

## II

(Nelegislatīvi akti)

## REGULAS

## KOMISIJAS DELEĢĒTĀ REGULA (ES) 2022/1855

(2022. gada 10. jūnijs),

**ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 648/2012 papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem, kuros precizē darījumu reģistriem ziņojamo datu minimumu un izmantojamo ziņojumu veidu**

(Dokuments attiecas uz EEZ)

EIROPAS KOMISIJA,

ņemot vērā Līgumu par Eiropas Savienības darbību,

ņemot vērā Eiropas Parlamenta un Padomes 2012. gada 4. jūlija Regulu (ES) Nr. 648/2012 par ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, centrālajiem darījumu partneriem un darījumu reģistriem <sup>(1)</sup> un jo īpaši tās 9. panta 5. punktu,

tā kā:

- (1) Deleģētā regula (ES) Nr. 148/2013 (2012. gada 19. decembris), ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 648/2012 par ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, centrālajiem darījumu partneriem un darījumu reģistriem un kas attiecas uz regulatīviem tehniskajiem standartiem par minimālajiem datiem, kuri jāsniedz darījumu reģistriem, ir būtiski grozīta. Tā kā būtu vajadzīgi turpmāki grozījumi, lai uzlabotu ziņošanas satvara skaidrību un nodrošinātu saskaņotību ar jauniem īstenošanas tehniskajiem standartiem un citiem starptautiski pieņemtiem standartiem, tā būtu jāatceļ un jāaizstāj ar šo regulu.
- (2) Pilnīga un precīza informācija par atvasinātajiem instrumentiem, tostarp norāde par uzņēmējdarbības notikumiem, kas izraisa izmaiņas atvasinātajos instrumentos, ir būtiska, lai nodrošinātu atvasināto instrumentu datu efektīvu izmantošanu.
- (3) Ja atvasinātā instrumenta līgumu veido tādu atvasināto instrumentu līgumu kombinācija, par kuriem sarunas tiek risinātas kopā kā par vienu ekonomiska nolīguma produktu, kompetentajām iestādēm ir jāsaprot katra attiecīgā atvasināto instrumentu līguma īpatnības. Tā kā kompetentajām iestādēm ir arī jāspēj saprast vispārējais konteksts, no ziņojuma vajadzētu būt skaidram, ka atvasināto instrumentu līgums ir daļa no kompleksa atvasinātā instrumenta. Tāpēc par atvasināto instrumentu līgumiem, kas ir saistīti ar atvasināto instrumentu līgumu kombināciju, būtu jāziņo atsevišķos ziņojumos par katru atvasināto instrumentu līgumu, izmantojot iekšējo identifikatoru, lai nodrošinātu saikni starp šiem ziņojumiem.
- (4) Tādu atvasināto instrumentu līgumu gadījumā, ko veido atvasināto instrumentu līgumu kombinācija, kas ir jāuzrāda vairāk nekā vienā ziņojumā, var būt grūti noteikt, kā attiecīgā informācija par līgumu būtu jāuzrāda ziņojumos un līdz ar to, cik ziņojumi būtu jāiesniedz. Tāpēc darījuma partneriem būtu jāvienojas par ziņojumu skaitu, kas jāiesniedz, lai izklāstītu sīku informāciju par šādu līgumu.

<sup>(1)</sup> OV L 201, 27.7.2012., 1. lpp.

- (5) Lai nodrošinātu elastību, darījuma partnerim vajadzētu būt iespējai deleģēt ziņojuma sniegšanu par līgumu otram darījuma partnerim vai trešai personai. Darījumu partneriem vajadzētu būt arī iespējai piekrist deleģēt ziņošanu kopīgai trešai struktūrai, tostarp centrālajam darījumu partnerim ("CCP"). Lai nodrošinātu datu kvalitāti, ja abu darījumu partneru vārdā tiek sniegts viens ziņojums, tajā būtu jāiekļauj visa attiecīgā informācija par katru darījumu partneri. Ja ziņošana tiek deleģēta, ziņojumā būtu jāiekļauj visa informācija, kas tiktu paziņota, ja ziņojumu būtu sagatavojis ziņojuma sniedzējs darījumu partneris.
- (6) Ir svarīgi atzīt, ka CCP darbojas kā atvasināto instrumentu līguma puse. Tādēļ, ja spēkā esošam līgumam CCP pēc tam veic tīrvērti, būtu jānorāda, ka tas ir izbeigts, un būtu jāziņo par jauno līgumu, kas izriet no veiktās tīrvērtes.
- (7) Ir svarīgi arī atzīt, ka daži atvasinātie instrumenti, piemēram, atvasinātie instrumenti, ko tirgo tirdzniecības vietās vai organizētās tirdzniecības platformās, kuras atrodas ārpus Savienības, atvasinātie instrumenti, kuriem tīrvērti veic CCP, vai līgumi par cenu starpību, bieži tiek izbeigti un iekļauti pozīcijā un ka šādu atvasināto instrumentu risks tiek pārvaldīts pozīciju līmenī. Turklāt no turpmākajiem dzīves cikla notikumiem atkarīga kļūst izrietošā pozīcija, nevis sākotnējie atvasinātie instrumenti darījuma līmenī. Lai nodrošinātu efektīvu un precīzu ziņošanu par šādiem atvasinātajiem instrumentiem, darījumu partneriem būtu jāļauj ziņot pozīciju līmenī. Lai nodrošinātu, ka darījumu partneri pozīcijas līmeņa ziņojumus neizmanto neatbilstīgi, būtu jāparedz īpaši nosacījumi, kas būtu jāizpilda, lai ziņotu pozīciju līmenī.
- (8) Lai pienācīgi uzraudzītu riska darījumu koncentrāciju un sistēmisko risku, ir ļoti būtiski nodrošināt, ka darījumu reģistriem tiek iesniegta pilnīga un precīza informācija par riska darījumu un nodrošinājumu, ar kuru abi darījumu partneri ir apmainījušies. Līguma vērtība, kas noteikta ar metodi, kura paredz vērtēšanu pēc tirgus vērtības vai pēc modeļa, norāda ar šo līgumu saistīto riska darījumu zīmi un apjomu un papildina informāciju par līgumā norādīto sākotnējo vērtību. Tādēļ ir svarīgi, ka darījumu partneri atvasināto instrumentu līgumu vērtējumus uzrāda saskaņā ar vienotu metodi. Turklāt ir vienlīdz svarīgi pieprasīt, lai tiktu ziņots par izvietotajām un saņemtajām sākotnējām un mainīgajām drošības rezervēm, kuras saistītas ar konkrētu atvasināto instrumentu. Tāpēc darījumu partneriem, kas nodrošina savus atvasinātos instrumentus, šāda nodrošinājuma informācija būtu jāsniedz darījuma līmenī. Ja nodrošinājumu aprēķina portfeļa līmenī, darījumu partneriem par izvietotajām un saņemtajām sākotnējām un mainīgajām drošības rezervēm, kas attiecas uz šo portfeli, būtu jāziņo, izmantojot unikālu kodu, ko noteicis ziņojuma sniedzējs darījumu partneris. Šim unikālajam kodam būtu jāidentificē konkrētais portfeli, par kuru notiek nodrošinājuma apmaiņa, kā arī jānodrošina, ka visus attiecīgos atvasinātos instrumentus var sasaistīt ar konkrēto portfeli.
- (9) Nosacītā summa ir būtiska atvasinātā instrumenta īpašība, lai noteiktu saistības, kas saistītas ar šo atvasināto instrumentu. Turklāt nosacītās summas izmanto kā vienu no rādītājiem, lai novērtētu riska darījumus, darījumu apjomus un atvasināto instrumentu tirgus lielumu. Tāpēc ir būtiski konsekventi ziņot par nosacītajām summām. Lai nodrošinātu, ka darījumu partneri saskaņotā veidā paziņo nosacītās summas, būtu jāprecizē vajadzīgā nosacītās summas aprēķināšanas metode attiecībā uz dažādiem produktu veidiem.
- (10) Tāpat informācija par atvasināto instrumentu cenu noteikšanu būtu jāsniedz konsekventi, tādējādi ļaujot kompetentajām iestādēm pārbaudīt paziņotos riska darījumus, novērtēt izmaksas un likviditāti atvasināto instrumentu tirgos, kā arī salīdzināt līdzīgu produktu cenas, ko tirgo dažādos tirgos.
- (11) Tādu dzīves cikla notikumu rezultātā kā tīrvērtē, pārjaunošana vai sablīvēšana tiek radīti, grozīti vai izbeigti noteikti atvasināto instrumentu līgumi. Lai kompetentās iestādes varētu izprast tirgū notiekošo notikumu secību un attiecības starp paziņotajiem atvasinātajiem instrumentiem, ir būtiski paredzēt metodi, ar ko sasaistīt visus attiecīgos atvasinātos instrumentus, kurus ietekmē viens un tas pats dzīves cikla notikums. Tā kā visefektīvākais veids, kā sasaistīt atvasinātos instrumentus, var atšķirties atkarībā no notikuma veida, būtu jānosaka dažādas sasaistes metodes.
- (12) Šī regula ir balstīta uz regulatīvo tehnisko standartu projektu, ko Komisijai iesniegusi Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestāde (EVTI).
- (13) EVTI ir veikusi atklātas sabiedriskās apspriešanas par regulatīvo tehnisko standartu projektu, kas ir šīs regulas pamatā, izanalizējusi potenciālās saistītās izmaksas un ieguvumus un lūgusi ieteikumu no Vērtspapīru un tirgu nozares ieinteresēto personu grupas, kura izveidota saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 1095/2010<sup>(2)</sup> 37. pantu.

<sup>(2)</sup> Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) Nr. 1095/2010 (2010. gada 24. novembris), ar ko izveido Eiropas Uzraudzības iestādi (Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestādi), groza Lēmumu Nr. 716/2009/EK un atceļ Komisijas Lēmumu 2009/77/EK (OV L 331, 15.12.2010., 84. lpp.).

- (14) Lai darījumu partneri un darījumu reģistri varētu veikt visas nepieciešamās darbības nolūkā pielāgoties jaunajām prasībām, šīs regulas piemērošanas diena būtu jāatliek par 18 mēnešiem,

IR PIENĒMUSI ŠO REGULU.

### 1. pants

#### Dati, ko ietver ziņojumos saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 9. panta 1. un 3. punktu

1. Ziņojumos darījumu reģistriem, kas sniegti saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 9. panta 1. un 3. punktu, iekļauj pilnīgus un precīzus datus, kuri izklāstīti šīs regulas pielikuma 1., 2. un 3. tabulā un kuri attiecas uz attiecīgo atvasināto instrumentu.

Šos datus sniedz vienā ziņojumā.

2. Ziņojot par atvasināto instrumentu līguma noslēgšanu, grozīšanu vai izbeigšanu, darījuma partneris savā ziņojumā norāda sīku informāciju par darbības veidu un notikuma veidu, kā aprakstīts pielikuma 2. tabulas 151. un 152. laukā, uz kuru attiecas minētā noslēgšana, grozījums vai izbeigšana.

3. Atkāpjoties no 1. punkta, ja pielikuma 1., 2. un 3. tabulas lauki neļauj efektīvi ziņot par 1. punktā minētajiem datiem, minētos datus norāda atsevišķos ziņojumos, piemēram, gadījumā, kad atvasināto instrumentu līgumu veido atvasināto instrumentu līgumu kombinācija, par kuriem sarunas tiek risinātas kopā kā par vienu ekonomiska nolīguma produktu.

Pirms ziņojuma iesniegšanas termiņa tāda atvasinātā instrumenta darījuma partneri, ko veido pirmajā daļā minēto atvasināto instrumentu līgumu kombinācija, vienojas par atsevišķo ziņojumu skaitu, kas ir jānosūta darījumu reģistram attiecībā uz konkrēto atvasināto instrumentu līgumu.

Darījuma partneris, kurš sniedz ziņojumu, saista atsevišķos ziņojumus ar identifikatoru, kas darījumu partnera līmenī ir unikāls attiecībā uz atvasināto instrumentu ziņojumu grupu, saskaņā ar pielikuma 2. tabulas 6. lauku.

4. Ja abu darījuma partneru vārdā iesniedz vienu ziņojumu, tajā ietver pielikuma 1., 2. un 3. tabulā noteikto informāciju, kas attiecas uz katru no darījuma partneriem.

5. Ja viens darījuma partneris darījumu reģistram sniedz ziņojumu par atvasinātā instrumenta datiem cita darījuma partnera vārdā vai ja trešā struktūra darījumu reģistram sniedz ziņojumu par līgumu viena vai abu darījuma partneru vārdā, ziņojumā ietver visus datus, kas tiktu paziņoti, ja par atvasināto instrumentu darījumu reģistram ziņotu katrs darījuma partneris atsevišķi.

### 2. pants

#### Darījumi, kam veikta tīrvērte

1. Ja atvasināto instrumentu līgumam, kura dati jau ir paziņoti saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 9. pantu, tīrvērti pēc tam veic centrālais darījumu partneris (CCP), šo atvasināto instrumentu līgumu uzrāda kā izbeigtu, šīs regulas pielikuma 2. tabulas 151. un 152. laukā precizējot darbības veidu "Izbeigt" un notikuma veidu "Tīrvērte". Jaunus atvasināto instrumentu līgumus, kas izriet no tīrvērtes, paziņo, šīs regulas pielikuma 2. tabulas 151. un 152. laukā precizējot darbības veidu "Jauns" un notikuma veidu "Tīrvērte".

2. Ja atvasināto instrumentu līgumu slēdz gan tirdzniecības vietā, gan organizētā tirdzniecības platformā, kas atrodas ārpus Savienības, un CCP veic tīrvērti tajā pašā dienā, paziņo tikai atvasināto instrumentu līgumus, kas izriet no tīrvērtes. Par šiem atvasināto instrumentu līgumiem ziņo, pielikuma 2. tabulas 151. un 152. laukā precizējot vai nu darbības veidu "Jauns", vai arī darbības veidu "Pozīcijas komponents" saskaņā ar 3. panta 2. punktu un notikuma veidu "Tīrvērte".

### 3. pants

#### Ziņošana pozīciju līmenī

1. Pēc tam, kad ir sniegti dati par atvasināto instrumentu līgumu, ko darījumu partneris ir noslēdzis, un pēc minētā atvasinātā instrumenta līguma izbeigšanas sakarā ar iekļaušanu pozīcijā, darījumu partnerim ir jāuz ziņot pozīciju līmenī, ja ir izpildīti visi turpmāk minētie nosacījumi:
  - a) risku pārvalda pozīciju līmenī;
  - b) ziņojumi attiecas uz atvasināto instrumentu līgumiem, kas noslēgti tirdzniecības vietā vai organizētā tirdzniecības platformā, kura atrodas ārpus Savienības, vai uz atvasinātajiem instrumentiem, kuriem tūrvērti veic CCP, vai uz cenu starpības līgumiem, kas ir savstarpēji aizvietojami un aizstāti ar pozīciju;
  - c) par atvasinātajiem instrumentiem darījuma līmenī, kā minēts pielikuma 2. tabulas 154. laukā, ir pareizi paziņots pirms to iekļaušanas pozīcijā;
  - d) par citiem notikumiem, kas ietekmē pozīcijas ziņojuma kopīgos laukus, paziņo atsevišķi;
  - e) šā punkta b) apakšpunktā minētie atvasināto instrumentu līgumi ir pienācīgi izbeigti, pielikuma 2. tabulas 151. laukā norādot darbības veidu "Izbeigt" un pielikuma 2. tabulas 152. laukā norādot notikuma veidu "Iekļaušana pozīcijā";
  - f) par izrietošo pozīciju ir pienācīgi paziņots vai nu kā par jaunu pozīciju, vai kā par esošas pozīcijas atjauninājumu;
  - g) ziņojums par pozīciju ir sagatavots pareizi, aizpildot visus piemērojamos laukus pielikuma 1. un 2. tabulā un norādot pielikuma 2. tabulas 154. laukā, ka ziņojums ir sagatavots pozīcijas līmenī;
  - h) atvasinātā instrumenta darījuma partneri vienojas, ka par atvasināto instrumentu būtu jāziņo pozīciju līmenī.
2. Ja pastāvošs atvasinātais instruments tajā pašā dienā ir jāiekļauj pozīcijas līmeņa ziņojumā, šādu atvasināto instrumentu uzrāda pielikuma 2. tabulas 151. laukā ar darbības veidu "Pozīcijas komponents".
3. Turpmākos atjauninājumus, tostarp vērtējuma atjauninājumus, nodrošinājuma atjauninājumus un citus grozījumus un dzīves cikla notikumus uzrāda pozīciju līmenī, un tos neuzrāda saistībā ar sākotnējiem atvasināto instrumentu līgumiem darījuma līmenī, kas tika izbeigti un iekļauti minētajā pozīcijā.

### 4. pants

#### Ziņojumu sniegšana par riska darījumiem

1. Datus par nodrošinājumu attiecībā gan uz atvasinātajiem instrumentiem, kam veikta tūrvērtē, gan uz tiem, kam tūrvērtē nav veikta, ietver visu izvietoto un saņemto nodrošinājumu atbilstoši pielikuma 3. tabulas 1. līdz 29. laukam.
2. Ja 1. darījuma partneris veic nodrošināšanu portfeļa līmenī, 1. darījuma partneris vai par ziņošanu atbildīgā struktūra ziņo darījumu reģistram par portfeļa līmenī izvietoto un saņemto nodrošinājumu saskaņā ar pielikuma 3. tabulas 1. līdz 29. lauku un norāda kodu, ar ko portfeli identificē saskaņā ar pielikuma 3. tabulas 9. lauku.
3. Nefinanšu darījumu partneriem, kas nav minēti Regulas (ES) Nr. 648/2012 10. pantā, vai struktūrām, kuras ir atbildīgas par ziņošanu viņu vārdā, nav jāziņo par līgumu vērtējumiem pēc nodrošinājuma vai pēc tirgus vērtības, vai pēc modeļa, kā minēts šīs regulas pielikuma 2. un 3. tabulā.
4. Attiecībā uz atvasināto instrumentu līgumiem, kuriem tūrvērti veic CCP, 1. darījumu partneris vai par ziņošanu atbildīgā struktūra saskaņā ar pielikuma 2. tabulas 21. līdz 25. lauku paziņo līguma vērtējumu, ko sniedzis centrālais darījumu partneris.
5. Attiecībā uz atvasināto instrumentu līgumiem, kuriem tūrvērti neveic CCP, 1. darījumu partneris vai par ziņošanu atbildīgā struktūra saskaņā ar šīs regulas pielikuma 2. tabulas 21. līdz 25. lauku paziņo atvasinātā instrumenta vērtējumu, kurš ir veikts saskaņā ar metodiku, kas noteikta 13. starptautiskajā finanšu pārskatu standartā (SFPS) "Patiesās vērtības novērtēšana", kas pieņemts ar Komisijas Regulu (EK) Nr. 1126/2008<sup>(\*)</sup>, nepiemērojot nekādu patiesās vērtības korekciju.

(\*) Komisijas Regula (EK) Nr. 1126/2008 (2008. gada 3. novembris), ar ko pieņem vairākus starptautiskos grāmatvedības standartus saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (EK) Nr. 1606/2002 (OV L 320, 29.11.2008., 1. lpp.).

## 5. pants

**Nosacītā summa**

1. Pielikuma 2. tabulas 55. un 64. laukā minētā atvasinātā instrumenta nosacīto summu nosaka šādi:
  - a) naudas vienībās tirgotu mijmaiņas līgumu, regulētā tirgū tirgotu nākotnes līgumu, regulētā tirgū netirgotu nākotnes līgumu un iespējas līgumu gadījumā, – atsaucēs summa;
  - b) to iespējas līgumu gadījumā, kas nav minēti a) apakšpunktā, – aprēķina, izmantojot norunas cenu;
  - c) to regulētā tirgū netirgotu nākotnes līgumu gadījumā, kas nav minēti a) apakšpunktā, – nākotnes darījumu cenas un pamatā esošā instrumenta kopējā nosacītā daudzuma reizinājums;
  - d) kapitāla vērtspapīru dividendžu mijmaiņas darījumu gadījumā – perioda fiksētās norunas cenas un akciju vai indeksa daļu skaita reizinājums;
  - e) kapitāla vērtspapīru svārstīguma mijmaiņas darījumu gadījumā – vega riska nosacītā summa;
  - f) kapitāla vērtspapīru dispersijas mijmaiņas darījumu gadījumā – dispersijas summa;
  - g) cenas starpības finanšu līgumu (CFDS) gadījumā – sākotnējās cenas un kopējā nosacītā daudzuma rezultātā iegūtā summa;
  - h) fiksētas/mainīgas cenas preču mijmaiņas līgumu gadījumā – fiksētās cenas un kopējā nosacītā daudzuma reizinājums;
  - i) preču bāzes mijmaiņas līgumu gadījumā – darījuma daļas (*leg*), kurai nav starpības (*spread*), pamatā esošā aktīva pēdējās darījuma laikā pieejamās tūlītējās cenas un daļas, kurai nav starpības, kopējā nosacītā daudzuma reizinājums;
  - j) mijmaiņas iespējas līgumu gadījumā – pamatā esošā līguma nosacītā summa;
  - k) tā atvasināto instrumentu līguma gadījumā, kas nav minēti a) līdz j) apakšpunktā, kur nosacīto summu aprēķina, izmantojot pamatā esošā aktīva cenu, un šāda cena ir pieejama tikai norēķinu veikšanas brīdī, – pamatā esošā aktīva cena līguma noslēgšanas dienas beigās.
2. Sākotnējā ziņojumā par atvasināto instrumentu līgumu, kura nosacītā summa laika gaitā mainās, precīzē nosacīto summu, kas piemērojama atvasināto instrumentu līguma noslēgšanas dienā, un nosacītās summas grafiku.

Ziņojot par nosacītās summas grafiku, darījuma partneri norāda visu turpmāk minēto:

- i) nekoriģēto datumu, kurā stājas spēkā attiecīgā nosacītā summa;
- ii) nosacītās summas nekoriģēto beigu datumu;
- iii) nosacīto summu, kas stājas spēkā attiecīgajā nekoriģētajā spēkā stāšanās datumā.

## 6. pants

**Cena**

1. Pielikuma 2. tabulas 48. laukā minēto atvasinātā instrumenta cenu nosaka šādi:
  - a) attiecībā uz mijmaiņas darījumiem ar periodiskiem maksājumiem, kas saistīti ar precēm, – fiksētā cena;
  - b) attiecībā uz regulētā tirgū netirgotiem nākotnes līgumiem, kas saistīti ar precēm un kapitāla vērtspapīriem – pamatā esošā instrumenta nākotnes darījumu cena;
  - c) attiecībā uz mijmaiņas darījumiem, kas saistīti ar kapitāla vērtspapīriem un cenu starpības līgumiem, – pamatā esošā instrumenta sākotnējā cena.

2. Atvasinātā instrumenta cenu pielikuma 2. tabulas 48. laukā nenorāda, ja tā ir norādīta citā pielikuma 2. tabulas laukā.

#### 7. pants

##### Ziņojumu sasaiste

Ziņojuma sniedzējs darījumu partneris vai par ziņošanu atbildīgā struktūra ziņojumus, kas saistīti ar atvasināto instrumentu līgumiem, kuri noslēgti vai izbeigti tā paša notikuma rezultātā, kā minēts pielikuma 2. tabulas 152. laukā, sasaista šādi:

- a) tīrvērtes, pakāpeniskas ieviešanas, sadales un izpildes gadījumā darījuma partneris ziņojumā vai ziņojumos, kas attiecas uz atvasināto instrumentu vai no minētā notikuma izrietošajiem atvasinātajiem instrumentiem, uzrāda tā sākotnējā atvasināto instrumentu līguma unikālo darījuma identifikatoru ("UTI"), kas izbeigts sakarā ar pielikuma 2. tabulas 3. laukā un 2. tabulas 152. laukā minēto notikumu;
- b) ja atvasināto instrumentu iekļauj pozīcijā, darījuma partneris ziņojumā par šo atvasināto instrumentu, kas nosūtīts ar darbības veidu "Pozīcijas komponents" vai darbības veida "Izbeigt" un notikuma veida "Iekļaušana pozīcijā" kombināciju, uzrāda tās pozīcijas UTI, kurā minētais atvasinātais instruments saskaņā ar pielikuma 2. tabulas 4. lauku ir iekļauts;
- c) tāda pēctirdzniecības riska samazināšanas ("PTRR") notikuma gadījumā, ko nodrošina PTRR pakalpojumu sniedzējs vai CCP, kas sniedz PTRR pakalpojumu, darījuma partneris visos ziņojumos, kuri attiecas uz atvasināto instrumentu līgumiem, kas tika izbeigti minētā notikuma dēļ vai izrietēja no tā, uzrāda unikālu kodu, kas identificē šo notikumu un ko pielikuma 2. tabulas 5. laukā norādījis minētais PTRR pakalpojuma sniedzējs vai CCP.

#### 8. pants

##### Atcelšana

Deleģēto regulu (ES) Nr. 148/2013 atceļ.

Atsauces uz atcelto regulu uzskata par atsaucēm uz šo regulu.

#### 9. pants

##### Stāšanās spēkā

Šī regula stājas spēkā divdesmitajā dienā pēc tās publicēšanas Eiropas Savienības Oficiālajā Vēstnesī.

To piemēro no 2024. gada 29. aprīlis.

Šī regula uzliek saistības kopumā un ir tieši piemērojama visās dalībvalstīs.

Briselē, 2022. gada 10. jūnijā

Komisijas vārdā –  
priekšsēdētāja  
Ursula VON DER LEYEN

## PIELIKUMS

1. tabula

	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
1.	Atvasinātā instrumenta līguma puses	Ziņojuma iesniegšanas laika zīmogs	Darījumu reģistram iesniegtā ziņojuma datums un laiks.
2.	Atvasinātā instrumenta līguma puses	Ziņojuma iesniedzējas struktūras identifikators	Ja par ziņošanu atbildīgā struktūra ir deleģējusi ziņojuma iesniegšanu trešai personai vai citam darījuma partnerim, šī struktūra ir jāidentificē šajā laukā ar unikālu kodu. Pretējā gadījumā šajā laukā būtu jānorāda par ziņošanu atbildīgā struktūra.
3.	Atvasinātā instrumenta līguma puses	Par ziņošanu atbildīgā struktūra	Ja finanšu darījuma partneris vienīgais ir atbildīgs (arī juridiski) par ziņošanu abu darījumu partneru vārdā saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 648/2012 <sup>(1)</sup> 9. panta 1.a punktu, un nefinanšu darījuma partneris neizlemj pats ziņot sīkāku informāciju par tā ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem ar finanšu darījuma partneri – šo finanšu darījuma partneri identificējošs unikālais kods. Ja pārvaldības sabiedrība ir atbildīga (arī juridiski) par ziņošanu PVKIU vārdā saskaņā ar minētās regulas 9. panta 1.b punktu – šo pārvaldības sabiedrību identificējošs unikāls kods. Ja AIF pārvaldnieks ir atbildīgs (arī juridiski) par ziņošanu AIF vārdā saskaņā ar minētās regulas 9. panta 1.c punktu – šo AIF pārvaldnieku identificējošs unikāls kods. Ja par AKUI pārvaldību un rīcību tās vārdā atbildīga pilnvarota struktūra ir atbildīga (arī juridiski) par ziņošanu tās vārdā saskaņā ar minētās regulas 9. panta 1.d punktu – šo struktūru identificējošs unikāls kods. Šis lauks attiecas tikai uz ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem.
4.	Atvasinātā instrumenta līguma puses	1. darījuma partneris (ziņojuma sniedzējs darījuma partneris)	Tā atvasināto instrumentu darījuma partnera identifikators, kurš izpilda ziņošanas pienākumu, izmantojot attiecīgo ziņojumu. Ja sadalītu atvasināto instrumentu darījumu fonda vārdā izpilda fonda pārvaldnieks, kā darījuma partneri norāda fondu, nevis fonda pārvaldnieku.
5.	Atvasinātā instrumenta līguma puses	1. darījuma partnera veids	Norādīt, vai 1. darījuma partneris ir centrālais darījuma partneris (CCP), finanšu darījuma partneris vai nefinanšu darījuma partneris, kā definēts Regulas (ES) Nr. 648/2012 2. panta 1., 8. un 9. punktā, vai minētās regulas 1. panta 5. punktā noteiktā vienība [struktūra].
6.	Atvasinātā instrumenta līguma puses	1. darījuma partnera uzņēmējdarbības sektors	1. darījuma partnera uzņēmuma darbības veids Ja 1. darījuma partneris ir finanšu darījuma partneris, šajā laukā iekļauj visus nepieciešamos kodus, kas iekļauti finanšu darījumu partneru taksonomijā Komisijas Īstenošanas regulas (ES) 2022/1860 <sup>(2)</sup> pielikuma 1. tabulas 6. laukā un attiecas uz šo darījuma partneri.

	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
			Ja 1. darījuma partneris ir nefinanšu darījuma partneris, šajā laukā iekļauj visus vajadzīgos kodus, kas iekļauti nefinanšu darījumu partneru taksonomijā Īstenošanas regulas (ES) 2022/1860 pielikuma 1. tabulas 6. laukā un attiecas uz šo darījumu partneri. Ja tiek ziņots par vairāk nekā vienu darbību, kodus norāda attiecīgās darbības relatīvās nozīmes secībā.
7.	Atvasinātā instrumenta līguma puses	1. darījuma partnera tīrvērtes sliekšnis	Informācija par to, vai 1. darījuma partnera rādītāji darījuma noslēgšanas datumā pārsniedz Regulas (ES) Nr. 648/2012 4. a panta 3. punktā vai 10. panta 3. punktā noteikto tīrvērtes sliekšni.
8.	Atvasinātā instrumenta līguma puses	2. darījuma partnera identifikatora veids	Norāde par to, vai 2. darījuma partnera identificēšanai ir izmantots juridiskās personas identifikators (LEI).
9.	Atvasinātā instrumenta līguma puses	2. darījuma partneris	Atvasināto instrumentu darījuma 2. darījuma partnera identifikators. Ja sadalītu atvasināto instrumentu darījumu fonda vārdā izpilda fonda pārvaldnieks, kā darījuma partneri norāda fondu, nevis fonda pārvaldnieku.
10.	Atvasinātā instrumenta līguma puses	2. darījuma partnera valsts	Ja 2. darījuma partneris ir fiziska persona – minētās personas dzīvesvietas valsts kods.
11.	Atvasinātā instrumenta līguma puses	2. darījumu partnera veids	Norādīt, vai 2. darījuma partneris ir centrālais darījuma partneris, finanšu darījuma partneris vai nefinanšu darījuma partneris, kā definēts Regulas (ES) Nr. 648/2012 2. panta 1., 8. un 9. punktā, vai minētās regulas 1. panta 5. punktā noteiktā vienība [struktūra].
12.	Atvasinātā instrumenta līguma puses	2. darījuma partnera uzņēmējdarbības sektors	2. darījuma partnera uzņēmuma darbības specifika Ja 2. darījuma partneris ir finanšu darījuma partneris, šajā laukā iekļauj visus nepieciešamos kodus, kas iekļauti finanšu darījumu partneru taksonomijā Īstenošanas regulas (ES) 2022/1860 pielikuma 1. tabulas 6. laukā un attiecas uz šo darījumu partneri. Ja 2. darījuma partneris ir nefinanšu darījuma partneris, šajā laukā iekļauj visus nepieciešamos kodus, kas iekļauti nefinanšu darījumu partneru taksonomijā Īstenošanas regulas (ES) 2022/1860 pielikuma 1. tabulas 6. laukā un attiecas uz šo darījumu partneri. Ja tiek ziņots par vairāk nekā vienu darbību, kodus norāda attiecīgās darbības relatīvās nozīmes secībā.
13.	Atvasinātā instrumenta līguma puses	2. darījuma partnera tīrvērtes sliekšnis	Informācija par to, vai 2. darījuma partnera rādītāji darījuma noslēgšanas datumā pārsniedz Regulas (ES) Nr. 648/2012 4. a panta 3. punktā vai 10. panta 3. punktā noteikto tīrvērtes sliekšni.
14.	Atvasinātā instrumenta līguma puses	2. darījuma partnera ziņošanas pienākums	Norāde par to, vai 2. darījuma partnerim ir ziņošanas pienākums saskaņā ar Regulu (ES) Nr. 648/2012, neatkarīgi no tā, kas ir atbildīgs (arī juridiski) par tā ziņošanu.



	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
15.	Atvasinātā instrumenta līguma puses	Brokera identifikators	Ja brokeris rīkojas kā 1. darījuma partnera starpnieks, pats nekļūstot par darījumu partneri, 1. darījuma partneris identificē šo brokeri ar unikālu kodu.
16.	Atvasinātā instrumenta līguma puses	Tīrvērtes dalībnieks	Tā tīrvērtes dalībnieka identifikators, ar kura starpniecību tika veikta atvasināto instrumentu darījuma tīrvērtē centrālajā darījumu partnerī. Šo datu elementu piemēro darījumiem, kuriem veikta tīrvērtē.
17.	Atvasinātā instrumenta līguma puses	Virziens	Norāde par to, vai 1. darījumu partneris ir pircējs vai pārdevējs, kā noteikts atvasinātā instrumenta līguma noslēgšanas dienā.
18.	Atvasinātā instrumenta līguma puses	1. daļas virziens	Norāde par to, vai 1. darījumu partneris ir 1. daļas maksātājs vai saņēmējs, kā noteikts atvasinātā instrumenta līguma noslēgšanas dienā.
19.	Atvasinātā instrumenta līguma puses	2. daļas virziens	Norāde par to, vai 1. darījumu partneris ir 2. daļas pircējs vai pārdevējs, kā noteikts atvasinātā instrumenta līguma noslēgšanas dienā.
20.	Atvasinātā instrumenta līguma puses	Tieši saistīts ar komercdarbību vai finanšu līdzekļu pārvaldības darbību	Informācija par to, vai līgums ir objektīvi novērtējams kā tieši saistīts ar 1. darījuma partnera komercdarbību vai finanšu līdzekļu pārvaldības darbību, kā minēts Regulas (ES) Nr. 648/2012 10. panta 3. punktā. Šo lauku aizpilda tikai tad, ja 1. darījuma partneris ir nefinanšu darījuma partneris, kā definēts Regulas (ES) Nr. 648/2012 2. panta 9. punktā.

(<sup>1</sup>) Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) Nr. 648/2012 (2012. gada 4. jūlijs) par ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, centrālajiem darījumu partneriem un darījumu reģistriem (OV L 201, 27.7.2012., 1. lpp.).

(<sup>2</sup>) Komisijas Īstenošanas regula (ES) 2022/1860 (2022. gada 10. jūnijs), ar ko nosaka īstenošanas tehniskos standartus Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 648/2012 piemērošanai attiecībā uz ziņošanas standartiem, formātiem, biežumu, metodēm un kārtību (skat. 68. lpp. šajā Oficiālajā Vēstnesī).

## 2. tabula

	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
1.	2.a iedaļa. Identifikatori un saites	UTI	Unikālais tirdzniecības identifikators, kas minēts Īstenošanas regulas (ES) 2022/1860 7. pantā.
2.	2.a iedaļa. Identifikatori un saites	Ziņojuma izsekošanas numurs	Ja atvasinātā instrumenta līgums izpildīts tirdzniecības vietā – minētajai izpildei unikāls tirdzniecības vietas ģenerētais numurs.
3.	2.a iedaļa. Identifikatori un saites	Iepriekšējs UTI (“viens pret vienu” un “viens pret daudziem” attiecībām starp darījumiem)	Tādam priekšgājējam darījumam piešķirts UTI, kurš dzīves cikla notikuma rezultātā ir radījis paziņoto darījumu, “viens pret vienu” attiecībā starp darījumiem (piemēram, pārjaunojuma gadījumā, kad darījums tiek izbeigts un tiek radīts jauns darījums) vai “viens pret daudziem” attiecībā starp darījumiem (piemēram, tīrvērtes gadījumā vai gadījumā, ja darījums tiek sadalīts vairākos dažādos darījumos). Šis datu elements nav piemērojams, ziņojot par “daudzi pret vienu” un “daudzi pret daudziem” attiecībām starp darījumiem (piemēram, sablīvējuma gadījumā).

	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
4.	2.a iedaļa. Identifikatori un saites	Nākamās pozīcijas <i>UTI</i>	Tās pozīcijas <i>UTI</i> , kurā ir iekļauts atvasinātais instruments. Šis lauks ir piemērojams tikai ziņojumiem, kas attiecas uz atvasinātā instrumenta līguma izbeigšanu saistībā ar tā iekļaušanu pozīcijā.
5.	2.a iedaļa. Identifikatori un saites	Pēctirdzniecības riska mazināšanas ( <i>PTRR</i> ) ID	Identifikators, ko pēctirdzniecības riska mazināšanas pakalpojuma sniedzējs vai pēctirdzniecības riska mazināšanas pakalpojumu sniedzošs centrālais darījumu partneris ir ģenerējis, lai savienotu visus atvasinātos instrumentus, ar kuriem norisinās pēctirdzniecības riska mazināšanas notikums vai kuri izriet no minētā pēctirdzniecības riska mazināšanas notikuma.
6.	2.a iedaļa. Identifikatori un saites	Paketes identifikators	Identifikators (ko nosaka 1. darījuma partneris), ar kuru savienot vienā un tajā pašā paketē esošos atvasinātos instrumentus saskaņā ar šīs regulas 1. panta 3. punkta trešo daļu. Pakete var ietvert darījumus, par kuriem jāziņo un par kuriem nav jāziņo.
7.	2.b iedaļa. Informācija par līgumu	Starptautiskie vērtspapīru identifikācijas numuri ( <i>ISIN</i> )	<i>ISIN</i> , ar ko identificē produktu, ja minēto produktu atļauts tirgot regulētā tirgū, <i>DTS</i> , <i>OTS</i> vai sistemātiskam internalizētājam.
8.	2.b iedaļa. Informācija par līgumu	Unikāls produkta identifikators ( <i>UPI</i> )	<i>UPI</i> , ar ko identificē produktu.
9.	2.b iedaļa. Informācija par līgumu	Produktu klasifikācija	Finanšu instrumenta klasifikācijas ( <i>CFI</i> ) kods, kas attiecas uz instrumentu.
10.	2.b iedaļa. Informācija par līgumu	Līguma veids	Katru paziņoto līgumu klasificē pēc tā veida.
11.	2.b iedaļa. Informācija par līgumu	Aktīvu klase	Katru paziņoto līgumu klasificē pēc tā pamatā esošo aktīvu klases.
12.	2.b iedaļa. Informācija par līgumu	Atvasinātais instruments, kura pamatā ir kriptoaktīvi	Norāde par to, vai atvasinātā instrumenta pamatā ir kriptoaktīvi.
13.	2.b iedaļa. Informācija par līgumu	Pamatā esošā aktīva identifikācijas veids	Attiecīgā pamatā esošā instrumenta identifikatora veids.
14.	2.b iedaļa. Informācija par līgumu	Pamatā esošā aktīva identifikācija	Tiešo bāzes instrumentu identificē, izmantojot unikālu identifikāciju, kas balstīta uz šā pamatā esošā instrumenta veidu. Kreditriskā mijmaiņas darījumiem jānorāda atsaucies saistības <i>ISIN</i> kods.
15.	2.b iedaļa. Informācija par līgumu	Pamatā esošā indeksa rādītājs	Pamatā esošā indeksa rādītājs, ja pieejams.

	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
16.	2.b iedaļa. Informācija par līgumu	Pamatā esošā indeksa nosaukums	Pamatā esošā indeksa pilns nosaukums, ko piešķir indeksa nodrošinātājs.
17.	2.b iedaļa. Informācija par līgumu	Specializēta groza kods	Ja atvasināto instrumentu darījuma pamatā ir specializēts grozs – unikālais kods, ko specializētā groza strukturētājs piešķir, lai sasaistītu tā sastāvdaļas.
18.	2.b iedaļa. Informācija par līgumu	Groza sastāvdaļu identifikators	Attiecībā uz specializētiem groziem, kuru sastāvā citstarp ir finanšu instrumenti, kas tiek tirgoti tirdzniecības vietā, norāda tikai finanšu instrumentus, kas tiek tirgoti tirdzniecības vietā.
19.	2.b iedaļa. Informācija par līgumu	1. norēķinu valūta	Skaidras naudas darījuma norēķina valūta, ja piemērojams. Attiecībā uz daudzvalūtu produktiem, kuriem nav veicams ieskaits, – 1. daļas norēķinu valūta. Šis datu elements nav piemērojams produktiem, par kuriem norēķinās ar fizisku piegādi (piemēram, mijmaiņas iespējas līgumi, par kuriem norēķinās ar fizisku piegādi).
20.	2.b iedaļa. Informācija par līgumu	2. norēķinu valūta	Skaidras naudas darījuma norēķina valūta, ja piemērojams. Attiecībā uz daudzvalūtu produktiem, kuriem nav veicams ieskaits, – 2. daļas norēķinu valūta. Šis datu elements nav piemērojams produktiem, par kuriem norēķinās ar fizisku piegādi (piemēram, mijmaiņas iespējas līgumi, par kuriem norēķinās ar fizisku piegādi).
21.	2.c iedaļa. Vērtējums	Vērtējuma summa	Līguma vērtējums pēc tirgus vērtības vai pēc modeļa, kā minēts šīs regulas pielikuma 4. pantā. Centrālā darījumu partnera vērtējums ir jāizmanto attiecībā uz darījumu, kam veikta tīrvērte.
22.	2.c iedaļa. Vērtējums	Vērtējuma valūta	Valūta, kurā ir denominēta vērtējuma summa.
23.	2.c iedaļa. Vērtējums	Vērtēšanas laika zīmogs	Datums un laiks pēdējam novērtējumam pēc tirgus vērtības, kuru veicis centrālais darījumu partneris vai kurš aprēķināts, izmantojot parametru pašreizējo vai pēdējo pieejamo tirgus cenu.
24.	2.c iedaļa. Vērtējums	Vērtības noteikšanas metode	1. darījuma partnera darījuma vērtējumam izmantotais avots un metode. Ja vismaz viens no izmantotajiem vērtējuma parametriem tiek klasificēts kā pēc modeļa novērtēts, visu vērtējumu klasificē kā novērtējumu pēc modeļa. Ja izmanto tikai tādus parametrus, kas klasificēti kā novērtēšana pēc tirgus vērtības, visu vērtējumu klasificē kā novērtējumu pēc tirgus vērtības.
25.	2.c iedaļa. Vērtējums	Delta risks	Atvasinātā instrumenta darījuma cenas izmaiņu attiecība pret pamatā esošā instrumenta cenas izmaiņām. Šis lauks attiecas tikai uz iespējas līgumiem un mijmaiņas iespējas līgumiem. Finanšu darījumu partneri un nefinanšu darījumu partneri, kas minēti Regulas (ES) Nr. 648/2012 10. pantā, katru dienu ziņo par atjaunināto delta risku.

	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
26.	2.d iedaļa. Nodrošinājums	Nodrošinājuma portfeļa rādītājs	Norāde par to, vai nodrošināšanu veica portfeļa līmenī. "Portfeļa līmenī" nozīmē darījumu kopumu, kam drošības rezerve noteikta kopā (neto vai bruto līmenī), pretēji scenārijam, kurā drošības rezerve tiek aprēķināta un norādīta katram individuālajam darījumam atsevišķi.
27.	2.d iedaļa. Nodrošinājums	Nodrošinājuma portfeļa kods	Ja par nodrošinājumu ziņo portfeļa līmenī – 1. darījumu partnera portfelim piešķirts unikāls kods. Šo datu elementu nepiemēro, ja nodrošināšana veikta darījuma līmenī, ja nav nodrošinājuma līguma vai ja nodrošinājums nav izvietots vai saņemts.
28.	2.e iedaļa. Riska mazināšana / ziņošana	Apstiprinājuma laika zīmogs	Apstiprinājuma datums un laiks, kā noteikts Komisijas Deleģētās regulas (ES) Nr. 149/2013 ( <sup>1</sup> ) 12. pantā. Piemēro tikai ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem, kuriem centrālais darījumu partneris neveic tīrvērti.
29.	2.e iedaļa. Riska mazināšana / ziņošana	Apstiprināts	Attiecībā uz jauniem darījumiem, par kuriem jāziņo, neatkarīgi no tā, vai ārpusbiržas atvasināto instrumentu līguma juridiski saistošie noteikumi ir dokumentēti un saskaņoti (apstiprināti) vai nē (neapstiprināti). Ja tie ir dokumentēti un saskaņoti, vai šāda apstiprināšana ir veikta: — izmantojot kopīgu apstiprināšanas ierīci vai platformu vai privātu vai divpusēju elektronisku sistēmu (elektroniski); — izmantojot cilvēklasāmu rakstisku dokumentu, piemēram, faksu, papīru vai manuāli apstrādātus e-pastus (neelektroniski). Piemēro tikai ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem, kuriem centrālais darījumu partneris neveic tīrvērti.
30.	2.f iedaļa. Tīrvērtē	Tīrvērtes pienākums	Jānorāda, vai līguma izpildes brīdī ziņojumā iekļautais līgums pieder pie ārpusbiržas atvasināto instrumentu kategorijas, uz kuru ir attiecināts tīrvērtes pienākums, un vai uz līguma darījumu partneriem attiecas tīrvērtes pienākums saskaņā ar Regulu (ES) Nr. 648/2012. Piemērojams tikai ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem.
31.	2.f iedaļa. Tīrvērtē	Tīrvērtē ir veikta	Norāde par to, vai centrālais darījumu partneris ir veicis atvasinātā instrumenta tīrvērti.
32.	2.f iedaļa. Tīrvērtē	Tīrvērtes laika zīmogs	Tīrvērtes veikšanas datums un laiks. Piemēro tikai ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, kuriem centrālais darījumu partneris veicis tīrvērti.
33.	2.f iedaļa. Tīrvērtē	Centrālais darījumu partneris	Tā centrālā darījumu partnera identifikators, kurš veicis darījuma tīrvērti. Šo datu elementu nepiemēro, ja datu elementa vērtība "Veikta tīrvērtē" vērtība ir "N" ("Nē, nav veikta centralizēta tīrvērtē").
34.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	Jumta līguma veids	Atsauce uz jumta līguma veidu, saskaņā ar kuru darījumu partneri ir noslēguši atvasinātā instrumenta līgumu.
35.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	Cits jumta līguma veids	Jumta līguma nosaukums. Šo lauku aizpilda vienīgi tad, ja šīs tabulas 34. laukā ir norādīts "OTHR".

	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
36.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	Jumta līguma versija	Attiecīgā gadījumā atsauce uz ziņojumā iekļautajam darījumam nozīmīgā jumta līguma versijas gadu.
37.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	Grupas iekšējais darījums	Jānorāda, vai līgumu noslēdza saistībā ar grupas iekšējo darījumu, kā noteikts Regulas (ES) Nr. 648/2012 3. pantā.
38.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	PTRR	Norāda, vai līgums izriet no PTRR operācijas.
39.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	PTRR metodes tips	<p>PTRR darbības veida rādītājs ziņošanas vajadzībām saskaņā ar Regulu (ES) Nr. 648/2012.</p> <p>Portfeļa sablīvējums bez trešās personas pakalpojumu sniedzēja: mehānisms, ar ko samazināt risku esošajos darījumu portfeļos, izmantojot cenas neveidojošus darījumus, galvenokārt, lai samazinātu nenomaksāto nosacīto summu, darījumu skaitu vai citādi saskaņotu noteikumus, pilnībā vai daļēji izbeidzot darījumus un parasti aizstājot izbeigtos atvasināto instrumentu darījumus ar jauniem aizvietošanas darījumiem.</p> <p>Portfeļa sablīvējums ar trešās personas pakalpojumu sniedzēju vai CCP: PTRR pakalpojums, ko sniedz pakalpojumu sniedzējs vai CCP, lai samazinātu risku esošajos darījumu portfeļos, izmantojot cenas neveidojošus darījumus, galvenokārt, lai samazinātu nenomaksāto nosacīto summu, darījumu skaitu vai citādi saskaņotu noteikumus, pilnībā vai daļēji izbeidzot darījumus un parasti aizstājot izbeigtos atvasināto instrumentu darījumus ar jauniem aizvietošanas darījumiem.</p> <p>Portfeļa līdzsvara atjaunošana / drošības rezervju pārvaldība: PTRR pakalpojums, ko sniedz pakalpojumu sniedzējs, lai samazinātu risku esošā tirdzniecības portfelī, pievienojot jaunus cenas neveidojošus darījumus, un kur netiek izbeigti vai aizstāti esošie darījumi portfelī un nosacītā vērtība tiek palielināta, nevis samazināta.</p> <p>Citi portfeļa PTRR pakalpojumi: PTRR pakalpojums, ko sniedz pakalpojumu sniedzējs, lai samazinātu risku esošajos tirdzniecības portfeļos, izmantojot cenas neveidojošus darījumus, un ja šāds pakalpojums nav kvalificējams kā portfeļa sablīvēšana vai portfeļa līdzsvara atjaunošana.</p>
40.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	PTRR pakalpojumu sniedzējs	Juridiskās personas identifikators (LEI), ar ko identificē PTRR pakalpojumu sniedzēju.
41.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	Izpildes vieta	<p>Darījuma izpildes vietas identifikācija.</p> <p>Izmanto ISO 10383 segmenta tirgus identifikatora kodu (MIC) attiecībā uz darījumiem, kurus izpilda tirdzniecības vietā, sistemātisks internalizētājs (SI) vai organizētā tirdzniecības platformā ārpus Savienības. Ja segmenta MIC nepastāv, izmanto darbības MIC.</p> <p>Izmanto MIC kodu "XOFF" attiecībā uz finanšu instrumentiem, kurus atļauts tirgot vai kurus tirgo tirdzniecības vietā, vai par kuriem iesniegts pieteikums, ja darījumu ar minēto finanšu instrumentu neizpilda tirdzniecības vietā, SI vai organizētā tirdzniecības platformā ārpus Savienības vai ja darījuma partnerim nav zināms, ka tas tirgojas ar 2. darījuma partneri, kas darbojas kā sistemātisks internalizētājs.</p>

	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
			Izmanto MIC kodu "XXXX" attiecībā uz finanšu instrumentiem, kurus nav atļauts tirgot vai kurus netirgo tirdzniecības vietā, vai par kuriem nav iesniegts pieteikums un kurus netirgo organizētā tirdzniecības platformā ārpus Savienības.
42.	2.c iedaļa. Ziņas par darījumu	Izpildes laika zīmogs	Datums un laiks, kad darījums sākotnēji tika izpildīts, kā rezultātā tika izveidots jauns <i>UTI</i> . Šis datu elements paliek nemainīgs visā <i>UTI</i> darbības laikā. Ziņojot par pozīciju līmeni, tam būtu jāattiecas uz laiku, kad pirmo reizi tika atvērta pozīcija.
43.	2.c iedaļa. Ziņas par darījumu	Spēkā stāšanās datums	Nekoriģēts datums, kurā stājas spēkā ārpusbiržas atvasināto instrumentu darījuma saistības, kā norādīts apstiprinājumā. Ja spēkā stāšanās datums nav norādīts līguma noteikumos, darījuma partneri atvasinātā instrumenta izpildes datumu paziņo šajā laukā.
44.	2.c iedaļa. Ziņas par darījumu	Termiņa beigu datumā	Nekoriģēts datums, kurā atvasināto instrumentu darījuma saistības vairs nav spēkā, kā norādīts apstiprinājumā. Priekšlaicīga izbeigšana neietekmē šo datu elementu.
45.	2.c iedaļa. Ziņas par darījumu	Priekšlaicīgas izbeigšanas datums	Paziņotā darījuma priekšlaicīgas izbeigšanas (termiņa beigu) spēkā stāšanās datums. Šo datu elementu piemēro, ja darījuma izbeigšana notiek pirms tā termiņa beigām darījuma partnera (vai darījuma partneru) <i>ex-interim</i> lēmuma dēļ.
46.	2.c iedaļa. Ziņas par darījumu	Līguma norēķinu galīgais datums	Nekoriģēts datums saskaņā ar līgumu, līdz kuram būtu jāveic visi naudas vai aktīvu pārvedumi un darījuma partneriem vairs nevajadzētu būt savstarpējam nenokārtotām saistībām saskaņā ar minēto līgumu. Attiecībā uz produktiem, kuriem var nebūt galīgā līgumiskā norēķina datuma (piemēram, Amerikas tipa iespēju līgumi), šis datu elements atspoguļo datumu, līdz kuram naudas vai aktīva pārvedums notiktu, ja līguma izbeigšana notiktu termiņa beigu datumā.
47.	2.c iedaļa. Ziņas par darījumu	Piegādes veids	Jānorāda, vai par līgumu norēķinās fiziskos aktīvos vai skaidrā naudā.
48.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	Cena	Cena, kas norādīta atvasinātā instrumenta darījumā. Tā neietver maksas, nodokļus vai komisijas maksas. Ja cena nav zināma, ziņojot par jaunu darījumu, cenu atjaunina, tiklīdz tā kļūst pieejama. Darījumiem, kas ir daļa no paketes, šis datu elements attiecīgā gadījumā ietver komponenta darījuma cenu.
49.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	Cenas valūta	Valūta, kurā ir denominēta cena. Cenas valūta ir piemērojama tikai tad, ja cena ir izteikta kā monetāra vērtība.

	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
	50. līdz 52. lauks ir atkārtojams, un tos aizpilda, ja atvasinātie instrumenti ietver cenu grafikus.		
50.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	Nekoriģēts cenas spēkā stāšanās datums	Nekoriģēts cenas spēkā stāšanās datums.
51.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	Nekoriģēts cenas beigu datums	Nekoriģēts cenas beigu datums (nepiemēro, ja konkrētā grafika perioda nekoriģētais beigu datums ir uzreiz pirms nākamā perioda nekoriģētā spēkā stāšanās datuma).
52.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	Cena, kas ir spēkā starp nekoriģēto spēkā stāšanās datumu un beigu datumu	Cena, kas ir spēkā starp nekoriģēto spēkā stāšanās datumu un nekoriģēto beigu datumu (ieskaitot).
53.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	Paketes darījuma cena	Visas paketes, kuras komponents ir uzrādītais atvasināto instrumentu darījums, tirdzniecības cena. Šo datu elementu nepiemēro, ja: — nav iesaistīta neviena pakete, vai — izmantota paketes darījuma starpība. Par cenām un saistītajiem darījumu datu elementiem (cenas valūta), kas veido paketes atsevišķos komponentus, ziņo, kad tie ir pieejami. Paketes darījuma cena var nebūt zināma, kad tiek ziņots par jaunu darījumu, bet to var atjaunināt vēlāk.
54.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	Paketes darījuma cenas valūta	Valūta, kurā ir denominēta paketes darījuma cena. Šo datu elementu nepiemēro, ja: — nav iesaistīta neviena pakete, vai — izmantota paketes darījuma starpība, vai — paketes darījumu cenu izsaka kā procentus.
55.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	1. daļas nosacītā summa	1. daļas nosacītā summa, kā minēts šīs regulas 5. pantā.
56.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	1. nosacītā valūta	Attiecīgā gadījumā: valūta, kurā denominēta 1. daļas nosacītā summa.
	57. līdz 59. lauks ir atkārtojams, un tos aizpilda, ja atvasinātie instrumenti ietver nosacītās summas grafikus.		

	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
57.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	1. daļas nosacītās summas spēkā stāšanās datums	Nekoriģētais datums, kurā stājas spēkā 1. daļas nosacītā summa.
58.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	1. daļas nosacītās summas beigu datums	1. daļas nosacītās summas nekoriģēts beigu datums (nepiemēro, ja konkrētā grafika perioda nekoriģētais beigu datums ir uzreiz pirms nākamā perioda nekoriģētā spēkā stāšanās datuma).
59.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	Nosacītā summa, kas ir spēkā attiecīgajā 1. daļas spēkā stāšanās datumā	1. daļas nosacītā summa, kas stājas spēkā attiecīgajā nekoriģētajā spēkā stāšanās datumā.
60.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	Kopējais 1. daļas nosacītais daudzums	Kopējais 1. daļas pamatā esošā aktīva nosacītais daudzums darījuma laikā. Ja kopējais nosacītais daudzums nav zināms, ziņojot par jaunu darījumu, kopējo nosacīto daudzumu atjaunina, tiklīdz tas kļūst pieejams.
	61. līdz 63. lauks ir atkārtojams, un tos aizpilda, ja atvasinātie instrumenti ietver nosacītā daudzuma grafikus.		
61.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	1. daļas nosacītā daudzuma spēkā stāšanās datums	Nekoriģēts datums, kurā stājas spēkā attiecīgais 1. daļas nosacītais daudzums
62.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	1. daļas nosacītā daudzuma beigu datums	1. daļas nosacītā daudzuma nekoriģētais beigu datums (nepiemēro, ja konkrētā grafika perioda nekoriģētais beigu datums ir uzreiz pirms nākamā perioda nekoriģētā spēkā stāšanās datuma).
63.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	Nosacītais daudzums, kas ir spēkā attiecīgajā 1. daļas spēkā stāšanās dienā	1. daļas nosacītais daudzums, kas stājas spēkā attiecīgajā nekoriģētajā spēkā stāšanās datumā.
64.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	2. daļas nosacītā summa	Attiecīgā gadījumā 2. daļas nosacītā summa, kā minēts šīs regulas 5. pantā.
65.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	2. nosacītā valūta	Attiecīgā gadījumā: valūta, kurā denominēta 2. daļas nosacītā summa.
	66. līdz 68. lauks ir atkārtojams, un tos aizpilda, ja atvasinātie instrumenti ietver nosacītās summas grafikus.		



	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
66.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	2. daļas nosacītās summas spēkā stāšanās datums	Nekoriģēts datums, kurā stājas spēkā attiecīgais 2. daļas nosacītais daudzums.
67.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	2. daļas nosacītās summas beigu datums	2. daļas nosacītā daudzuma nekoriģētais beigu datums (nepiemēro, ja konkrētā grafika perioda nekoriģētais beigu datums ir uzreiz pirms nākamā perioda nekoriģētā spēkā stāšanās datuma).
68.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	Nosacītā summa, kas ir spēkā attiecīgajā 2. daļas spēkā stāšanās datumā	2. daļas nosacītā summa, kas stājas spēkā attiecīgajā nekoriģētajā spēkā stāšanās datumā.
69.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	Kopējais 2. daļas nosacītais daudzums	Kopējais 2. daļas pamatā esošā aktīva nosacītais daudzums darījuma laikā. Ja kopējais nosacītais daudzums nav zināms, ziņojot par jaunu darījumu, kopējo nosacīto daudzumu atjaunina, tiklīdz tas kļūst pieejams.
	70. līdz 72. lauks ir atkārtojams, un tos aizpilda, ja atvasinātie instrumenti ietver nosacītā daudzuma grafikus.		
70.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	2. daļas nosacītā daudzuma spēkā stāšanās datums	Nekoriģēts datums, kurā stājas spēkā attiecīgais 2. daļas nosacītais daudzums.
71.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	2. daļas nosacītā daudzuma beigu datums	2. daļas nosacītā daudzuma nekoriģētais beigu datums (nepiemēro, ja konkrētā grafika perioda nekoriģētais beigu datums ir uzreiz pirms nākamā perioda nekoriģētā spēkā stāšanās datuma).
72.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	Nosacītais daudzums, kas ir spēkā attiecīgajā 2. daļas spēkā stāšanās dienā	2. daļas nosacītais daudzums, kas stājas spēkā attiecīgajā nekoriģētajā spēkā stāšanās datumā.
	73. līdz 78. lauku iedaļa ir atkārtojama		
73.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	Cits maksājuma veids	Citas maksājuma summas veids. Iespējas līguma prēmijas maksājums nav iekļauts kā maksājuma veids, jo prēmijas par iespējas līgumu uzrāda, izmantojot iespēju līguma prēmijas īpašo datu elementu.
74.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	Cita maksājuma summa	Maksājumu summas ar atbilstošiem maksājumu veidiem, lai pielāgotu prasības darījumu aprakstiem no dažādām aktīvu klasēm.
75.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	Cita maksājuma valūta	Valūta, kurā ir denominēta cita maksājuma summa.

	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
76.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	Cits maksājuma datums	Nekoriģēts datums, kurā samaksāta otra maksājuma summa.
77.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	Cits maksājuma veicējs	Citas maksājuma summas maksātāja identifikators.
78.	2.g iedaļa. Ziņas par darījumu	Cits maksājuma saņēmējs	Citas maksājuma summas saņēmēja identifikators.
79.	2.h iedaļa. Procentu likmes	1. daļas fiksētā likme vai kupons	Attiecīgā gadījumā jānorāda izmantotā 1. daļas fiksētā likme vai kupons.
80.	2.h iedaļa. Procentu likmes	1. daļas fiksētās likmes vai kupona dienu aprēķina princips	Attiecīgā gadījumā: dienu aprēķina princips (dēvēts arī par aprēķinātajām dienām vai aprēķinu nosacījumu, vai dienu aprēķina metodi), kas nosaka, kā aprēķina procentu maksājumus. To izmanto, lai aprēķinātu aprēķina perioda gada daļu, un tas norāda aprēķina perioda dienu skaitu, kas dalīts ar dienu skaitu gadā.
81.	2.h iedaļa. Procentu likmes	1. daļas fiksētās likmes vai kupona maksājumu biežuma periods	Attiecīgā gadījumā: laika vienība, kas saistīta ar maksājumu biežumu, piemēram, diena, nedēļa, mēnesis, gads vai plūsmas termiņš 1. daļas fiksētajai likmei vai kuponam.
82.	2.h iedaļa. Procentu likmes	1. daļas fiksētās likmes vai kupona maksājumu biežuma perioda reizinātājs	Attiecīgā gadījumā: laika vienību skaits (izteikts ar maksājumu biežuma periodu), kas nosaka 1. daļas fiksētās likmes vai kupona periodisku maksājumu datumu biežumu. Piemēram, darījumam, kurā maksājumi tiek veikti reizi divos mēnešos, ir maksājumu biežuma periods "MNTM" (ik mēnesi) un maksājumu biežuma perioda reizinātājs 2. Šo datu elementu nepiemēro, ja maksājumu biežums ir "ADHO" ( <i>ad-hoc</i> ). Ja maksājumu biežuma periods ir "EXPI" (maksājums termiņā), maksājumu biežuma reizinātājs ir 1. Ja maksājumu biežums ir tekošā dienā, maksājumu biežuma periods ir "DAIL" un maksājumu biežuma reizinātājs ir 0.
83.	2.h iedaļa. Procentu likmes	1. daļas mainīgās likmes identifikators	Attiecīgā gadījumā: tās izmantotās procentu likmes identifikators, ko pārskata iepriekš noteiktos intervālos, atsaucoties uz tirgus bāzes likmi.
84.	2.h iedaļa. Procentu likmes	1. daļas mainīgās likmes rādītājs	Pamatā esošā indeksa rādītājs, ja pieejams.
85.	2.h iedaļa. Procentu likmes	1. daļas mainīgās likmes nosaukums	Procentu likmes pilns nosaukums, ko piešķir indeksa nodrošinātājs.
86.	2.h iedaļa. Procentu likmes	1. daļas mainīgās likmes dienu aprēķina princips	Attiecīgā gadījumā: dienu aprēķina princips (dēvēts arī par aprēķinātajām dienām vai aprēķinu nosacījumu, vai dienu aprēķina metodi), kas nosaka, kā aprēķina 1. daļas mainīgās likmes procentu maksājumus. To izmanto, lai aprēķinātu aprēķina perioda gada daļu, un tas norāda aprēķina perioda dienu skaitu, kas dalīts ar dienu skaitu gadā.

	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
87.	2.h iedaļa. Procentu likmes	1. daļas mainīgās likmes maksājuma biežuma periods	Attiecīgā gadījumā: laika vienība, kas saistīta ar maksājumu biežumu, piemēram, diena, nedēļa, mēnesis, gads vai plūsmas termiņš 1. daļas mainīgajai likmei.
88.	2.h iedaļa. Procentu likmes	1. daļas mainīgās likmes maksājuma biežuma perioda reizinātājs	Attiecīgā gadījumā: laika vienību skaits (izteikts ar maksājumu biežuma periodu), kas nosaka 1. daļas mainīgās likmes periodisku maksājumu datumu biežumu. Piemēram, darījumam, kurā maksājumi tiek veikti divos mēnešos, ir maksājumu biežuma periods "MNTM" (ik mēnesi) un maksājumu biežuma perioda reizinātājs 2. Šo datu elementu nepiemēro, ja maksājumu biežums ir "ADHO" ( <i>ad-hoc</i> ). Ja maksājumu biežuma periods ir "EXPI" (maksājums termiņā), maksājumu biežuma reizinātājs ir 1. Ja maksājumu biežums ir tekošā dienā, maksājumu biežuma periods ir "DAIL" un maksājumu biežuma reizinātājs ir 0.
89.	2.h iedaļa. Procentu likmes	1. daļas mainīgās likmes atsaucē periods – laikposms	Laikposms, kas raksturo 1. daļas mainīgās likmes atsaucē periodu.
90.	2.h iedaļa. Procentu likmes	1. daļas mainīgās likmes atsaucē periods – reizinātājs	Laikposma reizinātājs, kas raksturo 1. daļas mainīgās likmes atsaucē periodu.
91.	2.h iedaļa. Procentu likmes	1. daļas mainīgās likmes pārskatīšanas biežuma periods	Attiecīgā gadījumā: laika vienība, kas saistīta ar maksājumu pārskatīšanas biežumu, piemēram, diena, nedēļa, mēnesis, gads vai plūsmas termiņš 1. daļas mainīgajai likmei.
92.	2.h iedaļa. Procentu likmes	1. daļas mainīgās likmes pārskatīšanas biežuma reizinātājs	Attiecīgā gadījumā: laika vienību skaits (izteikts ar maksājumu biežuma periodu), kas nosaka 1. daļas mainīgās likmes periodisku maksājumu pārskatīšanas datumu biežumu. Piemēram, darījumam, kurā maksājumi tiek veikti divos mēnešos, ir maksājumu biežuma periods "MNTM" (ik mēnesi) un maksājumu biežuma perioda reizinātājs 2. Šo datu elementu nepiemēro, ja maksājumu biežums ir "ADHO" ( <i>ad-hoc</i> ). Ja maksājumu biežuma periods ir "EXPI" (maksājums termiņā), maksājumu biežuma reizinātājs ir 1. Ja maksājumu biežums ir tekošā dienā, maksājumu biežuma periods ir "DAIL" un maksājumu biežuma reizinātājs ir 0.
93.	2.h iedaļa. Procentu likmes	1. daļas starpība	Attiecīgā gadījumā jānorāda 1. daļas starpība: ārpusbiržas atvasināto instrumentu darījumiem ar periodiskiem maksājumiem (piemēram, procentu likmju mijmaiņas darījumi no fiksētas pret mainīgu, bāzes mijmaiņa, preču mijmaiņas darījumi), — atsevišķās mainīgās(-o) daļas(-u) indeksa atsaucē cenas starpība, ja ir mainīgās(-o) daļas(-u) starpība; — atšķirība starp abu mainīgo daļu indeksu atsaucē cenām.

	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
94.	2.h iedaļa. Procentu likmes	1. daļas valūtas starpība	Attiecīgā gadījumā: valūta, kurā denominēta 1. daļas starpība. Šo datu elementu piemēro tikai tad, ja starpību izsaka kā naudas summu.
95.	2.h iedaļa. Procentu likmes	2. daļas fiksētā likme	Attiecīgā gadījumā jānorāda izmantotā 2. daļas fiksētā likme.
96.	2.h iedaļa. Procentu likmes	2. daļas fiksētās likmes dienu aprēķina princips	Attiecīgā gadījumā: dienu aprēķina princips (dēvēts arī par aprēķinātajām dienām vai aprēķinu nosacījumu, vai dienu aprēķina metodi), kas nosaka, kā aprēķina procentu maksājumus. To izmanto, lai aprēķinātu aprēķina perioda gada daļu, un tas norāda aprēķina perioda dienu skaitu, kas dalīts ar dienu skaitu gadā.
97.	2.h iedaļa. Procentu likmes	2. daļas fiksētās likmes maksājumu biežuma periods	Attiecīgā gadījumā: laika vienība, kas saistīta ar maksājumu biežumu, piemēram, diena, nedēļa, mēnesis, gads vai plūsmas termiņš 2. daļas fiksētajai likmei.
98.	2.h iedaļa. Procentu likmes	2. daļas fiksētās likmes maksājumu biežuma perioda reizinātājs	Attiecīgā gadījumā: laika vienību skaits (izteikts ar maksājumu biežuma periodu), kas nosaka 2. daļas fiksētās likmes periodisku maksājumu datumu biežumu. Piemēram, darījumam, kurā maksājumi tiek veikti reizi divos mēnešos, ir maksājumu biežuma periods "MNTH" (ik mēnesi) un maksājumu biežuma perioda reizinātājs 2. Šo datu elementu nepiemēro, ja maksājumu biežums ir "ADHO" ( <i>ad-hoc</i> ). Ja maksājumu biežuma periods ir "EXPI" (maksājums termiņā), maksājumu biežuma reizinātājs ir 1. Ja maksājumu biežums ir tekošā dienā, maksājumu biežuma periods ir "DAIL" un maksājumu biežuma reizinātājs ir 0.
99.	2.h iedaļa. Procentu likmes	2. daļas mainīgās likmes identifikators	Attiecīgā gadījumā: izmantotās procentu likmes identifikators, ko pārskata iepriekš noteiktos intervālos, atsaucoties uz tirgus bāzes likmi
100.	2.h iedaļa. Procentu likmes	2. daļas mainīgās likmes rādītājs	Pamatā esošā indeksa rādītājs, ja pieejams.
101.	2.h iedaļa. Procentu likmes	2. daļas mainīgās likmes nosaukums	Procentu likmes pilns nosaukums, ko piešķir indeksa nodrošinātājs.
102.	2.h iedaļa. Procentu likmes	2. daļas mainīgās likmes dienu aprēķina princips	Attiecīgā gadījumā: dienu aprēķina princips (dēvēts arī par aprēķinātajām dienām vai aprēķinu nosacījumu, vai dienu aprēķina metodi), kas nosaka, kā aprēķina 2. daļas mainīgās likmes procentu maksājumus. To izmanto, lai aprēķinātu aprēķina perioda gada daļu, un tas norāda aprēķina perioda dienu skaitu, kas dalīts ar dienu skaitu gadā.
103.	2.h iedaļa. Procentu likmes	2. daļas mainīgās likmes maksājuma biežuma periods	Attiecīgā gadījumā: laika vienība, kas saistīta ar maksājumu biežumu, piemēram, diena, nedēļa, mēnesis, gads vai plūsmas termiņš 2. daļas mainīgajai likmei.

	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
104.	2.h iedaļa. Procentu likmes	2. daļas mainīgās likmes maksājuma biežuma perioda reizinātājs	Attiecīgā gadījumā: laika vienību skaits (izteikts ar maksājumu biežuma periodu), kas nosaka 2. daļas mainīgās likmes periodisku maksājumu datumu biežumu. Piemēram, darījumam, kurā maksājumi tiek veikti reizi divos mēnešos, ir maksājumu biežuma periods "MNTH" (ik mēnesi) un maksājumu biežuma perioda reizinātājs 2. Šo datu elementu nepiemēro, ja maksājumu biežums ir "ADHO" ( <i>ad-hoc</i> ). Ja maksājumu biežuma periods ir "EXPI" (maksājums termiņā), maksājumu biežuma reizinātājs ir 1. Ja maksājumu biežums ir tekošā dienā, maksājumu biežuma periods ir "DAIL" un maksājumu biežuma reizinātājs ir 0.
105.	2.h iedaļa. Procentu likmes	2. daļas mainīgās likmes atsaucē periods – laikposms	Laikposms, kas raksturo 2. daļas mainīgās likmes atsaucē periodu.
106.	2.h iedaļa. Procentu likmes	2. daļas mainīgās likmes atsaucē periods – reizinātājs	Laikposma reizinātājs, kas raksturo 2. daļas mainīgās likmes atsaucē periodu.
107.	2.h iedaļa. Procentu likmes	2. daļas mainīgās likmes pārskatīšanas biežuma periods	Attiecīgā gadījumā: laika vienība, kas saistīta ar maksājumu pārskatīšanas biežumu, piemēram, diena, nedēļa, mēnesis, gads vai plūsmas termiņš 2. daļas mainīgajai likmei.
108.	2.h iedaļa. Procentu likmes	2. daļas mainīgās likmes pārskatīšanas biežuma reizinātājs	Attiecīgā gadījumā: laika vienību skaits (izteikts ar maksājumu biežuma periodu), kas nosaka 2. daļas mainīgās likmes periodisku maksājumu pārskatīšanas datumu biežumu. Piemēram, darījumam, kurā maksājumi tiek veikti reizi divos mēnešos, ir maksājumu biežuma periods "MNTH" (ik mēnesi) un maksājumu biežuma perioda reizinātājs 2. Šo datu elementu nepiemēro, ja maksājumu biežums ir "ADHO" ( <i>ad-hoc</i> ). Ja maksājumu biežuma periods ir "EXPI" (maksājums termiņā), maksājumu biežuma reizinātājs ir 1. Ja maksājumu biežums ir tekošā dienā, maksājumu biežuma periods ir "DAIL" un maksājumu biežuma reizinātājs ir 0.
109.	2.h iedaļa. Procentu likmes	2. daļas starpība	Attiecīgā gadījumā jānorāda 2. daļas starpība: ārpusbiržas atvasināto instrumentu darījumiem ar periodiskiem maksājumiem (piemēram, procentu likmju mijmaiņas darījumi no fiksētas pret mainīgu, bāzes mijmaiņa, preču mijmaiņas darījumi), — atsevišķās mainīgās(-o) daļas(-u) indeksa atsaucē cenas starpība, ja ir mainīgās(-o) daļas(-u) starpība; — atšķirība starp abu mainīgo daļu indeksu atsaucē cenām.
110.	2.h iedaļa. Procentu likmes	2. daļas valūtas starpība	Attiecīgā gadījumā: valūta, kurā denominēta 2. daļas starpība. Šo datu elementu piemēro tikai tad, ja starpību izsaka kā naudas summu.

	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
111.	2.h iedaļa. Procentu likmes	Paketes darījuma starpība	<p>Visas paketes, kurā paketes darījuma komponents ir uzrādītais atvasināto instrumentu darījums, tirdzniecības cena.</p> <p>Paketes darījuma cena, ja paketes cena ir izteikta kā starpība, atšķirība starp divām atsauces cenām.</p> <p>Šo datu elementu nepiemēro, ja:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— nav iesaistīta neviena pakete, vai</li> <li>— izmantota paketes darījuma cena.</li> </ul> <p>Par starpību un saistītajiem darījumu datu elementiem (starpības valūta), kas veido paketes atsevišķās sastāvdaļas, ziņo, kad tie ir pieejami.</p> <p>Paketes darījuma starpība var nebūt zināma, kad tiek ziņots par jaunu darījumu, bet to var atjaunināt vēlāk.</p>
112.	2.h iedaļa. Procentu likmes	Paketes darījuma starpības valūta	<p>Valūta, kurā ir denominēta paketes darījuma starpība.</p> <p>Šo datu elementu nepiemēro, ja:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— nav iesaistīta neviena pakete, vai</li> <li>— izmantota paketes darījuma cena, vai</li> <li>— paketes darījumu starpību izsaka kā procentus vai bāzes punktus.</li> </ul>
113.	2.i iedaļa. Ārvalstu valūta	1. valūtas maiņas kurss	<p>Valūtas maiņas kurss starp divām dažādām atvasinātā instrumenta darījumā noteiktām valūtām, par kurām darījuma sākumā vienojušies darījuma partneri, izteikts kā valūtas maiņas kurss, bāzes valūtu konvertējot uz kotācijas valūtu.</p>
114.	2.i iedaļa. Ārvalstu valūta	Valūtas nākotnes maiņas kurss	<p>Valūtas nākotnes maiņas kurss, par ko darījuma partneri vienojušies līgumā. To izsaka kā pamatvalūtas cenu kotētajā valūtā.</p>
115.	2.i iedaļa. Ārvalstu valūta	Valūtas maiņas kursa bāze	<p>Valūtu pāris un kārtība, kādā denominēts valūtas maiņas kurss, izteikts kā bāzes valūta vai kotācijas valūta.</p>
116.	2.j iedaļa. Preces un emisijas kvotas (vispārīgi)	Bāzes produkts	<p>Pamatprodukts, kas norādīts preču klasifikācijā Īstenošanas regulas (ES) 2022/1860 pielikuma 4. tabulā.</p>
117.	2.j iedaļa. Preces un emisijas kvotas (vispārīgi)	Apakšprodukts	<p>Apakšprodukts, kas norādīts preču klasifikācijā Īstenošanas regulas (ES) 2022/1860 pielikuma 4. tabulā.</p> <p>Šajā laukā ir vajadzīgs konkrēts bāzes produkts.</p>
118.	2.j iedaļa. Preces un emisijas kvotas (vispārīgi)	Lejupējāks apakšprodukts	<p>Lejupējāks apakšprodukts, kas norādīts preču klasifikācijā Īstenošanas regulas (ES) 2022/1860 pielikuma 4. tabulā.</p> <p>Šajā laukā ir vajadzīgs īpašs apakšprodukts.</p>

	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
119.	2.k iedaļa. Preces un emisijas kvotas (enerģētika)	Piegādes vieta vai zona	Piegādes vieta(-as) vai tirgus reģions(-i).
120.	2.k iedaļa. Preces un emisijas kvotas (enerģētika)	Starpsavienojuma punkts	Jānorāda transportēšanas līguma robeža(-as) vai robežpunkts (-i).
121.	2.k iedaļa. Preces un emisijas kvotas (enerģētika)	Slodzes veids	Piegādes profila identifikācija.
	122. līdz 131. lauku iedaļa ir atkārtojama		
122.	2.k iedaļa. Preces un emisijas kvotas (enerģētika)	Piegādes intervāla sākuma laiks	Piegādes intervāla sākuma laiks katram blokam vai formai.
123.	2.k iedaļa. Preces un emisijas kvotas (enerģētika)	Piegādes intervāla beigu laiks	Piegādes intervāla beigu laiks katram blokam vai formai.
124.	2.k iedaļa. Preces un emisijas kvotas (enerģētika)	Piegādes sākuma datums	Jānorāda piegādes sākuma datums.
125.	2.k iedaļa. Preces un emisijas kvotas (enerģētika)	Piegādes beigu datums	Jānorāda piegādes beigu datums.
126.	2.k iedaļa. Preces un emisijas kvotas (enerģētika)	Ilgums	Piegādes perioda ilgums.
127.	2.k iedaļa. Preces un emisijas kvotas (enerģētika)	Nedēļas dienas	Piegādes nedēļas dienas.
128.	2.k iedaļa. Preces un emisijas kvotas (enerģētika)	Piegādes kapacitāte	Darījumā iekļauto vienību skaits katram 122. un 123. laukā norādītajam piegādes intervālam.

	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
129.	2.k iedaļa. Preces un emisijas kvotas (enerģētika)	Daudzuma vienība	Izmantotā mērvienība.
130.	2.k iedaļa. Preces un emisijas kvotas (enerģētika)	Cenas/laika intervāla daudzumi	Attiecīgā gadījumā cena par daudzumu piegādes laika intervālā.
131.	2.k iedaļa. Preces un emisijas kvotas (enerģētika)	Cenas/laika intervāla daudzuma valūta	Valūta, kurā izteikta cena par laika intervāla daudzumu.
132.	2.l iedaļa. Iespējas līgumi	Iespējas līguma veids	Norāde par to, vai atvasinātā instrumenta līgums ir pirkšanas iespējas līgums (tiesības pirkt konkrētu pamatā esošu aktīvu) vai pārdošanas iespējas līgums (tiesības pārdot konkrētu pamatā esošu aktīvu), vai arī par to, ka atvasinātā instrumenta līguma izpildes laikā nav iespējams konstatēt, vai līgums ir pirkšanas iespējas līgums vai pārdošanas iespējas līgums. Mijmaiņas iespējas līgumu gadījumā tas ir: — “pārdošanas iespējas līgums” – saņēmēja mijmaiņas iespējas līguma gadījumā, kad pircējam ir tiesības noslēgt mijmaiņas līgumu kā fiksētas likmes saņēmējam; — “pirkšanas iespējas līgums” – maksātāja mijmaiņas iespējas līguma gadījumā, kad pircējam ir tiesības noslēgt mijmaiņas līgumu kā fiksētas likmes maksātājam. Procentu likmju maksimālās robežvērtības līgumu un procentu likmju minimālās robežvērtības līgumu gadījumā tas ir: — “pārdošanas iespējas līgums” – procentu likmju minimālās robežvērtības līguma gadījumā; — “pirkšanas iespējas līgums” – procentu likmju maksimālās robežvērtības līguma gadījumā.
133.	2.l iedaļa. Iespējas līgumi	Iespējas līguma veids.	Jānorāda, vai iespējas līgumu var izpildīt tikai konkrētā datumā (Eiropas), vairākos iepriekš noteiktos datos (Bermudu) vai jebkurā brīdī līguma darbības laikā (Amerikas).
134.	2.l iedaļa. Iespējas līgumi	Norunas cena	— Iespējas līgumiem, kas nav ārvalstu valūtu iespējas līgumi, mijmaiņas iespējas līgumi un līdzīgi produkti – cena, par kādu iespējas līguma īpašnieks var pirkt vai pārdot iespējas līguma pamatā esošo aktīvu. — Ārvalstu valūtu iespējas līgumiem – valūtas maiņas kurss, par kādu var izpildīt iespēju līgumu, izteikts kā valūtas maiņas kurss, bāzes valūtu konvertējot uz kotācijas valūtu. Piemērā 0,9426 USD/EUR, USD ir bāzes valūta un EUR ir kotācijas valūta; 1 USD= 0,9426 EUR. Ja norunas cena nav zināma, ziņojot par jaunu darījumu, cenu atjaunina, tiklīdz tā kļūst pieejama. — Svārstīguma un dispersijas mijmaiņas līgumiem un līdzīgiem produktiem svārstīguma norunas cenu uzrāda šajā datu elementā.
	135. līdz 137. lauks ir atkārtojams, un tos aizpilda, ja atvasinātie instrumenti ietver norunas cenu grafikus.		



	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
135.	2.l iedaļa. Iespējas līgumi	Norunas cenas spēkā stāšanās datums	Nekoriģēts norunas cenas spēkā stāšanās datums.
136.	2.l iedaļa. Iespējas līgumi	Norunas cenas beigu datums	Nekoriģēts norunas cenas beigu datums. (nepiemēro, ja konkrētā grafika perioda nekoriģētais beigu datums ir uzreiz pirms nākamā perioda nekoriģētā spēkā stāšanās datuma).
137.	2.l iedaļa. Iespējas līgumi	Norunas cena, kas ir spēkā attiecīgajā spēkā stāšanās dienā	Norunas cena, kas ir spēkā starp nekoriģēto spēkā stāšanās datumu un nekoriģēto beigu datumu (ieskaitot).
138.	2.l iedaļa. Iespējas līgumi	Norunas cenas valūta/valūtu pāris	Kapitāla vērtspapīru iespējas līgumiem, preču iespējas līgumiem un līdzīgiem produktiem – valūta, kurā ir denominēta norunas cena. Attiecībā uz ārvalstu valūtas iespējas līgumiem: valūtu pāris un kārtība, kādā izteikta norunas cena. To izsaka kā bāzes valūtu pret kotācijas valūtu.
139.	2.l iedaļa. Iespējas līgumi	Iespējas līguma prēmijas summa	Attiecībā uz visu aktīvu klašu iespēju līgumiem un mijmaiņas iespējas līgumiem – monetārā summa, ko samaksājis iespējas līguma pircējs. Šo datu elementu nepiemēro, ja instruments nav iespējas līgums vai neietver nekādu iespēju.
140.	2.l iedaļa. Iespējas līgumi	Iespējas līguma prēmijas valūta	Attiecībā uz visu aktīvu klašu iespējas līgumiem un mijmaiņas iespējas līgumiem – valūta, kurā ir denominēta iespējas līguma prēmijas summa. Šo datu elementu nepiemēro, ja instruments nav iespējas līgums vai neietver nekādu iespēju.
141.	2.l iedaļa. Iespējas līgumi	Iespējas līguma prēmijas maksājuma datums	Nekoriģēts datums, kurā samaksāta iespējas līguma prēmija.
142.	2.i iedaļa. Iespējas līgumi	Pamatā esošā aktīva termiņa beigu datums	Mijmaiņas iespējas līgumu gadījumā – pamatā esošā mijmaiņas darījuma termiņa beigu datums.
143.	2.m iedaļa. Kredīta atvasinātie instrumenti	Prioritāte	Norāda parāda vērtspapīra vai parāda groza vai indeksa, kas ir atvasinātā instrumenta pamatā, prioritāti.
144.	2.m iedaļa. Kredīta atvasinātie instrumenti	Atsauces struktūra	Pamatā esošās atsauces struktūras identifikācija.
145.	2.m iedaļa. Kredīta atvasinātie instrumenti	Sērijas	Indeksa satura sērijas numurs, ja piemērojams.
146.	2.m iedaļa. Kredīta atvasinātie instrumenti	Versija	Jaunu sēriju versiju emitē, ja notiek viena instrumenta saistību neizpilde un indekss ir atkārtoti jāsver, lai noteiktu indeksā esošo kopējo instrumentu jauno skaitu.
147.	2.m iedaļa. Kredīta atvasinātie instrumenti	Indeksa koeficients	Koeficients, ko piemēro nosacītajai summai (šīs tabulas 55. lauks), lai to pielāgotu visiem iepriekšējiem kredīta notikumiem attiecīgajā indeksa sērijā.
148.	2.m iedaļa. Kredīta atvasinātie instrumenti	Laidiens	Norāde par to, vai atvasinātā instrumenta līgums ir sadalīts vairākos laidienos.
149.	2.m iedaļa. Kredīta atvasinātie instrumenti	Kreditriskā mijmaiņas līguma (CDS) indeksa piesaistes punkts	Definēts zemākais punkts, kurā zaudējumu līmenis pamatā esošajā portfeli samazina laidiena nosacīto summu. Piemēram, laidiena nosacītā summa ar piesaistes punktu 3 % apmērā tiks samazināta pēc tam, kad portfeli būs radušies 3 % zaudējumu. Šo datu elementu nepiemēro, ja darījums nav CDS laidiena darījums (indeksa vai specializēts grozs).

	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
150.	2.m iedaļa. Kredīta atvasinātie instrumenti	CDS indeksa atsaistes punkts	Definēts punkts, pēc kura zaudējumi pamatā esošajā portfeli vairs nesamazina laidiena nosacīto summu. Piemēram, laidiena nosacītā summa ar piesaistes punktu 3 % un atsaistes punktu 6 % apmērā tiks samazināta pēc tam, kad portfeli būs 3 % zaudējumu. Portfeļa zaudējumi 6 % apmērā samazina laidiena nosacīto summu. Šo datu elementu nepiemēro, ja darījums nav CDS laidiena darījums (indeksa vai specializēts grozs).
151.	2.n iedaļa. Atvasinātā instrumenta grozījumi	Darbības veids	<ul style="list-style-type: none"> <li>— Jauns: pirmo reizi paziņo par atvasināto instrumentu darījuma vai pozīcijas līmenī.</li> <li>— Grozīt: grozījums iepriekš paziņota atvasinātā instrumenta noteikumos vai informācijā darījuma vai pozīcijas līmenī, bet ne ziņojuma korekcija.</li> <li>— Koriģēt: Ziņojums, ar ko koriģē iepriekš iesniegta ziņojuma kļūdainos datu laukus.</li> <li>— Izbeigt: Esoša atvasinātā instrumenta izbeigšana darījuma vai pozīcijas līmenī.</li> <li>— Kļūda: Nepareizi iesniegta visa ziņojuma anulēšana tad, kad atvasinātais instruments, darījuma vai pozīcijas līmenī, nekad nav stājies spēkā un tam nav tikušas piemērotas Regulas (ES) Nr. 648/2012 ziņošanas prasības, bet tas ir ticis paziņots darījumu reģistram kļūdas dēļ, vai ziņojuma dublikāta anulēšana.</li> <li>— Atjaunot: tāda atvasinātā instrumenta atjaunošana darījuma vai pozīcijas līmenī, kas tika atcelts ar darbības veidu "Kļūda" vai izbeigts kļūdas dēļ.</li> <li>— Vērtēšana: atvasinātā instrumenta vērtējuma atjaunināšana darījuma vai pozīcijas līmenī</li> <li>— Pozīcijas komponents: ziņojums par jaunu atvasināto instrumentu, kas tajā pašā dienā ir iekļauts atsevišķā ziņojumā par pozīciju.</li> </ul>
152.	2.n iedaļa. Atvasinātā instrumenta grozījumi	Notikuma veids	<ul style="list-style-type: none"> <li>— Darījums: atvasinātā instrumenta līguma noslēgšana vai atkārtotas sarunas par tā noteikumiem, kuru rezultātā netiek mainīts darījuma partneris</li> <li>— Pakāpeniskā ieviešana: notikums, kur atvasinātā instrumenta daļa vai viss atvasinātais instruments tiek nodots 2. darījuma partnerim (un tas tiek paziņots kā jauns atvasinātais instruments) un esošais atvasināto instrumentu līgums tiek vai nu izbeigts, vai arī tiek mainīta tā nosacītā vērtība.</li> <li>— PTRR pēctirdzniecības riska samazināšanas pasākums</li> <li>— Priekšlaicīga izbeigšana: atvasināto instrumentu līguma izbeigšana darījuma vai pozīcijas līmenī</li> <li>— Tīrvērtē: tīrvērtē, kā definēts Regulas (ES) Nr. 648/2012 2. panta 3. punktā</li> <li>— Izpilde: iespējas līguma vai mijmaiņas iespējas līguma pilnīga vai daļēja izpilde, ko veic viens darījuma partneris.</li> <li>— Sadale: Sadales notikums, ja pastāvošs atvasinātais instruments tiek sadalīts dažādiem darījumu partneriem un uzrādīts kā jauni atvasinātie instrumenti ar samazinātām nosacītām summām.</li> <li>— Kredītnotikums: attiecas tikai uz kredītu atvasinātajiem instrumentiem. Kredītnotikums, kura rezultātā tiek grozīts atvasinātā instrumenta līgums darījuma vai pozīcijas līmenī</li> </ul>

	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
			<p>Korporatīvais notikums: Korporatīva darbība attiecībā uz pamatā esošajiem kapitāla vērtspapīriem, kas ietekmē šo kapitāla vērtspapīru atvasinātos instrumentus</p> <p>— Iekļaušana pozīcijā: Atvasinātā instrumenta vai cenu starpības līguma, kam CCP veicis tīrvērti, iekļaušana pozīcijā, ja esošais atvasināto instrumentu līgums tiek izbeigts un vai nu tiek radīta jauna pozīcija, vai arī mainīta esošās pozīcijas nosacītā vērtība.</p> <p>Atjauninājums – nenokārtota atvasinātā instrumenta atjaunināšana, kas veikta pārejas periodā, lai nodrošinātu tā atbilstību grozītajām ziņošanas prasībām.</p>
153.	2.n iedaļa. Atvasinātā instrumenta grozījumi	Notikuma datums	Datums, kurā noticis ar atvasināto instrumentu līgumu saistīts notikums, par kuru jāsniedz ziņojums un kurš norādīts ziņojumā, vai – grozījuma gadījumā –, kad grozījums stājas spēkā.
154.	2.n iedaļa. Atvasinātā instrumenta grozījumi	Līmenis	Norāde par to, vai ziņojums ir sagatavots darījuma vai pozīciju līmenī. Ziņojumu par pozīciju līmeņiem var izmantot tikai kā papildinājumu darījuma līmeņa ziņošanai, lai ziņotu par pēctirdzniecības notikumiem, un vienīgi tad, ja atsevišķie darījumi ar aizvietojamiem produktiem ir aizstāti ar šo pozīciju.

(<sup>1</sup>) Komisijas Deleģētā regula (ES) Nr. 149/2013 (2012. gada 19. decembris), ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 648/2012 attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par netiešas tīrvērtes mehānismu, tīrvērtes pienākumu, publisko reģistru, pieeju tirdzniecības vietai, nefinanšu darījuma partneriem un riska ierobežošanas paņēmieniem ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem, kuriem tīrvērti neveic centrālais darījuma partneris (OV L 052, 23.2.2013., 11. lpp.).

### 3. tabula

Postenis	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
1.	Atvasinātā instrumenta līguma puses	Ziņojuma iesniegšanas laika zīmogs	Darījumu reģistram iesniegtā ziņojuma datums un laiks.
2.	Atvasinātā instrumenta līguma puses	Ziņojuma iesniedzējas struktūras identifikators	Ja par ziņošanu atbildīgais darījuma partneris ir deleģējis ziņojuma iesniegšanu trešai personai vai citam darījuma partnerim, šī struktūra ir jāidentificē šajā laukā ar unikālu kodu. Pretējā gadījumā šajā laukā būtu jānorāda par ziņošanu atbildīgā struktūra.
3.	Atvasinātā instrumenta līguma puses	Par ziņošanu atbildīgā struktūra	Ja finanšu darījuma partneris vienīgais ir atbildīgs (arī juridiski) par ziņošanu abu darījumu partneru vārdā saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 9. panta 1.a punktu, un nefinanšu darījuma partneris neizlemj pats ziņot sīkāku informāciju par tā ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem ar finanšu darījuma partneri – šo finanšu darījuma partneri identificējošs unikālais kods. Ja pārvaldības sabiedrība ir atbildīga (arī juridiski) par ziņošanu PVKIU vārdā saskaņā ar minētās regulas 9. panta 1.b punktu – šo pārvaldības sabiedrību identificējošs unikāls kods. Ja AIF pārvaldnieks ir atbildīgs (arī juridiski) par ziņošanu AIF vārdā

Postenis	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
			saskaņā ar minētās Regulas 9. panta 1.c punktu – šo AIF pārvaldnieku identificējošs unikāls kods. Ja par AKUI pārvaldību un rīcību tās vārdā atbildīga pilnvarota struktūra ir atbildīga (arī juridiski) par ziņošanu tās vārdā saskaņā ar minētās regulas 9. panta 1.d punktu – šo struktūru identificējošs unikāls kods. Šis lauks attiecas tikai uz ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem.
4.	Atvasinātā instrumenta līguma puses	1. darījuma partneris (ziņojuma sniedzējs darījuma partneris)	Tā atvasināto instrumentu darījuma partnera identifikators, kurš izpilda ziņošanas pienākumu, izmantojot attiecīgo ziņojumu. Ja sadalītu atvasināto instrumentu darījumu fonda vārdā izpilda fonda pārvaldnieks, kā darījuma partneri norāda fondu, nevis fonda pārvaldnieku.
5.	Atvasinātā instrumenta līguma puses	2. darījuma partnera identifikatora veids	Norāde par to, vai 2. darījuma partnera identificēšanai ir izmantots juridiskās personas identifikators ( <i>LEI</i> ).
6.	Atvasinātā instrumenta līguma puses	2. darījuma partneris	Atvasināto instrumentu darījuma 2. darījuma partnera identifikators. Ja sadalītu atvasināto instrumentu darījumu fonda vārdā izpilda fonda pārvaldnieks, kā darījuma partneri norāda fondu, nevis fonda pārvaldnieku.
7.	Nodrošinājums	Nodrošinājuma laika zīmogs	Datums un laiks, no kura paziņo drošības rezervju vērtības.
8.	Nodrošinājums	Nodrošinājuma portfeļa rādītājs	Norāde par to, vai nodrošināšanu veica portfeļa līmenī. "Portfeļa līmenī" nozīmē darījumu kopumu, kam drošības rezerve noteikta kopā (neto vai bruto līmenī), pretēji scenārijam, kurā drošības rezerve tiek aprēķināta un norādīta katram individuālajam darījumam atsevišķi.
9.	Nodrošinājums	Nodrošinājuma portfeļa kods	Ja par nodrošinājumu ziņo portfeļa līmenī – 1. darījumu partnera portfelim piešķirts unikāls kods. Šo datu elementu nepiemēro, ja nodrošināšana veikta darījuma līmenī, ja nav nodrošinājuma līguma vai ja nodrošinājums nav izvietots vai saņemts.
10.	Nodrošinājums	UTI	Unikālais tirdzniecības identifikators, kas minēts Īstenošanas regulas (ES) 2022/1860 7. pantā.
11.	Nodrošinājums	Nodrošinājuma kategorija	Norādīt, vai pastāv nodrošinājuma līgums starp darījumu partneriem. Šo datu elementu sniedz par katru darījumu vai katru portfeli atkarībā no tā, vai nodrošināšana tiek veikta darījuma vai portfeļa līmenī, un to piemēro gan darījumiem, kam veikta tīrvērtē, gan darījumiem, kuriem tīrvērtē nav veikta.

Postenis	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
12.	Nodrošinājums	1. darījumu partnera izvietotā sākotnējā drošības rezerve (pirms diskonta)	<p>1. darījuma partnera izvietotās sākotnējās drošības rezerves vērtība naudas izteiksmē, t. sk. jebkura drošības rezerve, kas ir procesā un vēl nav nokārtota.</p> <p>Ja nodrošināšanu veic portfeļa līmenī, izvietotā sākotnējā drošības rezerve attiecas uz visu portfeli; ja nodrošināšanu veic atsevišķiem darījumiem, izvietotā sākotnējā drošības rezerve attiecas uz šādu atsevišķu darījumu.</p> <p>Šis lauks attiecas uz sākotnējās drošības rezerves kopējo pašreizējo vērtību, nevis uz tās ikdienas izmaiņām.</p> <p>Datu elements attiecas gan uz darījumiem, kuriem tīrvērtē nav veikta, gan darījumiem, kuru tīrvērtē tiek veikta centralizēti. Attiecībā uz darījumiem, kuru tīrvērtē tiek veikta centralizēti, datu elements neietver nedz iemaksas fondā saistību neizpildes gadījumiem, nedz nodrošinājumu, kas CCP iesniegts pret likviditātes nodrošinājumu, t. i., piešķirtās kredītlīnijas.</p> <p>Ja izvietotā sākotnējā drošības rezerve ir denominēta vairāk nekā vienā valūtā, šīs summas konvertē vienā valūtā, ko izvēlējies 1. darījuma partneris un uzrāda kā vienu kopējo vērtību.</p>
13.	Nodrošinājums	1. darījumu partnera izvietotā sākotnējā drošības rezerve (pēc diskonta)	<p>1. darījuma partnera izvietotās sākotnējās drošības rezerves vērtība naudas izteiksmē, t. sk. jebkura drošības rezerve, kas atrodas tranzītā un vēl nav nokārtota.</p> <p>Ja nodrošināšanu veic portfeļa līmenī, izvietotā sākotnējā drošības rezerve attiecas uz visu portfeli; ja nodrošināšanu veic atsevišķiem darījumiem, izvietotā sākotnējā drošības rezerve attiecas uz šādu atsevišķu darījumu.</p> <p>Šis lauks attiecas uz sākotnējās drošības rezerves kopējo pašreizējo vērtību pēc diskonta piemērošanas (ja attiecināms), nevis uz tās ikdienas izmaiņām.</p> <p>Datu elements attiecas gan uz darījumiem, kuriem tīrvērtē nav veikta, gan darījumiem, kuru tīrvērtē tiek veikta centralizēti. Attiecībā uz darījumiem, kuru tīrvērtē tiek veikta centralizēti, datu elements neietver nedz iemaksas fondā saistību neizpildes gadījumiem, nedz nodrošinājumu, kas CCP iesniegts pret likviditātes nodrošinājumu, t. i., piešķirtās kredītlīnijas.</p> <p>Ja izvietotā sākotnējā drošības rezerve ir denominēta vairāk nekā vienā valūtā, šīs summas konvertē vienā valūtā, ko izvēlējies 1. darījuma partneris un uzrāda kā vienu kopējo vērtību.</p>
14.	Nodrošinājums	Izvietotās sākotnējās drošības rezerves valūta	<p>Valūta, kurā ir denominēta izvietotā sākotnējā drošības rezerve.</p> <p>Ja izvietotā sākotnējā drošības rezerve ir denominēta vairāk nekā vienā valūtā, šis datu elements atspoguļo vienu no tām valūtām, kurā 1. darījuma partneris ir izvēlējies konvertēt visas izvietoto sākotnējo drošības rezervju vērtības.</p>
15.	Nodrošinājums	1. darījumu partnera izvietotā mainīgā drošības rezerve (pirms diskonta)	<p>1. darījuma partnera izvietotās mainīgās drošības rezerves monetārā vērtība, t. sk. drošības rezerve, par kuru norēķinās skaidrā naudā, un jebkura drošības rezerve, kas ir procesā un vēl nav nokārtota.</p>

Postenis	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
			<p>Iespējamā mainīgā drošības rezerve nav iekļauta.</p> <p>Ja nodrošināšanu veic portfeļa līmenī, izvietotā mainīgā drošības rezerve attiecas uz visu portfeli; ja nodrošināšanu veic atsevišķiem darījumiem, izvietotā mainīgā drošības rezerve attiecas uz šādu atsevišķu darījumu.</p> <p>Šis lauks attiecas uz mainīgās drošības rezerves kopējo pašreizējo vērtību, kas uzkrāta kopš pirmā paziņojuma par attiecībā uz portfeli vai darījumu izvietotajām mainīgajām drošības rezervēm.</p> <p>Ja izvietotā mainīgā drošības rezerve ir denominēta vairāk nekā vienā valūtā, šīs summas konvertē vienā valūtā, ko izvēlēties 1. darījuma partneris un uzrāda kā vienu kopējo vērtību.</p>
16.	Nodrošinājums	1. darījumu partnera izvietotā mainīgā drošības rezerve (pēc diskonta)	<p>1. darījuma partnera izvietotās mainīgās drošības rezerves monetārā vērtība, t. sk. drošības rezerve, par kuru norēķinās skaidrā naudā, un jebkura drošības rezerve, kas ir tranzītā un vēl nav nokārtota.</p> <p>Iespējamā mainīgā drošības rezerve nav iekļauta.</p> <p>Ja nodrošināšanu veic portfeļa līmenī, izvietotā mainīgā drošības rezerve attiecas uz visu portfeli; ja nodrošināšanu veic atsevišķiem darījumiem, izvietotā mainīgā drošības rezerve attiecas uz šādu atsevišķu darījumu.</p> <p>Šis lauks attiecas uz mainīgās drošības rezerves kopējo pašreizējo vērtību pēc diskonta piemērošanas (ja attiecināms), kas uzkrāta kopš pirmā paziņojuma par attiecībā uz portfeli vai darījumu izvietotajām mainīgajām drošības rezervēm.</p> <p>Ja izvietotā mainīgā drošības rezerve ir denominēta vairāk nekā vienā valūtā, šīs summas konvertē vienā valūtā, ko izvēlēties 1. darījuma partneris un uzrāda kā vienu kopējo vērtību.</p>
17.	Nodrošinājums	Izvietotās mainīgās drošības rezerves valūta	<p>Valūta, kurā ir denominēta izvietotā mainīgā drošības rezerve.</p> <p>Ja izvietotā mainīgā drošības rezerve ir denominēta vairāk nekā vienā valūtā, šis datu elements atspoguļo vienu no tām valūtām, kurā 1. darījuma partneris ir izvēlēties konvertēt visas izvietoto mainīgo drošības rezervju vērtības.</p>
18.	Nodrošinājums	1. darījumu partnera izvietotais papildu nodrošinājums	<p>1. darījuma partnera izvietotā papildu nodrošinājuma vērtība naudas izteiksmē atsevišķi un neatkarīgi no sākotnējās un mainīgās drošības rezerves. Šis lauks attiecas uz papildu nodrošinājuma kopējo pašreizējo vērtību pirms diskonta piemērošanas (ja attiecināms), nevis uz tās ikdienas izmaiņām.</p> <p>Jebkuru izvietotās sākotnējās vai mainīgās drošības rezerves summu, kas pārsniedz pieprasīto sākotnējo drošības rezervi vai pieprasīto mainīgo drošības rezervi, uzrāda kā daļu no attiecīgi izvietotās sākotnējās drošības rezerves vai mainīgās drošības rezerves, nevis iekļauj kā izvietoto papildu nodrošinājumu.</p> <p>Darījumiem, kuru tīrvērtē tiek veikta centralizēti, papildu nodrošinājumu uzrāda tikai tādā apmērā, kādā to var iedalīt konkrētam portfelim vai darījumam.</p>

Postenis	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
19.	Nodrošinājums	Izvietotā papildu nodrošinājuma valūta	Valūta, kurā ir denominēts izvietotais papildu nodrošinājums. Ja izvietotais papildu nodrošinājums ir denominēts vairāk nekā vienā valūtā, šis datu elements atspoguļo vienu no tām valūtām, kurā 1. darījuma partneris ir izvēlējis konvertēt visas izvietotā papildu nodrošinājuma vērtības.
20.	Nodrošinājums	1. darījumu partnera saņemtā sākotnējā drošības rezerve (pirms diskonta)	1. darījuma partnera saņemtās sākotnējās drošības rezerves vērtība naudas izteiksmē, t. sk. jebkura drošības rezerve, kas atrodas tranzītā un vēl nav nokārtota. Ja nodrošināšanu veic portfeļa līmenī, saņemtā sākotnējā drošības rezerve attiecas uz visu portfeli; ja nodrošināšanu veic atsevišķiem darījumiem, saņemtā sākotnējā drošības rezerve attiecas uz šādu atsevišķu darījumu. Šis lauks attiecas uz sākotnējās drošības rezerves kopējo pašreizējo vērtību, nevis uz tās ikdienas izmaiņām. Datu elements attiecas gan uz darījumiem, kuriem tīrvērtē nav veikta, gan darījumiem, kuru tīrvērtē tiek veikta centralizēti. Attiecībā uz darījumiem, kuru tīrvērtē tiek veikta centralizēti, datu elements neietver nodrošinājumu, ko CCP saņēmis tā ieguldījumu darbības ietvaros. Ja saņemtā sākotnējā drošības rezerve ir denominēta vairāk nekā vienā valūtā, šis summas konvertē vienā valūtā, ko izvēlējis 1. darījuma partneris un uzrāda kā vienu kopējo vērtību.
21.	Nodrošinājums	1. darījumu partnera saņemtā sākotnējā drošības rezerve (pēc diskonta)	1. darījuma partnera saņemtās sākotnējās drošības rezerves vērtība naudas izteiksmē, t. sk. jebkura drošības rezerve, kas atrodas tranzītā un vēl nav nokārtota. Ja nodrošināšanu veic portfeļa līmenī, saņemtā sākotnējā drošības rezerve attiecas uz visu portfeli; ja nodrošināšanu veic atsevišķiem darījumiem, saņemtā sākotnējā drošības rezerve attiecas uz šādu atsevišķu darījumu. Šis lauks attiecas uz sākotnējās drošības rezerves kopējo pašreizējo vērtību pēc diskonta piemērošanas (ja attiecināms), nevis uz tās ikdienas izmaiņām. Datu elements attiecas gan uz darījumiem, kuriem tīrvērtē nav veikta, gan darījumiem, kuru tīrvērtē tiek veikta centralizēti. Attiecībā uz darījumiem, kuru tīrvērtē tiek veikta centralizēti, datu elements neietver nodrošinājumu, ko CCP saņēmis tā ieguldījumu darbības ietvaros. Ja saņemtā sākotnējā drošības rezerve ir denominēta vairāk nekā vienā valūtā, šis summas konvertē vienā valūtā, ko izvēlējis 1. darījuma partneris un uzrāda kā vienu kopējo vērtību.
22.	Nodrošinājums	Saņemtās sākotnējās drošības rezerves valūta	Valūta, kurā ir denominēta saņemtā sākotnējā drošības rezerve. Ja saņemtā sākotnējā drošības rezerve ir denominēta vairāk nekā vienā valūtā, šis datu elements atspoguļo vienu no tām valūtām, kurā 1. darījuma partneris ir izvēlējis konvertēt visas saņemto sākotnējo drošības rezervju vērtības.

Postenis	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
23.	Nodrošinājums	1. darījumu partnera saņemtā mainīgā drošības rezerve (pirms diskonta)	<p>1. darījuma partnera saņemtās mainīgās drošības rezerves monetārā vērtība, t. sk. drošības rezerve, par kuru norēķinās skaidrā naudā, un jebkura drošības rezerve, kas ir tranzītā un vēl nav nokārtota.</p> <p>Iespējamā mainīgā drošības rezerve nav iekļauta.</p> <p>Ja nodrošināšanu veic portfeļa līmenī, saņemtā mainīgā drošības rezerve attiecas uz visu portfeli; ja nodrošināšanu veic atsevišķiem darījumiem, saņemtā mainīgā drošības rezerve attiecas uz šādu atsevišķu darījumu.</p> <p>Šis lauks attiecas uz mainīgās drošības rezerves kopējo pašreizējo vērtību, kas uzkrāta kopš pirmā paziņojuma par attiecībā uz portfeli vai darījumu saņemtajām mainīgajām drošības rezervēm.</p> <p>Ja saņemtā mainīgā drošības rezerve ir denominēta vairāk nekā vienā valūtā, šīs summas konvertē vienā valūtā, ko izvēlēties 1. darījuma partneris un uzrāda kā vienu kopējo vērtību.</p>
24.	Nodrošinājums	1. darījumu partnera saņemtā mainīgā drošības rezerve (pēc diskonta)	<p>1. darījuma partnera saņemtās mainīgās drošības rezerves monetārā vērtība, t. sk. drošības rezerve, par kuru norēķinās skaidrā naudā, un jebkura drošības rezerve, kas ir tranzītā un vēl nav nokārtota.</p> <p>Iespējamā mainīgā drošības rezerve nav iekļauta.</p> <p>Ja nodrošināšanu veic portfeļa līmenī, saņemtā mainīgā drošības rezerve attiecas uz visu portfeli; ja nodrošināšanu veic atsevišķiem darījumiem, saņemtā mainīgā drošības rezerve attiecas uz šādu atsevišķu darījumu.</p> <p>Šis lauks attiecas uz saņemtās mainīgās drošības rezerves kopējo pašreizējo vērtību pēc diskonta piemērošanas (ja attiecināms), kas uzkrāta kopš pirmā paziņojuma par attiecībā uz portfeli/darījumu saņemtajām mainīgajām drošības rezervēm.</p> <p>Ja saņemtā mainīgā drošības rezerve ir denominēta vairāk nekā vienā valūtā, šīs summas konvertē vienā valūtā, ko izvēlēties 1. darījuma partneris un uzrāda kā vienu kopējo vērtību.</p>
25.	Nodrošinājums	Saņemtās mainīgās drošības rezerves valūta	<p>Valūta, kurā ir denominēta saņemtā mainīgā drošības rezerve.</p> <p>Ja saņemtā mainīgā drošības rezerve ir denominēta vairāk nekā vienā valūtā, šis datu elements atspoguļo vienu no tām valūtām, kurā 1. darījuma partneris ir izvēlēties konvertēt visas saņemto mainīgo drošības rezervju vērtības.</p>
26.	Nodrošinājums	1. darījumu partnera saņemtais papildu nodrošinājums	<p>1. darījuma partnera saņemtā papildu nodrošinājuma vērtība naudas izteiksmē atsevišķi un neatkarīgi no sākotnējās un mainīgās drošības rezerves. Šis datu elements attiecas uz papildu nodrošinājuma kopējo pašreizējo vērtību pirms diskonta piemērošanas (ja attiecināms), nevis uz tās ikdienas izmaiņām.</p> <p>Jebkuru saņemtās sākotnējās vai mainīgās drošības rezerves summu, kas pārsniedz pieprasīto sākotnējo drošības rezervi vai pieprasīto mainīgo drošības rezervi, uzrāda kā daļu no attiecīgi saņemtās sākotnējās drošības rezerves vai mainīgās drošības rezerves, nevis iekļauj kā saņemto papildu nodrošinājumu.</p>



Postenis	Iedaļa	Lauks	Paziņojamā informācija
			Darījumiem, kuru tīrvērtē tiek veikta centralizēti, papildu nodrošinājumu uzrāda tikai tādā apmērā, kādā to var iedalīt konkrētam portfelim vai darījumam.
27.	Nodrošinājums	Saņemtā papildu nodrošinājuma valūta	Valūta, kurā ir denominēts saņemtais papildu nodrošinājums. Ja papildu nodrošinājums ir denominēts vairāk nekā vienā valūtā, šis datu elements atspoguļo vienu no tām valūtām, kurā 1. darījuma partneris ir izvēlējis konvertēt visas saņemtā papildu nodrošinājuma vērtības.
28.	Nodrošinājums	Darbības veids	Ziņojums ietver vienu no šādiem darbības veidiem: a) jaunu drošības rezerves atlikumu vai drošības rezervju detalizētības izmaiņas identificē kā “atjaunināta informācija par drošības rezervi”; b) tādu datu lauku korekcija, kas iepriekšējos ziņojumos tika iesniegti nepareizi, apzīmē ar norādi “Koriģēt”.
29.	Nodrošinājums	Notikuma datums	Datums, kurā noticis ar atvasināto instrumentu līgumu saistītais notikums, par kuru jāsniedz ziņojums un kurš norādīts ziņojumā. Nodrošinājuma atjauninājuma gadījumā – datums, par kuru tiek sniegta ziņojumā ietvertā informācija.