

**ROZPORZĄDZENIE WYKONAWCZE KOMISJI (UE) 2019/363****z dnia 13 grudnia 2018 r.****ustanawiające wykonawcze standardy techniczne w odniesieniu do formatu i częstotliwości dokonywania zgłoszeń szczegółowych informacji dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych do repozytoriów transakcji zgodnie z rozporządzeniem Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 oraz zmieniające rozporządzenie wykonawcze Komisji (UE) nr 1247/2012 w odniesieniu do stosowania kodów sprawozdawczych w zgłoszeniach dotyczących instrumentów pochodnych****(Tekst mający znaczenie dla EOG)**

KOMISJA EUROPEJSKA,

uwzględniając rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 z dnia 25 listopada 2015 r. w sprawie przejrzystości transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ponownego wykorzystania oraz zmiany rozporządzenia (UE) nr 648/2012 <sup>(1)</sup>, w szczególności jego art. 4 ust. 10,

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) Szczegółowe informacje przekazywane przez kontrahentów transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych do repozytoriów transakcji lub Europejskiego Urzędu Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych (ESMA) należy przedkładać w zharmonizowanym formacie w celu ułatwienia gromadzenia i agregowania danych oraz ich porównywania między repozytoriami transakcji. Aby zminimalizować koszty dla kontrahentów dokonujących zgłoszeń format sprawozdawczy dla transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych powinien być w miarę możliwości spójny z formatem służącym do dokonywania zgłoszeń dotyczących instrumentów pochodnych, przewidzianym w art. 9 rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012. W związku z tym w niniejszym rozporządzeniu określono format dla każdego pola zawierającego informacje, które należy zgłosić, oraz dokonano standaryzacji zgłoszenia poprzez odniesienie do normy ISO powszechnie stosowanej w branży finansowej.
- (2) Globalny system LEI (identyfikatorów podmiotu prawnego, „kodów LEI”) został już w pełni wdrożony, w związku z czym każdy kontrahent transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych powinien korzystać wyłącznie z tego systemu w celu identyfikacji podmiotu prawnego w zgłoszeniu. Aby korzystanie z systemu kodów LEI przez kontrahenta było skuteczne, powinien on zapewnić, by dane referencyjne dotyczące jego kodu LEI były nowelizowane zgodnie z warunkami określonymi przez akredytowany podmiot nadający kod LEI (lokalną jednostkę operacyjną). Prowadzone są obecnie prace nad rozszerzeniem zakresu globalnego systemu LEI w taki sposób, aby umożliwiał on identyfikację oddziałów podmiotów prawnych. Do czasu zakończenia tych prac oraz uznania takiego rozszerzenia za odpowiednie do celów dokonywania zgłoszeń dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, jak również do czasu stosownej zmiany niniejszego rozporządzenia, należy – jeżeli transakcja finansowana z użyciem papierów wartościowych została zawarta za pośrednictwem oddziału kontrahenta – na potrzeby identyfikacji tego oddziału stosować kod ISO kraju, w którym zlokalizowany jest ten oddział.
- (3) Prowadzone są również prace nad globalnym systemem unikatowego identyfikatora transakcji (UTI, z ang. *unique trade identifier*) mającym na celu identyfikowanie transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych. Do czasu zakończenia prac nad globalnym systemem UTI oraz uznania go za odpowiedni do celów dokonywania zgłoszeń dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, jak również do czasu stosownej zmiany niniejszego rozporządzenia, na potrzeby identyfikacji transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych należy stosować UTI uzgodniony przez kontrahentów.
- (4) W art. 4a rozporządzenia wykonawczego Komisji (UE) nr 1247/2012 <sup>(3)</sup> ustanowiono procedurę służącą określeniu podmiotu odpowiedzialnego za wygenerowanie UTI w przypadku dokonywania zgłoszeń dotyczących instrumentów pochodnych w sytuacjach, w których kontrahenci nie uzgodnili podmiotu odpowiedzialnego za wygenerowanie UTI. Aby zapewnić spójność pomiędzy dokonywaniem zgłoszeń dotyczących instrumentów pochodnych oraz dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych podobną procedurę należy ustanowić w odniesieniu do kontrahentów dokonujących zgłoszeń transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych.

<sup>(1)</sup> Dz.U. L 337 z 23.12.2015, s. 1.

<sup>(2)</sup> Dz.U. L 201 z 27.7.2012, s. 1.

<sup>(3)</sup> 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 (Dz.U. L 352 z 21.12.2012, s. 20).

- (5) Obecnie nie ma ustalonej praktyki rynkowej w zakresie określania strony kontraktu, po której znajduje się kontrahent, w przypadku transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych. Należy w związku z tym ustanowić szczegółowe przepisy, aby zapewnić możliwość dokładnego i spójnego określenia podmiotu przekazującego zabezpieczenie oraz podmiotu przyjmującego zabezpieczenie w ramach transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych.
- (6) W odniesieniu do pojedynczej transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych może zostać dokonanych wiele zgłoszeń, np. w przypadku kolejnych zmian dokonanych w odniesieniu do tej transakcji. Aby zapewnić, by każde zgłoszenie dotyczące transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych oraz każda taka transakcja (jako całość) mogły być należycie zrozumiane, zgłoszeń należy dokonywać w porządku chronologicznym, w jakim nastąpiły zgłaszane zdarzenia.
- (7) Aby zmniejszyć obciążenie związane ze zgłaszaniem zmian niektórych wartości, a w szczególności szczegółowych informacji o wartości zabezpieczenia, wniesionym lub otrzymanym depozycie zabezpieczającym oraz ponownym wykorzystaniu zabezpieczenia, informacje te należy przekazywać według stanu na koniec każdego dnia tylko w przypadku, gdy różnią się one od wcześniej przekazanych informacji.
- (8) Szczegółowe informacje dotyczące pozostającej do spłaty pożyczki związanej z transakcją z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego należy przekazywać według stanu na koniec każdego dnia w przypadku, gdy w walucie bazowej występuje saldo ujemne środków pieniężnych netto lub gdy wartość rynkowa pozycji krótkich kontrahenta jest dodatnia.
- (9) Wartość rynkową papierów wartościowych będących przedmiotem udzielenia lub zaciągnięcia pożyczki należy zgłaszać według stanu na koniec każdego dnia. Podobnie w sytuacji, gdy kontrahenci zgłaszają wartość rynkową zabezpieczenia, powinni tego dokonywać według stanu na koniec każdego dnia.
- (10) Podstawę niniejszego rozporządzenia stanowi projekt wykonawczych standardów technicznych przedłożony Komisji przez ESMA zgodnie z procedurą określoną w art. 15 rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 1095/2010 z dnia 24 listopada 2010 r. w sprawie ustanowienia Europejskiego Urzędu Nadzoru (Europejskiego Urzędu Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych) <sup>(4)</sup>.
- (11) ESMA przeprowadził otwarte konsultacje publiczne na temat tego projektu wykonawczych standardów technicznych, przeanalizował potencjalne związane z nim koszty i korzyści oraz zwrócił się o opinię do Grupy Interesariuszy z Sektora Giełd i Papierów Wartościowych powołanej zgodnie z art. 37 rozporządzenia (UE) nr 1095/2010.
- (12) Podobnie jak w przypadku dokonywania zgłoszeń dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, nadal trwają prace nad pewnymi identyfikatorami i kodami stosowanymi do zgłaszania instrumentów pochodnych. Do czasu gdy te identyfikatory i kody będą dostępne oraz zostaną uznane za odpowiednie do celów dokonywania zgłoszeń, jak również do czasu stosownej zmiany rozporządzenia wykonawczego (UE) nr 1247/2012, w niniejszym rozporządzeniu przewidziano stosowanie kodu CFI według ISO 10692 do celów klasyfikacji instrumentów pochodnych, dla których nie jest dostępny kod ISIN według ISO 6166 ani kod AII, jak również stosowanie unikatowego identyfikatora transakcji uzgodnionego przez kontrahentów w celu identyfikacji zgłoszenia dotyczącego instrumentów pochodnych. Aby zapewnić pewność prawa w odniesieniu do odpowiedniej procedury zmiany wymogów mających zastosowanie do dokonywania zgłoszeń dotyczących instrumentów pochodnych, jak również wymagany stopień spójności między dokonywaniem zgłoszeń dotyczących instrumentów pochodnych oraz dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, rozporządzenie wykonawcze (UE) nr 1247/2012 powinno odnosić się jedynie do wymogów mających obecnie zastosowanie do dokonywania tych zgłoszeń.
- (13) Należy zatem odpowiednio zmienić rozporządzenie wykonawcze (UE) nr 1247/2012,

PRZYJMUJE NINIEJSZE ROZPORZĄDZENIE:

#### Artykuł 1

### **Standardy i formaty danych na potrzeby zgłoszeń dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych**

Szczegółowe informacje dotyczące transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych zawarte w zgłoszeniu, którego należy dokonać zgodnie z art. 4 ust. 1 rozporządzenia (UE) 2015/2365, przekazuje się zgodnie ze standardami i formatami określonymi w tabelach 1–5 w załączniku I. Zgłoszenia dokonuje się w jednolitej formie elektronicznej nadającej się do odczytu maszynowego oraz przy użyciu jednolitego szablonu XML zgodnie z metodyką ISO 20022.

<sup>(4)</sup> Dz.U. L 331 z 15.12.2010, s. 84.

## Artykuł 2

**Identyfikacja kontrahentów i innych podmiotów**

1. W zgłoszeniu, o którym mowa w art. 1, za pomocą identyfikatora podmiotu prawnego („kod LEI”) zgodnego z ISO 17442 identyfikuje się następujące podmioty:

- a) beneficjenta będącego podmiotem prawnym;
- b) brokera;
- c) kontrahenta centralnego (CCP), który otrzymał zezwolenie zgodnie z rozporządzeniem (UE) nr 648/2012;
- d) członka rozliczającego;
- e) pełnomocnika pożyczkodawcy (*agent lender*);
- f) uczestnika centralnego depozytu papierów wartościowych (CDPW);
- g) kontrahenta będącego podmiotem prawnym;
- h) agenta trójstronnego;
- i) podmiot przekazujący zgłoszenie;
- j) emitenta papieru wartościowego, który w ramach transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych był przedmiotem udzielenia lub zaciągnięcia pożyczki lub został przekazany jako zabezpieczenie.

2. Kontrahent transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych zapewnia, by dane referencyjne dotyczące jego kodu LEI zgodnego z ISO 17442 były nowelizowane zgodnie z warunkami określonymi przez dowolną akredytowaną lokalną jednostkę operacyjną globalnego systemu LEI.

3. W przypadku gdy transakcja finansowana z użyciem papierów wartościowych została zawarta za pośrednictwem oddziału kontrahenta, w zgłoszeniu, o którym mowa w art. 1, stosuje się kod określony w polu 7 i polu 8 w tabeli 1 w załączniku I w celu identyfikacji tego kontrahenta.

## Artykuł 3

**Unikatowy identyfikator transakcji**

1. Zgłoszenie identyfikuje się przy użyciu unikatowego identyfikatora transakcji („UTI”) uzgodnionego przez kontrahentów, zgodnie z formatem określonym w polu 1 w tabeli 2 w załączniku I.

2. Jeżeli kontrahenci nie uzgodnią, który podmiot jest odpowiedzialny za wygenerowanie UTI, który należy nadać zgłoszeniu, kontrahenci ustalają podmiot odpowiedzialny za wygenerowanie UTI zgodnie z poniższym:

- a) w przypadku centralnie zrealizowanych i centralnie rozliczonych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych UTI jest generowany dla członka rozliczającego przez CCP w miejscu rozliczenia transakcji. Drugi UTI generuje dla swojego kontrahenta dany członek rozliczający;
- b) w przypadku centralnie zrealizowanych, lecz nierozliczonych centralnie transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych UTI jest generowany przez system obrotu, w którym wykonano transakcję, dla jego członka;
- c) w przypadku centralnie potwierdzonych i centralnie rozliczonych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych UTI jest generowany dla członka rozliczającego przez CCP w miejscu rozliczenia transakcji. Drugi UTI generuje dla swojego kontrahenta dany członek rozliczający;
- d) w przypadku transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych centralnie potwierdzonych za pomocą środków elektronicznych, lecz nierozliczonych centralnie UTI jest generowany przez platformę odpowiedzialną za potwierdzanie warunków transakcji w miejscu potwierdzenia;
- e) w przypadku wszystkich transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych innych niż transakcje, o których mowa w lit. a)–d), stosuje się, co następuje:
  - (i) w przypadku gdy kontrahenci finansowi zawierają transakcję finansowaną z użyciem papierów wartościowych z kontrahentami niefinansowymi, UTI jest generowany przez kontrahentów finansowych;
  - (ii) w przypadku wszystkich transakcji udzielenia lub zaciągnięcia pożyczki papierów wartościowych innych niż transakcje, o których mowa w pkt (i), UTI jest generowany przez podmiot przekazujący zabezpieczenie, o którym to podmiocie mowa w art. 4;

- (iii) w przypadku wszystkich transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych innych niż transakcje, o których mowa w ppkt (i) i (ii), UTI jest generowany przez podmiot przyjmujący zabezpieczenie, o którym to podmiocie mowa w art. 4.
3. Kontrahent generujący UTI podaje ten identyfikator do wiadomości drugiego kontrahenta na tyle szybko, by ten drugi kontrahent mógł wypełnić swój obowiązek sprawozdawczy.

#### Artykuł 4

##### Strona kontraktu, po której znajduje się kontrahent

1. Stronę transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych, po której znajduje się kontrahent, o której mowa w polu 9 w tabeli 1 w załączniku I, określa się zgodnie z ust. 2–4.
2. W przypadku transakcji odkupu, transakcji zwrotnych kupno-sprzedaż i transakcji zwrotnych sprzedaż-kupno kontrahenta, który dokonuje zakupu papierów wartościowych, towarów lub gwarantowanych praw do papierów wartościowych lub towarów na etapie otwarcia lub etapie kasowym transakcji i który uzgadnia ich sprzedaż po ustalonej cenie w przyszłym terminie na etapie zakończenia lub etapie terminowym transakcji, wskazuje się w polu 9 w tabeli 1 w załączniku I jako podmiot przyjmujący zabezpieczenie. Kontrahenta, który dokonuje sprzedaży tych papierów wartościowych, towarów lub gwarantowanych praw, wskazuje się w polu 9 w tabeli 1 w załączniku I jako podmiot przekazujący zabezpieczenie.
3. W przypadku transakcji zaciągnięcia pożyczki papierów wartościowych lub towarów oraz transakcji udzielenia pożyczki papierów wartościowych lub towarów kontrahenta, który przekazuje papiery wartościowe lub towary pod warunkiem że pożyczkobiorca zwróci równoważne papiery wartościowe lub towary w przyszłym terminie lub na żądanie strony przekazującej, wskazuje się w polu 9 w tabeli 1 w załączniku I jako podmiot przyjmujący zabezpieczenie. Kontrahenta, któremu przekazywane są te papiery wartościowe lub towary, wskazuje się w polu 9 w tabeli 1 w załączniku I jako podmiot przekazujący zabezpieczenie.
4. W przypadku transakcji z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego pożyczkobiorcą, to jest kontrahenta, któremu udziela się pożyczki w zamian za zabezpieczenie, wskazuje się w polu 9 w tabeli 1 w załączniku I jako podmiot przekazujący zabezpieczenie. Pożyczkodawcą, to jest kontrahenta, który udziela pożyczki w zamian za zabezpieczenie, wskazuje się w polu 9 w tabeli 1 w załączniku I jako podmiot przyjmujący zabezpieczenie.

#### Artykuł 5

##### Częstotliwość zgłoszeń dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych

1. Wszystkie zgłoszenia zawierające szczegółowe informacje dotyczące transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych, o których to zgłoszeniach mowa w art. 1 ust. 2 rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/356 <sup>(5)</sup>, przekazuje się w porządku chronologicznym, w jakim nastąpiły zgłaszane zdarzenia.
2. Kontrahent transakcji z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego przekazuje szczegółowe informacje dotyczące pozostającej do spłaty pożyczki związanej z transakcją z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego według stanu na koniec każdego dnia w przypadku, gdy w walucie bazowej występuje ujemne saldo środków pieniężnych netto lub gdy wartość rynkowa pozycji krótkich kontrahenta jest dodatnia.
3. Kontrahent nierozliczonej transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych zgłasza każdą zmianę szczegółowych informacji dotyczących zabezpieczenia podawanych w polach 75–94 w tabeli 2 w załączniku I przy użyciu rodzaju czynności „Collateral update” (aktualizacja zabezpieczenia). Kontrahent zgłasza te zmienione szczegółowe informacje według stanu na koniec każdego dnia do czasu zgłoszenia przez niego zakończenia transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych lub zgłoszenia przez niego transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych przy użyciu rodzaju czynności „Error” (błąd) lub do upływu terminu zapadalności transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych, w zależności od tego, co nastąpi wcześniej.
4. Kontrahent nierozliczonej transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych zgłasza każdą zmianę wartości rynkowej na koniec dnia papierów wartościowych będących przedmiotem udzielenia lub zaciągnięcia pożyczki w polu 57 w tabeli 2 w załączniku I przy użyciu rodzaju czynności „Valuation update” (aktualizacja wyceny). Kontrahent zgłasza tę zmienioną wartość rynkową według stanu na koniec każdego dnia do czasu zgłoszenia przez niego zakończenia transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych lub zgłoszenia przez niego transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych przy użyciu rodzaju czynności „Error” (błąd) lub do upływu terminu zapadalności transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych.

<sup>(5)</sup> Rozporządzenie delegowane Komisji (UE) 2019/356 z dnia 13 grudnia 2018 r. uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych określających szczegółowe informacje dotyczące transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, które należy zgłaszać repozytoriom transakcji (zob. s. 1 niniejszego Dziennika Urzędowego).

5. Kontrahent zgłasza każdą zmianę łącznej kwoty wniesionego lub otrzymanego depozytu zabezpieczającego dla wszystkich rozliczonych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych według stanu na koniec dnia w polach 8–19 w tabeli 3 w załączniku I przy użyciu rodzaju czynności „Margin update” (aktualizacja depozytu zabezpieczającego), po tym jak dokonał pierwszego zgłoszenia łącznej kwoty wniesionego lub otrzymanego depozytu zabezpieczającego przy użyciu rodzaju czynności „New” (nowe).

6. Kontrahent zgłasza każdą zmianę wartości ponownie wykorzystanego zabezpieczenia, reinwestowanych środków pieniężnych oraz źródeł finansowania przy użyciu rodzaju czynności „Reuse update” (aktualizacja ponownego wykorzystania) według stanu na koniec dnia w polach 8–14 w tabeli 4 w załączniku I, po tym jak dokonał zgłoszenia odpowiednich wartości przy użyciu rodzaju czynności „New” (nowe).

#### Artykuł 6

### Zmiany w rozporządzeniu wykonawczym (UE) nr 1247/2012

W rozporządzeniu wykonawczym (UE) nr 1247/2012 wprowadza się następujące zmiany:

1) w art. 4 wprowadza się następujące zmiany:

a) ust. 7 otrzymuje brzmienie:

„Instrument pochodny klasyfikuje się w polu 4 w tabeli 2 w załączniku przy użyciu kodu służącego do klasyfikacji instrumentów finansowych (CFI) według ISO 10692.”;

b) skreśla się ust. 8 i 9;

2) art. 4a ust. 1 otrzymuje brzmienie:

„1. Zgłoszenie transakcji identyfikuje się przy użyciu unikatowego identyfikatora transakcji uzgodnionego przez kontrahentów.”;

3) załącznik zastępuje się tekstem znajdującym się w załączniku II do niniejszego rozporządzenia.

#### Artykuł 7

### 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 13 grudnia 2018 r.

W imieniu Komisji  
Jean-Claude JUNCKER  
Przewodniczący

## ZAŁĄCZNIK I

**Formaty, które należy stosować na potrzeby zgłoszeń szczegółowych informacji dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, o których to zgłoszeniach mowa w art. 4 ust. 1 i 5 rozporządzenia (UE) 2015/2365**

Tabela 1

**Informacje dotyczące kontrahenta**

Nr	Pole	Format
1	Znacznik czasu zgłoszenia	Data i czas zgodnie z ISO 8601 według formatu uniwersalnego czasu koordynowanego (UTC), tj. RRRR-MM-DDThh:mm:ssZ
2	Podmiot przekazujący zgłoszenie	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodny z ISO 17442, kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych.
3	Kontrahent dokonujący zgłoszenia	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodny z ISO 17442, kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych.
4	Charakter kontrahenta dokonującego zgłoszenia	„F” = kontrahent finansowy „N” = kontrahent niefinansowy
5	Sektor przedsiębiorstw, w którym działa kontrahent dokonujący zgłoszenia	<p>Taksonomia dla kontrahentów finansowych:</p> <p>„CDTI” – instytucja kredytowa, która otrzymała zezwolenie zgodnie z dyrektywą Parlamentu Europejskiego i Rady 2013/36/UE <sup>(1)</sup> lub rozporządzeniem Rady (UE) nr 1024/2013 <sup>(2)</sup>, lub podmiot z państwa trzeciego, który potrzebowałby zezwolenia lub rejestracji zgodnie z tym aktem ustawodawczym</p> <p>„INVF” – firma inwestycyjna, która otrzymała zezwolenie zgodnie z dyrektywą Parlamentu Europejskiego i Rady 2014/65/UE <sup>(3)</sup>, lub podmiot z państwa trzeciego, który potrzebowałby zezwolenia lub rejestracji zgodnie z tym aktem ustawodawczym</p> <p>„INUN” – zakład ubezpieczeń, który otrzymał zezwolenie zgodnie z dyrektywą Parlamentu Europejskiego i Rady 2009/138/WE <sup>(4)</sup> (Wypłacalność II), lub podmiot z państwa trzeciego, który potrzebowałby zezwolenia lub rejestracji zgodnie z tym aktem ustawodawczym</p> <p>„AIFD” – AFI zarządzany przez ZAFI, który otrzymał zezwolenie lub został zarejestrowany zgodnie z dyrektywą Parlamentu Europejskiego i Rady 2011/61/UE <sup>(5)</sup>, lub podmiot z państwa trzeciego, który potrzebowałby zezwolenia lub rejestracji zgodnie z tym aktem ustawodawczym</p> <p>„ORPI” – instytucja pracowniczych programów emerytalnych, która otrzymała zezwolenie lub została zarejestrowana zgodnie z dyrektywą 2003/41/WE Parlamentu Europejskiego i Rady <sup>(6)</sup>, lub podmiot z państwa trzeciego, który potrzebowałby zezwolenia lub rejestracji zgodnie z tym aktem ustawodawczym</p> <p>„CCPS” – kontrahent centralny, który otrzymał zezwolenie zgodnie z rozporządzeniem Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 <sup>(7)</sup>, lub podmiot z państwa trzeciego, który potrzebowałby zezwolenia lub rejestracji zgodnie z tym aktem ustawodawczym</p> <p>„REIN” – zakład reasekuracji, który otrzymał zezwolenie zgodnie z dyrektywą Wypłacalność II, lub podmiot z państwa trzeciego, który potrzebowałby zezwolenia lub rejestracji zgodnie z tym aktem ustawodawczym</p> <p>„CSDS” – centralny depozyt papierów wartościowych, który otrzymał zezwolenie zgodnie z rozporządzeniem Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 909/2014 <sup>(8)</sup>, lub podmiot z państwa trzeciego, który potrzebowałby zezwolenia lub rejestracji zgodnie z tym aktem ustawodawczym</p> <p>„UCIT” – przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania w zbywalne papiery wartościowe (UCITS) oraz jego spółka zarządzająca, które otrzymały zezwolenie zgodnie z dyrektywą Parlamentu Europejskiego i Rady 2009/65/WE <sup>(9)</sup>, lub podmiot z państwa trzeciego, który potrzebowałby zezwolenia lub rejestracji zgodnie z tym aktem ustawodawczym</p>

Nr	Pole	Format
		<p>Taksonomia dla kontrahentów niefinansowych: Poniższe kategorie odpowiadają głównym sekcjom statystycznej klasyfikacji działalności gospodarczej we Wspólnocie Europejskiej (NACE), jak określono w rozporządzeniu (WE) nr 1893/2006 Parlamentu Europejskiego i Rady <sup>(10)</sup></p> <p>„A” – Rolnictwo, leśnictwo i rybactwo  „B” – Górnictwo i wydobywanie  „C” – Przetwórstwo przemysłowe  „D” – Wytwarzanie i zaopatrywanie w energię elektryczną, gaz, parę wodną i powietrze do układów klimatyzacyjnych  „E” – Dostawa wody, gospodarowanie ściekami i odpadami oraz działalność związana z rekultywacją  „F” – Budownictwo  „G” – Handel hurtowy i detaliczny, naprawa pojazdów samochodowych i motocykli  „H” – Transport i gospodarka magazynowa  „I” – Działalność związana z zakwaterowaniem i usługami gastronomicznymi  „J” – Informacja i komunikacja  „K” – Działalność finansowa i ubezpieczeniowa  „L” – Działalność związana z obsługą rynku nieruchomości  „M” – Działalność profesjonalna, naukowa i techniczna  „N” – Działalność w zakresie usług administrowania i działalność wspierająca  „O” – Administracja publiczna i obrona narodowa; obowiązkowe ubezpieczenia społeczne  „P” – Edukacja  „Q” – Opieka zdrowotna i pomoc społeczna  „R” – Działalność związana z kulturą, rozrywką i rekreacją  „S” – Pozostała działalność usługowa  „T” – Gospodarstwa domowe zatrudniające pracowników; gospodarstwa domowe produkujące wyroby i świadczące usługi na własne potrzeby  „U” – Organizacje i zespoły eksterytorialne</p>
6	Dodatkowa klasyfikacja sektorowa	<p>„ETFT” – ETF (fundusz inwestycyjny typu ETF)  „MMFT” – MMF (fundusz rynku pieniężnego)  „REIT” – REIT (fundusz inwestycyjny inwestujący w nieruchomości)  „OTHR” – inne</p>
7	Oddział kontrahenta dokonującego zgłoszenia	ISO 3166-1 alfa-2 – kod kraju składający się z dwóch znaków alfabetycznych.
8	Oddział drugiego kontrahenta	ISO 3166-1 alfa-2 – kod kraju składający się z dwóch znaków alfabetycznych.
9	Strona kontraktu, po której znajduje się kontrahent	<p>„TAKE” – Przyjmujący zabezpieczenie  „GIVE” – Przekazujący zabezpieczenie</p>
10	Podmiot odpowiedzialny za zgłoszenie	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodny z ISO 17442, kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych.
11	Drugi kontrahent	<p>Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodny z ISO 17442, kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych.  Kod klienta (maksymalnie 50 znaków alfanumerycznych).</p>
12	Kraj drugiego kontrahenta	ISO 3166-1 alfa-2 – kod kraju składający się z dwóch znaków alfabetycznych.

Nr	Pole	Format
13	Beneficjent	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodny z ISO 17442, kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych. Kod klienta (maksymalnie 50 znaków alfanumerycznych).
14	Agent trójstronny	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodny z ISO 17442, kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych.
15	Broker	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodny z ISO 17442, kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych.
16	Członek rozliczający	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodny z ISO 17442, kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych.
17	Uczestnik lub pośredni uczestnik centralnego depozytu papierów wartościowych („CDPW”)	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodny z ISO 17442, kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych.
18	Pożyczkodawca („agent lender”)	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodny z ISO 17442, kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych.

- (1) Dyrektywa Parlamentu Europejskiego i Rady 2013/36/UE z dnia 26 czerwca 2013 r. w sprawie warunków dopuszczenia instytucji kredytowych do działalności oraz nadzoru ostrożnościowego nad instytucjami kredytowymi i firmami inwestycyjnymi (Dz.U. L 176 z 27.6.2013, s. 338).
- (2) Rozporządzenie Rady (UE) nr 1024/2013 z dnia 15 października 2013 r. powierzające Europejskiemu Bankowi Centralnemu szczególne zadania w odniesieniu do polityki związanej z nadzorem ostrożnościowym nad instytucjami kredytowymi (Dz.U. L 287 z 29.10.2013, s. 63).
- (3) Dyrektywa Parlamentu Europejskiego i Rady 2014/65/UE z dnia 15 maja 2014 r. w sprawie rynków instrumentów finansowych (Dz.U. L 173 z 12.6.2014, s. 349).
- (4) Dyrektywa Parlamentu Europejskiego i Rady 2009/138/WE z dnia 25 listopada 2009 r. w sprawie podejmowania i prowadzenia działalności ubezpieczeniowej i reasekuracyjnej (Wyłącznie II) (Dz.U. L 335 z 17.12.2009, s. 1).
- (5) Dyrektywa Parlamentu Europejskiego i Rady 2011/61/UE z dnia 8 czerwca 2011 r. w sprawie zarządzających alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi (Dz.U. L 174 z 1.7.2011, s. 1).
- (6) Dyrektywa 2003/41/WE Parlamentu Europejskiego i Rady z dnia 3 czerwca 2003 r. w sprawie działalności instytucji pracowniczych programów emerytalnych oraz nadzoru nad takimi instytucjami (Dz.U. L 235 z 23.9.2003, s. 10).
- (7) 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 (Dz.U. L 201 z 27.7.2012, s. 1).
- (8) Rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 909/2014 z dnia 23 lipca 2014 r. w sprawie usprawnienia rozrachunku papierów wartościowych w Unii Europejskiej i w sprawie centralnych depozytów papierów wartościowych (Dz.U. L 257 z 28.8.2014, s. 1).
- (9) Dyrektywa Parlamentu Europejskiego i Rady 2009/65/WE z dnia 13 lipca 2009 r. w sprawie koordynacji przepisów ustawowych, wykonawczych i administracyjnych odnoszących się do przedsiębiorstw zbiorowego inwestowania w zbywalne papiery wartościowe (UCITS) (Dz.U. L 302 z 17.11.2009, s. 32).
- (10) Rozporządzenie (WE) nr 1893/2006 Parlamentu Europejskiego i Rady z dnia 20 grudnia 2006 r. w sprawie statystycznej klasyfikacji działalności gospodarczej NACE Rev. 2 (Dz.U. L 393 z 30.12.2006, s. 1).

Tabela 2

**Dane dotyczące pożyczki i zabezpieczenia**

Nr	Pole	Format
1	Unikatowy identyfikator transakcji (UTI)	Kod składający się z maksymalnie 52 znaków alfanumerycznych, wliczając cztery znaki specjalne: Dopuszczalne są jedynie duże litery alfabetu A–Z oraz cyfry 0–9.
2	Numer referencyjny zgłoszenia	Kod składający się z maksymalnie 52 znaków alfanumerycznych, wliczając cztery znaki specjalne: Dopuszczalne są jedynie duże litery alfabetu A–Z oraz cyfry 0–9.
3	Data zdarzenia	Data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD
4	Rodzaj transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych	„SLEB” – transakcja udzielenia pożyczki papierów wartościowych lub towarów bądź transakcja zaciągnięcia pożyczki papierów wartościowych lub towarów „SBSC” – transakcja zwrotna kupno-sprzedaż lub transakcja zwrotna sprzedaż-kupno „REPO” – transakcja odkupu „MGLD” – transakcja z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego



Nr	Pole	Format
5	Rozliczono	„true” (prawda) „false” (fałsz)
6	Znacznik czasu rozliczenia	Data i czas zgodnie z ISO 8601 według formatu uniwersalnego czasu koordynowanego (UTC), tj. RRRR-MM-DDThh:mm:ssZ
7	CCP	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodny z ISO 17442, kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych.
8	System obrotu	Kod identyfikacyjny rynku (MIC) zgodnie z ISO 10383, składający się z 4 znaków alfanumerycznych. Jeżeli dla systemu obrotu istnieją MIC segmentów, należy stosować MIC segmentów.
9	Rodzaj umowy ramowej	„MRAA” – MRA „GMRA” – GMRA „MSLA” – MSLA „GMSL” – GMSLA „ISDA” – ISDA „DERP” – Deutscher Rahmenvertrag für Wertpapierpensionsgeschäfte „CNBR” – China Bond Repurchase Master Agreement „KRRR” – Korea Financial Investment Association (KOFIA) Standard Repurchase Agreement „CARA” – Investment Industry Regulatory Organization of Canada (IIROC) Repurchase/Reverse Repurchase Transaction Agreement „FRFB” – Convention-Cadre Relative aux Operations de Pensions Livrees „CHRA” – Swiss Master Repurchase Agreement „DEMA” – German Master Agreement „JPBR” – Japanese Master Agreement on the Transaction with Repurchase Agreement of the Bonds „ESRA” – Contrato Marco de compraventa y Reporto de valores „OSLA” – Overseas Securities Lending Agreement (OSLA) „MEFI” – Master Equity and Fixed Interest Stock Lending Agreement (MEFISLA) „GESL” – Gilt Edged Stock Lending Agreement (GESLA) „KRSL” – Korean Securities Lending Agreement (KOSLA) „DERD” – Deutscher Rahmenvertrag für Wertpapierdarlehen „AUSL” – Australian Masters Securities Lending Agreement (AMSLA) „JPBL” – Japanese Master Agreement on Lending Transaction of Bonds „JPSL” – Japanese Master Agreement on the Borrowing and Lending Transactions of Share Certificates „BIAG” – bilateral agreement (umowa dwustronna) „CSDA” – CSD bilateral agreement (umowa dwustronna CDPW) lub „OTHR”, jeżeli rodzaj umowy ramowej nie widnieje w powyższym wykazie
10	Inny rodzaj umowy ramowej	Maksymalnie 50 znaków alfanumerycznych.
11	Wersja umowy ramowej	Data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR
12	Znacznik czasu realizacji transakcji	Data i czas zgodnie z ISO 8601 według formatu uniwersalnego czasu koordynowanego (UTC), tj. RRRR-MM-DDThh:mm:ssZ
13	Data waluty (termin rozpoczęcia)	Data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD

Nr	Pole	Format
14	Termin zapadalności (termin zakończenia)	Data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD
15	Data zakończenia	Data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD
16	Minimalny okres wypowiedzenia	Pole zawierające maksymalnie 3 znaki (liczba całkowita).
17	Najwcześniejszy termin wypowiedzenia	Data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD
18	Wskaźnik zabezpieczenia ogólnego	„SPEC” – zabezpieczenie szczególne „GENE” – zabezpieczenie ogólne
19	Wskaźnik dostawy według wartości („DBV”)	„true” (prawda) „false” (fałsz)
20	Metoda przekazania zabezpieczenia	„TTCA” – uzgodnienie dotyczące zabezpieczeń polegające na przeniesieniu tytułu „SICA” – uzgodnienie dotyczące zabezpieczeń finansowych w formie gwarancji „SIUR” – uzgodnienie dotyczące zabezpieczeń finansowych w formie gwarancji z prawem wykorzystania
21	Brak terminu zapadalności	„true” (prawda) „false” (fałsz)
22	Tryb zakończenia transakcji	„EGRN” – evergreen (zawsze możliwe) „ETSB” – extendable (z możliwością przedłużenia) „NOAP” – nie ma zastosowania

W przypadku pożyczki związanej z transakcją z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego atrybuty wymienione w polach 23–34 należy powielić i wypełnić dla każdej waluty wykorzystanej w ramach tej pożyczki.

23	Stała stopa procentowa	Maksymalnie 11 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 10 cyfr po przecinku, wartość wyrażona procentowo, przy czym 100 % zapisuje się jako „100”. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
24	Wzór obliczania dni	Kod reprezentujący wzór obliczania dni: „A001” – IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule „A002” – IC30365 „A003” – IC30Actual „A004” – Actual360 „A005” – Actual365Fixed „A006” – ActualActualICMA „A007” – IC30E360orEuroBondBasismodel1 „A008” – ActualActualISDA „A009” – Actual365LorActuActubasisRule „A010” – ActualActualISDA „A011” – IC30360ICMAor30360basicrule „A012” – IC30E2360orEurobondbasismodel2 „A013” – IC30E3360orEurobondbasismodel3 „A014” – Actual365NL Lub maksymalnie 35 znaków alfanumerycznych, jeżeli danego wzoru obliczania dni nie uwzględniono w powyższym wykazie.

Nr	Pole	Format
25	Zmienna stopa procentowa	Kod reprezentujący zmienną stopę procentową „EONA” – EONIA „EONS” – EONIA SWAP „EURI” – EURIBOR „EUUS” – EURODOLLAR „EUCH” – EuroSwiss „GCFR” – GCF REPO „ISDA” – ISDAFIX „LIBI” – LIBID „LIBO” – LIBOR „MAAA” – Muni AAA „PFAN” – Pfandbriefe „TIBO” – TIBOR „STBO” – STIBOR „BBSW” – BBSW „JIBA” – JIBAR „BUBO” – BUBOR „CDOR” – CDOR „CIBO” – CIBOR „MOSP” – MOSPRIM „NIBO” – NIBOR „PRBO” – PRIBOR „TLBO” – TELBOR „WIBO” – WIBOR „TREA” – Treasury „SWAP” – SWAP „FUSW” – Future SWAP Lub maksymalnie 25 znaków alfanumerycznych, jeżeli danej stopy referencyjnej nie uwzględniono w powyższym wykazie.
26	Okres odniesienia dla zmiennej stopy procentowej – okres czasu	Okres czasu wskazujący okres odniesienia, który podaje się, stosując następujące skróty: „YEAR” – Rok „MNTH” – Miesiąc „WEEK” – Tydzień „DAYS” – Dzień
27	Okres odniesienia dla zmiennej stopy procentowej – mnożnik	Będący liczbą całkowitą mnożnik okresu czasu wskazującego okres odniesienia dla zmiennej stopy procentowej. Maksymalnie 3 znaki numeryczne.
28	Częstotliwość płatności według zmiennej stopy procentowej – okres czasu	Okres czasu wskazujący, jak często kontrahenci wymieniają płatności, który podaje się, stosując następujące skróty: „YEAR” – Rok „MNTH” – Miesiąc „WEEK” – Tydzień „DAYS” – Dzień
29	Częstotliwość płatności według zmiennej stopy procentowej – mnożnik	Będący liczbą całkowitą mnożnik okresu czasu wskazującego, jak często kontrahenci wymieniają płatności. Maksymalnie 3 znaki numeryczne.

Nr	Pole	Format
30	Częstotliwość aktualizacji zmiennej stopy procentowej – okres czasu	Okres czasu wskazujący, jak często kontrahenci aktualizują zmienną stopę procentową repo, który podaje się, stosując następujące skróty: „YEAR” – Rok „MNTH” – Miesiąc „WEEK” – Tydzień „DAYS” – Dzień
31	Częstotliwość aktualizacji zmiennej stopy procentowej – mnożnik	Będący liczbą całkowitą mnożnik okresu czasu wskazującego, jak często kontrahenci aktualizują zmienną stopę procentową repo. Maksymalnie 3 znaki numeryczne.
32	Spread	Maksymalnie 5 znaków numerycznych.
33	Kwota w walucie pożyczki związanej z transakcją z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	Maksymalnie 18 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 5 cyfr po przecinku. Separatorsa dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
34	Waluta pożyczki związanej z transakcją z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.

Pola 35–36 należy powielić i wypełnić dla każdej korekty zmiennej stopy procentowej.

35	Korygowana stopa procentowa	Maksymalnie 11 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 10 cyfr po przecinku, wartość wyrażona procentowo, przy czym 100 % zapisuje się jako „100”. Separatorsa dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
36	Data rozpoczęcia stosowania stopy procentowej	Data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD
37	Kwota główna w dniu waluty	Maksymalnie 18 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 5 cyfr po przecinku. Separatorsa dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
38	Kwota główna w terminie zapadalności	Maksymalnie 18 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 5 cyfr po przecinku. Separatorsa dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
39	Waluta kwoty głównej	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.
40	Rodzaj składnika aktywów	„SECU” – Securities (papiery wartościowe) „COMM” – Commodities (Towary)
41	Identyfikator papieru wartościowego	Kod ISIN zgodnie z ISO 6166, złożony z 12 znaków alfanumerycznych.
42	Klasyfikacja papieru wartościowego	Kod CFI zgodnie z ISO 10692, złożony z 6 liter.

Jeżeli udzielono pożyczki towaru lub zaciągnięto pożyczkę towaru, klasyfikację danego towaru określa się w polach 43, 44 i 45.

43	Produkt bazowy	Dopuszczone są tylko wartości z kolumny „produkt bazowy” w tabeli dotyczącej klasyfikacji towarowych instrumentów pochodnych.
----	----------------	---

Nr	Pole	Format
44	Podrodzaj produktu	Dopuszczone są tylko wartości z kolumny „podrodzaj produktu” w tabeli dotyczącej klasyfikacji towarowych instrumentów pochodnych.
45	Następny podrodzaj produktu	Dopuszczone są tylko wartości z kolumny „następny podrodzaj produktu” w tabeli dotyczącej klasyfikacji towarowych instrumentów pochodnych.
46	Ilość lub kwota nominalna	Maksymalnie 18 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 5 cyfr po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
47	Jednostka miary	„KILO” – Kilogram (kilogram), „PIEC” – Piece (jednostka), „TONS” – Ton (tona), „METR” – Metre (metr), „INCH” – Inch (cal), „YARD” – Yard (jard), „GBGA” – GBGallon (galon angielski), „GRAM” – Gram (gram), „CMET” – Centimetre (centymetr), „SMET” – SquareMetre (metr kwadratowy), „FOOT” – Foot (stopa), „MILE” – Mile (mila), „SQIN” – SquareInch (cal kwadratowy), „SQFO” – SquareFoot (stopa kwadratowa), „SQMI” – SquareMile (mila kwadratowa), „GBOU” – GBOunce (uncja angielska), „USOU” – USOunce (uncja amerykańska), „GBPI” – GBPint (pinta angielska), „USPI” – USPint (pinta amerykańska), „GBQA” – GBQuart (kwarta angielska), „USQA” – USQuart (kwarta amerykańska), „USGA” – USGallon (galon amerykański), „MMET” – Millimetre (milimetr), „KMET” – Kilometre (kilometr), „SQYA” – SquareYard (jard kwadratowy), „ACRE” – Acre (akr), „ARES” – Are (ar), „SMIL” – SquareMillimetre (milimetr kwadratowy), „SCMT” – SquareCentimetre (centymetr kwadratowy), „HECT” – Hectare (hektar), „SQKI” – SquareKilometre (kilometr kwadratowy), „MILI” – MilliLitre (mililitr), „CELI” – Centilitre (centylitr), „LITR” – Litre (litr), „PUND” – Pound (funt), „ALOW” – Allowances (uprawnienie), „ACCY” – AmountOfCurrency (kwota waluty), „BARL” – Barrels (baryłka), „BCUF” – BillionCubicFeet (miliard stóp sześciennych), „BDFE” – BoardFeet (stopa deskowa), „BUSL” – Bushels (buszel), „CEER” – CertifiedEmissionsReduction (poświadczona redukcja emisji), „CLRT” – ClimateReserveTonnes (tona rezerwy klimatycznej), „CBME” – CubicMeters (metr sześcienny), „DAYS” – Days (dzień), „DMET” – DryMetricTons (tona metryczna suchego produktu), „ENVC” – EnvironmentalCredit (kredyt środowiskowy), „ENVO” – EnvironmentalOffset (kompensata środowiskowa), „HUWG” – Hundredweight (kwintal), „WDC” – KilowattDayCapacity (zdolność wytwórcza w kW na dzień), „KWHO” – KilowattHours (kilowatogodzina), „KWHC” – KilowattHoursCapacity (zdolność wytwórcza w kW na godzinę), „KMO” – KilowattMinuteCapacity (zdolność wytwórcza w kW na minutę), „KWMC” – KilowattMonthCapacity (zdolność wytwórcza w kW na miesiąc), „KWYC” – KilowattYearCapacity (zdolność wytwórcza w kW na rok), „MWDC” – MegawattDayCapacity (zdolność wytwórcza w MW na dzień), „MWHO” – MegawattHours (megawatogodzina), „MWHC” – MegawattHoursCapacity (zdolność wytwórcza w MW na godzinę), „MWMC” – MegawattMinuteCapacity (zdolność wytwórcza w MW na minutę), „MMOC” – MegawattMonthCapacity (zdolność wytwórcza w MW na miesiąc), „MWYC” – MegawattYearCapacity (zdolność wytwórcza w MW na rok), „TONE” – MetricTons (tona metryczna), „MIBA” – MillionBarrels (milion baryłek), „MBTU” – OneMillionBTU (milion BTU), „OZTR” – TroyOunces (uncja jubilerska), „UCWT” – USHundredweight (kwintal amerykański), „IPNT” – IndexPoint (punkt indeksu), „PWRD” – PrincipalWithRelationToDebtInstrument (kwota główna związana z instrumentem dłużnym), „DGEU” – DieselGallonEquivalent (ekwiwalent galonu oleju napędowego), „GGEU” – GasolineGallonEquivalent (ekwiwalent galonu benzyny), „TOCD” – TonsOfCarbonDioxide (tona dwutlenku węgla).
48	Waluta kwoty nominalnej	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.
49	Cena papieru wartościowego lub towaru	Maksymalnie 18 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 5 cyfr po przecinku, w przypadku gdy cena jest wyrażona w jednostkach. Maksymalnie 11 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 10 cyfr po przecinku, w przypadku gdy cena jest wyrażona procentowo lub jako stopa zwrotu. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
50	Waluta, w jakiej wyrażona jest cena	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.

Nr	Pole	Format
51	Jakość papieru wartościowego	„INVG” – Investment grade (opatrzone ratingiem na poziomie inwestycyjnym) „NIVG” – Investment grade (opatrzone ratingiem na poziomie innym niż inwestycyjny) „NOTR” – Non-rated (nieopatrzone ratingiem) „NOAP” – nie ma zastosowania
52	Termin zapadalności papieru wartościowego	Data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD
53	Jurysdykcja właściwa dla emitenta	ISO 3166-1 alfa-2 – kod kraju składający się z dwóch znaków alfabetycznych.
54	LEI emitenta	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodny z ISO 17442, kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych.
55	Rodzaj papieru wartościowego	„GOVS” – Papiery wartościowe emitowane przez podmioty rządowe „SUNS” – Papiery wartościowe emitowane przez agencje i podmioty ponadnarodowe „FIDE” – Dłużne papiery wartościowe (w tym obligacje zabezpieczone) emitowane przez banki i inne instytucje finansowe „NFID” – dłużne papiery wartościowe przedsiębiorstw (w tym obligacje zabezpieczone) emitowane przez instytucje niefinansowe „SEPR” – Produkty sekurytyzowane (w tym CDO, CMBS, ABCP) „MEQU” – Akcje uwzględnione w głównych indeksach (w tym obligacje zamienne) „OEUQ” – Inne akcje (w tym obligacje zamienne) „OTHR” – Inne aktywa (w tym udziały w funduszach wspólnego inwestowania)
56	Wartość pożyczki	Maksymalnie 18 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 5 cyfr po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
57	Wartość rynkowa	Maksymalnie 18 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 5 cyfr po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
58	Stała stawka rabatu	Maksymalnie 11 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 10 cyfr po przecinku, wartość wyrażona procentowo, przy czym 100 % zapisuje się jako „100”. Znaku liczby ujemnej (jeżeli go użyto) nie liczy się jako znaku numerycznego.
59	Zmienna stawka rabatu	Kod reprezentujący zmienną stopę procentową „EONA” – EONIA „EONS” – EONIA SWAP „EURI” – EURIBOR „EUUS” – EURODOLLAR „EUCH” – EuroSwiss „GCFR” – GCF REPO „ISDA” – ISDAFIX „LIBI” – LIBID „LIBO” – LIBOR „MAAA” – Muni AAA „PFAN” – Pfandbriefe „TIBO” – TIBOR „STBO” – STIBOR „BBSW” – BBSW

Nr	Pole	Format
		„JIBA” – JIBAR „BUBO” – BUBOR „CDOR” – CDOR „CIBO” – CIBOR „MOSP” – MOSPRIM „NIBO” – NIBOR „PRBO” – PRIBOR „TLBO” – TELBOR „WIBO” – WIBOR „TREA” – Treasury „SWAP” – SWAP „FUSW” – Future SWAP Lub maksymalnie 25 znaków alfanumerycznych, jeżeli danej stopy referencyjnej nie uwzględniono w powyższym wykazie.
60	Okres odniesienia dla zmiennej stawki rabatu – okres czasu	Okres czasu wskazujący okres odniesienia, który podaje się, stosując następujące skróty: „YEAR” – Rok „MNTH” – Miesiąc „WEEK” – Tydzień „DAYS” – Dzień
61	Okres odniesienia dla zmiennej stawki rabatu – mnożnik	Będący liczbą całkowitą mnożnik okresu czasu wskazującego okres odniesienia dla zmiennej stawki rabatu. Maksymalnie 3 znaki numeryczne.
62	Częstotliwość płatności według zmiennej stawki rabatu – okres czasu	Okres czasu wskazujący, jak często kontrahenci wymieniają płatności, który podaje się, stosując następujące skróty: „YEAR” – Rok „MNTH” – Miesiąc „WEEK” – Tydzień „DAYS” – Dzień
63	Częstotliwość płatności według zmiennej stawki rabatu – mnożnik	Będący liczbą całkowitą mnożnik okresu czasu wskazującego, jak często kontrahenci wymieniają płatności. Maksymalnie 3 znaki numeryczne.
64	Częstotliwość aktualizacji zmiennej stawki rabatu – okres czasu	Okres czasu wskazujący, jak często kontrahenci aktualizują zmienną stawkę rabatu, który podaje się, stosując następujące skróty: „YEAR” – Rok „MNTH” – Miesiąc „WEEK” – Tydzień „DAYS” – Dzień
65	Częstotliwość aktualizacji zmiennej stawki rabatu – mnożnik	Będący liczbą całkowitą mnożnik okresu czasu wskazującego, jak często kontrahenci aktualizują zmienną stawkę rabatu. Maksymalnie 3 znaki numeryczne.
66	Spread stawki rabatu	Maksymalnie 5 znaków numerycznych.
67	Opłata za udzielenie pożyczki	Maksymalnie 11 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 10 cyfr po przecinku, wartość wyrażona procentowo, przy czym 100 % zapisuje się jako „100”.

Nr	Pole	Format
68	Uzgodnienia o wyłączności	„true” (prawda) „false” (fałsz)
69	Pozostająca do spłaty pożyczka związana z transakcją z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	Maksymalnie 18 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 5 cyfr po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
70	Waluta bazowa pozostającej do spłaty pożyczki związanej z transakcją z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.
71	Wartość rynkowa pozycji krótkich	Maksymalnie 18 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 5 cyfr po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
Dane dotyczące zabezpieczenia		
72	Oznakowanie niezabezpieczonego udzielania pożyczek papierów wartościowych	„true” (prawda) „false” (fałsz)
73	Zabezpieczenie ekspozycji netto	„true” (prawda) „false” (fałsz)
74	Data waluty zabezpieczenia	Data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD
Jeżeli wykorzystano szczególne zabezpieczenie pola 75–94 należy w stosownych przypadkach powielić i wypełnić dla każdego składnika zabezpieczenia.		
75	Rodzaj składnika zabezpieczenia	„SECU” – Securities (papiery wartościowe) „COMM” – Commodities (towary), tylko w przypadku transakcji odkupu, transakcji zaciągnięcia lub udzielenia pożyczki papierów wartościowych lub towarów oraz transakcji zwrotnych kupno-sprzedaż „CASH” – Cash (środki pieniężne)
Jeżeli jako zabezpieczenie wykorzystano środki pieniężne, należy to określić w polach 76 i 77.		
76	Kwota zabezpieczenia gotówkowego	Maksymalnie 18 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 5 cyfr po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
77	Waluta zabezpieczenia gotówkowego	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.
78	Identyfikacja papieru wartościowego wykorzystanego jako zabezpieczenie	Kod ISIN zgodnie z ISO 6166, złożony z 12 znaków alfanumerycznych.
79	Klasyfikacja papieru wartościowego wykorzystanego jako zabezpieczenie	Kod CFI zgodnie z ISO 10692, złożony z 6 liter.



Nr	Pole	Format
Jeżeli jako zabezpieczenie wykorzystano towar, klasyfikację danego towaru określa się w polach 80, 81 i 82.		
80	Produkt bazowy	Dopuszczone są tylko wartości z kolumny „produkt bazowy” w tabeli dotyczącej klasyfikacji towarowych instrumentów pochodnych.
81	Podrodzaj produktu	Dopuszczone są tylko wartości z kolumny „podrodzaj produktu” w tabeli dotyczącej klasyfikacji towarowych instrumentów pochodnych.
82	Następny podrodzaj produktu	Dopuszczone są tylko wartości z kolumny „następny podrodzaj produktu” w tabeli dotyczącej klasyfikacji towarowych instrumentów pochodnych.
83	Ilość zabezpieczeń lub kwota nominalna zabezpieczenia	Maksymalnie 18 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 5 cyfr po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
84	Jednostka miary zabezpieczenia	„KILO” – Kilogram (kilogram), „PIEC” – Piece (jednostka), „TONS” – Ton (tona), „METR” – Metre (metr), „INCH” – Inch (cal), „YARD” – Yard (jard), „GBGA” – GBGallon (galon angielski), „GRAM” – Gram (gram), „CMET” – Centimetre (centymetr), „SMET” – SquareMetre (metr kwadratowy), „FOOT” – Foot (stopa), „MILE” – Mile (mila), „SQIN” – SquareInch (cal kwadratowy), „SQFO” – SquareFoot (stopa kwadratowa), „SQMI” – SquareMile (mila kwadratowa), „GBOU” – GBOunce (uncja angielska), „USOU” – USOunce (uncja amerykańska), „GBPI” – GBPint (pinta angielska), „USPI” – USPint (pinta amerykańska), „GBQA” – GBQuart (kwarta angielska), „USQA” – USQuart (kwarta amerykańska), „USGA” – USGallon (galon amerykański), „MMET” – Millimetre (milimetr), „KMET” – Kilometre (kilometr), „SQYA” – SquareYard (jard kwadratowy), „ACRE” – Acre (akr), „ARES” – Are (ar), „SMIL” – SquareMillimetre (milimetr kwadratowy), „SCMT” – SquareCentimetre (centymetr kwadratowy), „HECT” – Hectare (hektar), „SQKI” – SquareKilometre (kilometr kwadratowy), „MIL” – MilliLitre (mililitr), „CELL” – Centilitre (centylitr), „LITR” – Litre (litr), „PUND” – Pound (funt), „ALOW” – Allowances (uprawnienie), „ACCY” – AmountOfCurrency (kwota waluty), „BARL” – Barrels (baryłka), „BCUF” – BillionCubicFeet (miliard stóp sześciennych), „BDFT” – BoardFeet (stopa deskowa), „BUSL” – Bushels (buszel), „CEER” – CertifiedEmissionsReduction (poświadczona redukcja emisji), „CLRT” – ClimateReserveTonnes (tona rezerwy klimatycznej), „CBME” – CubicMeters (metr sześcienny), „DAYS” – Days (dzień), „DMET” – DryMetricTons (tona metryczna suchego produktu), „ENVC” – EnvironmentalCredit (kredyt środowiskowy), „ENVO” – EnvironmentalOffset (kompensata środowiskowa), „HUWG” – Hundredweight (kwintal), „WDC” – KilowattDayCapacity (zdolność wytwórcza w kW na dzień), „KWHO” – KilowattHours (kilowatogodzina), „KWHC” – KilowattHoursCapacity (zdolność wytwórcza w kW na godzinę), „KMOC” – KilowattMinuteCapacity (zdolność wytwórcza w kW na minutę), „KWMC” – KilowattMonthCapacity (zdolność wytwórcza w kW na miesiąc), „KWYC” – KilowattYearCapacity (zdolność wytwórcza w kW na rok), „MWDC” – MegawattDayCapacity (zdolność wytwórcza w MW na dzień), „MWHO” – MegawattHours (megawatogodzina), „MWHC” – MegawattHoursCapacity (zdolność wytwórcza w MW na godzinę), „MWMC” – MegawattMinuteCapacity (zdolność wytwórcza w MW na minutę), „MMOC” – MegawattMonthCapacity (zdolność wytwórcza w MW na miesiąc), „MWYC” – MegawattYearCapacity (zdolność wytwórcza w MW na rok), „TONE” – MetricTons (tona metryczna), „MIBA” – MillionBarrels (milion baryłek), „MBTU” – OneMillionBTU (milion BTU), „OZTR” – TroyOunces (uncja jubilerska), „UCWT” – USHundredweight (kwintal amerykański), „IPNT” – IndexPoint (punkt indeksu), „PWRD” – PrincipalWithRelationToDebtInstrument (kwota główna związana z instrumentem dłużnym), „DGEU” – DieselGallonEquivalent (ekwiwalent galonu oleju napędowego), „GGEU” – GasolineGallonEquivalent (ekwiwalent galonu benzyny), „TOCD” – TonsOfCarbonDioxide (tona dwutlenku węgla).
85	Waluta nominalnej wartości zabezpieczenia	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.
86	Waluta, w jakiej wyrażona jest cena	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.
87	Cena jednostki	Maksymalnie 18 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 5 cyfr po przecinku, w przypadku gdy cena jest wyrażona w jednostkach. Maksymalnie 11 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 10 cyfr po przecinku, w przypadku gdy cena jest wyrażona procentowo lub jako stopa zwrotu. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.

Nr	Pole	Format
88	Wartość rynkowa zabezpieczenia	Maksymalnie 18 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 5 cyfr po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
89	Redukcja wartości lub depozyt zabezpieczający	Maksymalnie 11 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 10 cyfr po przecinku, wartość wyrażona procentowo, przy czym 100 % zapisuje się jako „100”. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
90	Jakość zabezpieczenia	„INVG” – Investment grade (opatrzone ratingiem na poziomie inwestycyjnym) „NIVG” – Investment grade (opatrzone ratingiem na poziomie innym niż inwestycyjny) „NOTR” – Non-rated (nieopatrzone ratingiem) „NOAP” – nie ma zastosowania
91	Termin zapadalności papieru wartościowego	Data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD
92	Jurysdykcja właściwa dla emitenta	ISO 3166-1 alfa-2 – kod kraju składający się z dwóch znaków alfabetycznych.
93	LEI emitenta	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodny z ISO 17442, kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych.
94	Rodzaj zabezpieczenia	„GOVS” – Papiery wartościowe emitowane przez podmioty rządowe „SUNS” – Papiery wartościowe emitowane przez agencje i podmioty ponadnarodowe „FIDE” – Dłużne papiery wartościowe (w tym obligacje zabezpieczone) emitowane przez banki i inne instytucje finansowe „NFID” – dłużne papiery wartościowe przedsiębiorstw (w tym obligacje zabezpieczone) emitowane przez instytucje niefinansowe „SEPR” – Produkty sekurytyzowane (w tym CDO, CMBS, ABCP) „MEQU” – Akcje uwzględnione w głównych indeksach (w tym obligacje zamienne) „O EQU” – Inne akcje (w tym obligacje zamienne) „OTHR” – Inne aktywa (w tym udziały w funduszach wspólnego inwestowania)
95	Dostępność zabezpieczenia do ponownego wykorzystania	„true” (prawda) „false” (fałsz)
Pole 96 należy wypełnić w przypadku gdy wykorzystano koszyk zabezpieczeń. Szczegółowego przypisania zabezpieczenia do transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, które są przedmiotem transakcji z wykorzystaniem puli zabezpieczeń, dokonuje się w polach 75–94, jeżeli dostępne są niezbędne informacje.		
96	Identyfikator koszyka zabezpieczeń	Kod ISIN zgodnie z ISO 6166, złożony z 12 znaków alfanumerycznych lub „NTAV”
97	Kod portfela	Kod składający się z 52 znaków alfanumerycznych, wliczając cztery znaki specjalne: - ' _ . Znaki specjalne są niedozwolone na początku i na końcu kodu. Spacje są niedozwolone.
98	Rodzaj czynności	„NEWT” – New (nowe) „MODI” – Modification (zmiana) „VALU” – Valuation (wycena) „COLU” – Collateral update (aktualizacja zabezpieczenia) „EROR” – Error (błąd) „CORR” – Correction (korekta)

Nr	Pole	Format
		„ETRM” – Termination/Early Termination (zakończenie/przedterminowe zakończenie) „POSC” – Position component (składnik pozycji)
99	Poziom	„TCTN” – Transakcja „PSTN” – Pozycja

Tabela 3

**Dane dotyczące depozytu zabezpieczającego**

Nr	Pole	Format
1	Znacznik czasu zgłoszenia	Data i czas zgodnie z ISO 8601 według formatu uniwersalnego czasu koordynowanego (UTC), tj. RRRR-MM-DDThh:mm:ssZ
2	Data zdarzenia	Data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD
3	Podmiot przekazujący zgłoszenie	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodny z ISO 17442, kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych.
4	Kontrahent dokonujący zgłoszenia	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodny z ISO 17442, kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych.
5	Podmiot odpowiedzialny za zgłoszenie	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodny z ISO 17442, kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych.
6	Drugi kontrahent	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodny z ISO 17442, kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych.
7	Kod portfela	Kod składający się z 52 znaków alfanumerycznych, wliczając cztery znaki specjalne: - _ . Znaki specjalne są niedozwolone na początku i na końcu kodu. Spacje są niedozwolone.
8	Wniesiony początkowy depozyt zabezpieczający	Maksymalnie 18 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 5 cyfr po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
9	Waluta wniesionego początkowego depozytu zabezpieczającego	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.
10	Wniesiony zmienny depozyt zabezpieczający	Maksymalnie 18 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 5 cyfr po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
11	Waluta wniesionego zmiennego depozytu zabezpieczającego	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.
12	Otrzymany początkowy depozyt zabezpieczający	Maksymalnie 18 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 5 cyfr po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
13	Waluta otrzymanego początkowego depozytu zabezpieczającego	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.
14	Otrzymany zmienny depozyt zabezpieczający	Maksymalnie 18 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 5 cyfr po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.

Nr	Pole	Format
15	Waluta otrzymanego zmiennego depozytu zabezpieczającego	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.
16	Wniesiona nadwyżka zabezpieczenia	Maksymalnie 18 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 5 cyfr po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
17	Waluta wniesionej nadwyżki zabezpieczenia	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.
18	Otrzymana nadwyżka zabezpieczenia	Maksymalnie 18 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 5 cyfr po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
19	Waluta otrzymanej nadwyżki zabezpieczenia	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.
20	Rodzaj czynności	„NEWT” – New (nowe) „MARU” – Margin update (aktualizacja depozytu zabezpieczającego) „EROR” – Error (błąd) „CORR” – Correction (korekta)

Tabela 4

**Dane dotyczące ponownego wykorzystania, reinwestycji środków pieniężnych i źródeł finansowania**

Nr	Pole	Format
1	Znacznik czasu zgłoszenia	Data i czas zgodnie z ISO 8601 według formatu uniwersalnego czasu koordynowanego (UTC), tj. RRRR-MM-DDThh:mm:ssZ
2	Data zdarzenia	Data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD
3	Podmiot przekazujący zgłoszenie	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodny z ISO 17442, kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych.
4	Kontrahent dokonujący zgłoszenia	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodny z ISO 17442, kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych.
5	Podmiot odpowiedzialny za zgłoszenie	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodny z ISO 17442, kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych.
Pole 6 należy powielić i wypełnić dla każdego składnika zabezpieczenia.		
6	Rodzaj składnika zabezpieczenia	„SECU” – Securities (papiery wartościowe) „CASH” – Cash (środki pieniężne)
Pola 7, 8, 9 i 10 należy powielić i wypełnić dla każdego papieru wartościowego.		
7	Składnik zabezpieczenia	Kod ISIN zgodnie z ISO 6166, złożony z 12 znaków alfanumerycznych.
8	Wartość ponownie wykorzystanego zabezpieczenia	Maksymalnie 18 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 5 cyfr po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
9	Szacowane ponowne wykorzystanie zabezpieczenia	Maksymalnie 18 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 5 cyfr po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.

Nr	Pole	Format
10	Waluta ponownie wykorzystanego zabezpieczenia	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.
11	Wskaźnik reinwestycji	Maksymalnie 11 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 10 cyfr po przecinku, wartość wyrażona procentowo, przy czym 100 % zapisuje się jako „100”.
Pola 12, 13 i 14 powiela się i wypełnia dla każdej inwestycji, w przypadku której zabezpieczenie gotówkowe zostało ponownie zainwestowane, oraz w odniesieniu do każdej waluty.		
12	Rodzaj reinwestowanej inwestycji gotówkowej	MMFT – registered money market fund (zarejestrowany fundusz rynku pieniężnego) „OCMP” – any other commingled pool (każda inna przemieszana pula) „REPM” – the repo market (rynek transakcji odkupu) „SDPU” – direct purchase of securities (bezpośredni zakup papierów wartościowych) „OTHR” – inne
13	Kwota reinwestowanych środków pieniężnych	Maksymalnie 18 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 5 cyfr po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
14	Waluta reinwestowanych środków pieniężnych	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.
W przypadku transakcji z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego kontrahent powiela i wypełnia pola 15, 16 i 17 dla każdego źródła finansowania i przedstawia w tych polach informacje na poziomie podmiotu.		
15	Źródła finansowania	„REPO” – transakcje odkupu lub transakcje zwrotne kupno-sprzedaż „SECL” – zabezpieczenie gotówkowe z tytułu udzielania pożyczek papierów wartościowych „FREE” – kredyty nieoprocentowane „CSHS” – przychody z krótkiej sprzedaży przez klientów „BSHS” – przychody z krótkiej sprzedaży przez brokera „UBOR” – niezabezpieczone zaciągnięte kredyty „OTHR” – inne
16	Wartość rynkowa źródeł finansowania	Maksymalnie 18 znaków numerycznych, wliczając maksymalnie 5 cyfr po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jeżeli nie jest to możliwe, proporcjonalna kwota.
17	Waluta źródeł finansowania	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.
18	Rodzaj czynności	„NEWT” – New (nowe) „REUU” – Reuse update (aktualizacja ponownego wykorzystania) „EROR” – Error (błąd) „CORR” – Correction (korekta)

Tabela 5

**Klasyfikacja towarów**

Produkt bazowy	Podrodzaj produktu	Następny podrodzaj produktu
„AGRI” – produkty rolne	„GROS” – ziarna zbóż, nasiona oleiste	„FWHT” – pszenica paszowa „SOYB” – nasiona soi „CORN” – kukurydza zwyczajna „RPSD” – rzepak „RICE” – ryż „OTHR” – inne

Produkt bazowy	Podrodzaj produktu	Następny podrodzaj produktu
	„SOFT” – produkty nietrwałe	„CCOA” – kakao „ROBU” – kawa robusta „WHSG” – cukier biały „BRWN” – cukier surowy „OTHR” – inne
	„POTA” – ziemniaki	
	„OOLI” – oliwa z oliwek	„LAMP” – lampante „OTHR” – inne
	„DIRY” – produkty mleczne	
	„FRST” – leśnictwo	
	„SEAF” – owoce morza	
	„LSTK” – zwierzęta gospodarskie	
	„GRIN” – ziarno	„MWHT” – pszenica na przemiał „OTHR” – inne
	„OTHR” – inne	
„NRGY” – energia	„ELEC” – elektryczność	„BSLD” – obciążenie podstawowe „FITR” – finansowe prawa przesyłowe „PKLD” – obciążenie szczytowe „OFFP” – obciążenie pozaszczytowe „OTHR” – inne
	„NGAS” – gaz ziemny	„GASP” – GASPOOL „LNGG” – LNG „NBPG” – NBP „NCGG” – NCG „TTFG” – TTF „OTHR” – inne
	„OILP” – olej	„BAKK” – Bakken „BDSL” – biodiesel „BRNX” – Brent NX „BRNX” – Brent NX „CNDA” – kanadyjski „COND” – skondensowany „DSEL” – olej napędowy „DUBA” – Dubaj „ESPO” – ESPO „ETHA” – etanol „FUEL” – paliwo „FOIL” – paliwo olejowe „GOIL” – olej napędowy

Produkt bazowy	Podrodzaj produktu	Następny podrodzaj produktu
		„GSLN” – benzyna „HEAT” – olej opałowy „JTFL” – paliwo do silników odrzutowych „KERO” – nafta „LLSO” – Light Louisiana Sweet (LLS) „MARS” – Mars „NAPH” – nafta „NGLO” – NGL „TAPO” – Tapis „URAL” – Ural „WTIO” – WTI „OTHR” – inne
	„CO” – węgiel „INRG” – Inter Energy (obejmujące różne nośniki energii) „RNNG” – energia odnawialna „LGHT” – lekkie frakcje „DIST” – destylaty „OTHR” – inne	
„ENVR” – środowiskowe	„EMIS” – emisje	„CERE” – CER „ERUE” – ERU „EUAE” – EUA „EUAA” – EUAA „OTHR” – inne
	„WE” – pogoda „CRBR” – związane z węglem „OTHR” – inne	
„FRGT” – fracht	„WETF” – ładunki mokre	„TNKR” – zbiornikowce „OTHR” – inne
	„DRYF” – ładunki suche	„DBCR” – masowce do ładunków suchych „OTHR” – inne
	„CSHP” – kontenerowce	
	„OTHR” – inne	
„FRTL” – nawozy	„AMMO” – amoniak „DAPH” – DAP (fosforan diamonu) „PTSH” – potas „SLPH” – siarka „UREA” – mocznik „UAAN” – UAN (mocznik i azotan amonu) „OTHR” – inne	

Produkt bazowy	Podrodzaj produktu	Następny podrodzaj produktu
„INDP” – produkty przemysłowe	„CSTR” – budownictwo „MFTG” – produkcja	
„METL” – metale	„NPRM” – nieszlachetne	„ALUM” – glin „ALUA” – stop glinu „CBLT” – kobalt „COPR” – miedź „IRON” – ruda żelaza „LEAD” – ołów „MOLY” – molibden „NASC” – NASAAC „NICK” – nikiel „STEL” – stal „TINN” – cyna „ZINC” – cynk „OTHR” – inne
	„PRME” – szlachetne	„GOLD” – złoto „SLVR” – srebro „PTNM” – platyna „PLDM” – pallad „OTHR” – inne
„MCEX” – złożone surowce egzotyczne (Multi Commodity Exotic)		
„PAPR” – papier	„CBRD” – papier do produkcji tektury falistej „NSPT” – papier gazetowy „PULP” – masa włóknista „RCVP” – makulatura „OTHR” – inne	
„POLY” – polipropylen	„PLST” – tworzywa sztuczne „OTHR” – inne	
„INFL” – inflacja		
„OEST” – oficjalne statystyki gospodarcze		
„OTHC” – inne C10, zgodnie z tabelą 10.1 w sekcji 10 w załączniku III do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2017/583 <sup>(1)</sup>		
„OTHR” – inne		

(<sup>1</sup>) Rozporządzenie delegowane Komisji (UE) 2017/583 z dnia 14 lipca 2016 r. uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 600/2014 w sprawie rynków instrumentów finansowych w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych dotyczących wymogów w zakresie przejrzystości dla systemów obrotu i firm inwestycyjnych w odniesieniu do obligacji, strukturyzowanych produktów finansowych, uprawnień do emisji oraz instrumentów pochodnych (Dz.U. L 87 z 31.3.2017, s. 229).



## ZAŁĄCZNIK II

Załącznik do rozporządzenia wykonawczego (UE) nr 1247/2012 zastępuje się tekstem znajdującym się poniżej.

„ZAŁĄCZNIK

Tabela 1

**Informacje dotyczące kontrahenta**

	Pole	Format
	Strony kontraktu	
1	Znacznik czasu zgłoszenia	Data i czas zgodnie z ISO 8601 według formatu uniwersalnego czasu koordynowanego (UTC) RRRR-MM-DDThh:mm:ssZ
2	Identyfikator kontrahenta dokonującego zgłoszenia	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodnie z ISO 17442 – kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych.
3	Rodzaj identyfikatora drugiego kontrahenta	»LEI« w przypadku identyfikatora podmiotu prawnego (LEI) zgodnie z ISO 17442. »CLC« w przypadku kodu klienta.
4	Identyfikator drugiego kontrahenta	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodnie z ISO 17442 – kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych. Kod klienta (maksymalnie 50 znaków alfanumerycznych).
5	Kraj drugiego kontrahenta	ISO 3166 – kod kraju składający się z dwóch liter.
6	Sektor przedsiębiorstw, w którym działa kontrahent dokonujący zgłoszenia	<p>Taksonomia dla kontrahentów finansowych:</p> <p>A = zakład ubezpieczeń na życie, który otrzymał zezwolenie zgodnie z dyrektywą Parlamentu Europejskiego i Rady 2009/138/WE <sup>(1)</sup></p> <p>C = instytucja kredytowa, która otrzymała zezwolenie zgodnie z dyrektywą Parlamentu Europejskiego i Rady 2013/36/UE <sup>(2)</sup></p> <p>F = firma inwestycyjna, która otrzymała zezwolenie zgodnie z dyrektywą 2004/39/WE Parlamentu Europejskiego i Rady <sup>(3)</sup></p> <p>I = zakład ubezpieczeń, który otrzymał zezwolenie zgodnie z dyrektywą 2009/138/WE</p> <p>L = alternatywny fundusz inwestycyjny zarządzany przez zarządzających alternatywnym funduszem inwestycyjnym (ZAFI), który otrzymał zezwolenie lub został zarejestrowany zgodnie z dyrektywą Parlamentu Europejskiego i Rady 2011/61/UE <sup>(4)</sup></p> <p>O = instytucja pracowniczych programów emerytalnych w rozumieniu art. 6 lit. a) dyrektywy 2003/41/WE Parlamentu Europejskiego i Rady <sup>(5)</sup></p> <p>R = zakład reasekuracji, który otrzymał zezwolenie zgodnie z dyrektywą 2009/138/WE</p> <p>U = przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania w zbywalne papiery wartościowe (UCITS) oraz jego spółka zarządzająca, które otrzymały zezwolenie zgodnie z dyrektywą Parlamentu Europejskiego i Rady 2009/65/WE <sup>(6)</sup></p> <p>Taksonomia dla kontrahentów niefinansowych: poniższe kategorie odpowiadają głównym sekcjom statystycznej klasyfikacji działalności gospodarczej we Wspólnocie Europejskiej (NACE), jak określono w rozporządzeniu (WE) nr 1893/2006 Parlamentu Europejskiego i Rady <sup>(7)</sup></p> <p>1 = Rolnictwo, leśnictwo i rybactwo</p> <p>2 = Górnictwo i wydobywanie</p> <p>3 = Przetwórstwo przemysłowe</p> <p>4 = Wytwarzanie i zaopatrywanie w energię elektryczną, gaz, parę wodną i powietrze do układów klimatyzacyjnych</p>

	Pole	Format
		<p>5 = Dostawa wody, gospodarowanie ściekami i odpadami oraz działalność związana z rekultywacją</p> <p>6 = Budownictwo</p> <p>7 = Handel hurtowy i detaliczny, naprawa pojazdów samochodowych i motocykli</p> <p>8 = Transport i gospodarka magazynowa</p> <p>9 = Działalność związana z zakwaterowaniem i usługami gastronomicznymi</p> <p>10 = Informacja i komunikacja</p> <p>11 = Działalność finansowa i ubezpieczeniowa</p> <p>12 = Działalność związana z obsługą rynku nieruchomości</p> <p>13 = Działalność profesjonalna, naukowa i techniczna</p> <p>14 = Działalność w zakresie usług administrowania i działalność wspierająca</p> <p>15 = Administracja publiczna i obrona narodowa; obowiązkowe ubezpieczenia społeczne</p> <p>16 = Edukacja</p> <p>17 = Opieka zdrowotna i pomoc społeczna</p> <p>18 = Działalność związana z kulturą, rozrywką i rekreacją</p> <p>19 = Pozostała działalność usługowa</p> <p>20 = Gospodarstwa domowe zatrudniające pracowników; gospodarstwa domowe produkujące wyroby i świadczące usługi na własne potrzeby</p> <p>21 = Organizacje i zespoły eksterytorialne</p> <p>W przypadku zgłoszenia więcej niż jednego rodzaju działalności należy podać kody uszeregowane według względnego znaczenia danego rodzaju działalności, rozdzielając je znakiem »-«.</p> <p>Pole to należy pozostawić puste w przypadku kontrahentów centralnych i innego rodzaju kontrahentów zgodnie z art. 1 ust. 5 rozporządzenia (UE) nr 648/2012.</p>
7	Charakter kontrahenta dokonującego zgłoszenia	<p>F = kontrahent finansowy</p> <p>N = kontrahent niefinansowy</p> <p>C = kontrahent centralny</p> <p>O = inny</p>
8	Identyfikator brokera	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodnie z ISO 17442 – kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych.
9	Identyfikator podmiotu dokonującego zgłoszenia	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodnie z ISO 17442 – kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych.
10	Identyfikator członka rozliczającego	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodnie z ISO 17442 – kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych.
11	Rodzaj identyfikatora beneficjenta	<p>»LEI« w przypadku identyfikatora podmiotu prawnego (LEI) zgodnie z ISO 17442.</p> <p>»CLC« w przypadku kodu klienta.</p>
12	Identyfikator beneficjenta	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodnie z ISO 17442 – kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych lub kod klienta składający się z maksymalnie 50 znaków alfanumerycznych, w przypadku gdy klient nie kwalifikuje się do uzyskania identyfikatora podmiotu prawnego.
13	Charakter, w jakim zawarto transakcję	<p>P = na własny rachunek (<i>principal</i>)</p> <p>A = na rachunek klienta (<i>agent</i>)</p>
14	Strona kontraktu, po której znajduje się kontrahent	<p>B = kupujący</p> <p>S = sprzedający</p> <p>Pole to wypełnia się zgodnie z art. 3a</p>

	Pole	Format
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 = powyżej progu N = poniżej progu
17	Wartość kontraktu	Maksymalnie 20 znaków numerycznych, wliczając cyfry po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki. Znaku liczby ujemnej (jeżeli go użyto) nie liczy się jako znaku numerycznego.
18	Waluta, w której wyrażono wartość	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.
19	Znacznik czasu wyceny	Data i czas zgodnie z ISO 8601 według formatu czasu UTC RRRR-MM-DDThh:mm:ssZ
20	Rodzaj wyceny	M = wycena według wartości rynkowej O = wycena według modelu C = wycena CCP
21	Zabezpieczenie	U = niezabezpieczony PC = częściowo zabezpieczony OC = zabezpieczony jednostronnie FC = w pełni zabezpieczony Pole to wypełnia się zgodnie z art. 3b
22	Zabezpieczenie na poziomie portfela	Y = tak N = nie
23	Kod portfela, dla którego wniesiono zabezpieczenie	Maksymalnie 52 znaki alfanumeryczne, wliczając cztery znaki specjalne: », - _.« Znaki specjalne są niedozwolone na początku i na końcu kodu. Spacje są niedozwolone.
24	Wniesiony początkowy depozyt zabezpieczający	Maksymalnie 20 znaków numerycznych, wliczając cyfry po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
25	Waluta wniesionego początkowego depozytu zabezpieczającego	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.
26	Wniesiony zmienny depozyt zabezpieczający	Maksymalnie 20 znaków numerycznych, wliczając cyfry po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
27	Waluta wniesionych zmiennych depozytów zabezpieczających	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.
28	Otrzymany początkowy depozyt zabezpieczający	Maksymalnie 20 znaków numerycznych, wliczając cyfry po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
29	Waluta otrzymanego początkowego depozytu zabezpieczającego	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.

	Pole	Format
30	Otrzymany zmienny depozyt zabezpieczający	Maksymalnie 20 znaków numerycznych, wliczając cyfry po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
31	Waluta otrzymanych zmiennych depozytów zabezpieczających	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.
32	Wniesiona nadwyżka zabezpieczenia	Maksymalnie 20 znaków numerycznych, wliczając cyfry po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
33	Waluta wniesionej nadwyżki zabezpieczenia	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.
34	Otrzymana nadwyżka zabezpieczenia	Maksymalnie 20 znaków numerycznych, wliczając cyfry po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.
35	Waluta otrzymanej nadwyżki zabezpieczenia	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.

- (1) Dyrektywa Parlamentu Europejskiego i Rady 2009/138/WE z dnia 25 listopada 2009 r. w sprawie podejmowania i prowadzenia działalności ubezpieczeniowej i reasekuracyjnej (Wypłacalność II) (Dz.U. L 335 z 17.12.2009, s. 1).
- (2) Dyrektywa Parlamentu Europejskiego i Rady 2013/36/UE z dnia 26 czerwca 2013 r. w sprawie warunków dopuszczenia instytucji kredytowych do działalności oraz nadzoru ostrożnościowego nad instytucjami kredytowymi i firmami inwestycyjnymi, zmieniająca dyrektywę 2002/87/WE i uchylająca dyrektywy 2006/48/WE oraz 2006/49/WE (Dz.U. L 176 z 27.6.2013, s. 338).
- (3) Dyrektywa 2004/39/WE Parlamentu Europejskiego i Rady z dnia 21 kwietnia 2004 r. w sprawie rynków instrumentów finansowych zmieniająca dyrektywę Rady 85/611/EWG i 93/6/EWG i dyrektywę 2000/12/WE Parlamentu Europejskiego i Rady oraz uchylająca dyrektywę Rady 93/22/EWG (Dz.U. L 145 z 30.4.2004, s. 1).
- (4) Dyrektywa Parlamentu Europejskiego i Rady 2011/61/UE z dnia 8 czerwca 2011 r. w sprawie zarządzających alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi i zmiany dyrektyw 2003/41/WE i 2009/65/WE oraz rozporządzeń (WE) nr 1060/2009 i (UE) nr 1095/2010 (Dz.U. L 174 z 1.7.2011, s. 1).
- (5) Dyrektywa 2003/41/WE Parlamentu Europejskiego i Rady z dnia 3 czerwca 2003 r. w sprawie działalności instytucji pracowniczych programów emerytalnych oraz nadzoru nad takimi instytucjami (Dz.U. L 235 z 23.9.2003, s. 10).
- (6) Dyrektywa Parlamentu Europejskiego i Rady 2009/65/WE z dnia 13 lipca 2009 r. w sprawie koordynacji przepisów ustawowych, wykonawczych i administracyjnych odnoszących się do przedsiębiorstw zbiorowego inwestowania w zbywalne papiery wartościowe (UCITS) (Dz.U. L 302 z 17.11.2009, s. 32).
- (7) Rozporządzenie (WE) nr 1893/2006 Parlamentu Europejskiego i Rady z dnia 20 grudnia 2006 r. w sprawie statystycznej klasyfikacji działalności gospodarczej NACE Rev. 2 i zmieniające rozporządzenie Rady (EWG) nr 3037/90 oraz niektóre rozporządzenia WE w sprawie określonych dziedzin statystycznych (Dz.U. L 393 z 30.12.2006, s. 1).

Tabela 2

## Dane wspólne

	Pole	Format	Rodzaje kontraktów pochodnych, których to dotyczy
	Sekcja 2a – Rodzaj kontraktu		Wszystkie kontrakty
1	Rodzaj kontraktu	CD = kontrakty finansowe na transakcje różnicowe FR = kontrakty terminowe na stopę procentową FU = kontrakty terminowe typu future FW = kontrakty terminowe typu forward OP = opcja SB = kontrakt typu spread bet SW = swap ST = opcja na swapy OT = inne	

	Pole	Format	Rodzaje kontraktów pochodnych, których to dotyczy
2	Klasa aktywów	CO = towary i uprawnienia do emisji CR = kredyty CU = waluta EQ = akcje IR = stopa procentowa	
	Sekcja 2b – Informacje dotyczące kontraktu		Wszystkie kontrakty
3	Rodzaj klasyfikacji produktu	C = CFI	
4	Klasyfikacja produktu	Kod CFI zgodnie z ISO 10692, złożony z 6 liter.	
5	Rodzaj identyfikatora produktu	Proszę określić odpowiedni identyfikator: I = ISIN A = AII	
6	Identyfikator produktu	W przypadku identyfikatora produktu »I«: kod ISIN zgodnie z ISO 6166, złożony z 12 znaków alfanumerycznych. W przypadku identyfikatora produktu »A«: pełny kod AII.	
7	Rodzaj identyfikatora instrumentu bazowego	I = ISIN A = AII B = koszyk X = indeks	
8	Identyfikator instrumentu bazowego	W przypadku identyfikatora instrumentu bazowego »I«: kod ISIN zgodnie z ISO 6166, złożony z 12 znaków alfanumerycznych. W przypadku identyfikatora instrumentu bazowego »A«: pełny kod AII. W przypadku identyfikatora instrumentu bazowego »B«: wszystkie poszczególne elementy składowe identyfikuje się przy użyciu kodu ISIN zgodnie z ISO 6166 lub podając pełny kod AII. Identyfikatory poszczególnych elementów składowych rozdziela się dywizem »-«. W przypadku identyfikatora instrumentu bazowego »X«: kod ISIN zgodnie z ISO 6166 (jeśli jest dostępny), w innych przypadkach – pełna nazwa indeksu nadana przez dostawcę indeksu.	
9	Waluta nominalna 1	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.	
10	Waluta nominalna 2	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.	
11	Waluta dostawy	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.	
	Sekcja 2c – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji		Wszystkie kontrakty
12	Identyfikator transakcji	Kod składający się z maksymalnie 52 znaków alfanumerycznych, wliczając cztery znaki specjalne: »., - _.« Znaki specjalne są niedozwolone na początku i na końcu kodu. Spacje są niedozwolone.	

	Pole	Format	Rodzaje kontraktów pochodnych, których to dotyczy
13	Numer referencyjny zgłoszenia	Pole zawierające maksymalnie 52 znaki alfanumeryczne.	
14	Numer identyfikacyjny składnika złożonego obrotu	Pole zawierające maksymalnie 35 znaki alfanumeryczne.	
15	Miejsce realizacji transakcji	Kod identyfikacyjny rynku (MIC) zgodnie z ISO 10383, składający się z 4 znaków alfanumerycznych, zgodnie z art. 4 lit. b).	
16	Kompresja	Y = jeżeli kontrakt jest wynikiem kompresji N = jeżeli kontrakt nie jest wynikiem kompresji	
17	Cena/stawka	Maksymalnie 20 znaków numerycznych, wliczając cyfry po przecinku. Separatorsa dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatorsa dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki. Znaku liczby ujemnej (jeżeli go użyto) nie liczy się jako znaku numerycznego. Jeżeli cenę zgłasza się w ujęciu procentowym, należy ją wyrazić procentowo, przy czym 100 % zapisuje się jako »100«.	
18	Oznaczenie ceny	U = jednostki P = procentowo Y = stopa zwrotu	
19	Waluta ceny	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.	
20	Kwota nominalna	Maksymalnie 20 znaków numerycznych, wliczając cyfry po przecinku. Separatorsa dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatorsa dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki. Znaku liczby ujemnej (jeżeli go użyto) nie liczy się jako znaku numerycznego.	
21	Mnożnik ceny	Maksymalnie 20 znaków numerycznych, wliczając cyfry po przecinku. Separatorsa dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatorsa dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.	
22	Ilość	Maksymalnie 20 znaków numerycznych, wliczając cyfry po przecinku. Separatorsa dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatorsa dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.	
23	Płatność z góry	Maksymalnie 20 znaków numerycznych, wliczając cyfry po przecinku. Znak liczby ujemnej stosuje się, aby wskazać, że płatność została dokonana, a nie otrzymana. Separatorsa dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatorsa dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki. Znaku liczby ujemnej (jeżeli go użyto) nie liczy się jako znaku numerycznego.	

	Pole	Format	Rodzaje kontraktów pochodnych, których to dotyczy
24	Rodzaj dostawy	C = środki pieniężne P = fizyczna O = opcjonalne dla kontrahenta lub ustalane przez osobę trzecią	
25	Znacznik czasu realizacji transakcji	Data i czas zgodnie z ISO 8601 według formatu czasu UTC RRRR-MM-DDThh:mm:ssZ	
26	Data wejścia w życie	Data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD	
27	Termin zapadalności	Data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD	
28	Data zakończenia	Data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD	
29	Data rozrachunku	Data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD	
30	Rodzaj umowy ramowej	Pole na tekst dowolny o maksymalnej długości 50 znaków, wskazujący nazwę ewentualnej umowy ramowej.	
31	Wersja umowy ramowej	Data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR	
	Sekcja 2d – Ograniczanie ryzyka/Zgłaszanie		Wszystkie kontrakty
32	Znacznik czasu potwierdzenia	Data i czas zgodnie z ISO 8601 według formatu czasu UTC RRRR-MM-DDThh:mm:ssZ	
33	Sposób dokonania potwierdzenia	Y = potwierdzenie nieelektroniczne N = brak potwierdzenia E = potwierdzenie elektroniczne	
	Sekcja 2e – Rozliczanie		Wszystkie kontrakty
34	Obowiązek rozliczania	Y = tak N = nie	
35	Rozliczono	Y = tak N = nie	
36	Znacznik czasu rozliczenia	Data i czas zgodnie z ISO 8601 według formatu czasu UTC RRRR-MM-DDThh:mm:ssZ	
37	CCP	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodnie z ISO 17442. Kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych.	
38	Transakcja wewnątrzgrupowa	Y = tak N = nie	
	Sekcja 2f – Stopy procentowe		Instrumenty pochodne na stopę procentową
39	Stała stopa procentowa części 1	Maksymalnie 10 znaków numerycznych, wliczając cyfry po przecinku, wartość wyrażona procentowo, przy czym 100 % zapisuje się jako »100«.	

	Pole	Format	Rodzaje kontraktów pochodnych, których to dotyczy
		<p>Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.</p> <p>Znaku liczby ujemnej (jeżeli go użyto) nie liczy się jako znaku numerycznego.</p>	
40	Stała stopa procentowa części 2	<p>Maksymalnie 10 znaków numerycznych, wliczając cyfry po przecinku, wartość wyrażona procentowo, przy czym 100 % zapisuje się jako »100«.</p> <p>Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.</p> <p>Znaku liczby ujemnej (jeżeli go użyto) nie liczy się jako znaku numerycznego.</p>	
41	Długość okresu stosowania stałej stopy procentowej części 1	Licznik/mianownik, gdzie zarówno licznik, jak i mianownik to znaki numeryczne lub wyrażenie »dni faktyczne«, np. 30/360 lub dni faktyczne/365	
42	Długość okresu stosowania stałej stopy procentowej części 2	Licznik/mianownik, gdzie zarówno licznik, jak i mianownik to znaki numeryczne lub wyrażenie »dni faktyczne«, np. 30/360 lub dni faktyczne/365	
43	Częstotliwość płatności stałej stopy procentowej części 1 – okres czasu	<p>Okres czasu wskazujący, jak często kontrahenci wymieniają płatności, który podaje się, stosując następujące skróty:</p> <p>Y = rok</p> <p>M = miesiąc</p> <p>W = tydzień</p> <p>D = dzień</p>	
44	Częstotliwość płatności stałej stopy procentowej części 1 – mnożnik	<p>Będący liczbą całkowitą mnożnik okresu czasu wskazującego, jak często kontrahenci wymieniają płatności.</p> <p>Maksymalnie 3 znaki numeryczne.</p>	
45	Częstotliwość płatności stałej stopy procentowej części 2 – okres czasu	<p>Okres czasu wskazujący, jak często kontrahenci wymieniają płatności, który podaje się, stosując następujące skróty:</p> <p>Y = rok</p> <p>M = miesiąc</p> <p>W = tydzień</p> <p>D = dzień</p>	
46	Częstotliwość płatności stałej stopy procentowej części 2 – mnożnik	<p>Będący liczbą całkowitą mnożnik okresu czasu wskazującego, jak często kontrahenci wymieniają płatności.</p> <p>Maksymalnie 3 znaki numeryczne.</p>	
47	Częstotliwość płatności zmiennej stopy procentowej części 1 – okres czasu	<p>Okres czasu wskazujący, jak często kontrahenci wymieniają płatności, który podaje się, stosując następujące skróty:</p> <p>Y = rok</p> <p>M = miesiąc</p> <p>W = tydzień</p> <p>D = dzień</p>	
48	Częstotliwość płatności zmiennej stopy procentowej części 1 – mnożnik	<p>Będący liczbą całkowitą mnożnik okresu czasu wskazującego, jak często kontrahenci wymieniają płatności.</p> <p>Maksymalnie 3 znaki numeryczne.</p>	



	Pole	Format	Rodzaje kontraktów pochodnych, których to dotyczy
49	Częstotliwość płatności zmiennej stopy procentowej części 2 – okres czasu	Okres czasu wskazujący, jak często kontrahenci wymieniają płatności, który podaje się, stosując następujące skróty: Y = rok M = miesiąc W = tydzień D = dzień	
50	Częstotliwość płatności zmiennej stopy procentowej części 2 – mnożnik	Będący liczbą całkowitą mnożnik okresu czasu wskazującego, jak często kontrahenci wymieniają płatności. Maksymalnie 3 znaki numeryczne.	
51	Częstotliwość aktualizacji zmiennej stopy procentowej części 1 – okres czasu	Okres czasu wskazujący, jak często kontrahenci aktualizują zmienną stopę procentową, który podaje się, stosując następujące skróty: Y = rok M = miesiąc W = tydzień D = dzień	
52	Częstotliwość aktualizacji zmiennej stopy procentowej części 1 – mnożnik	Będący liczbą całkowitą mnożnik okresu czasu wskazującego, jak często kontrahenci aktualizują zmienną stopę procentową. Maksymalnie 3 znaki numeryczne.	
53	Częstotliwość aktualizacji zmiennej stopy procentowej części 2 – okres czasu	Okres czasu wskazujący, jak często kontrahenci aktualizują zmienną stopę procentową, który podaje się, stosując następujące skróty: Y = rok M = miesiąc W = tydzień D = dzień	
54	Częstotliwość aktualizacji zmiennej stopy procentowej części 2 – mnożnik	Będący liczbą całkowitą mnożnik okresu czasu wskazującego, jak często kontrahenci aktualizują zmienną stopę procentową. Maksymalnie 3 znaki numeryczne.	
55	Zmienna stopa procentowa części 1	Nazwa indeksu, od którego zależy zmienna stopa procentowa: »EONA« – EONIA »EONS« – EONIA SWAP »EURI« – EURIBOR »EUUS« – EURODOLLAR »EUCH« – EuroSwiss »GCFR« – GCF REPO »ISDA« – ISDAFIX »LIBI« – LIBID »LIBO« – LIBOR »MAAA« – Muni AAA »PFAN« – Pfandbriefe »TIBO« – TIBOR »STBO« – STIBOR »BBSW« – BBSW	

	Pole	Format	Rodzaje kontraktów pochodnych, których to dotyczy
		»JIBA« – JIBAR »BUBO« – BUBOR »CDOR« – CDOR »CIBO« – CIBOR »MOSP« – MOSPRIM »NIBO« – NIBOR »PRBO« – PRIBOR »TLBO« – TELBOR »WIBO« – WIBOR »TREA« – Treasury »SWAP« – SWAP »FUSW« – Future SWAP lub maksymalnie 25 znaków alfanumerycznych, jeżeli danej stopy referencyjnej nie uwzględniono w powyższym wykazie.	
56	Okres odniesienia dla zmiennej stopy procentowej części 1 – okres czasu	Okres czasu wskazujący okres odniesienia, który podaje się, stosując następujące skróty: Y = rok M = miesiąc W = tydzień D = dzień	
57	Okres odniesienia dla zmiennej stopy procentowej części 1 – mnożnik	Będący liczbą całkowitą mnożnik okresu czasu wskazującego okres odniesienia. Maksymalnie 3 znaki numeryczne.	
58	Zmienna stopa procentowa części 2	Nazwa indeksu, od którego zależy zmienna stopa procentowa: »EONA« – EONIA »EONS« – EONIA SWAP »EURI« – EURIBOR »EUUS« – EURODOLLAR »EUCH« – EuroSwiss »GCFR« – GCF REPO »ISDA« – ISDAFIX »LIBI« – LIBID »LIBO« – LIBOR »MAAA« – Muni AAA »PFAN« – Pfandbriefe »TIBO« – TIBOR »STBO« – STIBOR »BBSW« – BBSW »JIBA« – JIBAR »BUBO« – BUBOR »CDOR« – CDOR »CIBO« – CIBOR »MOSP« – MOSPRIM »NIBO« – NIBOR »PRBO« – PRIBOR	

	Pole	Format	Rodzaje kontraktów pochodnych, których to dotyczy
		»TLBO« – TELBOR »WIBO« – WIBOR »TREA« – Treasury »SWAP« – SWAP »FUSW« – Future SWAP lub maksymalnie 25 znaków alfanumerycznych, jeżeli danej stopy referencyjnej nie uwzględniono w powyższym wykazie.	
59	Okres odniesienia dla zmiennej stopy procentowej części 2 – okres czasu	Okres czasu wskazujący okres odniesienia, który podaje się, stosując następujące skróty: Y = rok M = miesiąc W = tydzień D = dzień	
60	Okres odniesienia dla zmiennej stopy procentowej części 2 – mnożnik	Będący liczbą całkowitą mnożnik okresu czasu wskazującego okres odniesienia. Maksymalnie 3 znaki numeryczne.	
	Sekcja 2 g – Transakcje walutowe		Walutowe instrumenty pochodne
61	Waluta dostawy 2	Trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217.	
62	Kurs walutowy 1	Maksymalnie 10 znaków numerycznych, wliczając cyfry po przecinku. Separatorsa dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki. Znaku liczby ujemnej (jeżeli go użyto) nie liczy się jako znaku numerycznego.	
63	Terminowy kurs walutowy	Maksymalnie 10 znaków numerycznych, wliczając cyfry po przecinku. Separatorsa dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki. Znaku liczby ujemnej (jeżeli go użyto) nie liczy się jako znaku numerycznego.	
64	Podstawa kursu walutowego	Dwa kody walut zgodnie z ISO 4217 rozdzielone »/«. Pierwszy kod waluty wskazuje walutę bazową, a drugi kod waluty wskazuje walutę kwotowaną.	
	Sekcja 2h – Towary i uprawnienia do emisji		Towarowe instrumenty pochodne i instrumenty pochodne na uprawnienia do emisji
	Uwagi ogólne		
65	Towarowy instrument bazowy	AG = produkt rolny EN = energia	

	Pole	Format	Rodzaje kontraktów pochodnych, których to dotyczy
		FR = towary stanowiące fracht ME = metale IN = indeks EV = środowisko naturalne EX = towary egzotyczne OT = inne	
66	Szczegółowe informacje dotyczące towaru	<p><i>Produkty rolne</i></p> <p>GO = ziarna zbóż, nasiona roślin oleistych DA = produkty mleczne LI = zwierzęta gospodarskie FO = produkty gospodarki leśnej SO = nietrwałe produkty rolne SF = owoce morza OT = inne</p> <p><i>Energia</i></p> <p>OI = ropa naftowa NG = gaz ziemny CO = węgiel EL = energia elektryczna IE = obejmujące różne nośniki energii OT = inne</p> <p><i>Towary stanowiące fracht</i></p> <p>DR = suche WT = mokre OT = inne</p> <p><i>Metale</i></p> <p>PR = metale szlachetne NP = metale nieszlachetne</p> <p><i>Środowisko naturalne</i></p> <p>WE = pogoda EM = emisje OT = inne</p>	
	Energia		
67	Miejsce lub strefa dostawy	Kod EIC złożony z 16 znaków alfanumerycznych. Pole powtarzalne.	
68	Punkt połączenia międzysystemowego	Kod EIC złożony z 16 znaków alfanumerycznych.	
69	Rodzaj obciążenia	BL = obciążenie podstawowe PL = obciążenie szczytowe OP = obciążenie pozaszczytowe BH = godzinowe/bloki godzinowe SH = kształtowanie ( <i>shaped</i> ) GD = doba gazowa OT = inne	

	Pole	Format	Rodzaje kontraktów pochodnych, których to dotyczy
	Powtarzalna część pól 70–77		
70	Okresy dostawy dla obciążeń	hh:mmZ	
71	Data i godzina rozpoczęcia dostawy	Data i czas zgodnie z ISO 8601 według formatu czasu UTC RRRR-MM-DDThh:mm:ssZ	
72	Data i godzina zakończenia dostawy	Data i czas zgodnie z ISO 8601 według formatu czasu UTC RRRR-MM-DDThh:mm:ssZ	
73	Czas trwania	N = minuty H = godzina D = dzień W = tydzień M = miesiąc Q = kwartał S = sezon Y = rok O = inne	
74	Dni tygodnia	WD = dni powszednie WN = weekend MO = poniedziałek TU = wtorek WE = środa TH = czwartek FR = piątek SA = sobota SU = niedziela Dopuszcza się wiele wartości rozdzielonych »/«.	
75	Wielkość dostawy	Maksymalnie 20 znaków numerycznych, wliczając cyfry po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki. Znaku liczby ujemnej (jeżeli go użyto) nie liczy się jako znaku numerycznego.	
76	Jednostka ilości	KW KWh/h KWh/d MW MWh/h MWh/d GW GWh/h GWh/d	

	Pole	Format	Rodzaje kontraktów pochodnych, których to dotyczy
		Therm/d KTherm/d MTherm/d cm/d mcm/d	
77	Cena za ilość w okresie dostawy	Maksymalnie 20 znaków numerycznych, wliczając cyfry po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki. Znaku liczby ujemnej (jeżeli go użyto) nie liczy się jako znaku numerycznego.	
	Sekcja 2i – Opcje		Kontrakty obejmujące opcję
78	Rodzaj opcji	P = opcja sprzedaży C = opcja kupna O = jeżeli nie można określić, czy chodzi o opcję kupna, czy opcję sprzedaży	
79	Tryb wykonania opcji	A = opcja amerykańska B = opcja bermudzka E = opcja europejska S = opcja azjatycka Dopuszcza się więcej niż jedną wartość.	
80	Cena wykonania (górnny/dolny pułap)	Maksymalnie 20 znaków numerycznych, wliczając cyfry po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki. Znaku liczby ujemnej (jeżeli go użyto) nie liczy się jako znaku numerycznego. Jeżeli cenę wykonania zgłasza się w ujęciu procentowym, należy ją wyrazić procentowo, przy czym 100 % zapisuje się jako »100«.	
81	Oznaczenie ceny wykonania	U = jednostki P = procentowo Y = stopa zwrotu	
82	Termin zapadalności instrumentu bazowego	Data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD	
	Sekcja 2j – Kredytowe instrumenty pochodne		
83	Uprzywilejowanie	SNDB = Uprzywilejowane, takie jak niezabezpieczone zobowiązania uprzywilejowane (zobowiązania korporacyjne/finansowe), dług państwowy w walucie obcej (zobowiązania rządowe),	

	Pole	Format	Rodzaje kontraktów pochodnych, których to dotyczy
		SBOD = podporządkowane, takie jak zobowiązania podporządkowane lub lower Tier 2 (banki), zobowiązania podporządkowane o dalszej kolejności spłaty lub upper Tier 2 (banki), OTHR = inne, takie jak akcje uprzywilejowane lub kapitał Tier 1 (banki) lub inne kredytowe instrumenty pochodne	
84	Podmiot referencyjny	ISO 3166 – kod kraju składający się z dwóch liter lub ISO 3166-2 – kod kraju składający się z dwóch liter, po którym następuje dywiz »« i kod podokręgu kraju składający się z maksymalnie trzech znaków alfanumerycznych lub identyfikator podmiotu prawnego (LEI) zgodnie z ISO 17442 – kod składający się z 20 znaków alfanumerycznych.	
85	Częstotliwość płatności	MNTH = miesięcznie QURT = kwartalnie MIAN = półrocznie YEAR = rocznie	
86	Podstawa obliczenia	Licznik/mianownik, gdzie zarówno licznik, jak i mianownik stanowią znaki numeryczne lub wyrażenie »dni faktyczne«, np. 30/360 lub dni faktyczne/365	
87	Seria	Pole zawierające maksymalnie 5 znaków (liczba całkowita).	
88	Wersja	Pole zawierające maksymalnie 5 znaków (liczba całkowita).	
89	Współczynnik indeksu ( <i>index factor</i> )	Maksymalnie 10 znaków numerycznych, wliczając cyfry po przecinku. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.	
90	Transza	T = podzielone na transze U = niepodzielone na transze	
91	Punkt inicjujący	Maksymalnie 10 znaków numerycznych, wliczając cyfry po przecinku, wartość wyrażona jako ułamek dziesiętny zawierający się w przedziale od 0 do 1. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.	
92	Punkt kończący	Maksymalnie 10 znaków numerycznych, wliczając cyfry po przecinku, wartość wyrażona jako ułamek dziesiętny zawierający się w przedziale od 0 do 1. Separatora dziesiętnego nie liczy się jako znaku numerycznego. Jako separatora dziesiętnego (jeżeli występuje) należy użyć kropki.	
	Sekcja 2k – Zmiany kontraktu		
93	Rodzaj czynności	N = New (nowe) M = Modify (zmiana)	

	Pole	Format	Rodzaje kontraktów pochodnych, których to dotyczy
		E = Error (błąd) C = Early Termination (przedterminowe zakończenie) R = Correction (korekta) Z = Compression (kompresja) V = Valuation update (aktualizacja wyceny) P = Position component (część składowa pozycji)	
94	Poziom	T = transakcja P = pozycja”	