ДЕЛЕГИРАН РЕГЛАМЕНТ (ЕС) 2017/590 НА КОМИСИЯТА  
от 28 юли 2016 година

за допълнение на Регламент (ЕС) № 600/2014 на Европейския парламент и на Съвета по  
отношение на регулаторните технически стандарти за докладването на сделки пред  
компетентните органи  
(текст от значение за ЕИП)

*ПРИЛОЖЕНИЕ I*

*Таблица 1*

**Легенда за таблица 2**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| СИМВОЛ | ТИП ДАННИ | ОПРЕДЕЛЕНИЕ |
| {ALPHANUM-n} | До n на брой буквено-цифрови знака | Поле за свободен текст. |
| {CFI CODE} | 6 знака | CFI код по ISO 10962 |
| {COUNTRYCODE 2} | 2 буквено-цифрови знака | 2-буквен код на държавата по ISO 3166-1 |
| {CURRENCYCODE 3} | 3 буквено-цифрови знака | 3-буквен код на валутата по ISO 4217 |
| {DATE\_TIME\_FORMAT} | Формат за представяне на дати и време по ISO 8601 | Дата и време в следния формат:  ГГГГ-ММ-ДДТчч:мм:сс.сссссс2.   * „ГГГГ“ е годината, * „ММ“ е месецът, * „ДД“ е денят, * „Т“ означава, че трябва да се използва буквата „Т“, * „чч“ е часът, * „мм“ е минутата, * „сс.сссссс“ е секундата и частите от секундата, * Z е времето по UTC.   Датите и часовете се отчитат по UTC. |
| {DATEFORMAT} | Формат за дати по ISO 8601 | Датите се представят в следния формат:  ГГГГ-ММ-ДД. |
| {DECIMAL-n/m} | Десетично число с общо до n ци­фри, от които до m цифри може да са цифри след десетичния знак | Цифрово поле както за положителни, така и за отрицателни стойно­сти:   * десетичният знак е „.“ (точка), * пред отрицателните числа се поставя „-“ (минус).   Стойностите се закръгляват и не се съкращават. |
| {INDEX} | 4 буквени знака | „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 |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| СИМВОЛ | ТИП ДАННИ | ОПРЕДЕЛЕНИЕ |
|  |  | „CDOR“ — CDOR  „CIBO“ — CIBOR  „MOSP“ — MOSPRIM  „NIBO“ — NIBOR  „PRBO“ — PRIBOR  „TLBO“ — TELBOR  „WIBO“ — WIBOR  „TREA“ — Treasury  „SWAP“ — SWAP  „FUSW“ — Future SWAP |
| {INTEGER-n} | Цяло число с общо до n цифри | Цифрово поле както за положителни, така и за отрицателни стойно­сти на цели числа. |
| {ISIN} | 12 буквено-цифрови знака | ISIN код по ISO 6166. |
| {LEI} | 20 буквено-цифрови знака | Идентификационен код за юридически лица по ISO 17442. |
| {MIC} | 4 буквено-цифрови знака | Идентификационен код на пазара по ISO 10383 |
| {NATIONAL\_ID} | 35 буквено-цифрови знака | Идентификационният код се съставя съгласно член 6 и таблицата от приложение II. |

*Таблица 2*

Данни, които трябва се докладват в отчетите за сделките

Всички полета са задължителни, освен ако е посочено друго.

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| № | ПОЛЕ | СЪДЪРЖАНИЕ, КОЕТО СЕ ДОКЛАДВА | ФОРМАТ И СТАНДАРТИ, КОИТО СЕ ИЗПОЛЗВАТ ЗА ДОКЛАДВАНЕТО |
| 1 | Статус на отчета | Указване дали отчетът за сделката е нов, или се касае за от­меняне. | „NEWT“ — Нов  „CANC“ — Отмяна |
| 2 | Референтен номер на сделката | Идентификационен номер, който при изпълняващия посред­ник е уникален за всеки отчет за сделка.  Когато съгласно член 26, параграф 5 от Регламент (ЕС) № 600/2014 мястото на търговия подава отчета от името на посредник, който не попада под действието на Регламент (ЕС) № 600/2014, мястото на търговия попълва в това поле номер, който се генерира вътрешно от мястото на търговия и е уникален за всеки отчет за сделка, подаден от мястото на търговия. | {ALPHANUM-52} |
| 3 | Идентификационен код на сделката, определен от мя­стото на търговия | Този номер се генерира от местата на търговия и се предос­тавя както на купувача, така и на продавача, съгласно член 12 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/580 (1).  Това поле се изисква само за пазарната страна на сделка, из­пълнена на дадено място на търговия. | {ALPHANUM-52} |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| № | ПОЛЕ | СЪДЪРЖАНИЕ, КОЕТО СЕ ДОКЛАДВА | ФОРМАТ И СТАНДАРТИ, КОИТО СЕ ИЗПОЛЗВАТ ЗА ДОКЛАДВАНЕТО |
| 4 | Идентификационен код на изпълняващия субект | Код, използван за идентифициране на субекта, който изпъл­нява сделката. | {LEI} |
| 5 | Инвестиционен посредник, обхванат от Директива 2014/65/ЕС | Указва дали субектът, който е идентифициран в поле 4, е инвестиционен посредник, обхванат от член 4, параграф 1 от Директива 2014/65/ЕС. | „true“ — да „false“ — не |
| 6 | Идентификационен код на подаващия субект | Код, използван за идентифициране на субекта, който подава отчета за сделката до компетентния орган в съответствие с член 26, параграф 7 от Регламент (ЕС) № 600/2014.  Когато отчетът се подава пряко от изпълняващия посредник до компетентния орган, в него се посочва кодът LEI на из­пълняващия посредник (когато изпълняващият посредник е юридическо лице).  Когато отчетът се подава от място на търговия, в него се по­сочва кодът LEI на оператора на мястото на търговия.  Когато отчетът се подава от ОМД, в него се попълва кодът LEI на ОМД. | {LEI} |

**Данни за купувача**

— За съвместни сметки полета 7—11 се повтарят за всеки купувач.

— Когато сделката се отнася до предадено нареждане, което е изпълнило условията за предаване, посочени в член 4, получаващият посредник попълва в полета 7—15 в отчета си на получаващ посредник информацията, получена от предаващия посредник.

— Когато предаването се отнася до предадено нареждане, което не е изпълнило условията за предаване, посочени в член 4, получа­ващият посредник третира предаващия посредник като купувач.

7 Идентификационен код купувача

на

Код, използван за идентифициране совия инструмент.

на придобиващия финан-

Когато придобиващият е юридическо лице, се използва ко­дът LEI на придобиващия.

Когато придобиващият не е юридическо лице, се използва идентификационният код, посочен в член 6.

{LEI}

{MIC}

{NATIONAL\_ID}

„INTC“

Когато сделката е изпълнена на място на търговия или на платформа за организирана търговия, което/която се намира извън Съюза и използва централен контрагент (ЦК), и когато самоличността на придобиващия не е разкрита, се използва кодът LEI на ЦК.

Когато сделката е извършена на място на търговия или на платформа за организирана търговия, което/която се намира извън Съюза и не използва ЦК, и когато самоличността на придобиващия не е разкрита, се използва кодът MIC на мя­стото на търговия или на платформата за организирана тър­говия, което/която се намира извън Съюза.

Когато придобиващият е инвестиционен посредник, който действа като систематичен участник (СУ), се използва кодът LEI на СУ.

„INTC“ се използва за обозначаване на агрегираната сметка на клиента при инвестиционния посредник, за да се до­кладва прехвърляне към или от тази сметка със свързано разпределение за отделния(те) клиент(и) съответно от или към въпросната сметка.

ПОЛЕ

СЪДЪРЖАНИЕ, КОЕТО СЕ ДОКЛАДВА

ФОРМАТ И СТАНДАРТИ,  
КОИТО СЕ ИЗПОЛЗВАТ ЗА  
ДОКЛАДВАНЕТО

В случай на опции и суапции купувачът е контрагентът, който притежава правото да упражни опцията, а продавачът е контрагентът, който продава опцията и получава премия.

В случай на фючърси и форуърди, различни от фючърси и форуърди, свързани с валути, купувачът е контрагентът, който купува инструмента, а продавачът е контрагентът, който продава инструмента.

В случай на суапове, свързани с ценни книжа, купувачът е контрагентът, който носи риска от промяна на цената на ба­зовата ценна книга и получава сумата на ценната книга. Продавачът е контрагентът, който плаща сумата на ценната книга.

В случай на суапове, свързани с лихвени проценти или ин­флационни индекси, купувачът е контрагентът, който плаща фиксираната ставка. Продавачът е контрагентът, който полу­чава фиксираната ставка. В случай на базови суапове (лих­вени суапове за размяна на плаващи лихвени проценти), ку­пувачът е контрагентът, който плаща спреда, а продавачът е контрагентът, който получава спреда.

В случай на суапове и форуърди, свързани с валути, и на кръстосани валутни суапове, купувачът е контрагентът, по­лучаващ валутата, която се явява първа при подреждане по азбучен ред съгласно стандарт ISO 4217, а продавачът е контрагентът, който предоставя тази валута.

В случай на суап, свързан с дивиденти, купувачът е контра­гентът, който получава равностойността на действителните плащания на дивиденти. Продавачът е контрагентът, който плаща дивидента и получава фиксираната ставка.

В случай на дериватни инструменти за прехвърляне на кре­дитен риск, с изключение на опции и суапции, купувачът е контрагентът, който купува защитата. Продавачът е контра­гентът, който продава защитата.

В случай на договор за деривати, свързан със стоки, купува­чът е контрагентът, който получава стоката, посочена в от­чета, а продавачът е контрагентът, който предоставя тази стока.

В случай на споразумения за лихвен форуърд, купувачът е контрагентът, който плаща фиксираната ставка, а продавачът е контрагентът, който получава фиксираната ставка.

При увеличение на номиналната стойност купувачът е иден­тичен на придобиващия финансовия инструмент в рамките на първоначалната сделка, а продавачът е идентичен на ли­цето, което се освобождава от финансовия инструмент в рамките на първоначалната сделка.

При намаление на номиналната стойност купувачът е иден­тичен на лицето, което се освобождава от финансовия ин­струмент в рамките на първоначалната сделка, а продавачът е идентичен на придобиващия финансовия инструмент в рамките на първоначалната сделка.

Допълнителни данни

— Полета 8—15 са приложими само ако купувачът е клиент.

— Полета 9—11 са приложими само ако купувачът е физическо лице.

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| № | ПОЛЕ | СЪДЪРЖАНИЕ, КОЕТО СЕ ДОКЛАДВА | ФОРМАТ И СТАНДАРТИ, КОИТО СЕ ИЗПОЛЗВАТ ЗА ДОКЛАДВАНЕТО |
| 8 | Държава на клона за купу­вача | Когато придобиващият е клиент, в това поле се идентифи­цира държавата на клона, който е получил нареждането от клиента или е взел инвестиционното решение от името на клиента в съответствие с дискреционен мандат, даден му от клиента, както се изисква по член 14, параграф 3.  Когато тази дейност не е извършена от клон, в полето се по­пълва кодът на държавата членка по произход на инвести­ционния посредник или кодът на държавата, в която е уста­новено главното управление или седалището на инвести­ционния посредник (в случай на посредници от трета дър­жава).  Когато сделката се отнася до предадено нареждане, което е изпълнило условията за предаване, посочени в член 4, това поле се попълва, като се използва информацията, получена от предаващия посредник. | {COUNTRYCODE\_2} |
| 9 | Купувач — собствено(и) име(на) | Пълното(ите) собствено(и) име(на) на купувача. В случай че има повече от едно собствено име, в това поле се посочват всички имена, като се отделят със запетая. | {ALPHANUM-140} |
| 10 | Купувач — фамилно(и) име(на) | Пълното(ите) фамилно(и) име(на) на купувача. В случай че има повече от едно фамилно име, в това поле се посочват всички фамилни имена, като се отделят със запетая. | {ALPHANUM-140} |
| 11 | Купувач — дата на раждане | Дата на раждане на купувача. | {DATEFORMAT} |

Лице, което взема решение от името на купувача

— Полета 12—15 са приложими само ако лицето, което взема решението, действа въз основа на правомощие за представителство.

12

Код на лицето, което взема решение от името на купу­вача

Код, използван за идентифициране на лицето, което взема решението за придобиване на финансовия инструмент.

Когато решението се взема от инвестиционен посредник, в това поле се попълват идентификационните данни на инве­стиционния посредник, а не на физическото лице, което взема инвестиционното решение.

{LEI}

{NATIONAL\_ID}

Когато лицето, което взема решението, е юридическо лице, се използва кодът LEI на лицето, което взема решението.

Когато лицето, което взема решението, не е юридическо лице, се използва идентификационният код, посочен в член 6.

Данни за лицето, което взема решение от името на купувача

— Полета 13—15 са приложими само ако лицето, което взема решението, е физическо лице.

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 13 | Лице, което взема решението за купуване — собствено(и) име(на) | Пълното(ите) собствено(и) име(на) на лицето, което взема ре­шението от името на купувача. В случай че има повече от едно собствено име, в това поле се посочват всички имена, като се отделят със запетая. | {ALPHANUM-140} |
| 14 | Лице, което взема решението за купуване — фамилно(и) име(на) | Пълното(ите) фамилно(и) име(на) на лицето, което взема ре­шението от името на купувача. В случай че има повече от едно фамилно име, в това поле се посочват всички фамилни имена, като се отделят със запетая. | {ALPHANUM-140} |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| № | ПОЛЕ | СЪДЪРЖАНИЕ, КОЕТО СЕ ДОКЛАДВА | ФОРМАТ И СТАНДАРТИ, КОИТО СЕ ИЗПОЛЗВАТ ЗА ДОКЛАДВАНЕТО |
| 15 | Лице, което взема решението за купуване — дата на ра­ждане | Дата на раждане на лицето, което взема решението от името на купувача. | {DATEFORMAT} |

Данни за продавача и лицето, което взема решението

— При съвместни сметки полета 16—20 се повтарят за всеки продавач.

— Когато сделката от името на продавача се отнася до предадено нареждане, което е изпълнило условията за предаване, посочени в член 4, получаващият посредник попълва в полета 16—24 в отчета си на получаващ посредник информацията, получена от пре­даващия посредник.

— Когато предаването се отнася до предадено нареждане, което не е изпълнило условията за предаване, посочени в член 4, получа­ващият посредник третира предаващия посредник като продавач.

16

Идентификационен

продавача

код

на

Код, използван за идентифициране на лицето, което се осво­бождава от финансовия инструмент.

Когато лицето, което се освобождава от финансовия инстру­мент, е юридическо лице, се използва кодът LEI на лицето, което се освобождава от финансовия инструмент.

{LEI}

{MIC}

{NATIONAL\_ID}

„INTC“

Когато лицето, което се освобождава от финансовия инстру­мент, не е юридическо лице, се използва идентификацион­ният код, посочен в член 6.

Когато сделката е изпълнена на място на търговия или на платформа за организирана търговия, което/която се намира извън Съюза и използва ЦК, и когато самоличността на ли­цето, което се освобождава от финансовия инструмент, не е разкрита, се използва кодът LEI на ЦК.

Когато сделката е изпълнена на място на търговия или плат­форма за организирана търговия, което/която се намира из­вън Съюза и не използва ЦК, и когато самоличността на ли­цето, което се освобождава от финансовия инструмент, не е разкрита, се използва кодът MIC на мястото на търговия или платформата за организирана търговия, което/която се намира извън Съюза.

Когато лицето, което се освобождава от финансовия инстру­мент, е инвестиционен посредник, който действа като СУ, се използва кодът LEI на СУ.

„INTC“ се използва за обозначаване на агрегираната сметка на клиента при инвестиционния посредник, за да се до­кладва прехвърляне към или от тази сметка със свързано разпределение за отделния(те) клиент(и) съответно от или към въпросната сметка.

В случай на опции и суапции купувачът е контрагентът, който притежава правото да упражни опцията, а продавачът е контрагентът, който продава опцията и получава премия.

В случай на фючърси и форуърди, различни от фючърси и форуърди, свързани с валути, купувачът е контрагентът, който купува инструмента, а продавачът е контрагентът, който продава инструмента.

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| № | ПОЛЕ | СЪДЪРЖАНИЕ, КОЕТО СЕ ДОКЛАДВА | ФОРМАТ И СТАНДАРТИ, КОИТО СЕ ИЗПОЛЗВАТ ЗА ДОКЛАДВАНЕТО |
|  |  | В случай на суапове, свързани с ценни книжа, купувачът е контрагентът, който носи риска от промяна на цената на ба­зовата ценна книга и получава сумата на ценната книга. Продавачът е контрагентът, който плаща сумата на ценната книга.  В случай на суапове, свързани с лихвени проценти или ин­флационни индекси, купувачът е контрагентът, който плаща фиксираната ставка. Продавачът е контрагентът, който полу­чава фиксираната ставка. В случай на базови суапове (лих­вени суапове за размяна на плаващи лихвени проценти), ку­пувачът е контрагентът, който плаща спреда, а продавачът е контрагентът, който получава спреда.  В случай на суапове и форуърди, свързани с валути, и на кръстосани валутни суапове, купувачът е контрагентът, по­лучаващ валутата, която се явява първа при подреждане по азбучен ред съгласно стандарт ISO 4217, а продавачът е контрагентът, който предоставя тази валута.  В случай на суап, свързан с дивиденти, купувачът е контра­гентът, който получава равностойността на действителните плащания на дивиденти. Продавачът е контрагентът, който плаща дивидента и получава фиксираната ставка.  В случай на дериватни инструменти за прехвърляне на кре­дитен риск, с изключение на опции и суапции, купувачът е контрагентът, който купува защитата. Продавачът е контра­гентът, който продава защитата.  В случай на договор за деривати, свързан със стоки, купува­чът е контрагентът, който получава стоката, посочена в от­чета, а продавачът е контрагентът, който предоставя тази стока.  В случай на споразумения за лихвен форуърд, купувачът е контрагентът, който плаща фиксираната ставка, а продавачът е контрагентът, който получава фиксираната ставка.  При увеличение на номиналната стойност продавачът е идентичен на лицето, което се освобождава от финансовия инструмент в рамките на първоначалната сделка.  При намаление на номиналната стойност продавачът е иден­тичен на придобиващия финансовия инструмент в рамките на първоначалната сделка. |  |
| 17—  24 | **Полета 17—24 отразяват всички полета, свързани с купувача, с номера 8—15 (данни взема решение), но за продавача.** | | **за купувача и лицето, което** |

**Данни за предаването**

— Полета 26 и 27 се попълват само за отчети за сделки от получаващ посредник, когато са били изпълнени всички условия за пре­даването съгласно член 4.

— Когато посредникът действа както като получаващ посредник, така и като предаващ посредник, той попълва поле 25, за да укаже, че е предаващ посредник, и попълва полета 26 и 27 от своя гледна точка в качеството си на получаващ посредник.

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 25 | Показател за предаване на на­реждане | „true“ се попълва от предаващия посредник в отчета на пре­даващия посредник, когато не са изпълнени условията за предаване, посочени в член 4  „false“ — във всички останали случаи | „true“  „false“ |
| 26 | Идентификационен код на предаващия посредник за ку­пувача | Код, използван за идентифициране на посредника, който предава нареждането.  Получаващият посредник попълва в това поле от отчета на получаващ посредник идентификационния код, предоставен от предаващия посредник. | {LEI} |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| № | ПОЛЕ | СЪДЪРЖАНИЕ, КОЕТО СЕ ДОКЛАДВА | ФОРМАТ И СТАНДАРТИ, КОИТО СЕ ИЗПОЛЗВАТ ЗА ДОКЛАДВАНЕТО |
| 27 | Идентификационен код на предаващия посредник за продавача | Код, използван за идентифициране на посредника, който предава нареждането.  Получаващият посредник попълва в това поле от отчета на получаващ посредник идентификационния код, предоставен от предаващия посредник. | {LEI} |

**Данни за сделката**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 28 | Дата и време на търгуване | Дата и време на изпълнение на сделката.  За сделки, изпълнени на място на търгуване, нивото на де­тайлност се определя в съответствие с изискванията, посо­чени в член 3 от Делегиран регламент (ЕС) 2017/574 на Ко­мисията (2).  За сделки, които не са изпълнени на място на търговия, да­тата и времето са датата и времето, когато контрагентите са договорили съдържанието на следните полета: количество, цена, валути в полета 31, 34 и 44, идентификационен код на инструмента, класификация на инструмента и код на ба­зовия инструмент, ако е приложимо. За сделки, които не са изпълнени на място на търговия, докладваното време трябва да бъде поне до най-близката секунда.  Когато сделката е резултат от нареждане, предадено на трета страна от изпълняващия посредник от името на клиент, ко- гато не са изпълнени условията за предаване, посочени в член 4, това са датата и времето на сделката, а не времето на предаване на нареждането. | {DATE\_TIME\_FORMAT} |
| 29 | Търгуване в качеството на | Посочва се дали сделката е резултат от извършването от страна на изпълняващия посредник на търговия за собствена сметка, опосредена чрез насрещни сделки, съгласно член 4, параграф 1, точка 38 от Директива 2014/65/ЕС, или търго­вия за собствена сметка съгласно член 4, параграф 1, точка 6 от Директива 2014/65/ЕС.  Когато сделката не е резултат от извършването от страна на изпълняващия посредник на търговия за собствена сметка, опосредена чрез насрещни сделки, или търговия за соб­ствена сметка, в полето се посочва, че сделката е изпълнена в друго качество. | „DEAL“ — търговия за соб­ствена сметка  „MTCH“ — търговия за соб­ствена сметка, опосредена чрез насрещни сделки  „AOTC“ — друго качество |
| 30 | Количество | Броят на единиците от финансовия инструмент или броят на договорите за деривати в рамките на сделката.  Номиналната или паричната стойност на финансовия ин­струмент.  При финансови залагания въз основа на спред, количеството е заложената парична стойност на пункт промяна в базовия финансов инструмент.  При суапове за кредитно неизпълнение, количеството е но­миналната стойност на придобиването на или освобождава­нето от защита.  При увеличение или намаление на номиналната стойност на договори за деривати, броят отразява абсолютната стойност на промяната и се изразява като положително число.  Информацията, която се докладва в това поле, трябва да от­говаря на стойностите, посочени в полета 33 и 46. | {DECIMAL-18/17} — ако количеството е изразено като брой единици  {DECIMAL-18/5} — ако ко­личеството е изразено като парична или номинална стойност |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| № | ПОЛЕ | СЪДЪРЖАНИЕ, КОЕТО СЕ ДОКЛАДВА | ФОРМАТ И СТАНДАРТИ, КОИТО СЕ ИЗПОЛЗВАТ ЗА ДОКЛАДВАНЕТО |
| 31 | Валута на количеството | Валута, в която е изразено количеството.  Приложимо е само ако количеството е изразено като номи­нална или парична стойност. | {CURRENCYCODE\_3} |
| 32 | Увеличение/намаление на но­миналната стойност на дери­ват | Посочва се дали сделката представлява увеличение, или на­маление на номиналната стойност на договор за деривати.  Това поле е приложимо само когато има промяна в номи­налната стойност на договор за деривати. | „INCR“ — увеличение „DECR“ — намаление |
| 33 | Цена | Цената, на която е сключена сделката, с изключение, ако е приложимо, на комисионата и начислената лихва.  В случай на договори за опции, това е премията на договора за деривати на базов инструмент или индексен пункт.  В случай на финансови залагания на основата на спред, това е референтната цена на базовия инструмент.  В случай на суапове за кредитно неизпълнение (СКН), това е купонът в базисни пунктове.  Когато цената се докладва в парично изражение, тя се по­сочва в основната валута.  Когато цената не е налична към дадения момент, но пред­стои да бъде определена, стойността е „PNDG“.  Когато цената не е приложима, стойността е „NOAP“.  Информацията, която се докладва в това поле, трябва да от­говаря на стойностите, посочени в полета 30 и 46. | {DECIMAL-18/13} — в слу­чай че цената е изразена като парична стойност  {DECIMAL-11/10} — в слу­чай че цената е изразена като процент или доходност  {DECIMAL-18/17} — в слу­чай че цената е изразена в базисни пунктове  „PNDG“— в случай че цената не е налична  „NOAP“ — в случай че це­ната не е приложима |
| 34 | Валута на цената | Валутата, в която е изразена цената (приложимо, ако цената е изразена като парична стойност). | {CURRENCYCODE\_3} |
| 35 | Нетна сума | Нетната сума на сделката означава паричната сума, която се плаща от купувача на дълговия инструмент при сетълмента на сделката. Тази парична сума е равна на: (чистата цена \* номиналната стойност) + всички начислени купони. В ре­зултат на това в нетната сума на сделката не се включват никакви комисиони или други такси, които се начисляват на купувача на дълговия инструмент.  Това поле е приложимо само когато финансовият инстру­мент е дългов. | {DECIMAL-18/5} |
| 36 | Място | Идентификация на мястото, на което е изпълнена сделката.  За сделки, които са изпълнени на място на търговия, чрез систематичен участник (СУ) или на платформа за организи­рана търговия, което/който/която се намира извън Съюза, се използва кодът MIC по ISO 10383 за съответния пазарен сегмент. Когато за съответния сегмент не съществува MIC, се използва оперативният MIC.  За финансови инструменти, които са допуснати до търговия или търгувани на място на търговия или за които е отпра­вено искане за допускане, когато сделката с този финансов инструмент не е изпълнена на място на търговия, чрез СУ или на платформа за организирана търговия, които се нами­рат извън Съюза, или когато инвестиционният посредник не знае, че търгува с друг инвестиционен посредник, действащ като СУ, се използва MIC код „XOFF“. | {MIC} |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| № | ПОЛЕ | СЪДЪРЖАНИЕ, КОЕТО СЕ ДОКЛАДВА | ФОРМАТ И СТАНДАРТИ, КОИТО СЕ ИЗПОЛЗВАТ ЗА ДОКЛАДВАНЕТО |
|  |  | За финансови инструменти, които не са допуснати до търго­вия или търгувани на място на търговия или за които не е отправено искане за допускане и които не се търгуват на платформа за организирана търговия, която се намира извън Съюза, но при които базовият инструмент е допуснат до търговия или се търгува на място на търговия, се използва MIC код „XXXX“. |  |
| 37 | Държава на членството на клона | Код, който се използва за идентифициране на държавата на клон на инвестиционен посредник, когато членството на клона на даден пазар е използвано за изпълнение на сдел­ката.  Когато не е използвано членството на клона на даден пазар, в това поле се попълва кодът на държавата членка по произ­ход на инвестиционния посредник или кодът на държавата, в която е установено главното управление или седалището на посредника (в случай на посредници от трети държави).  Това поле се попълва само за пазарната страна на сделка, из­пълнена на място за търговия или платформа за организи­рана търговия, което/която се намира извън Съюза. | {COUNTRYCODE\_2} |
| 38 | Предварително плащане | Паричната стойност на всяко предварително плащане, полу­чено или извършено от продавача.  Когато продавачът получава предварителното плащане, се попълва положителна стойност. Когато продавачът извършва предварителното плащане, се попълва отрицателна стойност. | {DECIMAL-18/5} |
| 39 | Валута на предварителното плащане | Валута на предварителното плащане. | {CURRENCYCODE\_3} |
| 40 | Идентификационен код на компонент при комплексна търговия | Вътрешен идентификационен код на докладващия посред­ник, който служи за идентифицирането на всички отчети, свързани с едно и също изпълнение на комбинация от фи­нансови инструменти в съответствие с член 12. На нивото на посредника кодът трябва да е уникален за групата отчети, свързани с изпълнението.  Това поле е приложимо само когато се прилагат условията, посочени в член 12. | {ALPHANUM-35} |

**Данни за инструмента**

41

Идентификационен

инструмента

код

на

Код, използван за идентифицирането на финансовия инстру­мент.

{ISIN}

Това поле е приложимо за финансовите инструменти, за които е отправено искане за допускане до търговия, които са допуснати до търговия или се търгуват на място на търго­вия или чрез систематичен участник. То е приложимо също така за финансовите инструменти, които имат ISIN и се тър­гуват на намираща се извън Съюза платформа за организи­рана търговия, когато базовият инструмент е финансов ин­струмент, търгуван на място на търговия.

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| № | ПОЛЕ | СЪДЪРЖАНИЕ, КОЕТО СЕ ДОКЛАДВА | ФОРМАТ И СТАНДАРТИ, КОИТО СЕ ИЗПОЛЗВАТ ЗА |
|  |  |  | ДОКЛАДВАНЕТО |

**Полета 42—56 не са приложими, когато:**

**сделките се изпълняват на място на търговия или когато инвестиционният посредник действа като СУ; или в поле 41 е попълнен ISIN, който фигурира в списъка с референтни данни от ЕОЦКП.**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 42 | Пълно наименование на ин­струмента | Пълно наименование на финансовия инструмент. | {ALPHANUM-350} |
| 43 | Класификация на инстру­мента | Таксономия, използвана за класифициране на финансовия инструмент.  Предоставя се пълен и точен CFI код. | {CFI\_CODE} |
| 44 | Валута на номиналната стой­ност, 1 | Валута, в която е деноминирана номиналната стойност.  В случай на договор за лихвен процент или валутни дери­вати, това е валутата на номиналната стойност на етап 1 или валутата 1 от двойката.  В случай на суапции, при които базовият суап е в една ва­лута, това е валутата на номиналната стойност на базовия суап. За суапции, при които базовият суап е в повече от една валута, това е валутата на номиналната стойност на етап 1 от суапа. | {CURRENCYCODE\_3} |
| 45 | Валута на номиналната стой­ност, 2 | В случай на суапове в повече от една валута или кръстосани валутни суапове, това е валутата, в която е деноминиран етап 2 от договора.  При суапции, при които базовият суап е в повече от една ва­лута, това е валутата, в която е деноминиран етап 2 от суапа. | {CURRENCYCODE\_3} |
| 46 | Множител на цената | Брой единици на базовия инструмент, включени в един до­говор за деривати.  Паричната стойност на един договор за суап, когато в по­лето за количество е указан броят на договорите за суап, включени в сделката. При фючърс или опция на основата на индекс, това е размерът на индексен пункт.  При финансови залагания въз основа на спред, това е промя­ната на цената на базовия инструмент, на който се основава финансовото залагане.  Информацията, която се докладва в това поле, трябва да от­говаря на стойностите, посочени в полета 30 и 33. | {DECIMAL-18/17} |
| 47 | Код на базовия инструмент | Кодът ISIN на базовия инструмент.  При американски депозитарни разписки, глобални депози- тарни разписки и подобни инструменти това е кодът ISIN на финансовия инструмент, на който се основават тези ин­струменти.  При конвертируеми облигации това е кодът ISIN на инстру­мента, в който може да бъде конвертирана облигацията.  При деривати или други инструменти, които имат базов ин­струмент, това е кодът ISIN на базовия инструмент, когато базовият инструмент е допуснат до търговия или се търгува на място на търговия. Когато базовият инструмент е диви­дент под формата на акции, това е кодът ISIN на съответната акция, даваща право на дивидента под формата на акции. | {ISIN} |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| № | ПОЛЕ | СЪДЪРЖАНИЕ, КОЕТО СЕ ДОКЛАДВА | ФОРМАТ И СТАНДАРТИ, КОИТО СЕ ИЗПОЛЗВАТ ЗА ДОКЛАДВАНЕТО |
|  |  | При суапове за кредитно неизпълнение се предоставя кодът ISIN на референтното задължение.  В случай че базовият инструмент е индекс и има ISIN, това е кодът ISIN за въпросния индекс.  Когато базовият инструмент е кошница, се включва ISIN на всеки съставен елемент на кошницата, който е допуснат до търговия или се търгува на място на търговия. Поле 47 се отчита толкова пъти, колкото е необходимо, за да бъдат до­кладвани всички инструменти от кошницата, които подле­жат на докладване. |  |
| 48 | Наименование на базовия ин­декс | Когато базовият инструмент е индекс, това е наименова­нието на индекса. | {INDEX}  или  {ALPHANUM-25} — ако наименованието на индекса не е включено в списъка {IN­DEX} |
| 49 | Срок на базовия индекс | В случай че базовият инструмент е индекс, това е срокът на индекса. | {INTEGER-3}+„DAYS“ — дни  {INTEGER-3}+„WEEK“ — седмици  {INTEGER-3}+„MNTH“ — месеци  {INTEGER-3}+„YEAR“ — го­дини |
| 50 | Вид опция | Посочва се дали договорът за деривати е кол (право да се за­купи конкретен базов актив), или пут (право да се продаде конкретен базов актив), или дали към момента на изпълне­нието не може да се определи дали е кол, или пут.  В случай на суапции видът е:  — „PUTO“ — в случай на суапция на получателя, при която купувачът има право да сключи суап като получа­тел на фиксирана ставка.  — „Call“ — в случай на суапция на платеца, при която ку­пувачът има право да сключи суап като платец на фик­сирана ставка.  В случай на тавани и подове видът е:  — „PUTO“ — в случай на под,  — „Call“ — в случай на таван.  Това поле е приложимо само за деривати, които са опции или варанти. | „PUTO“ — пут  „CALL“ — кол  „OTHR“ — когато не може да се определи дали опцията е кол, или пут |
| 51 | Цена на упражняване | Предварително определена цена, на която притежателят ще трябва да купи или да продаде базовия инструмент, или указване, че цената не може да бъде определена към мо­мента на изпълнението.  Това поле е приложимо само за опция или варант, когато цената на упражняване може да бъде определена към мо­мента на изпълнението.  Когато цената не е налична към дадения момент, но пред­стои да бъде определена, стойността е „PNDG“.  Когато цена на упражняване не е приложима, полето не се попълва. | {DECIMAL-18/13} — в слу­чай че цената е изразена като парична стойност  {DECIMAL-11/10} — в слу­чай че цената е изразена като процент или доходност  {DECIMAL-18/17} — в слу­чай че цената е изразена като базисни пунктове  „PNDG“ — в случай че це­ната не е налична |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| № | ПОЛЕ | СЪДЪРЖАНИЕ, КОЕТО СЕ ДОКЛАДВА | ФОРМАТ И СТАНДАРТИ, КОИТО СЕ ИЗПОЛЗВАТ ЗА ДОКЛАДВАНЕТО |
| 52 | Валута на цената на упражня­ване | Валута на цената на упражняване | {CURRENCYCODE\_3} |
| 53 | Вид на опцията според датата на упражняване | Посочва се дали опцията може да бъде упражнена само на фиксирана дата (европейски и азиатски тип), поредица от предварително определени дати (бермудски тип) или във всеки един момент през срока на договора (американски тип).  Това поле е приложимо само за опции, варанти и сертифи­кати за права. | „EURO“ — европейски „AMER“ — американски „ASIA“ — азиатски  „BERM“ — бермудски  „OTHR“ — друг вид |
| 54 | Дата на падежа | Дата на падежа на финансовия инструмент.  Това поле е приложимо само за дългови инструменти с определен падеж. | {DATEFORMAT} |
| 55 | Дата на изтичане | Дата на изтичане на финансовия инструмент. Това поле е приложимо само за деривати с определена дата на изтичане. | {DATEFORMAT} |
| 56 | Вид на доставката | Посочва се дали сделката е уредена чрез физическа доставка, или чрез парично плащане.  Когато видът на доставката не може да бъде определен към момента на изпълнението, стойността е „OPTL“.  Полето е приложимо само за деривати. | „PHYS“ — уредена чрез фи­зическа доставка  „CASH“ — уредена чрез па­рично плащане  „OPTL“ — по избор на кон­трагента или когато се опре­деля от трета страна |

**Търговец, алгоритми, освобождаване от задължения, показатели**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 57 | Инвестиционно решение в рамките на посредника | Код, използван за идентифициране на лицето или алгори­тъма в рамките на инвестиционния посредник, което лице или който алгоритъм е отговорно/отговорен за инвестицион­ното решение.  За физически лица се използва идентификационният код, посочен в член 6.  Ако инвестиционното решение е взето от алгоритъм, полето се попълва съгласно определеното в член 8.  Това поле е приложимо само за инвестиционно решение в рамките на посредника.  Когато сделката се отнася до предадено нареждане, което е изпълнило условията за предаване, посочени в член 4, това поле се попълва от получаващия посредник в отчета на по­лучаващия посредник, като се използва информацията, по­лучена от предаващия посредник. | {NATIONAL\_ID} — физиче­ски лица  {ALPHANUM-50} — алго­ритми |
| 58 | Държава на клона, който упражнява надзор върху отго­ворното за инвестиционното решение лице | Код, използван за идентифициране на държавата на клона на инвестиционния посредник, от който е лицето, отговорно за инвестиционното решение, както е посочено в член 14, параграф 3, буква б).  Когато върху лицето, отговорно за инвестиционното реше­ние, не е упражняван надзор от клон, в това поле се по­пълва кодът на държавата членка по произход на инвести­ционния посредник или кодът на държавата, в която е уста­новено главното управление или седалището на посредника (в случай на посредници от трети държави). | {COUNTRYCODE\_2} |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| № | ПОЛЕ | СЪДЪРЖАНИЕ, КОЕТО СЕ ДОКЛАДВА | ФОРМАТ И СТАНДАРТИ, КОИТО СЕ ИЗПОЛЗВАТ ЗА ДОКЛАДВАНЕТО |
|  |  | Когато сделката се отнася до предадено нареждане, което е изпълнило условията за предаване, посочени в член 4, това поле се попълва от получаващия посредник в отчета на по­лучаващия посредник, като се използва информацията, по­лучена от предаващия посредник.  Това поле не е приложимо, когато инвестиционното реше­ние е взето от алгоритъм. |  |
| 59 | Изпълнение в рамките на по­средника | Код, използван за идентифициране на лицето или алгори­тъма в рамките на инвестиционния посредник, което лице или който алгоритъм е отговорно/отговорен за изпълне­нието.  За физически лица се използва идентификационният код, посочен в член 6. Ако изпълнението е извършено от алгори­тъм, полето се попълва съгласно посоченото в член 9. | {NATIONAL\_ID} — физиче­ски лица  {ALPHANUM-50} — алго­ритми |
| 60 | Държава на клона, който упражнява надзор върху ли­цето, отговорно за изпълне­нието | Код, използван за идентифициране на държавата на клона на инвестиционния посредник, от който е лицето, отговорно за изпълнението на сделката, както е посочено в член 14, параграф 3, буква в).  Когато върху лицето, отговорно за изпълнението, не е упражняван надзор от клон, в това поле се попълва кодът на държавата членка по произход на инвестиционния по­средник или кодът на държавата, в която е установено глав­ното управление или седалището на посредника (в случай на посредници от трети държави).  Това поле не е приложимо, когато изпълнението е извър­шено от алгоритъм. | {COUNTRYCODE\_2} |
| 61 | Показател за освобождаване от задължения | Посочва се дали сделката е изпълнена съгласно освобожда­ване от задължения преди сключването, в съответствие с членове 4 и 9 от Регламент (ЕС) № 600/2014.  За дялови инструменти:  „RFPT“ = сделка с референтна цена  „NLIQ“ = договорени сделки с ликвидни финансови инстру­менти  „OILQ“ = договорени сделки с неликвидни финансови ин­струменти  „PRIC“ = договорени сделки, които подлежат на условия, различни от текущата пазарна цена на този капиталов фи­нансов инструмент.  За недялови инструменти:  „SIZE“ = сделка над определен размер  „ILQD“ = сделка с неликвиден инструмент  Това поле се попълва само за пазарната страна на сделка, из­пълнена при освобождаване от задължения на място на тър­говия. | Попълват се едно или повече от следните обозначения: „RFPT“ — референтна цена  „NLIQ“ — договорена (лик­видни)  „OILQ“ — договорена (не- ликвидни)  „PRIC“ — договорена (усло­вия)  „SIZE“ — над определен раз­мер  „ILQD“ — неликвиден ин­струмент |
| 62 | Показател за къса продажба | Къса продажба, сключена от инвестиционен посредник от негово име или от името на клиент, както е описано в член 11.  Когато инвестиционен посредник изпълнява сделка от името на клиент, който продава, и инвестиционният посредник, като полага максимални усилия според възможностите си, не може да определи дали сделката е за къса продажба, в това поле се попълва „UNDI“. | „SESH“ — къса продажба без изключение от правилата  'SSEX' — къса продажба с изключение от правилата 'SELL' — без къса продажба  'UNDI' — няма налична ин­формация |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| № | ПОЛЕ | СЪДЪРЖАНИЕ, КОЕТО СЕ ДОКЛАДВА | ФОРМАТ И СТАНДАРТИ, КОИТО СЕ ИЗПОЛЗВАТ ЗА ДОКЛАДВАНЕТО |
|  |  | Когато сделката се отнася до предадено нареждане, което е изпълнило условията за предаване, посочени в член 4 от на­стоящия регламент, това поле се попълва от получаващия посредник в отчета на получаващия посредник, като се из­ползва информацията, получена от предаващия посредник.  Това поле е приложимо само когато инструментът е обхва­нат от Регламент (ЕС) № 236/2012 и продавачът е инвести­ционният посредник или клиент на инвестиционния по­средник. |  |
| 63 | Показател за извънборсова сделка след сключването на сделката | Показател за вида на сделката според член 20, параграф 3, буква а) и член 21, параграф 5, буква а) от Регламент (ЕС) № 600/2014.  За всички инструменти:  „BENC“ = сделки с бенчмаркове  „ACTX“ = агентски кръстосани сделки  „LRGS“ = големи по мащаб сделки след сключването на сделката  „ILQD“ = сделка с неликвиден инструмент  „SIZE“ = сделка над определен размер  „CANC“ = отмени  „AMND“ = изменения  За дялови инструменти:  „SDIV“ = сделки със специални дивиденти  „RPRI“ = сделки, по които е предоставена по-добра цена  „DUPL“ = дублиращи отчети за търговията  „TNCP“ = сделки, които не допринасят за процеса на опре­деляне на цените за целите на член 23 от Регламент (ЕС) № 600/2014  За недялови инструменти:  „TPAC“ = пакетна сделка  „XFPH“ = обмен за сделка с физическа доставка | Попълват се едно или повече от следните обозначения: „BENC“ — бенчмарк  „ACTX“ — агентски кръсто­сани  „LRGS“ — големи по мащаб  „ILQD“ — неликвиден ин­струмент  „SIZE“ — над определен раз­мер  „CANC“ — отмени  „AMND“ — изменения  „SDIV“ — специален диви­дент  „RPRI“ — по-добра цена  „DUPL“ — дублиращи  „TNCP“ — недопринасящи за процеса на определяне на це­ните  „TPAC“ — пакет  „XFPH“ — обмен за физи­ческа доставка |
| 64 | Показател за стокови дери­вати | Посочва се дали сделката намалява риска по обективно из­мерим начин в съответствие с член 57 от Директива 2014/65/ЕС.  Когато сделката се отнася до предадено нареждане, което е изпълнило условията за предаване, посочени в член 4, това поле се попълва от получаващия посредник в отчетите на получаващия посредник, като се използва информацията, получена от предаващия посредник. Това поле е приложимо само за сделки със стокови деривати. | „true“ — да „false“ — не |
| 65 | Показател за сделки за фи­нансиране с ценни книжа | „true“ се попълва, когато сделката попада в обхвата на дей­ност, но е освободена от задължението за докладване съ­гласно Регламент (ЕС) 2015/2365.  „false“ — в останалите случаи. | „true“ — да „false“ — не |

(1) Делегиран регламент (ЕС) 2017/580 на Комисията от 24 юни 2016 г. за допълване на Регламент (ЕС) № 600/2014 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на регулаторните технически стандарти за съхраняването на съответната информация, свързана с нарежданията относно финан­сови инструменти (вж. страница 193 от настоящия брой на Официален вестник).

(2) Делегиран регламент (ЕС) 2017/574 на Комисията от 7 юни 2016 г. за допълване на Директива 2014/65/ЕС на Европейския парламент и на Съвета по отношение на регулаторните технически стандарти във връзка със степента на точност на бизнес часовниците (вж. страница 148 от настоящия брой на Официален вестник).

*ПРИЛОЖЕНИЕ II*

**Национални клиентски идентификационни кодове за физически лица, които трябва да се използват в отчетите за сделки**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 2-буквен код по ISO 3166 —  1 | Наименование на държавата | 1-ви приоритетен идентификационен код | 2-ри приоритетен идентифика­ционен код | 3-ти приори­тетен иденти­фикационен код |
| AT | Австрия | CONCAT |  |  |
| BE | Белгия | Белгийски национален номер  (Numero de registre national — Rijksregi- sternummer) | CONCAT |  |
| BG | България | Български личен номер | CONCAT |  |
| CY | Кипър | Номер на национален паспорт | CONCAT |  |
| CZ | Чешка република | Национален идентификационен номер  (Rodne ci'slo) | Номер на паспорт | CONCAT |
| DE | Германия | CONCAT |  |  |
| DK | Дания | Личен идентификационен код с  10 буквено-цифрови знака: ДДММГГХХХХ | CONCAT |  |
| EE | Естония | Естонски личен идентификационен код (Isikukood) |  |  |
| ES | Испания | Данъчен идентификационен номер (Codigo de identification fiscal) |  |  |
| FI | Финландия | Личен идентификационен код | CONCAT |  |
| FR | Франция | CONCAT |  |  |
| GB | Обединено кралство | Национален осигурителен номер на Обеди­неното кралство | CONCAT |  |
| GR | Гърция | 10-цифрен номер в DSS за дял на инвести­тор (10 DSS digit investor share) | CONCAT |  |
| HR | Хърватия | Личен идентификационен номер (OIB — Osobni identifikacijski broj) | CONCAT |  |
| HU | Унгария | CONCAT |  |  |
| IE | Ирландия | CONCAT |  |  |
| IS | Исландия | Личен идентификационен код (Kennitala) |  |  |
| IT | Италия | Данъчен код (Codice fiscale) |  |  |
| LI | Лихтенщайн | Номер на национален паспорт | Номер на национална лична карта | CONCAT |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 2-буквен код по ISO 3166 —  1 | Наименование на държавата | 1-ви приоритетен идентификационен код | 2-ри приоритетен идентифика­ционен код | 3-ти приори­тетен иденти­фикационен код |
| LT | Литва | Личен код  (Asmens kodas) | Номер на национален паспорт | CONCAT |
| LU | Люксембург | CONCAT |  |  |
| LV | Латвия | Личен код  (Personas kods) | CONCAT |  |
| MT | Малта | Национален идентификационен номер | Номер на национален паспорт |  |
| NL | Нидерландия | Номер на национален паспорт | Номер на национална лична карта | CONCAT |
| NO | Норвегия | 11-цифрен личен идентификационен номер (Foedselsnummer) | CONCAT |  |
| PL | Полша | Национален идентификационен номер (PESEL) | Данъчен номер  (Numer identyfikacji podatko- wej) |  |
| PT | Португалия | Данъчен номер  (Numero de Identif'icacao Fiscal) | Номер на национален паспорт | CONCAT |
| RO | Румъния | Национален идентификационен номер  (Cod Numeric Personal) | Номер на национален паспорт | CONCAT |
| SE | Швеция | Личен идентификационен номер | CONCAT |  |
| SI | Словения | Личен идентификационен номер  (EMSO: Enotna Maticna Stevilka Obcana) | CONCAT |  |
| SK | Словакия | Личен номер  (Rodne ci'slo) | Номер на национален паспорт | CONCAT |
| **Всички други държави** | | **Номер на национален паспорт** | **CONCAT** |  |