UAN (močovina a dusičnan amonný) „OTHR“ – jiné	

Základní produkt	Podprodukt	Další podprodukt
„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
„MCEX“ – vícekomoditní exotické		
„PAPR“ – papír	„CBRD“ – vlnitá kartonáž „NSPT“ – novinový papír „PULP“ – buničina „RCVP“ – sběrný papír „OTHR“ – jiné	
„POLY“ – polypropylen	„PLST“ – umělá hmota „OTHR“ – jiné	
„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 o trzích finančních nástrojů, pokud jde o regulační technické normy týkající se požadavků na transparentnost pro obchodní systémy a investiční podniky v souvislosti s dluhopisy, strukturovanými finančními produkty, povolenkami na emise a deriváty (Úř. věst. L 87, 31.3.2017, s. 229).

PŘÍLOHA II

Příloha prováděcího nařízení (EU) č. 1247/2012 se nahrazuje zněním uvedeným níže.

„PŘÍLOHA

Tabulka 1

Údaje o protistraně

	Pole	Formát
	Smluvní strany	
1	Časové razítko podání zprávy	Datum podle normy ISO 8601 a ve formátu koordinovaného světového času (UTC) RRRR-MM-DDThh:mm:ssZ
2	Identifikace vykazující protistrany	Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 o 20 alfanumerických znacích
3	Typ identifikace druhé protistrany	„LEI“ pro identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 „CLC“ pro kód klienta
4	Identifikace druhé protistrany	Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 o 20 alfanumerických znacích Kód klienta (maximálně 50 alfanumerických znaků).
5	Země druhé protistrany	Kód země o dvou znacích podle normy ISO 3166
6	Korporátní sektor vykazující protistrany	Taxonomie pro finanční protistrany: A = životní pojišťovna s povolením v souladu se směrnicí Evropského parlamentu a Rady 2009/138/ES ⁽¹⁾ C = úvěrová instituce s povolením v souladu se směrnicí Evropského parlamentu a Rady 2013/36/EU ⁽²⁾ F = investiční podnik s povolením v souladu se směrnicí Evropského parlamentu a Rady 2004/39/ES ⁽³⁾ I = pojišťovna s povolením v souladu se směrnicí 2009/138/ES L = alternativní investiční fond spravovaný správcí alternativních investičních fondů s povolením nebo registrací v souladu se směrnicí Evropského parlamentu a Rady 2011/61/ ⁽⁴⁾ O = instituce zaměstnaneckého penzijního pojištění ve smyslu čl. 6 písm. a) směrnice Evropského parlamentu a Rady 2003/41/ES ⁽⁵⁾ R = zajišťovna s povolením v souladu se směrnicí 2009/138/ES U = subjekty kolektivního investování do převoditelných cenných papírů (SKIPCP) a jejich správcovská společnost s povolením v souladu se směrnicí Evropského parlamentu a Rady 2009/65/ES ⁽⁶⁾ Taxonomie pro nefinanční protistrany Následující kategorie odpovídají hlavním oddílům statistické klasifikace ekonomických činností v Evropském společenství (NACE), jak je vymezena v nařízení Evropského parlamentu a Rady (ES) č. 1893/2006 ⁽⁷⁾ 1 = zemědělství, lesnictví a rybářství 2 = těžba a dobývání 3 = výroba/zpracovatelský průmysl 4 = dodávání elektřiny, plynu, páry a klimatizovaného vzduchu

	Pole	Formát
		5 = zásobování vodou, činnosti související s odpadními vodami, odpady a sanacemi 6 = stavebnictví 7 = velkoobchod a maloobchod; opravy a údržba motorových vozidel 8 = doprava a skladování 9 = ubytování, stravování a pohostinství 10 = informační a komunikační činnosti 11 = peněžnictví a pojišťovnictví 12 = činnosti v oblasti nemovitostí 13 = odborné, vědecké a technické činnosti 14 = administrativní a podpůrné činnosti 15 = veřejná správa a obrana; povinné sociální zabezpečení 16 = vzdělávání 17 = zdravotní a sociální péče 18 = kulturní, zábavní a rekreační činnosti 19 = ostatní činnosti 20 = činnosti domácností jako zaměstnavatelů; činnosti domácností produkujících blíže neurčené výrobky a služby pro vlastní potřebu 21 = činnosti exteritoriálních organizací a orgánů Vyazuje-li se více než jedna činnost, uveďte seznam kódů v pořadí relativního významu odpovídajících činností a oddělte je pomlčkou „-“. Nevyplňujte v případě ústředních protistran a jiných typů protistran v souladu s čl. 1 odst. 5 nařízení (EU) č. 648/2012.
7	Povaha vykazující protistrany	F = finanční protistrana N = nefinanční protistrana C = ústřední protistrana O = ostatní
8	Identifikace makléře	Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 o 20 alfanumerických znacích
9	Identifikace subjektu předkládajícího zprávu	Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 o 20 alfanumerických znacích
10	Identifikace člena clearingového systému	Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 o 20 alfanumerických znacích
11	Typ identifikace oprávněné osoby	„LEI“ pro identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 „CLC“ pro kód klienta
12	Identifikace oprávněné osoby	Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 o 20 alfanumerických znacích nebo kód klienta o maximálně 50 alfanumerických znacích v případě, že klient není způsobilý mít identifikační kód právnické osoby
13	Obchodní postavení	P = hlavní činnost A = zprostředkovatel
14	Postavení protistrany	B = kupující S = prodávající Vyplněno v souladu s článkem 3a

	Pole	Formát
15	Přímá souvislost s obchodní činností nebo korporátním financováním	Y = Ano N = Ne
16	Clearingová prahová hodnota	Y = nad prahovou hodnotou N = pod prahovou hodnotou
17	Hodnota smlouvy	Maximálně 20 numerických znaků včetně desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka. Znaménko mínus, je-li použito, se za číselný znak nepočítá.
18	Měna, ve které je uvedena hodnota	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích
19	Časové razítko ocenění	Datum ve formátu podle normy ISO 8601 v koordinovaném světovém čase UTC (RRRR-MM-DDThh:mm:ssZ)
20	Typ ocenění	M = tržní ocenění O = ocenění pomocí modelu C = ocenění ústřední protistrany
21	Zajištění	U = nezajištěno PC = částečně zajištěno OC = zajištěno jednostranně FC = plně zajištěno Vyplněno v souladu s článkem 3b
22	Zajišťovací portfolio	Y = Ano N = Ne
23	Kód zajišťovacího portfolia	Maximálně 52 alfanumerických znaků včetně čtyř speciálních znaků: „., - _“ Speciální znaky nejsou povoleny na začátku ani na konci kódu. Mezery nejsou povoleny.
24	Poskytnutá počáteční marže	Maximálně 20 numerických znaků včetně desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.
25	Měna poskytnuté počáteční marže	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích
26	Poskytnutá variační marže	Maximálně 20 numerických znaků včetně desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.
27	Měna poskytnuté variační marže	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích
28	Obdržená počáteční marže	Maximálně 20 numerických znaků včetně desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.
29	Měna obdržené počáteční marže	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích

	Pole	Formát
30	Obdržená variační marže	Maximálně 20 numerických znaků včetně desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.
31	Měna obdržené variační marže	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích
32	Poskytnuté nadměrné zajištění	Maximálně 20 numerických znaků včetně desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.
33	Měna poskytnutého nadměrného zajištění	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích
34	Obdržené nadměrné zajištění	Maximálně 20 numerických znaků včetně desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.
35	Měna obdrženého nadměrného zajištění	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích

- (¹) Směrnice Evropského parlamentu a Rady 2009/138/ES ze dne 25. listopadu 2009 o přístupu k pojišťovací a zajišťovací činnosti a jejím výkonu (Solventnost II) (Úř. věst. L 335, 17.12.2009, s. 1).
- (²) Směrnice Evropského parlamentu a Rady 2013/36/EU ze dne 26. června 2013 o přístupu k činnosti úvěrových institucí a o obezřetnostním dohledu nad úvěrovými institucemi a investičními podniky, o změně směrnice 2002/87/ES a zrušení směrnic 2006/48/ES a 2006/49/ES (Úř. věst. L 176, 27.6.2013, s. 338).
- (³) Směrnice Evropského parlamentu a Rady 2004/39/ES ze dne 21. dubna 2004 o trzích finančních nástrojů, o změně směrnice Rady 85/611/EHS a 93/6/EHS a směrnice Evropského parlamentu a Rady 2000/12/ES a o zrušení směrnice Rady 93/22/EHS (Úř. věst. L 145, 30.4.2004, s. 1).
- (⁴) Směrnice Evropského parlamentu a Rady 2011/61/EU ze dne 8. června 2011 o správcích alternativních investičních fondů a o změně směrnic 2003/41/ES a 2009/65/ES a nařízení (ES) č. 1060/2009 a (EU) č. 1095/2010 (Úř. věst. L 174, 1.7.2011, s. 1).
- (⁵) Směrnice Evropského parlamentu a Rady 2003/41/ES ze dne 3. června 2003 o činnostech institucí zaměstnaneckého penzijního pojištění a dohledu nad nimi (Úř. věst. L 235, 23.9.2003, s. 10).
- (⁶) Směrnice Evropského parlamentu a Rady 2009/65/ES ze dne 13. července 2009 o koordinaci právních a správních předpisů týkajících se subjektů kolektivního investování do převoditelných cenných papírů (SKIPCP) (Úř. věst. L 302, 17.11.2009, s. 32).
- (⁷) Nařízení Evropského parlamentu a Rady (ES) č. 1893/2006 ze dne 20. prosince 2006, kterým se zavádí statistická klasifikace ekonomických činností NACE Revize 2 a kterým se mění nařízení Rady (EHS) č. 3037/90 a některá nařízení ES o specifických statistických oblastech (Úř. věst. L 393, 30.12.2006, s. 1).

Tabulka 2

Společné údaje

	Pole	Formát	Příslušné druhy derivátových smluv
	Oddíl 2a – Druh smlouvy		Všechny smlouvy
1	Druh smlouvy	CD = finanční rozdílové smlouvy FR = dohody o budoucí úrokové sazbě FU = futures FW = forwardy OP = opce SB = sázka na spready SW = swapy ST = swapce OT = ostatní	

	Pole	Formát	Příslušné druhy derivátových smluv
2	Kategorie aktiv	CO = komoditní deriváty a deriváty na emisní povolenky CR = úvěrové deriváty CU = měnové deriváty EQ = akciové deriváty IR = úrokové deriváty	
	Oddíl 2b – Informace týkající se smluv		Všechny smlouvy
3	Druh klasifikace produktu	C = CFI	
4	Klasifikace produktu	Kód klasifikace finančních nástrojů podle normy ISO 10692 o šesti abecedních znacích.	
5	Typ identifikace produktu	Uveďte uplatňovanou identifikaci: I = ISIN A = AII	
6	Identifikace produktu	Pro identifikační kód produktu typu I: Kód ISIN podle normy ISO 6166 o 12 alfanumerických znacích Pro identifikační kód produktu typu A: úplný kód AII	
7	Typ identifikace podkladového nástroje	I = ISIN A = AII B = koš X = index	
8	Identifikace podkladového nástroje	U identifikace podkladového nástroje typu I: kód ISIN podle normy ISO 6166 o 12 alfanumerických znacích U identifikace podkladového nástroje typu A: úplný kód AII U identifikace podkladového nástroje typu B: veškeré jednotlivé složky identifikace ISIN podle normy ISO 6166 nebo úplný kód AII. Identifikační kódy jednotlivých složek musí být odděleny pomlčkou „-“. U identifikace podkladového nástroje typu X: ISIN podle normy ISO 6166, je-li k dispozici, jinak plný název indexu přidělený poskytovatelem indexu	
9	Jmenovitá měna 1	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích	
10	Jmenovitá měna 2	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích	
11	Měna dodání	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích	
	Oddíl 2c – Údaje o obchodu		Všechny smlouvy
12	Identifikace obchodu	Kód o maximálně 52 alfanumerických znacích včetně čtyř speciálních znaků: „_“ - „_“ Speciální znaky nejsou povoleny na začátku ani na konci kódu. Mezery nejsou povoleny.	

	Pole	Formát	Příslušné druhy derivátových smluv
13	Pořadové číslo zprávy	Maximálně 52 znaků v alfanumerickém poli.	
14	Identifikace složek komplexního obchodu	Maximálně 35 znaků v alfanumerickém poli.	
15	Místo provedení	Identifikační kód trhu (MIC) podle normy ISO 10383 o čtyřech alfanumerických znacích v souladu s čl. 4 písm. b).	
16	Komprese	Y = smlouva vyplývá z komprese N = smlouva nevyplyvá z komprese	
17	Cena/kurz	Maximálně 20 numerických znaků včetně desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka. Znaménko mínus, je-li použito, se za číselný znak nepočítá. Pokud je cena vykázána v procentních hodnotách, měla by být vyjádřena jako procentní podíl, kde 100 % je vyjádřeno jako „100“	
18	Cenová notace	U = jednotky P = procentní podíl Y = výnos	
19	Měna ceny	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích.	
20	Jmenovitá cena	Maximálně 20 numerických znaků včetně desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka. Znaménko mínus, je-li použito, se za číselný znak nepočítá.	
21	Cenový multiplikátor	Maximálně 20 numerických znaků včetně desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.	
22	Množství	Maximálně 20 numerických znaků včetně desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.	
23	Platba předem	Maximálně 20 numerických znaků včetně desetinných míst. Záporné znaménko se použije k označení skutečnosti, že platba byla provedena, a ne obdržena. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka. Znaménko mínus, je-li použito, se za číselný znak nepočítá.	

	Pole	Formát	Příslušné druhy derivátových smluv
24	Druh dodání	C = hotovost P = fyzicky O = na volbě protistrany nebo určeno třetí stranou	
25	Časové razítko provedení	Datum ve formátu podle normy ISO 8601 v koordinovaném světovém čase UTC (RRRR-MM-DDThh:mm:ssZ)	
26	Datum účinnosti	Formát data podle ISO 8601 RRRR-MM-DD	
27	Datum splatnosti	Formát data podle ISO 8601 RRRR-MM-DD	
28	Datum ukončení	Formát data podle ISO 8601 RRRR-MM-DD	
29	Datum vypořádání	Formát data podle ISO 8601 RRRR-MM-DD	
30	Typ rámcové dohody	Volný text, pole s maximálně 50 znaky identifikující název použité rámcové dohody, pokud existuje.	
31	Verze rámcové dohody	Datum podle normy ISO 8601 ve formátu RRRR	
	Oddíl 2d – Zmírňování rizika/vykazování		Všechny smlouvy
32	Časové razítko potvrzení	Datum ve formátu podle normy ISO 8601 v koordinovaném světovém čase UTC (RRRR-MM-DDThh:mm:ssZ)	
33	Způsob potvrzení	Y = potvrzeno neelektronicky N = nepotvrzeno E = potvrzeno elektronicky	
	Oddíl 2e – Clearing		Všechny smlouvy
34	Clearingová povinnost	Y = Ano N = Ne	
35	Clearing proveden	Y = Ano N = Ne	
36	Časové razítko clearingů	Datum ve formátu podle normy ISO 8601 v koordinovaném světovém čase UTC (RRRR-MM-DDThh:mm:ssZ)	
37	Ústřední protistrana	Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 kód o 20 alfanumerických znacích	
38	Uvnitř skupiny	Y = Ano N = Ne	
	Oddíl 2f – Úrokové sazby		Úrokové deriváty
39	Pevná sazba složky 1	Maximálně 10 číselných znaků včetně desetinných míst vyjádřených jako procentní podíl, kde 100 % je vyjádřeno jako „100“.	

	Pole	Formát	Příslušné druhy derivátových smluv
		Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka. Znaménko mínus, je-li použito, se za číselný znak nepočítá.	
40	Pevná sazba složky 2	Maximálně 10 číselných znaků včetně desetinných míst vyjádřených jako procentní podíl, kde 100 % je vyjádřeno jako „100“. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka. Znaménko mínus, je-li použito, se za číselný znak nepočítá.	
41	Počet dní pevné sazby složky 1	Čítec/jmenovatel, kde čítec i jmenovatel jsou číselné znaky nebo abecední výraz „skutečný“, např. 30/360 nebo skutečný/365	
42	Počet dní pevné sazby složky 2	Čítec/jmenovatel, kde čítec i jmenovatel jsou číselné znaky nebo abecední výraz „skutečný“, např. 30/360 nebo skutečný/365	
43	Četnost plateb pevné sazby složky 1 – období	Období, jež popisuje, jak často si protistrany navzájem platí, přičemž se použijí tyto zkratky: Y = rok M = měsíc W = týden D = den	
44	Četnost plateb pevné sazby složky 1 – multiplikátor	Celočíselný multiplikátor období popisujícího, jak často si protistrany navzájem platí. Maximálně 3 číselné znaky.	
45	Četnost plateb pevné sazby složky 2 – období	Období, jež popisuje, jak často si protistrany navzájem platí, přičemž se použijí tyto zkratky: Y = rok M = měsíc W = týden D = den	
46	Četnost plateb pevné sazby složky 2 – multiplikátor	Celočíselný multiplikátor období popisujícího, jak často si protistrany navzájem platí. Maximálně 3 číselné znaky.	
47	Četnost plateb pohyblivé sazby složky 1 – období	Období, jež popisuje, jak často si protistrany navzájem platí, přičemž se použijí tyto zkratky: Y = rok M = měsíc W = týden D = den	
48	Četnost plateb pohyblivé sazby složky 1 – multiplikátor	Celočíselný multiplikátor období popisujícího, jak často si protistrany navzájem platí. Maximálně 3 číselné znaky.	

	Pole	Formát	Příslušné druhy derivátových smluv
49	Četnost plateb pohyblivé sazby složky 2 – období	Období, jež popisuje, jak často si protistrany navzájem platí, přičemž se použijí tyto zkratky: Y = rok M = měsíc W = týden D = den	
50	Četnost plateb pohyblivé sazby složky 2 – multiplikátor	Celočíselný multiplikátor období popisujícího, jak často si protistrany navzájem platí. Maximálně 3 číselné znaky.	
51	Četnost znovunastavení pohyblivé sazby složky 1 – období	Období, jež popisuje, jak často protistrany znovu nastavují pohyblivou sazbu, přičemž se použijí tyto zkratky: Y = rok M = měsíc W = týden D = den	
52	Četnost znovunastavení pohyblivé sazby složky 1 – multiplikátor	Celočíselný multiplikátor časového období popisujícího, jak často protistrany znovu nastavují pohyblivou sazbu. Maximálně 3 číselné znaky.	
53	Četnost znovunastavení pohyblivé sazby složky 2 – období	Období, jež popisuje, jak často protistrany znovu nastavují pohyblivou sazbu, přičemž se použijí tyto zkratky: Y = rok M = měsíc W = týden D = den	
54	Četnost znovunastavení pohyblivé sazby složky 2 – multiplikátor	Celočíselný multiplikátor časového období popisujícího, jak často protistrany znovu nastavují pohyblivou sazbu. Maximálně 3 číselné znaky.	
55	Pohyblivá sazba složky 1	Název indexu pohyblivé sazby „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	

	Pole	Formát	Příslušné druhy derivátových smluv
		„JIBA“ – JIBAR „BUBO“ – BUBOR „CDOR“ – CDOR „CIBO“ – CIBOR „MOSP“ – MOSPRIM „NIBO“ – NIBOR „PRBO“ – PRIBOR „TLBO“ – TELBOR „WIBO“ – WIBOR „TREA“ – Státní pokladniční poukázky „SWAP“ – Swapy „FUSW“ – Termínované swapy nebo maximálně 25 alfanumerických znaků, pokud není referenční sazba zahrnuta do výše uvedeného seznamu	
56	Referenční období pohyblivé sazby složky 1 – období	Období popisující referenční období, přičemž se použijí tyto zkratky: Y = rok M = měsíc W = týden D = den	
57	Referenční období pohyblivé sazby složky 1 – multiplikátor	Celočíselný multiplikátor časového období popisujícího referenční období. Maximálně 3 číselné znaky.	
58	Pohyblivá sazba složky 2	Název indexu pohyblivé sazby „EONA“ – EONIA „EONS“ – EONIA SWAP „EURI“ – EURIBOR „EUUS“ – EURODOLLAR „EUCH“ – EuroSwiss „GCFR“ – GCF REPO „ISDA“ – ISDAFIX „LIBI“ – LIBID „LIBO“ – LIBOR „MAAA“ – Muni AAA „PFAN“ – Pfandbriefe „TIBO“ – TIBOR „STBO“ – STIBOR „BBSW“ – BBSW „JIBA“ – JIBAR „BUBO“ – BUBOR „CDOR“ – CDOR „CIBO“ – CIBOR „MOSP“ – MOSPRIM „NIBO“ – NIBOR „PRBO“ – PRIBOR	

	Pole	Formát	Příslušné druhy derivátových smluv
		„TLBO“ – TELBOR „WIBO“ – WIBOR „TREA“ – Státní pokladniční poukázky „SWAP“ – Swapy „FUSW“ – Termínované swapy nebo maximálně 25 alfanumerických znaků, pokud není referenční sazba zahrnuta do výše uvedeného seznamu	
59	Referenční období pohyblivé sazby složky 2 – období	Období popisující referenční období, přičemž se použijí tyto zkratky: Y = rok M = měsíc W = týden D = den	
60	Referenční období pohyblivé sazby složky 2 – multiplikátor	Celočíselný multiplikátor časového období popisujícího referenční období. Maximálně 3 číselné znaky.	
	Oddíl 2 g – Devizový trh		Měnové deriváty
61	Měna dodání 2	Kód měny podle ISO 4217 o třech abecedních znacích	
62	Měnový kurz 1	Maximálně 10 číselných znaků včetně desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka. Znaménko mínus, je-li použito, se za číselný znak nepočítá.	
63	Forwardový směnný kurz	Maximálně 10 numerických znaků včetně desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka. Znaménko mínus, je-li použito, se za číselný znak nepočítá.	
64	Základ směnného kurzu	Dva kódy měn podle normy ISO 4217 oddělené lomítkem „/“. První kód měny označuje základní měnu a druhý kód měny označuje kótovanou měnu.	
	Oddíl 2h – Komoditní deriváty a deriváty na emisní povolenky		Komoditní deriváty a deriváty na emisní povolenky
	Obecně		
65	Komodity	AG = zemědělské EN = energetické	

	Pole	Formát	Příslušné druhy derivátových smluv
		FR = v oblasti nákladní dopravy ME = kovy IN = indexové EV = v oblasti životního prostředí EX = exotické OT = ostatní	
66	Podrobnosti o komoditách	<i>Zemědělské</i> GO = obiloviny, olejnatá semena DA = mléko a mléčné výrobky LI = hospodářská zvířata FO = lesnické produkty SO = netrvanlivé produkty SF = mořské plody OT = ostatní <i>Energetické</i> OI = ropa NG = zemní plyn CO = uhlí EL = elektřina IE = meziprodukt OT = ostatní <i>V oblasti nákladní dopravy</i> DR = suchá WT = vlhká OT = ostatní <i>Kovy</i> PR = drahé kovy NP = běžné kovy <i>V oblasti životního prostředí</i> WE = počasí EM = emise OT = ostatní	
	Energetické		
67	Místo nebo oblast dodávek	Kód EIC o 16 alfanumerických znacích Opakovatelné pole.	
68	Propojovací bod	Kód EIC o 16 alfanumerických znacích	
69	Typ dodávky	BL = dodávka 24 hodin PL = dodávka ve špičce OP = dodávka mimo špičku BH = dodávka v hodinách/blokových hodinách SH = dodávka kumulativní GD = plynárenský den OT = ostatní	

	Pole	Formát	Příslušné druhy derivátových smluv
	Opakovatelný oddíl polí 70–77		
70	Intervaly dodávky	hh:mmZ	
71	Datum a čas zahájení dodávky	Datum ve formátu podle normy ISO 8601 v koordinovaném světovém čase UTC (RRRR-MM-DDThh:mm:ssZ)	
72	Datum a čas ukončení dodávky	Datum ve formátu podle normy ISO 8601 v koordinovaném světovém čase UTC (RRRR-MM-DDThh:mm:ssZ)	
73	Doba trvání	N = minuty H = hodina D = den W = týden M = měsíc Q = čtvrtletí S = období Y = ročně O = ostatní	
74	Dny v týdnu	WD = pracovní dny WN = víkend MO = pondělí TU = úterý WE = středa TH = čtvrtek FR = pátek SA = sobota SU = neděle Více hodnot oddělených lomítkem „/“ je povoleno	
75	Kapacita dodávky	Maximálně 20 číselných znaků včetně desetinných míst Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka. Znaménko mínus, je-li použito, se za číselný znak nepočítá.	
76	Jednotka množství	KW KWh/h KWh/d MW MWh/h MWh/d GW GWh/h GWh/d	

	Pole	Formát	Příslušné druhy derivátových smluv
		Therm/d KTherm/d MTherm/d cm/d mcm/d	
77	Cena/množství za časový interval	Maximálně 20 numerických znaků včetně desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka. Znaménko mínus, je-li použito, se za číselný znak nepočítá.	
	Oddíl 2i – Opce		Smlouvy obsahující opce
78	Typ opce	P = prodejní C = kupní O = nelze-li určit druh opce (kupní či prodejní)	
79	Rozdělení opcí podle uplatnění	A = americká B = bermudská E = evropská S = asijská Více než jedna hodnota je povolena	
80	Realizační cena (cap/floor sazba)	Maximálně 20 numerických znaků včetně desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka. Znaménko mínus, je-li použito, se za číselný znak nepočítá. Pokud je realizační cena vykázána v procentních hodnotách, měla by být vyjádřena jako procentní podíl, kde 100 % je vyjádřeno jako „100“.	
81	Označení realizační ceny	U = jednotky P = procentní podíl Y = výnos	
82	Datum splatnosti podkladového nástroje	Formát data podle ISO 8601 RRRR-MM-DD	
	Oddíl 2j – Úvěrové deriváty		
83	Seniorita	SNDB = senioritní, např. senioritní nezajištěné dluhové cenné papíry (korporace/finanční instituce), státní dluh v cizí měně (vláda),	

	Pole	Formát	Příslušné druhy derivátových smluv
		SBOD = podřízený, např. podřízený dluh nebo dluhové nástroje kapitálu Lower Tier 2 (banky), vedlejší podřízený dluh nebo dluhové nástroje kapitálu Upper Tier 2 (banky), OTHR = ostatní, např. prioritní akcie nebo kapitál Tier 1 (banky) nebo jiné úvěrové deriváty	
84	Referenční subjekt	Kód země o dvou znacích podle normy ISO 3166 nebo kód země o dvou znacích podle normy ISO 3166-2, po němž následuje pomlčka „-“ a kód nižší územní jednotky země o maximálně 3 alfanumerických znacích nebo Identifikační kód právnické osoby (LEI) podle normy ISO 17442 o 20 alfanumerických znacích	
85	Četnost plateb	MNTH = měsíčně QURT = čtvrtletně MIAN = půlročně YEAR = ročně	
86	Základ pro výpočet	Číselník/jmenovatel, kde číselník i jmenovatel jsou číselné znaky nebo abecední výraz „skutečný“, např. 30/360 nebo skutečný/365	
87	Série	Celočíselné pole s maximálně 5 znaky	
88	Verze	Celočíselné pole s maximálně 5 znaky	
89	Indexový faktor	Maximálně 10 numerických znaků včetně desetinných míst. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.	
90	Tranše	T = tranšovaný U = netranšovaný	
91	Záchytný bod	Maximálně 10 číselných znaků včetně desetinných míst vyjádřených jako desetinný zlomek mezi 0 a 1. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.	
92	Uvolňující bod	Maximálně 10 číselných znaků včetně desetinných míst vyjádřených jako desetinný zlomek mezi 0 a 1. Desetinný oddělovač se za číselný znak nepočítá. Pokud se desetinný oddělovač použije, představuje jej tečka.	
	Oddíl 2k - Změny smlouvy		
93	Druh opatření	N = nová smlouva M = změna	

	Pole	Formát	Příslušné druhy derivátových smluv
		E = chyba C = předčasné ukončení R = oprava Z = komprese V = aktualizace ocenění P = dílčí pozice	
94	Úroveň	T = obchod P = pozice“	