

**ROZPORZĄDZENIE WYKONAWCZE KOMISJI (UE) NR 1247/2012****z dnia 19 grudnia 2012 r.****ustanawiające wykonawcze standardy techniczne w odniesieniu do formatu i częstotliwości dokonywania zgłoszeń dotyczących transakcji do repozytoriów transakcji zgodnie z rozporządzeniem Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i repozytoriów transakcji****(Tekst mający znaczenie dla EOG)**

KOMISJA EUROPEJSKA,

uwzględniając Traktat o funkcjonowaniu Unii Europejskiej,

uwzględniając opinię Europejskiego Banku Centralnego <sup>(1)</sup>,uwzględniając rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 z dnia 4 lipca 2012 r. w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i repozytoriów transakcji <sup>(2)</sup>, w szczególności jego art. 9 ust. 6,

a także mając na uwadze, co następuje:

- (1) Aby uniknąć niespójności, przekazywanie repozytoriom transakcji wszelkich informacji zgodnie z art. 9 rozporządzenia (UE) nr 648/2012 powinno następować według tych samych zasad i standardów oraz w jednolitych formatach, niezależnie od repozytorium transakcji, zaangażowanych kontrahentów i rodzaju instrumentów pochodnych. W związku z tym na potrzeby opisu obrotu instrumentami pochodnymi należy korzystać z jednolitego zbioru danych.
- (2) Ponieważ instrumenty pochodne będące przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym zazwyczaj ani nie są jednoznacznie identyfikowalne za pomocą istniejących i szeroko stosowanych na rynkach finansowych kodów (takich jak kod ISIN, International Securities Identification Number), ani też nie dają się opisać z wykorzystaniem kodu ISO służącego do klasyfikacji instrumentów finansowych (CFI), konieczne jest opracowanie nowej, uniwersalnej metody identyfikacji. Jeżeli istnieje niepowtarzalny identyfikator produktu, który jest zgodny z zasadami niepowtarzalności, neutralności, wiarygodności, otwartego standardu, skalowalności oraz dostępności, a także jest dostępny po rozsądnych kosztach, podlega właściwemu systemowi zarządzania i jest przyjęty na potrzeby stosowania w Unii, należy go stosować. Dopóki nie istnieje niepowtarzalny identyfikator produktu spełniający te wymogi, należy stosować klasyfikację przejściową.
- (3) Instrument bazowy powinien być identyfikowany za pomocą niepowtarzalnego identyfikatora, chociaż w chwili obecnej nie istnieje zstandaryzowany dla całego rynku kod umożliwiający identyfikację instrumentów bazowych wchodzących w skład koszyka. Kontrahenci powinni zatem zostać zobowiązani do wskazywania co najmniej, że dany instrument bazowy stanowi koszyk oraz, w miarę możliwości, do stosowania kodów ISIN w odniesieniu do zstandaryzowanych indeksów.
- (4) Celem zapewnienia spójności wszystkie strony kontraktu pochodnego powinny być identyfikowane za pomocą

niewpowtarzalnego kodu. W szczególności celem zapewnienia spójności ze sprawozdaniem Komitetu ds. Systemów Płatności i Rozrachunku (Committee on Payment and Settlement Systems, CPSS) i Międzynarodowej Organizacji Komisji Papierów Wartościowych (International Organisation of Securities Commissions, IOSCO) w sprawie wymogów dotyczących agregowania i zgłaszania danych na temat instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, w którym jako narzędzie agregowania danych opisano identyfikatory podmiotów prawnych, do celów identyfikacji wszystkich kontrahentów finansowych i niefinansowych, maklerów, partnerów centralnych oraz beneficjentów należy stosować, gdy tylko będzie dostępny i przyjęty na potrzeby stosowania w Unii, globalny lub tymczasowy identyfikator podmiotu prawnego, który należy ustalić w ramach systemu zarządzania zgodnego z zaleceniami Rady Stabilności Finansowej w sprawie wymogów dotyczących danych. W przypadku transakcji dokonywanych na zlecenie jako beneficjentów należy wskazać osoby fizyczne lub podmioty prawne, w których imieniu zawarto dany kontrakt.

- (5) Należy uwzględnić podejścia wykorzystywane w państwach trzecich, a także przez same repozytoria transakcji z chwilą rozpoczęcia przez nie działalności. Aby zatem zapewnić kontrahentom rozwiązanie racjonalne pod względem kosztów oraz ograniczyć ryzyko operacyjne repozytoriów transakcji, należy wyznaczyć różne daty rozpoczęcia dokonywania zgłoszeń dla poszczególnych klas instrumentów pochodnych – najwcześniejszą dla najbardziej zstandaryzowanych klas i późniejsze daty dla pozostałych klas. Kontrakty pochodne, które zostały zawarte przed dniem wejścia w życie rozporządzenia (UE) nr 648/2012, w tymże dniu lub po tym dniu i które nie obowiązują już w dniu rozpoczęcia dokonywania zgłoszeń lub po tej dacie, mają drugorzędne znaczenie do celów regulacyjnych. Zgodnie z art. 9 ust. 1 lit. a) rozporządzenia (UE) nr 648/2012 kontrakty te nadal podlegają jednak obowiązkowi zgłoszenia. Aby zapewnić w tych przypadkach wydajny i proporcjonalny system dokonywania zgłoszeń oraz uwzględnić kwestię trudności z odtworzeniem danych dotyczących kontraktów, które już nie obowiązują, w przypadku tych zgłoszeń należy przewidzieć wydłużony termin.
- (6) Podstawę niniejszego rozporządzenia stanowi projekt wykonawczych standardów technicznych przedłożony Komisji przez Europejski Urząd Nadzoru Giełd i Papierów wartościowych (dalej EUNGI PW).
- (7) Zgodnie z art. 15 rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 1095/2010 z dnia 24 listopada 2010 r. w sprawie ustanowienia Europejskiego Urzędu

<sup>(1)</sup> Dotychczas nieopublikowane w Dzienniku Urzędowym

<sup>(2)</sup> Dz.U. L 201 z 27.7.2012.

Nadzoru (Europejskiego Urzędu Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych) <sup>(1)</sup> EUNGiPW przeprowadził otwarte konsultacje społeczne na temat tego projektu wykonawczych standardów technicznych, przeanalizował związane z nimi potencjalne koszty i korzyści oraz zasięgnął opinii Grupy Interesariuszy z Sektora Giełd i Papierów Wartościowych powołanej zgodnie z art. 37 wspomnianego rozporządzenia,

PRZYJMUJE NINIEJSZE ROZPORZĄDZENIE:

#### Artykuł 1

### Format zgłoszeń dotyczących kontraktów pochodnych

Informacje zawarte w zgłoszeniu dokonywanym zgodnie z art. 9 rozporządzenia (UE) nr 648/2012 są przekazywane w formacie określonym w załączniku do niniejszego rozporządzenia.

#### Artykuł 2

### Częstotliwość zgłoszeń dotyczących kontraktów pochodnych

Jeżeli tak stanowi art. 11 ust. 2 rozporządzenia (UE) nr 648/2012, kontrakty zgłaszane do repozytorium transakcji są codziennie poddawane wycenieniu według wartości rynkowej lub w oparciu o model. Wszelkie inne elementy zgłoszenia, określone w załączniku do niniejszego rozporządzenia i w załączniku do aktu delegowanego dotyczącego regulacyjnych standardów technicznych określających minimalny poziom szczegółowości informacji podlegających zgłoszeniu repozytorium transakcji zgodnie z art. 9 ust. 5 rozporządzenia (UE) nr 648/2012, są przekazywane w przypadku wystąpienia danego zdarzenia i z uwzględnieniem przewidzianych w art. 9 rozporządzenia (UE) nr 648/2012 terminów, w szczególności w odniesieniu do zawarcia, zmiany lub rozwiązania kontraktu.

#### Artykuł 3

### Identyfikacja kontrahentów i pozostałych osób prawnych

1. Następujące podmioty prawne są identyfikowane w zgłoszeniu za pomocą identyfikatora podmiotu prawnego:

- a) beneficjent będący osobą prawną;
- b) makler;
- c) partner centralny;
- d) członek rozliczający będący osobą prawną;
- e) kontrahent będący osobą prawną;
- f) podmiot dokonujący zgłoszenia.

2. Jeżeli identyfikator podmiotu prawnego nie jest dostępny, w zgłoszeniu stosuje się tymczasowy identyfikator podmiotu ustalony na poziomie Unii, który jest:

- a) niepowtarzalny;
- b) neutralny;
- c) wiarygodny;
- d) oparty na otwartym standardzie;
- e) skalowalny;
- f) dostępny;
- g) dostępny po rozsądnych kosztach;

h) objęty właściwym systemem zarządzania.

3. Jeżeli nie jest dostępny ani identyfikator podmiotu prawnego, ani tymczasowy identyfikator podmiotu, w zgłoszeniu stosuje się kod identyfikacyjny jednostki zgodnie z ISO 9362, o ile jest dostępny.

#### Artykuł 4

### Identyfikacja instrumentów pochodnych

1. Kontrakt pochodny jest identyfikowany w zgłoszeniu za pomocą niepowtarzalnego identyfikatora produktu, który jest:

- a) niepowtarzalny;
- b) neutralny;
- c) wiarygodny;
- d) oparty na otwartym standardzie;
- e) skalowalny;
- f) dostępny;
- g) dostępny po rozsądnych kosztach;
- h) objęty właściwym systemem zarządzania.

2. Jeżeli nie istnieje niepowtarzalny identyfikator produktu, kontrakt pochodny jest identyfikowany w zgłoszeniu za pomocą kombinacji nadanego mu kodu ISIN zgodnie z ISO 6166 lub kodu Alternative Instrument Identifier z odpowiednim kodem CFI zgodnie z ISO 10962.

3. Jeżeli kombinacja, o której mowa w ust. 2, nie jest dostępna, rodzaj instrumentu pochodnego jest identyfikowany w następujący sposób:

- a) jako klasę instrumentu pochodnego podaje się jedną z następujących kategorii:
  - (i) towarowy instrument pochodny;
  - (ii) kredytowy instrument pochodny;
  - (iii) walutowy instrument pochodny;
  - (iv) instrument pochodny na akcje;
  - (v) instrument pochodny na stopę procentową;
  - (vi) inne;
- b) jako typ instrumentu pochodnego podaje się jedną z następujących kategorii:
  - (i) kontrakty różnic kursowych;
  - (ii) kontrakty terminowe na stopę procentową;
  - (iii) kontrakty terminowe typu forward;
  - (iv) kontrakty terminowe typu future;
  - (v) opcje;
  - (vi) swapy;
  - (vii) inne;
- c) w przypadku instrumentów pochodnych, które nie należą do konkretnej klasy lub konkretnego typu instrumentów pochodnych, zgłoszenie jest dokonywane w oparciu o klasę lub typ instrumentów pochodnych, które kontrahenci uzgodnili jako te, do których należy przyporządkować dany kontrakt.

<sup>(1)</sup> Dz.U. L 331 z 15.12.2010, s. 84.

## Artykuł 5

**Data rozpoczęcia dokonywania zgłoszeń**

1. Kontrakty dotyczące kredytowych instrumentów pochodnych oraz instrumentów pochodnych na stopę procentową są zgłaszane:

- a) jeżeli przed dniem 1 kwietnia 2013 r. dla danej klasy instrumentów pochodnych zostało zarejestrowane repozytorium transakcji zgodnie z art. 55 rozporządzenia (UE) nr 648/2012 – począwszy od dnia 1 lipca 2013 r.;
- b) jeżeli do dnia 1 kwietnia 2013 r. dla danej klasy instrumentów pochodnych nie zostało zarejestrowane żadne repozytorium transakcji – po upływie 90 dni od zarejestrowania repozytorium transakcji dla danej klasy instrumentów pochodnych zgodnie z art. 55 rozporządzenia (UE) nr 648/2012;
- c) jeżeli do dnia 1 lipca 2015 r. dla danej klasy instrumentów pochodnych nie zostało zarejestrowane żadne repozytorium transakcji zgodnie z art. 55 rozporządzenia (UE) nr 648/2012 – począwszy od dnia 1 lipca 2015 r.; Wymóg dokonywania zgłoszeń zaczyna obowiązywać z tym dniem, a kontrakty są zgłaszane EUNGiPW zgodnie z art. 9 ust. 3 tego rozporządzenia do chwili zarejestrowania repozytorium transakcji dla danej klasy instrumentów pochodnych.

2. Kontrakty pochodne inne niż wymienione w ust. 1 są zgłaszane:

- a) jeżeli przed dniem 1 października 2013 r. dla danej klasy instrumentów pochodnych zostało zarejestrowane repozytorium transakcji zgodnie z art. 55 rozporządzenia (UE) nr 648/2012 – począwszy od dnia 1 stycznia 2014 r.;
- b) jeżeli do dnia 1 października 2013 r. dla danej klasy instrumentów pochodnych nie zostało zarejestrowane żadne repozytorium transakcji – po upływie 90 dni od zarejestrowania repozytorium transakcji dla danej klasy instrumentów pochodnych zgodnie z art. 55 rozporządzenia (UE) nr 648/2012;

c) jeżeli do dnia 1 lipca 2015 r. dla danej klasy instrumentów pochodnych nie zostało zarejestrowane żadne repozytorium transakcji zgodnie z art. 55 rozporządzenia (UE) nr 648/2012 – począwszy od dnia 1 lipca 2015 r.; Wymóg dokonywania zgłoszeń zaczyna obowiązywać z tym dniem, a kontrakty są zgłaszane EUNGiPW zgodnie z art. 9 ust. 3 tego rozporządzenia do chwili zarejestrowania repozytorium transakcji dla danej klasy instrumentów pochodnych.

3. Kontrakty pochodne, które obowiązywały w dniu 16 sierpnia 2012 r. i które nadal obowiązują w dniu rozpoczęcia dokonywania zgłoszeń, są zgłaszane do repozytorium transakcji w terminie 90 dni od daty rozpoczęcia dokonywania zgłoszeń dla danej klasy instrumentów pochodnych.

4. Kontrakty pochodne, które:

- a) zostały zawarte przed dniem 16 sierpnia 2012 r. i w dalszym ciągu obowiązują w dniu 16 sierpnia 2012 r. lub
- b) zostały zawarte w dniu 16 sierpnia 2012 r. lub po tym dniu

i które nie obowiązują już w dniu rozpoczęcia dokonywania zgłoszeń lub po tej dacie, są zgłaszane do repozytorium transakcji w terminie 3 lat od daty rozpoczęcia dokonywania zgłoszeń dla danej klasy instrumentów pochodnych.

5. Datę rozpoczęcia dokonywania zgłoszeń przedłuża się o 180 dni do celów zgłaszania informacji, o których mowa w art. 3 aktu delegowanego dotyczącego regulacyjnych standardów technicznych określających minimalny poziom szczegółowości informacji podlegających zgłoszeniu repozytorium transakcji zgodnie z art. 9 ust. 5 rozporządzenia (UE) nr 648/2012.

## Artykuł 6

**Wejście w życie**

Niniejsze rozporządzenie wchodzi w życie dwudziestego dnia po jego opublikowaniu w *Dzienniku Urzędowym Unii Europejskiej*.

Niniejsze rozporządzenie wiąże w całości i jest bezpośrednio stosowane we wszystkich państwach członkowskich.

Sporządzono w Brukseli dnia 19 grudnia 2012 r.

W imieniu Komisji  
José Manuel BARROSO  
Przewodniczący

## ZAŁĄCZNIK

Tabela 1

## Informacje dotyczące kontrahenta

	Pole	Format
	Strony kontraktu	
1	Znacznik czasu zgłoszenia	Zapis daty według ISO 8601 / zapis czasu według UTC.
2	Kod identyfikacyjny kontrahenta	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) (20 znaków alfanumerycznych), tymczasowy identyfikator podmiotu (20 znaków alfanumerycznych), kod identyfikacyjny jednostki (BIC) (11 znaków alfanumerycznych) lub kod klienta (50 znaków alfanumerycznych).
3	Kod identyfikacyjny drugiego kontrahenta	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) (20 znaków alfanumerycznych), tymczasowy identyfikator podmiotu (20 znaków alfanumerycznych), kod identyfikacyjny jednostki (BIC) (11 znaków alfanumerycznych) lub kod klienta (50 znaków alfanumerycznych).
4	Nazwa kontrahenta	100 znaków alfanumerycznych lub niewypełnione w przypadku, gdy podano identyfikator podmiotu prawnego (LEI).
5	Siedziba kontrahenta	500 znaków alfanumerycznych lub niewypełnione w przypadku, gdy podano identyfikator podmiotu prawnego (LEI).
6	Branża, do której należy kontrahent	Klasyfikacja: A = zakład ubezpieczeń, który otrzymał zezwolenie zgodnie z dyrektywą 2002/83/WE; C = instytucja kredytowa, która otrzymała zezwolenie zgodnie z dyrektywą 2006/48/WE; F = firma inwestycyjna, która otrzymała zezwolenie zgodnie z dyrektywą 2004/39/WE; I = zakład ubezpieczeń, który otrzymał zezwolenie zgodnie z dyrektywą 73/239/EWG; L = alternatywny fundusz inwestycyjny zarządzany przez ZAFI, który otrzymał zezwolenie lub został zarejestrowany zgodnie z dyrektywą 2011/61/UE; O = instytucja pracowniczych programów emerytalnych w rozumieniu art. 6 pkt a) dyrektywy 2003/41/WE; R = zakład reasekuracji, który otrzymał zezwolenie zgodnie z dyrektywą 2005/68/WE; U = UCITS i jego spółka zarządzająca, które otrzymały zezwolenie zgodnie z dyrektywą 2009/65/WE; lub niewypełnione w przypadku, gdy podano identyfikator podmiotu prawnego (LEI) lub w przypadku kontrahentów niefinansowych.
7	Kontrahent finansowy/niefinansowy	F = kontrahent finansowy, N = kontrahent niefinansowy.
8	Kod identyfikacyjny maklera	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) (20 znaków alfanumerycznych), tymczasowy identyfikator podmiotu (20 znaków alfanumerycznych), kod identyfikacyjny jednostki (BIC) (11 znaków alfanumerycznych) lub kod klienta (50 znaków alfanumerycznych).

	Pole	Format
	Strony kontraktu	
9	Kod identyfikacyjny podmiotu dokonującego zgłoszenia	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) (20 znaków alfanumerycznych), tymczasowy identyfikator podmiotu (20 znaków alfanumerycznych), kod identyfikacyjny jednostki (BIC) (11 znaków alfanumerycznych) lub kod klienta (50 znaków alfanumerycznych).
10	Kod identyfikacyjny członka rozliczającego	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) (20 znaków alfanumerycznych), tymczasowy identyfikator podmiotu (20 znaków alfanumerycznych), kod identyfikacyjny jednostki (BIC) (11 znaków alfanumerycznych) lub kod klienta (50 znaków alfanumerycznych).
11	Kod identyfikacyjny beneficjenta	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) (20 znaków alfanumerycznych), tymczasowy identyfikator podmiotu (20 znaków alfanumerycznych), kod identyfikacyjny jednostki (BIC) (11 znaków alfanumerycznych) lub kod klienta (50 znaków alfanumerycznych).
12	Charakter, w jakim zawarto transakcję	P = na własny rachunek, A = na rachunek klienta.
13	Strona kontraktu, po której znajduje się kontrahent	B = kupujący / S = sprzedający.
14	Kontrakt z kontrahentem spoza EOG	Y = Tak / N = Nie.
15	Bezpośredni związek z działalnością gospodarczą lub działalnością w zakresie zarządzania aktywami i pasywami	Y = Tak / N = Nie.
16	Próg wiążący się z obowiązkiem rozliczania	Y = przekroczony, N = nieprzekroczony.
17	Wycena kontraktu według wartości rynkowej	Maksymalnie 20 znaków numerycznych w formacie xxxx,yyyyy.
18	Waluta wyceny kontraktu według wartości rynkowej	Kod waluty według ISO 4217, trzy znaki alfabetyczne.
19	Data wyceny	Zapis daty według ISO 8601.
20	Godzina wyceny	Zapis godziny według UTC.
21	Rodzaj wyceny	M = według wartości rynkowej / O = w oparciu o model.
22	Zabezpieczenie	U = niezabezpieczony, PC = częściowo zabezpieczony, OC = jednostronnie zabezpieczony lub FC = w pełni zabezpieczony.
23	Zabezpieczenie na poziomie portfela	Y = Tak / N = Nie.
24	Kod portfela, dla którego złożono zabezpieczenie	Maksymalnie 10 znaków numerycznych.
25	Wartość zabezpieczenia	Wskazanie całkowitej wartości złożonego zabezpieczenia; maksymalnie 20 znaków numerycznych w formacie xxxx,yyyyy.

	Pole	Format
	Strony kontraktu	
26	Waluta wartości zabezpieczenia	Wskazanie waluty dla wartości podanej w polu 25; Kod waluty według ISO 4217, trzy znaki alfabetyczne.

Tabela 2

**Informacje dotyczące kontraktu**

	Pole	Format	Rodzaje kontraktów pochodnych, których to dotyczy
	Sekcja 2a – rodzaj kontraktu		Wszystkie kontrakty
1	Stosowana klasyfikacja	Wskazanie stosowanej klasyfikacji: U = identyfikator produkt [zatwierdzony w Europie] I = ISIN/AII + CFI E = klasyfikacja przejściowa	
2	Kod identyfikacyjny produktu nr 1	Jeżeli klasyfikacja = U: Identyfikator produktu (UPI), do określenia Jeżeli klasyfikacja = I: ISIN lub AII, kod alfanumeryczny złożony z 12 znaków Jeżeli klasyfikacja = E: Klasa instrumentów pochodnych: CO = towarowy instrument pochodny CR = kredytowy instrument pochodny CU = walutowy instrument pochodny EQ = instrument pochodny na akcje IR = instrument pochodny na stopę procentową OT = inne	
3	Kod identyfikacyjny produktu nr 2	Jeżeli klasyfikacja = U: niewypełnione Jeżeli klasyfikacja = I: CFI, kod złożony z 6 znaków alfabetycznych Jeżeli klasyfikacja = E: Typ instrumentu pochodnego: CD = kontrakty różnic kursowych FR = kontrakty terminowe na stopę procentową FU = kontrakty terminowe typu future FW = kontrakty terminowe typu forward OP = opcja SW = swap OT = inne	

	Pole	Format	Rodzaje kontraktów pochodnych, których to dotyczy
4	Instrument bazowy	ISIN (12 znaków alfanumerycznych); LEI (20 znaków alfanumerycznych); tymczasowy identyfikator podmiotu (20 znaków alfanumerycznych), UPI (do określenia); B = koszyk; I = indeks.	
5	Waluta nominalna 1	Kod waluty według ISO 4217, trzy znaki alfabetyczne.	
6	Waluta nominalna 2	Kod waluty według ISO 4217, trzy znaki alfabetyczne.	
7	Waluta dostawy	Kod waluty według ISO 4217, trzy znaki alfabetyczne.	
	Sekcja 2b – szczegółowe informacje dotyczące transakcji		Wszystkie kontrakty
8	Kod identyfikacyjny transakcji	Maksymalnie 52 znaki alfanumeryczne.	
9	Numer referencyjny transakcji	Maksymalnie 40 znaków alfanumerycznych.	
10	Miejsce realizacji transakcji	Kod identyfikacyjny platformy obrotu (MIC, Market Identifier Code) według ISO 10383, cztery znaki alfabetyczne. Tam, gdzie to stosowne, XOFF w przypadku instrumentów pochodnych notowanych na rynku regulowanym, które są przedmiotem obrotu pozagiełdowego, lub XXXX w przypadku instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym.	
11	Kompresja	Y = jeżeli kontrakt jest wynikiem kompresji; N = jeżeli kontrakt nie jest wynikiem kompresji;	
12	Cena/stawka	Maksymalnie 20 znaków numerycznych w formacie xxxx,yyyyy.	
13	Oznaczenie ceny	Np. kod waluty według ISO 4217, trzy znaki alfabetyczne, procent.	
14	Kwota nominalna	Maksymalnie 20 znaków numerycznych w formacie xxxx,yyyyy.	
15	Mnożnik ceny	Maksymalnie 10 znaków numerycznych.	
16	Ilość	Maksymalnie 10 znaków numerycznych.	
17	Płatność z góry	Maksymalnie 10 znaków numerycznych w formacie xxxx,yyyyy w przypadku płatności dokonywanych przez kontrahenta dokonującego zgłoszenia oraz w formacie xxxx,yyyyy w przypadku płatności dokonywanych na rzecz kontrahenta dokonującego zgłoszenia.	
18	Typ dostawy	C = gotówka, P = fizyczna, O = możliwość wyboru przez kontrahenta.	
19	Znacznik czasu realizacji transakcji	Zapis daty według ISO 8601 / zapis godziny według UTC.	
20	Data wejścia w życie	Zapis daty według ISO 8601.	
21	Termin zapadalności	Zapis daty według ISO 8601.	

	Pole	Format	Rodzaje kontraktów pochodnych, których to dotyczy
22	Data rozwiązania	Zapis daty według ISO 8601.	
23	Data rozrachunku	Zapis daty według ISO 8601.	
24	Rodzaj umowy ramowej	Pole tekstowe o maksymalnie 50 znakach, wskazanie nazwy umowy ramowej, jeżeli z takowej korzystano.	
25	Wersja umowy ramowej	Rok w formacie xxxx.	
	Sekcja 2c – ograniczanie ryzyka / zgłaszanie ryzyka		Wszystkie kontrakty
26	Znacznik czasu potwierdzenia	Zapis daty według ISO 8601 / zapis godziny według UTC.	
27	Sposób dokonania potwierdzenia	Y = potwierdzony w inny sposób niż elektronicznie, N = niepotwierdzony, E = potwierdzony elektronicznie.	
	Sekcja 2d - Rozliczanie		Wszystkie kontrakty
28	Obowiązek rozliczania	Y = Tak / N = Nie.	
29	Rozliczono	Y = Tak / N = Nie.	
30	Znacznik czasu rozliczenia	Zapis daty według ISO 8601 / zapis godziny według UTC.	
31	Kod identyfikacyjny CCP	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) (20 znaków alfanumerycznych) lub – jeżeli nie jest dostępny – tymczasowy identyfikator podmiotu (20 znaków alfanumerycznych) lub – jeżeli oba nie są dostępne – kod identyfikacyjny jednostki (BIC) (11 znaków alfanumerycznych).	
32	Transakcja wewnątrzgrupowa	Y = Tak / N = Nie.	
	Sekcja 2e – stopy procentowe		Instrumenty pochodne na stopę procentową
33	Stała stopa procentowa części („nogi”) 1	Znaki numeryczne w formacie xxxx,yyyyy.	
34	Stała stopa procentowa części („nogi”) 2	Znaki numeryczne w formacie xxxx,yyyyy.	
35	Długość okresu stosowania stałej stopy procentowej	Faktyczna liczba dni/365; 30B/360 lub inny sposób obliczenia.	
36	Częstotliwość płatności – część („noga”) o stałym oprocentowaniu	Będący liczbą całkowitą mnożnik (liczba całkowita) okresu czasu, który wskazuje, jak często kontrahenci wymieniają płatności, np. 10D, 3M, 5Y.	
37	Częstotliwość płatności – część o zmiennym oprocentowaniu	Będący liczbą całkowitą mnożnik (liczba całkowita) okresu czasu, który wskazuje, jak często kontrahenci wymieniają płatności, np. 10D, 3M, 5Y.	
38	Częstotliwość ustalania na nowo zmiennej stopy procentowej	D = Będący liczbą całkowitą mnożnik (liczba całkowita) okresu czasu, który wskazuje, jak często kontrahenci wymieniają płatności, np. 10D, 3M, 5Y.	
39	Zmienna stopa procentowa części („nogi”) 1	Nazwa indeksu, od którego zależy zmienna stopa procentowa, np. 3M Euribor.	



	Pole	Format	Rodzaje kontraktów pochodnych, których to dotyczy
40	Zmienna stopa procentowa części („nogi”) 2	Nazwa indeksu, od którego zależy zmienna stopa procentowa, np. 3M Euribor.	
	Sekcja 2f – transakcje walutowe		Walutowe instrumenty pochodne
41	Waluta 2	Kod waluty według ISO 4217, trzy znaki alfabetyczne.	
42	Kurs walutowy 1	Maksymalnie 10 znaków numerycznych w formacie xxxx,yyyyy.	
43	Terminowy kurs walutowy	Maksymalnie 10 znaków numerycznych w formacie xxxx,yyyyy.	
44	Podstawa kursu walutowego	Np. EUR/USD lub USD/EUR.	
	Sekcja 2g – transakcje towarowe	Jeżeli zgłoszony identyfikator produktu zawiera wszystkie poniższe informacje, nie ma potrzeby dokonywania zgłoszenia, chyba że istnieje obowiązek zgłoszenia zgodnie z rozporządzeniem (UE) nr 1227/2011.	Towarowe instrumenty pochodne
	Ogólnie		
45	Towarowy instrument bazowy	AG = produkt rolny EN = energia FR = towary stanowiące fracht ME = metale IN = indeks EV = ochrona środowiska EX = towary egzotyczne	
46	Szczegółowe informacje dotyczące towaru	<i>Produkty rolne:</i> GO = ziarna zbóż, nasiona roślin oleistych DA = produkty mleczne LI = zwierzęta gospodarskie FO = produkty gospodarki leśnej SO = nietrwałe produkty rolne <i>Energia:</i> OI = ropa naftowa NG = gaz ziemny CO = węgiel EL = energia elektryczna IE = obejmujące różne nośniki energii <i>Metale:</i> PR = metale szlachetne NP = metale nieszlachetne <i>Związane z ochroną środowiska:</i> WE = pogoda EM = emisje	

	Pole	Format	Rodzaje kontraktów pochodnych, których to dotyczy
	Energia		
47	Miejsce lub strefa dostawy	Kod EIC złożony z 16 znaków alfanumerycznych.	
48	Punkt połączenia międzysystemowego	Pole tekstowe o maksymalnie 50 znakach.	
49	Rodzaj obciążenia	Obejmująca pola 50–54 sekcja do ewentualnego powtórzenia służąca określeniu profilu dostawy produktu dla poszczególnych okresów dostawy w ciągu dnia. BL = obciążenie podstawowe PL = obciążenie szczytowe OP = obciążenie pozaszczytowe BH = bloki godzinowe OT = inne	
50	Data i godzina rozpoczęcia dostawy	Zapis daty według ISO 8601 / zapis godziny według UTC.	
51	Data i godzina zakończenia dostawy	Zapis daty według ISO 8601 / zapis godziny według UTC.	
52	Zakontraktowana ilość	Pole tekstowe o maksymalnie 50 znakach.	
53	Ilość jednostek	10 znaków numerycznych w formacie xxxx,yyyyy.	
54	Cena za ilość w okresie dostawy	10 znaków numerycznych w formacie xxxx,yyyyy.	
	Sekcja 2h - opcje		Kontrakty obejmujące opcje
55	Rodzaj opcji	P = opcja kupna, C = opcja sprzedaży.	
56	Rodzaj opcji (sposób wykonania)	A = amerykańska, B = bermudzka, E = europejska, S = azjatycka.	
57	Cena wykonania (górnny/dolny pułap)	Maksymalnie 10 znaków numerycznych w formacie xxxx,yyyyy.	
	Sekcja 2i – zmiany dokonywane w zgłoszeniu		Wszystkie kontrakty
58	Rodzaj zmiany	N = New (nowy kontrakt) M = Modify (zmiana informacji) E = Error (anulowanie błędnego zgłoszenia) C = Cancel (rozwiązanie kontraktu) Z = Compression (kompresja kontraktu) V = Valuation update (aktualizacja wyceny kontraktu) O = Other (inne)	
59	Szczegółowe informacje dotyczące zmiany	Pole tekstowe o maksymalnie 50 znakach.	