



Rada
Unii Europejskiej

Bruksela, 17 czerwca 2022 r.
(OR. en)

10387/22
ADD 1

EF 179
ECOFIN 638
DELECT 98

PISMO PRZEWODNIE

Od: Sekretarz generalna Komisji Europejskiej (podpisała dyrektor Martine DEPREZ)

Do: Sekretariat Generalny Rady

Nr dok. Kom.: C(2022) 3589 final

Dotyczy: ZAŁĄCZNIK do ROZPORZĄDZENIA DELEGOWANEGO KOMISJI (UE) .../... uzupełniającego rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych określających minimalny poziom szczegółowości danych podlegających zgłoszeniu repozytoriom transakcji oraz rodzaj zgłoszeń, które należy stosować

Delegacje otrzymują w załączeniu dokument C(2022) 3589 final.

Załącznik: C(2022) 3589 final



Bruksela, dnia 10.6.2022 r.
C(2022) 3589 final

ANNEX

ZAŁĄCZNIK

do

ROZPORZĄDZENIA DELEGOWANEGO KOMISJI (UE) .../...

**uzupełniającego rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012
w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych określających minimalny
poziom szczegółowości danych podlegających zgłoszeniu repozytoriom transakcji oraz
rodzaj zgłoszeń, które należy stosować**

ZALĄCZNIK

Tabela 1

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
1	Strony kontraktu na instrument pochodny	Znacznik czasu zgłoszenia	Data i godzina przekazania zgłoszenia do repozytorium transakcji.
2	Strony kontraktu na instrument pochodny	Identyfikator podmiotu przekazującego zgłoszenie	W przypadku gdy podmiot odpowiedzialny za dokonanie zgłoszenia delegował obowiązek dokonania zgłoszenia do osoby trzeciej lub drugiego kontrahenta, podmiot ten musi zostać zidentyfikowany w tym polu za pomocą niepowtarzalnego kodu. W przeciwnym razie w tym polu należy wskazać podmiot odpowiedzialny za zgłaszanie.
3	Strony kontraktu na instrument pochodny	Podmiot odpowiedzialny za zgłaszanie	Jeżeli wyłączną odpowiedzialność i odpowiedzialność prawną za sprawozdawczość w imieniu obu kontrahentów zgodnie z art. 9 ust. 1a rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 ¹ ponosi kontrahent finansowy, a kontrahent niefinansowy nie decyduje się na zgłoszenie we własnym zakresie szczegółowych informacji na temat swoich kontraktów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, niepowtarzalny kod identyfikujący tego kontrahenta finansowego. W przypadku gdy za dokonywanie zgłoszeń w imieniu przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania w zbywalne papiery wartościowe (UCITS) zgodnie z art. 9 ust. 1b tego rozporządzenia odpowiedzialna i prawnie odpowiedzialna jest spółka zarządzająca, niepowtarzalny kod identyfikujący tę spółkę zarządzającą. W przypadku gdy

¹ 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).

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			<p>za dokonywanie zgłoszeń w imieniu alternatywnego funduszu inwestycyjnego (AFI) zgodnie z art. 9 ust. 1c tego rozporządzenia odpowiedzialny i prawnie odpowiedzialny jest zarządzający alternatywnym funduszem inwestycyjnym (ZAFI), niepowtarzalny kod identyfikujący tego ZAFI.</p> <p>W przypadku gdy upoważniony podmiot, który jest odpowiedzialny za zarządzanie IORP i działanie w jej imieniu, jest odpowiedzialny i prawnie odpowiedzialny za dokonywanie zgłoszeń w jej imieniu zgodnie z art. 9 ust. 1d tego rozporządzenia, niepowtarzalny kod identyfikujący ten podmiot.</p> <p>Niniejsze pole ma zastosowanie wyłącznie do instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym.</p>
4	Strony kontraktu na instrument pochodny	Kontrahent 1 (kontrahent dokonujący zgłoszenia)	<p>Identyfikator kontrahenta transakcji na instrumentach pochodnych, który wypełnia swój obowiązek zgłaszania za pośrednictwem danego zgłoszenia.</p> <p>W przypadku przypisanej transakcji na instrumentach pochodnych realizowanej przez zarządzającego funduszem w imieniu funduszu, jako kontrahenta zgłasza się fundusz, a nie zarządzającego funduszem.</p>
5	Strony kontraktu na instrument pochodny	Charakter kontrahenta 1	<p>Należy wskazać, czy kontrahent 1 jest kontrahentem centralnym („CCP”), kontrahentem finansowym lub kontrahentem niefinansowym zdefiniowanym w art. 2 pkt 1, 8 i 9 rozporządzenia (UE) nr 648/2012, lub podmiotem, o którym mowa w art. 1 ust. 5 tego rozporządzenia.</p>

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
6	Strony kontraktu na instrument pochodny	Sektor przedsiębiorstw, w którym działa kontrahent 1	<p>Charakter działalności przedsiębiorstwa kontrahenta 1.</p> <p>Jeżeli kontrahent 1 jest kontrahentem finansowym, pole to zawiera wszystkie niezbędne kody zawarte w taksonomii kontrahentów finansowych w polu 6 tabeli 1 w załączniku do [do Urzędu Publikacji: proszę wstawić odniesienie do C(2022) 3588] i mające zastosowanie do tego kontrahenta.</p> <p>Jeżeli kontrahent 1 jest kontrahentem niefinansowym, pole to zawiera wszystkie niezbędne kody zawarte w taksonomii kontrahentów niefinansowych w polu 6 tabeli 1 w załączniku do [do Urzędu Publikacji: proszę wstawić odniesienie do C(2022) 3588] i mające zastosowanie do tego kontrahenta.</p> <p>W przypadku zgłoszenia więcej niż jednego rodzaju działalności należy podać kody uszeregowane według względnego znaczenia danego rodzaju działalności.</p>
7	Strony kontraktu na instrument pochodny	Próg wiążący się z obowiązkiem rozliczania dla kontrahenta 1	Informacje, czy kontrahent 1 w dniu zawarcia transakcji przekracza próg wiążący się z obowiązkiem rozliczania, o którym mowa w art. 4a ust. 3 lub art. 10 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012.
8	Strony kontraktu na instrument pochodny	Rodzaj identyfikatora kontrahenta 2	Wskazanie, czy do identyfikacji kontrahenta 2 wykorzystano LEI.
9	Strony kontraktu na instrument pochodny	Kontrahent 2	Identyfikator drugiego kontrahenta transakcji na instrumentach pochodnych. W przypadku przypisanej transakcji na instrumentach pochodnych realizowanej przez zarządzającego funduszem w imieniu funduszu, jako kontrahenta zgłasza się fundusz, a nie zarządzającego funduszem.
10	Strony	Kraj kontrahenta 2	W przypadku gdy kontrahent 2 jest

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
	kontraktu na instrument pochodny		osobą fizyczną, kod kraju zamieszkania tej osoby.
11	Strony kontraktu na instrument pochodny	Charakter kontrahenta 2	Należy wskazać, czy kontrahent 2 jest CCP, kontrahentem finansowym lub kontrahentem niefinansowym zdefiniowanym w art. 2 pkt 1, 8 i 9 rozporządzenia (UE) nr 648/2012, lub podmiotem, o którym mowa w art. 1 ust. 5 tego rozporządzenia.
12	Strony kontraktu na instrument pochodny	Sektor przedsiębiorstw, w którym działa kontrahent 2	Charakter działalności przedsiębiorstwa kontrahenta 2. Jeżeli kontrahent 2 jest kontrahentem finansowym, pole to zawiera wszystkie niezbędne kody zawarte w taksonomii kontrahentów finansowych w polu 6 tabeli 1 w załączniku do [do Urzędu Publikacji: proszę wstawić odniesienie do C(2022) 3588] i mające zastosowanie do tego kontrahenta. Jeżeli kontrahent 2 jest kontrahentem niefinansowym, pole to zawiera wszystkie niezbędne kody zawarte w taksonomii kontrahentów niefinansowych w polu 6 tabeli 1 w załączniku do [do Urzędu Publikacji: proszę wstawić odniesienie do C(2022) 3588] i mające zastosowanie do tego kontrahenta. W przypadku zgłoszenia więcej niż jednego rodzaju działalności należy podać kody uszeregowane według względnego znaczenia danego rodzaju działalności.
13	Strony kontraktu na instrument pochodny	Próg wiążący się z obowiązkiem rozliczania dla kontrahenta 2	Informacje, czy kontrahent 2 w dniu zawarcia transakcji przekracza próg wiążący się z obowiązkiem rozliczania, o którym mowa w art. 4a ust. 3 lub art. 10 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012.
14	Strony kontraktu na instrument	Obowiązek zgłaszania spoczywający na kontrahencie 2	Wskazanie, czy na kontrahencie 2 spoczywa obowiązek zgłaszania na podstawie rozporządzenia (UE) nr 648/2012, niezależnie od tego, kto

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
	poходny		ponosi odpowiedzialność i odpowiedzialność prawną za dokonywanie zgłoszeń w jego imieniu.
15	Strony kontraktu na instrument pochodny	Identyfikator brokera	W przypadku gdy w charakterze pośrednika kontrahenta 1 działa broker, nie stając się samym kontrahentem, kontrahent 1 identyfikuje tego maklera za pomocą niepowtarzalnego kodu.
16	Strony kontraktu na instrument pochodny	Członek rozliczający	Identyfikator członka rozliczającego, za pośrednictwem którego transakcja na instrumentach pochodnych była rozliczana przez CCP. Ten element danych ma zastosowanie do rozliczonych transakcji.
17	Strony kontraktu na instrument pochodny	Kierunek	Wskazanie, czy kontrahent 1 jest kupującym czy sprzedającym według stanu na dzień zawarcia instrumentu pochodnego.
18	Strony kontraktu na instrument pochodny	Kierunek „nogi” 1	Wskazanie, czy kontrahent 1 jest płatnikiem czy odbiorcą „nogi” 1 według stanu na dzień zawarcia instrumentu pochodnego.
19	Strony kontraktu na instrument pochodny	Kierunek „nogi” 2	Wskazanie, czy kontrahent 1 jest płatnikiem czy odbiorcą „nogi” 2 według stanu na dzień zawarcia instrumentu pochodnego.
20	Strony kontraktu na instrument pochodny	Bezpośredni związek z działalnością handlową lub działalnością samofinansującą	Informacja, czy kontrakt jest w obiektywny i mierzalny sposób bezpośrednio związany z działalnością gospodarczą lub działalnością w zakresie zarządzania aktywami i pasywami kontrahenta 1, o których mowa w art. 10 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012. Pole to wypełnia się wyłącznie w przypadku, gdy kontrahent 1 jest kontrahentem niefinansowym zdefiniowanym w art. 2 pkt 9 rozporządzenia (UE) nr 648/2012.

Tabela 2

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
1	Sekcja 2a – Identyfikatory i odnośniki	Unikatowy identyfikator transakcji (UTI)	Unikatowy identyfikator transakcji, o którym mowa w art. 7 [<i>Do Urzędu Publikacji: proszę wstawić odniesienie do C(2022) 3588</i>].
2	Sekcja 2a – Identyfikatory i odnośniki	Numer referencyjny zgłoszenia	W przypadku gdy instrument pochodny został wykonany w systemie obrotu – niepowtarzalny dla wykonania tego instrumentu numer wygenerowany przez ten system obrotu.
3	Sekcja 2a – Identyfikatory i odnośniki	UTI poprzedniej transakcji (dla transakcji, między którymi występuje relacja typu „jeden za jeden” i „jeden za wiele”)	UTI przypisana do poprzedniej transakcji, która doprowadziła do zgłoszonej transakcji ze względu na zdarzenie związane z cyklem życia kontraktu, w ramach związku typu jeden do jednego między transakcjami (np. w przypadku przedłużenia, gdy transakcja zostaje rozwiązana i wygenerowana zostaje nowa transakcja) lub w ramach związku typu jeden do wielu między transakcjami (np. w ramach rozliczania lub jeżeli transakcja zostaje podzielona na kilka różnych transakcji). Ten element danych nie ma zastosowania przy

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			zgłaszaniu związków typu wiele do jednego i wiele do wielu między transakcjami (np. w przypadku kompresji).
4	Sekcja 2a – Identyfikatory i odnośniki	UTI późniejszej pozycji	UTI pozycji, do której włączono dany instrument pochodny. Pole to ma zastosowanie wyłącznie do zgłoszeń dotyczących rozwiązania instrumentu pochodnego ze względu na jego włączenie do pozycji.
5	Sekcja 2a – Identyfikatory i odnośniki	Identyfikator na potrzeby posttransakcyjnej redukcji ryzyka (PTRR)	Identyfikator wygenerowany przez dostawcę usług PTRR lub CCP świadczącego usługę PTRR w celu połączenia wszystkich instrumentów pochodnych objętych danym zdarzeniem PTRR i wynikających z tego zdarzenia.
6	Sekcja 2a – Identyfikatory i odnośniki	Identyfikator pakietu	Identyfikator (określony przez kontrahenta 1) w celu powiązania instrumentów pochodnych w tym samym pakiecie zgodnie z art. 1 ust. 3 akapit trzeci niniejszego rozporządzenia. Pakiet może obejmować transakcje podlegające zgłoszeniu i transakcje niepodlegające zgłoszeniu.
7	Sekcja 2b – Informacje dotyczące kontraktu	Międzynarodowy kod identyfikujący papier wartościowy (ISIN)	Kod ISIN identyfikujący produkt, jeżeli produkt ten jest dopuszczony do obrotu lub jest przedmiotem obrotu na rynku regulowanym,

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			wielostronnej platformie obrotu, zorganizowanej platformie obrotu lub w podmiocie systematycznie internalizującym transakcje.
8	Sekcja 2b – Informacje dotyczące kontraktu	Unikatowy identyfikator produktu (UPI)	UPI identyfikujący produkt.
9	Sekcja 2b – Informacje dotyczące kontraktu	Klasyfikacja produktu	Kod klasyfikacji instrumentów finansowych (kod CFI) dotyczący instrumentu.
10	Sekcja 2b – Informacje dotyczące kontraktu	Rodzaj kontraktu	Każdy zgłoszony kontrakt klasyfikuje się według jego rodzaju.
11	Sekcja 2b – Informacje dotyczące kontraktu	Klasa aktywów	Każdy zgłoszony kontrakt klasyfikuje się według klasy jego aktywów bazowych.
12	Sekcja 2b – Informacje dotyczące kontraktu	Instrument pochodny oparty na kryptoaktywach	Wskazanie, czy instrument pochodny jest oparty kryptoaktywach.
13	Sekcja 2b – Informacje dotyczące kontraktu	Rodzaj identyfikatora instrumentu bazowego	Rodzaj jednostronnego identyfikatora instrumentu bazowego.
14	Sekcja 2b – Informacje dotyczące kontraktu	Identyfikator instrumentu bazowego	Bezpośredni instrument bazowy identyfikuje się za pomocą niepowtarzalnego identyfikatora dotyczącego tego instrumentu bazowego w oparciu o jego rodzaj. W przypadku swapów ryzyka kredytowego należy podać kod ISIN zobowiązania referencyjnego.

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
15	Sekcja 2b – Informacje dotyczące kontraktu	Wskazanie indeksu bazowego	Wskaźnik indeksu instrumentu bazowego, w stosownych przypadkach.
16	Sekcja 2b – Informacje dotyczące kontraktu	Nazwa indeksu bazowego	Pełna nazwa indeksu instrumentu bazowego nadana przez dostawcę indeksu.
17	Sekcja 2b – Informacje dotyczące kontraktu	Kod koszyka niestandardowego	Jeżeli transakcja na instrumentach pochodnych opiera się na koszyku strukturyzowanym, niepowtarzalny kod nadany przez podmiot odpowiedzialny za strukturę koszyka w celu powiązania jego składników.
18	Sekcja 2b – Informacje dotyczące kontraktu	Identyfikator składników koszyka	W przypadku koszyków strukturyzowanych składających się między innymi z instrumentów finansowych będących przedmiotem obrotu w systemie obrotu określa się wyłącznie instrumenty finansowe będące przedmiotem obrotu w systemie obrotu.
19	Sekcja 2b – Informacje dotyczące kontraktu	Waluta rozliczeniowa 1	W stosownych przypadkach waluta rozrachunku pieniężnego transakcji. W przypadku produktów wielowalutowych, które nie podlegają kompensowaniu – waluta rozliczeniowa „nogi” 1. Ten element danych nie ma zastosowania do produktów rozliczanych fizycznie (np.

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			rozliczanych fizycznie opcji na swapy).
20	Sekcja 2b – Informacje dotyczące kontraktu	Waluta rozliczeniowa 2	W stosownych przypadkach waluta rozrachunku pieniężnego transakcji. W przypadku produktów wielowalutowych, które nie podlegają kompensowaniu – waluta rozliczeniowa „nogi” 2. Ten element danych nie ma zastosowania do produktów rozliczanych fizycznie (np. rozliczanych fizycznie opcji na swapy).
21	Sekcja 2c – Wycena	Kwota wyceny	Wycena kontraktu według wartości rynkowej lub wycena według modelu, o których mowa w art. 4 niniejszego rozporządzenia. W odniesieniu do rozliczonej transakcji stosuje się wycenę CCP.
22	Sekcja 2c – Wycena	Waluta wyceny	Waluta, w której denominuje się kwotę wyceny.
23	Sekcja 2c – Wycena	Znacznik czasu wyceny	Data i godzina ostatniej wyceny według wartości rynkowej dostarczonej przez CCP lub obliczonej na podstawie bieżącej lub ostatniej dostępnej ceny rynkowej transakcji

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			wejściowych.
24	Sekcja 2c – Wycena	Metoda wyceny	<p>Źródło i metoda wyceny transakcji stosowana przez kontrahenta 1.</p> <p>Jeżeli w wycenie wykorzystuje się co najmniej jedną transakcję wejściową, którą klasyfikuje się jako wycenianą według modelu, wówczas całą wycenę klasyfikuje się jako wycenę według modelu.</p> <p>Jeżeli wykorzystywane są wyłącznie transakcje wejściowe, które klasyfikuje się jako wyceniane według wartości rynkowej, wówczas całą wycenę klasyfikuje się jako wycenę według wartości rynkowej.</p>
25	Sekcja 2c – Wycena	Współczynnik delta	<p>Stosunek zmiany ceny transakcji na instrumentach pochodnych do zmiany ceny instrumentu bazowego.</p> <p>Niniejsze pole ma zastosowanie wyłącznie do opcji i opcji na swapy. Kontrahenci finansowi i kontrahenci niefinansowi, o których mowa w art. 10 rozporządzenia (UE) nr 648/2012, zgłaszają codziennie zaktualizowany współczynnik delta.</p>

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
26	Sekcja 2d – Zabezpieczenie	Wskazanie, czy zabezpieczenie wniesiono na poziomie portfela	Wskazanie dotyczący tego, czy zabezpieczenie wniesiono na poziomie portfela. Określenie „na poziomie portfela” oznacza zbiór transakcji podlegających obowiązkowi wniesienia wspólnego depozytu zabezpieczającego (w ujęciu netto albo brutto) w przeciwieństwie do scenariusza, w którym depozyt zabezpieczający jest obliczany i księgowany oddzielnie dla każdej pojedynczej transakcji.
27	Sekcja 2d – Zabezpieczenie	Kod portfela, dla którego wniesiono zabezpieczenie	Jeżeli zabezpieczenie jest zgłaszane na poziomie portfela, niepowtarzalny kod przypisany portfelowi przez kontrahenta 1. Ten element danych nie ma zastosowania, jeżeli zabezpieczenie wniesiono na poziomie transakcji lub jeżeli nie zawarto umowy zabezpieczającej, lub jeżeli nie wniesiono ani nie otrzymano żadnego zabezpieczenia.
28	Sekcja 2e – Ograniczanie ryzyka / zgłaszanie	Znacznik czasu potwierdzenia	Data i godzina potwierdzenia, zgodnie z art. 12 rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) nr 149/2013 ² . Ma zastosowanie wyłącznie

² Rozporządzenie delegowane Komisji (UE) nr 149/2013 z dnia 19 grudnia 2012 r. uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych dotyczących pośrednich uzgodnień rozliczeniowych, obowiązku rozliczania, rejestru publicznego, dostępu do systemu obrotu, kontrahentów niefinansowych, technik ograniczania ryzyka związanego z kontraktami pochodnymi będącymi przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, które nie są rozliczane przez kontrahenta centralnego (Dz.U. L 52 z 23.2.2013, s. 11).

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			do kontraktów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, które nie są rozliczane przez CCP.
29	Sekcja 2e – Ograniczanie ryzyka / zgłaszanie	Potwierdzono	<p>W przypadku nowych transakcji podlegających zgłoszeniu – czy prawnie wiążące warunki kontraktu pochodnego będącego przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym zostały udokumentowane i uzgodnione (potwierdzone) czy też nie (niepotwierdzone). Jeżeli transakcje udokumentowano i uzgodniono, czy takie potwierdzenie zostało dokonane:</p> <ul style="list-style-type: none"> • za pośrednictwem wspólnego systemu lub platformy potwierdzania lub prywatnego lub dwustronnego systemu elektronicznego (elektronicznie); • za pośrednictwem dokumentu pisemnego nadającego się do odczytu przez człowieka, takiego jak faks, papier lub ręcznie przetwarzane wiadomości e-mail (nieelektronicznie). <p>Ma zastosowanie wyłącznie do kontraktów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, które nie są rozliczane przez CCP.</p>

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
30	Sekcja 2f – Rozliczanie	Obowiązek rozliczania	Wskazanie, czy zgłaszany kontrakt należy do kategorii instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, które uznano za podlegające obowiązkowi rozliczania, a obaj kontrahenci będący stronami kontraktu podlegają obowiązkowi rozliczania na podstawie rozporządzenia (UE) nr 648/2012, z chwilą wykonania kontraktu. Ma zastosowanie wyłącznie do kontraktów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym.
31	Sekcja 2f – Rozliczanie	Rozliczono	Wskaźnik tego, czy instrument pochodny został rozliczony przez CCP.
32	Sekcja 2f – Rozliczanie	Znacznik czasu rozliczenia	Data i godzina dokonania rozliczenia. Ma zastosowanie wyłącznie do kontraktów pochodnych, które są rozliczane przez CCP.
33	Sekcja 2f – Rozliczanie	Kontrahent centralny	Identyfikator CCP, który rozliczył transakcję. Ten element danych nie ma zastosowania, jeżeli wartość elementu danych „Rozliczone” wynosi „N” („Nie, nierozliczane centralnie”).

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
34	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Rodzaj umowy ramowej	Odniesienie do rodzaju umowy ramowej, na podstawie której kontrahenci zawarli instrument pochodny.
35	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Rodzaj innej umowy ramowej	Nazwa umowy ramowej. Pole to wypełnia się wyłącznie w przypadku, gdy w polu 34 w niniejszej tabeli wskazano „OTHR”.
36	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Wersja umowy ramowej	W stosownych przypadkach wskazanie roku umowy ramowej właściwej dla zgłaszanej transakcji.
37	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Transakcja wewnątrzgrupowa	Wskazanie, czy kontrakt zawarto jako transakcję wewnątrzgrupową zgodnie z definicją w art. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012.
38	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Posttransakcyjna redukcja ryzyka (PTRR)	Wskazanie, czy kontrakt wynika z operacji posttransakcyjnej w zakresie redukcji ryzyka.
39	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Rodzaj techniki PTRR	Wskaźnik rodzaju operacji posttransakcyjnej w zakresie redukcji ryzyka do celów sprawozdawczości na podstawie rozporządzenia (UE) nr 648/2012. Kompresja portfela bez udziału usługodawcy będącego osobą trzecią: Uzgodnienie mające na celu zmniejszenie ryzyka w istniejących portfelach transakcji z wykorzystaniem

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			<p>transakcji pozacenowych głównie w celu zmniejszenia nierozliczonej kwoty nominalnej, liczby transakcji lub w celu dokonania innej harmonizacji warunków w drodze całkowitego lub częściowego rozwiązania transakcji, często też w celu zastąpienia rozwiązanych instrumentów pochodnych nowymi transakcjami odtworzenia.</p> <p>Kompresja portfela z udziałem usługodawcy będącego osobą trzecią lub CCP: Usługa w zakresie posttransakcyjnej redukcji ryzyka (PTRR) świadczona przez usługodawcę lub CCP i mająca na celu zmniejszenie ryzyka w istniejących portfelach transakcji z wykorzystaniem transakcji pozacenowych głównie w celu zmniejszenia nierozliczonej kwoty nominalnej, liczby transakcji lub w celu dokonania innej harmonizacji warunków w drodze całkowitego lub częściowego rozwiązania transakcji, często też w celu zastąpienia rozwiązanych instrumentów pochodnych nowymi transakcjami odtworzenia.</p> <p>Równoważenie struktury portfela/zarządzanie</p>

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			<p>depozytem zabezpieczającym: Usługa w zakresie posttransakcyjnej redukcji ryzyka świadczona przez usługodawcę w celu zmniejszenia ryzyka w istniejącym portfelu transakcji poprzez dodanie nowych transakcji pozacenowych i w przypadku gdy żadne istniejące transakcje w portfelu nie zostały rozwiązane ani zastąpione, a wartość nominalna jest zwiększana, a nie zmniejszana.</p> <p>Pozostałe usługi w zakresie posttransakcyjnej redukcji ryzyka w ramach portfela: Usługa w zakresie posttransakcyjnej redukcji ryzyka świadczona przez usługodawcę w celu zmniejszenia ryzyka w istniejących portfelach transakcji z wykorzystaniem transakcji pozacenowych i w przypadku gdy taka usługa nie kwalifikuje się jako kompresja portfela ani równoważenie struktury portfela.</p>
40	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Dostawca usług w zakresie PTRR	LEI identyfikujący usługodawcę świadczącego usługi posttransakcyjne w zakresie redukcji ryzyka
41	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Miejsce realizacji transakcji	Określenie systemu, w którym wykonano transakcję. W przypadku do transakcji wykonywanych

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			<p>w systemie obrotu, przez podmiot systematycznie internalizujący transakcje („SI”) lub na zorganizowanej platforma obrotu poza Unią należy stosować kod identyfikacyjny segmentu rynku zgodnie z normą ISO 10383. Jeżeli segmentu rynku nie istnieje, należy stosować operacyjny kod identyfikacyjny segmentu rynku.</p> <p>Należy stosować kod identyfikacyjny segmentu rynku „XOFF” w odniesieniu do instrumentów finansowych dopuszczonych do obrotu lub będących przedmiotem obrotu w systemie obrotu, lub w przypadku których złożono wnioszek o dopuszczenie, jeżeli transakcja na tym instrumencie finansowym nie jest realizowana w systemie obrotu lub przez podmiot systematycznie internalizujący transakcje, lub zorganizowaną platformę obrotu znajdujące się poza Unią, lub jeżeli kontrahent nie wie, czy prowadzi obrót z kontrahentem 2 działającym w charakterze podmiotu systematycznie internalizującego transakcje.</p> <p>Należy stosować kod identyfikacyjny segmentu rynku „XXXX” w odniesieniu do</p>

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			instrumentów finansowych niedopuszczonych do obrotu ani niebędących przedmiotem obrotu w systemie obrotu, lub w przypadku których nie złożono wniosku o dopuszczenie i które nie są przedmiotem obrotu na zorganizowanej platformie obrotu znajdującej się poza Unią.
42	Sekcja 2c – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Znacznik czasu realizacji transakcji	Data i godzina pierwotnego wykonania transakcji, które doprowadziło do wygenerowania nowego UTI. Ten element danych pozostaje niezmienione przez cały okres ważności UTI. W przypadku sprawozdawczości na poziomie pozycji należy wskazać czasu, w którym pozycja została otwarta po raz pierwszy.
43	Sekcja 2c – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Data rozpoczęcia obowiązywania	Nieskorygowana data rozpoczęcia obowiązywania zobowiązań z tytułu transakcji na instrumentach pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, wskazana w potwierdzeniu. Jeżeli data rozpoczęcia obowiązywania nie jest określona jako część warunków kontraktu, kontrahenci zgłaszają w tym polu datę wykonania instrumentu

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			poходnego.
44	Sekcja 2c – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Data wygaśnięcia	Nieskorygowana data zakończenia obowiązywania zobowiązań z tytułu transakcji na instrumentach pochodnych, wskazana w potwierdzeniu. Przedterminowe rozwiązanie nie ma wpływu na ten element danych.
45	Sekcja 2c – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Data przedterminowego zakończenia transakcji	Data rozpoczęcia obowiązywania przedterminowego zakończenia (wygaśnięcia) zgłoszonej transakcji. Ten element danych ma zastosowanie, jeżeli zakończenie transakcji następuje przed terminem jej zapadalności ze względu na decyzję <i>ex-interim</i> kontrahenta (lub kontrahentów).
46	Sekcja 2c – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Data ostatecznego rozrachunku określona w umowie	Nieskorygowana data przewidziana w kontrakcie, do której powinien nastąpić cały transfer środków pieniężnych lub aktywów, a kontrahenci nie powinni już mieć żadnych pozostałych do spłaty zobowiązań wobec siebie w ramach tego kontraktu.

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			W przypadku produktów, które nie mają daty ostatecznego rozrachunku określonego w umowie (np. opcji amerykańskich), ten element danych zawiera datę, do której transfer środków pieniężnych lub aktywów miałby miejsce, gdyby rozwiązanie kontraktu miało nastąpić w dacie wygaśnięcia.
47	Sekcja 2c – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Rodzaj dostawy	Wskazanie, czy kontrakt jest rozliczany fizycznie czy gotówkowo.
48	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Cena	Cena określona w transakcji na instrumentach pochodnych. Nie obejmuje ona opłat, podatków ani prowizji. Jeżeli w chwili zgłaszania nowej transakcji cena nie jest znana, jest ona aktualizowana w miarę dostępności. W przypadku transakcji, które stanowią część pakietu, ten element danych zawiera, w stosownych przypadkach, cenę transakcji będącej składnikiem pakietu.
49	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Waluta, w jakiej wyrażono cenę	Waluta, w której denominowana jest cena. Waluta, w jakiej wyrażono cenę, ma zastosowanie tylko wtedy, gdy cena jest wyrażona jako wartość pieniężna.

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
	Pola 50–52 są powtarzalne i wypełnia się je w przypadku instrumentów pochodnych obejmujących harmonogramy zmian cen.		
50	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Nieskorygowana data rozpoczęcia obowiązywania ceny	Nieskorygowana data rozpoczęcia obowiązywania ceny.
51	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Nieskorygowana data zakończenia obowiązywania ceny	Nieskorygowana data zakończenia obowiązywania ceny (nie ma zastosowania, jeżeli nieskorygowana data zakończenia obowiązywania danego harmonogramu przypada bezpośrednio przed nieskorygowaną datą rozpoczęcia obowiązywania dotyczącą następnego okresu).
52	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Cena obowiązująca w okresie między nieskorygowaną datą rozpoczęcia obowiązywania a datą zakończenia obowiązywania	Cena obowiązująca w okresie między nieskorygowaną datą rozpoczęcia obowiązywania a nieskorygowaną datą zakończenia obowiązywania, z tą ostatnią włącznie.
53	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Cena transakcji pakietowej	Cena w obrocie dotycząca całego pakietu, którego zgłoszona transakcja na instrumentach pochodnych jest elementem. Ten element danych nie ma zastosowania

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			<p>w przypadku gdy</p> <ul style="list-style-type: none"> • zgłoszenie nie dotyczy żadnego pakietu lub • stosuje się spread transakcji pakietowej. <p>Ceny i powiązane elementy danych transakcji (waluta, w jakiej wyrażono cenę), które stanowią poszczególne składniki pakietu, zgłasza się, jeżeli są dostępne. Cena transakcji pakietowej może nie być znana w chwili zgłoszenia nowej transakcji, ale może zostać zaktualizowana w późniejszym terminie.</p>
54	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Waluta, w jakiej wyrażono cenę transakcji pakietowej	<p>Waluta, w której denominowana jest cena transakcji pakietowej. Ten element danych nie ma zastosowania w przypadku gdy</p> <ul style="list-style-type: none"> • zgłoszenie nie dotyczy żadnego pakietu lub • stosuje się spread transakcji pakietowej, lub • cena transakcji pakietowej jest wyrażona jako wartość procentowa.
55	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Kwota nominalna „nogi” 1	Kwota nominalna „nogi” 1, o której mowa w art. 5 niniejszego rozporządzenia.
56	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Waluta, w jakiej wyrażono kwotę nominalną „nogi” 1	W stosownych przypadkach: waluta, w której denominowana jest kwota nominalna „nogi” 1.
	Pola 57–59 są powtarzalne i wypełnia się je		

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
	w przypadku instrumentów pochodnych obejmujących harmonogramy zmian kwoty nominalnej		
57	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Data rozpoczęcia obowiązywania kwoty nominalnej „nogi” 1	Nieskorygowana data, w której zaczyna obowiązywać powiązana kwota nominalna „nogi” 1.
58	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Data zakończenia obowiązywania kwoty nominalnej „nogi” 1	Nieskorygowana data zakończenia obowiązywania kwoty nominalnej „nogi” 1 (nie ma zastosowania, jeżeli nieskorygowana data zakończenia obowiązywania danego harmonogramu przypada bezpośrednio przed nieskorygowaną datą rozpoczęcia obowiązywania dotyczącą następnego okresu).
59	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Kwota nominalna „nogi” 1 obowiązująca w powiązanej dacie rozpoczęcia obowiązywania	Kwota nominalna „nogi” 1, która zaczyna obowiązywać w powiązanej nieskorygowanej dacie rozpoczęcia obowiązywania.
60	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Całkowita ilość nominalna „nogi” 1	Zagregowana ilość nominalna bazowego składnika aktywów „nogi” 1 w okresie trwania transakcji. Jeżeli w chwili zgłaszania nowej transakcji ilość nominalna nie jest znana, jest ona aktualizowana w miarę dostępności.

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
	Pola 61–63 są powtarzalne i wypełnia się je w przypadku instrumentów pochodnych obejmujących harmonogramy zmian ilości nominalnej		
61	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Data rozpoczęcia obowiązywania ilości nominalnej „nogi” 1	Nieskorygowana data, w której zaczyna obowiązywać powiązana ilość nominalna „nogi” 1
62	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Data zakończenia obowiązywania ilości nominalnej „nogi” 1	Nieskorygowana data zakończenia obowiązywania ilości nominalnej „nogi” 1 (nie ma zastosowania, jeżeli nieskorygowana data zakończenia obowiązywania danego harmonogramu przypada bezpośrednio przed nieskorygowaną datą rozpoczęcia obowiązywania dotyczącą następnego okresu).
63	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Ilość nominalna „nogi” 1 obowiązująca w powiązanej dacie rozpoczęcia obowiązywania	Ilość nominalna „nogi” 1, która zaczyna obowiązywać w powiązanej nieskorygowanej dacie rozpoczęcia obowiązywania.
64	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Kwota nominalna „nogi” 2	W stosownych przypadkach, kwota nominalna „nogi” 2, o której mowa w art. 5 niniejszego rozporządzenia.

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
65	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Waluta, w jakiej wyrażono kwotę nominalną „nogi” 2	W stosownych przypadkach: waluta, w której denominowana jest kwota nominalna „nogi” 2.
	Pola 66–68 są powtarzalne i wypełnia się je w przypadku instrumentów pochodnych obejmujących harmonogramy zmian kwoty nominalnej		
66	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Data rozpoczęcia obowiązywania kwoty nominalnej „nogi” 2	Nieskorygowana data, w której zaczyna obowiązywać powiązana kwota nominalna „nogi” 2.
67	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Data zakończenia obowiązywania kwoty nominalnej „nogi” 2	Nieskorygowana data zakończenia obowiązywania kwoty nominalnej „nogi” 2 (nie ma zastosowania, jeżeli nieskorygowana data zakończenia obowiązywania danego harmonogramu przypada bezpośrednio przed nieskorygowaną datą rozpoczęcia obowiązywania dotyczącą następnego okresu).
68	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Kwota nominalna „nogi” 2 obowiązująca w powiązanej dacie rozpoczęcia obowiązywania	Kwota nominalna „nogi” 2, która zaczyna obowiązywać w powiązanej nieskorygowanej dacie rozpoczęcia obowiązywania.

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
69	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Całkowita ilość nominalna „nogi” 2	Zagregowana ilość nominalna bazowego składnika aktywów „nogi” 2 w okresie trwania transakcji. Jeżeli w chwili zgłaszania nowej transakcji ilość nominalna nie jest znana, jest ona aktualizowana w miarę dostępności.
	Pola 70–72 są powtarzalne i wypełnia się je w przypadku instrumentów pochodnych obejmujących harmonogramy zmian ilości nominalnej		
70	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Data rozpoczęcia obowiązania ilości nominalnej „nogi” 2	Nieskorygowana data, w której zaczyna obowiązywać ilość nominalna „nogi” 2.
71	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Data zakończenia obowiązania ilości nominalnej „nogi” 2	Nieskorygowana data zakończenia obowiązania ilości nominalnej „nogi” 2 (nie ma zastosowania, jeżeli nieskorygowana data zakończenia obowiązania danego harmonogramu przypada bezpośrednio przed nieskorygowaną datą rozpoczęcia obowiązania dotyczącą następnego okresu).
72	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Ilość nominalna „nogi” 2 obowiązująca w powiązanej dacie rozpoczęcia obowiązania	Ilość nominalna „nogi” 2, która zaczyna obowiązywać w powiązanej nieskorygowanej dacie

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			rozpoczęcia obowiązywania.
	Sekcja obejmująca pola od 73 do 78 jest powtarzalna.		
73	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Rodzaj innej płatności	Rodzaj innej kwoty płatności Płatność premii opcyjnej nie jest uwzględniana jako rodzaj płatności, ponieważ premie opcyjne są zgłaszane z wykorzystaniem elementu danych dotyczącego premii opcyjnych.
74	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Kwota innej płatności	Kwoty płatności wraz z odpowiadającymi im rodzajami płatności w celu uwzględnienia wymogów dotyczących opisów transakcji z różnych klas aktywów.
75	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Waluta innej płatności	Waluta, w której denominuje się kwotę innej płatności.
76	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Data innej płatności	Nieskorygowana data wypłaty kwoty innej płatności.
77	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Płatnik dokonujący innej płatności	Identyfikator płatnika kwoty innej płatności.
78	Sekcja 2g – Szczegółowe informacje dotyczące transakcji	Odbiorca innej płatności	Identyfikator odbiorcy kwoty innej płatności.

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
79	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Stała stopa procentowa „nogi” 1 lub kupon	W stosownych przypadkach wskazanie stałej stopy procentowej „nogi” 1 lub kuponu.
80	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Konwencja liczenia dni dla płatności według stałej stopy procentowej lub kuponu – „noga” 1	W stosownych przypadkach: konwencja liczenia dni (często nazywana również ułamkiem liczby dni lub podstawą liczenia dni, lub metodą liczenia dni), która określa sposób obliczania płatności odsetkowych. Jest ona wykorzystywana do obliczenia ułamka roku okresu obliczeniowego i wskazuje liczbę dni w okresie obliczeniowym podzieloną przez liczbę dni w roku.
81	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Częstotliwość płatności według stałej stopy procentowej lub kuponu – „noga” 1	W stosownych przypadkach: jednostka czasowa związana z częstotliwością płatności, np. dzień, tydzień, miesiąc, rok lub czas trwania strumienia dla stałej stopy procentowej „nogi” 1 lub kupon.
82	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Mnożnik częstotliwości płatności według stałej stopy procentowej lub kuponu – „noga” 1	W stosownych przypadkach: liczba jednostek czasu (wyrażona za pomocą częstotliwości płatności), która określa częstotliwość występowania okresowych terminów płatności w odniesieniu do stałej stopy procentowej „nogi” 1 lub kupon. Na przykład transakcja, w ramach której płatności następują co dwa

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			miesiące, jest przedstawiona za pomocą częstotliwości płatności „MNTN” (miesięcznie) i mnożnika częstotliwości płatności równego 2. Ten element danych nie ma zastosowania, jeżeli częstotliwość płatności przyjmuje wartość „ADHO”. Jeżeli częstotliwości płatności przyjmuje wartość „EXPI”, mnożnik częstotliwości płatności wynosi 1. Jeżeli częstotliwość płatności jest śróddzienna, wówczas częstotliwość płatności przyjmuje wartość „DAIL”, a mnożnik częstotliwości płatności wynosi 0.
83	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Identyfikator zmiennej stopy procentowej „nogi” 1	W stosownych przypadkach: identyfikator stosowanych stóp procentowych, które są ustalane ponownie w z góry określonych odstępach czasu w drodze odniesienia do rynkowej stopy referencyjnej.
84	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Wskazanie zmiennej stopy procentowej „nogi” 1	Wskazanie stopy procentowej, jeżeli jest dostępna.
85	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Nazwa zmiennej stopy procentowej „nogi” 1	Pełna nazwa stopy procentowej nadana przez dostawcę indeksu.

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
86	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Konwencja liczenia dni dla płatności według zmiennej stopy procentowej – „noga” 1	W stosownych przypadkach: konwencja liczenia dni (często nazywana również ułamkiem liczby dni lub podstawą liczenia dni, lub metodą liczenia dni), która określa sposób obliczania płatności odsetkowych z tytułu zmiennej stopy procentowej w ramach „nogi” 1. Jest ona wykorzystywana do obliczenia ułamka roku okresu obliczeniowego i wskazuje liczbę dni w okresie obliczeniowym podzieloną przez liczbę dni w roku.
87	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Częstotliwość płatności według zmiennej stopy procentowej – „noga” 1	W stosownych przypadkach: jednostka czasowa związana z częstotliwością płatności, np. dzień, tydzień, miesiąc, rok lub czas trwania strumienia dla zmiennej stopy procentowej w ramach „nogi” 1.
88	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Mnożnik częstotliwości płatności według zmiennej stopy procentowej – „noga” 1	W stosownych przypadkach: liczba jednostek czasu (wyrażona za pomocą częstotliwości płatności), która określa częstotliwość występowania okresowych terminów płatności w odniesieniu do zmiennej stopy procentowej w ramach „nogi” 1. Na przykład transakcja, w ramach której płatności następują co dwa miesiące, jest przedstawiona za pomocą

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			<p>częstotliwości płatności „MNTN” (miesięcznie) i mnożnika częstotliwości płatności równego 2. Ten element danych nie ma zastosowania, jeżeli częstotliwość płatności przyjmuje wartość „ADHO”. Jeżeli częstotliwości płatności przyjmuje wartość „EXPI”, mnożnik częstotliwości płatności wynosi 1. Jeżeli częstotliwość płatności jest śróddzienna, wówczas częstotliwość płatności przyjmuje wartość „DAIL”, a mnożnik częstotliwości płatności wynosi 0.</p>
89	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Okres odniesienia dla zmiennej stopy procentowej w ramach „nogi” 1 – okres czasu	Przedział czasu opisujący okres odniesienia dla zmiennej stopy procentowej w ramach „nogi” 1.
90	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Okres odniesienia dla zmiennej stopy procentowej w ramach „nogi” 1 – mnożnik	Mnożnik przedziału czasu opisującego okres odniesienia dla zmiennej stopy procentowej w ramach „nogi” 1.
91	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Częstotliwość aktualizacji zmiennej stopy procentowej – „noga” 1	W stosownych przypadkach: jednostka czasowa związana z częstotliwością ponownego ustalania płatności, np. dzień, tydzień, miesiąc, rok lub czas trwania strumienia dla zmiennej stopy procentowej w ramach „nogi” 1.

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
92	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Mnożnik częstotliwości aktualizacji zmiennej stopy procentowej – „noga” 1	<p>W stosownych przypadkach: liczba jednostek czasu (wyrażona za pomocą częstotliwości płatności), która określa częstotliwość występowania okresowych terminów ponownego ustalania płatności w odniesieniu do zmiennej stopy procentowej w ramach „nogi” 1. Na przykład transakcja, w ramach której płatności następują co dwa miesiące, jest przedstawiona za pomocą częstotliwości płatności „MNTM” (miesięcznie) i mnożnika częstotliwości płatności równego 2. Ten element danych nie ma zastosowania, jeżeli częstotliwość płatności przyjmuje wartość „ADHO”. Jeżeli częstotliwość płatności przyjmuje wartość „EXPI”, mnożnik częstotliwości płatności wynosi 1. Jeżeli częstotliwość płatności jest śróddzienna, wówczas częstotliwość płatności przyjmuje wartość „DAIL”, a mnożnik częstotliwości płatności wynosi 0.</p>

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
93	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Spread „nogi” 1	<p>W stosownych przypadkach wskazanie spreadu w ramach „nogi” 1: w przypadku transakcji na instrumentach pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym z okresowymi płatnościami (np. swapy stałej/zmiennej stopy procentowej, swapy stopy procentowej typu zmienna za zmienną, swapy towarowe),</p> <ul style="list-style-type: none"> • spread ceny referencyjnej w ramach indeksu w odniesieniu do pojedynczej „nogi” (pojedynczych „nóg”) o zmiennym oprocentowaniu przypadku, gdy w odniesieniu do „nogi” o zmiennym oprocentowaniu stosuje się spread. • różnica między cenami referencyjnymi w ramach dwóch indeksów w odniesieniu do „nóg” o zmiennym oprocentowaniu.
94	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Waluta, w jakiej wyrażono spread „nogi” 1	<p>W stosownych przypadkach: waluta, w której denominowany jest spread „nogi” 1. Ten element danych ma zastosowanie tylko wtedy, gdy spread jest wyrażony jako kwota pieniężna.</p>
95	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Stała stopa procentowa „nogi” 2	<p>W stosownych przypadkach wskazanie stałej stopy procentowej stosowanej w ramach</p>

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			„nogi” 2.
96	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Konwencja liczenia dni dla płatności według stałej stopy procentowej – „noga” 2	W stosownych przypadkach: konwencja liczenia dni (często nazywana również ułamkiem liczby dni lub podstawą liczenia dni, lub metodą liczenia dni), która określa sposób obliczania płatności odsetkowych. Jest ona wykorzystywana do obliczenia ułamka roku okresu obliczeniowego i wskazuje liczbę dni w okresie obliczeniowym podzieloną przez liczbę dni w roku.
97	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Częstotliwość płatności według stałej stopy procentowej – „noga” 2	W stosownych przypadkach: jednostka czasowa związana z częstotliwością płatności, np. dzień, tydzień, miesiąc, rok lub czas trwania strumienia dla stałej stopy procentowej „nogi” 2.
98	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Mnożnik częstotliwości płatności według stałej stopy procentowej – „noga” 2	W stosownych przypadkach: liczba jednostek czasu (wyrażona za pomocą częstotliwości płatności), która określa częstotliwość występowania okresowych terminów płatności w odniesieniu do stałej stopy procentowej „nogi” 2. Na przykład transakcja, w ramach której płatności następują co dwa miesiące, jest przedstawiona za pomocą częstotliwości płatności

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			„MNTH” (miesięcznie) i mnożnika częstotliwości płatności równego 2. Ten element danych nie ma zastosowania, jeżeli częstotliwość płatności przyjmuje wartość „ADHO”. Jeżeli częstotliwości płatności przyjmuje wartość „EXPI”, mnożnik częstotliwości płatności wynosi 1. Jeżeli częstotliwość płatności jest śróddzienna, wówczas częstotliwość płatności przyjmuje wartość „DAIL”, a mnożnik częstotliwości płatności wynosi 0.
99	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Identyfikator zmiennej stopy procentowej „nogi” 2	W stosownych przypadkach: identyfikator stosowanych stóp procentowych, które są ustalane ponownie w z góry określonych odstępach czasu w drodze odniesienia do rynkowej stopy referencyjnej.
100	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Wskazanie zmiennej stopy procentowej „nogi” 2	Wskazanie stopy procentowej, jeżeli jest dostępna.
101	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Nazwa zmiennej stopy procentowej „nogi” 2	Pełna nazwa stopy procentowej nadana przez dostawcę indeksu.

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
102	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Konwencja liczenia dni dla płatności według zmiennej stopy procentowej – „noga” 2	W stosownych przypadkach: konwencja liczenia dni (często nazywana również ułamkiem liczby dni lub podstawą liczenia dni, lub metodą liczenia dni), która określa sposób obliczania płatności odsetkowych z tytułu zmiennej stopy procentowej w ramach „nogi” 2. Jest ona wykorzystywana do obliczenia ułamka roku okresu obliczeniowego i wskazuje liczbę dni w okresie obliczeniowym podzieloną przez liczbę dni w roku.
103	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Częstotliwość płatności według zmiennej stopy procentowej – „noga” 2	W stosownych przypadkach: jednostka czasowa związana z częstotliwością płatności, np. dzień, tydzień, miesiąc, rok lub czas trwania strumienia dla zmiennej stopy procentowej w ramach „nogi” 2.
104	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Mnożnik częstotliwości płatności według zmiennej stopy procentowej – „noga” 2	W stosownych przypadkach: liczba jednostek czasu (wyrażona za pomocą częstotliwości płatności), która określa częstotliwość występowania okresowych terminów płatności w odniesieniu do zmiennej stopy procentowej w ramach „nogi” 2. Na przykład transakcja, w ramach której płatności następują co dwa miesiące, jest przedstawiona za pomocą

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			<p>częstotliwości płatności „MNTN” (miesięcznie) i mnożnika częstotliwości płatności równego 2. Ten element danych nie ma zastosowania, jeżeli częstotliwość płatności przyjmuje wartość „ADHO”. Jeżeli częstotliwości płatności przyjmuje wartość „EXPI”, mnożnik częstotliwości płatności wynosi 1. Jeżeli częstotliwość płatności jest śróddzienna, wówczas częstotliwość płatności przyjmuje wartość „DAIL”, a mnożnik częstotliwości płatności wynosi 0.</p>
105	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Okres odniesienia dla zmiennej stopy procentowej w ramach „nogi” 2 – okres czasu	Przedział czasu opisujący okres odniesienia dla zmiennej stopy procentowej w ramach „nogi” 2.
106	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Okres odniesienia dla zmiennej stopy procentowej w ramach „nogi” 2 – mnożnik	Mnożnik przedziału czasu opisującego okres odniesienia dla zmiennej stopy procentowej w ramach „nogi” 2.
107	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Częstotliwość aktualizacji zmiennej stopy procentowej – „noga” 2	W stosownych przypadkach: jednostka czasowa związana z częstotliwością ponownego ustalania płatności, np. dzień, tydzień, miesiąc, rok lub czas trwania strumienia dla zmiennej stopy procentowej w ramach „nogi” 2.

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
108	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Mnożnik częstotliwości aktualizacji zmiennej stopy procentowej – „noga” 2	W stosownych przypadkach: liczba jednostek czasu (wyrażona za pomocą częstotliwości płatności), która określa częstotliwość występowania okresowych terminów ponownego ustalania płatności w odniesieniu do zmiennej stopy procentowej w ramach „nogi” 2. Na przykład transakcja, w ramach której płatności następują co dwa miesiące, jest przedstawiona za pomocą częstotliwości płatności „Mnth” (miesięcznie) i mnożnika częstotliwości płatności równego 2. Ten element danych nie ma zastosowania, jeżeli częstotliwość płatności przyjmuje wartość „ADHO”. Jeżeli częstotliwość płatności przyjmuje wartość „EXPI”, mnożnik częstotliwości płatności wynosi 1. Jeżeli częstotliwość płatności jest śróddzienna, wówczas częstotliwość płatności przyjmuje wartość „DAIL”, a mnożnik częstotliwości płatności wynosi 0.
109	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Spread „nogi” 2	W stosownych przypadkach wskazanie spreadu „nogi” 2: w przypadku transakcji na instrumentach pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			<p>z okresowymi płatnościami (np. swapy stałej lub zmiennej stopy procentowej, swapy stopy procentowej typu zmienna za zmienną, swapy towarowe),</p> <ul style="list-style-type: none"> • spread ceny referencyjnej w ramach indeksu w odniesieniu do pojedynczej „nogi” (pojedynczych „nóg”) o zmiennym oprocentowaniu przypadku, gdy w odniesieniu do „nogi” o zmiennym oprocentowaniu stosuje się spread. • różnica między cenami referencyjnymi w ramach dwóch indeksów w odniesieniu do „nóg” o zmiennym oprocentowaniu.
110	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Waluta, w jakiej wyrażono spread „nogi” 2	<p>W stosownych przypadkach: waluta, w której denominowany jest spread „nogi” 2. Ten element danych ma zastosowanie tylko wtedy, gdy spread jest wyrażony jako kwota pieniężna.</p>

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
111	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Spread transakcji pakietowej	<p>Cena w obrocie dotycząca całego pakietu, którego elementem jest zgłoszona transakcja pakietowe na instrumentach pochodnych.</p> <p>Cena transakcji pakietowej, gdy cena pakietu jest wyrażona jako spread, różnica między dwiema cenami referencyjnymi.</p> <p>Ten element danych nie ma zastosowania w przypadku gdy</p> <ul style="list-style-type: none"> • zgłoszenie nie dotyczy żadnego pakietu lub • stosuje się cenę transakcji pakietowej. <p>Spread i powiązane elementy danych transakcji (waluta spreadu), które stanowią poszczególne składniki pakietu, zgłasza się, jeżeli są dostępne.</p> <p>Spread transakcji pakietowej może nie być znany w chwili zgłoszenia nowej transakcji, ale może zostać zaktualizowany w późniejszym terminie.</p>
112	Sekcja 2h – Stopy procentowe	Waluta, w jakiej wyrażono spread transakcji pakietowej	<p>Waluta, w której denominowany jest spread transakcji pakietowej.</p> <p>Ten element danych nie ma zastosowania w przypadku gdy</p> <ul style="list-style-type: none"> • zgłoszenie nie dotyczy żadnego pakietu lub • stosuje się cenę transakcji pakietowej, lub • spread transakcji pakietowej jest wyrażony jako wartość procentowa lub w punktach bazowych.

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
113	Sekcja 2i – Transakcje walutowe	Kurs walutowy 1	Kurs wymiany między dwiema różnymi walutami określonymi w transakcji na instrumentach pochodnych uzgodniony przez kontrahentów w chwili rozpoczęcia transakcji, wyrażony jako kurs wymiany z przeliczenia waluty bazowej na walutę kwotowaną.
114	Sekcja 2i – Transakcje walutowe	Terminowy kurs walutowy	Terminowy kurs walutowy uzgodniony między kontrahentami w kontrakcie. Wyraża się go jako cenę waluty bazowej w walucie kwotowanej.
115	Sekcja 2i – Transakcje walutowe	Podstawa kursu walutowego	Para walutowa i kolejność, w której kurs walutowy jest denominowany, w walucie bazowej lub walucie kwotowanej.
116	Sekcja 2j – Towary i uprawnienia do emisji (ogólne)	Produkt bazowy	Produkt bazowy określony w klasyfikacji towarów w tabeli 4 załącznika do [do Urzędu Publikacji: proszę wstawić odniesienie do C(2022) 3588]
117	Sekcja 2j – Towary i uprawnienia do emisji (ogólne)	Podrodzaj produktu	Podrodzaj produktu określony w klasyfikacji towarów w tabeli 4 załącznika do [do Urzędu Publikacji: proszę wstawić odniesienie do C(2022) 3588] W tym polu należy podać konkretny produkt bazowy.

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
118	Sekcja 2j – Towary i uprawnienia do emisji (ogólne)	Dalszy podrodzaj produktu	Dalszy podrodzaj produktu określony w klasyfikacji towarów w tabeli 4 załącznika do [do Urzędu Publikacji: proszę wstawić odniesienie do C(2022) 3588] W tym polu należy podać konkretny podrodzaj produktu.
119	Sekcja 2k – Towary i uprawnienia do emisji (energia)	Miejsce lub strefa dostawy	Miejsce lub miejsca dostawy lub obszar lub obszary rynku
120	Sekcja 2k – Towary i uprawnienia do emisji (energia)	Punkt połączenia międzysystemowego	Wskazanie punktu granicznego lub punktów granicznych określonych w umowie przesyłowej.
121	Sekcja 2k – Towary i uprawnienia do emisji (energia)	Rodzaj obciążenia	Identyfikacja profilu dostawy.
	Sekcja obejmująca pola od 122 do 131 jest powtarzalna.		
122	Sekcja 2k – Towary i uprawnienia do emisji (energia)	Czas rozpoczęcia przedziału czasowego dostawy	Czas rozpoczęcia okresu dostawy w odniesieniu do każdego bloku lub formy.
123	Sekcja 2k – Towary i uprawnienia do emisji (energia)	Czas zakończenia przedziału czasowego dostawy	Czas zakończenia okresu dostawy w odniesieniu do każdego bloku lub formy.

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
124	Sekcja 2k – Towary i uprawnienia do emisji (energia)	Data rozpoczęcia dostawy	Data rozpoczęcia dostawy.
125	Sekcja 2k – Towary i uprawnienia do emisji (energia)	Data zakończenia dostawy	Data zakończenia dostawy.
126	Sekcja 2k – Towary i uprawnienia do emisji (energia)	Czas trwania	Czas trwania okresu dostawy.
127	Sekcja 2k – Towary i uprawnienia do emisji (energia)	Dni tygodnia	Dni tygodnia, w których realizowana jest dostawa.
128	Sekcja 2k – Towary i uprawnienia do emisji (energia)	Wielkość dostawy	Liczba jednostek uwzględnionych w transakcji dla każdego okresu dostawy określonego w polach 122 i 123.
129	Sekcja 2k – Towary i uprawnienia do emisji (energia)	Jednostka ilości	Zastosowana jednostka miary.
130	Sekcja 2k – Towary i uprawnienia do emisji (energia)	Cena/iłość w przedziale czasowym	W stosownych przypadkach, cena za ilość w przedziale czasowym dostawy.
131	Sekcja 2k – Towary i uprawnienia do emisji (energia)	Waluta, w jakiej wyrażono cenę/iłość w przedziale czasowym	Walutę, w której wyrażona jest cena za ilość w okresie dostawy.

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
132	Sekcja 21 – Opcje	Rodzaj opcji	<p>Wskazanie, czy kontrakt pochodny jest opcją kupna (prawo do zakupu danego bazowego składnika aktywów) lub opcją sprzedaży (prawo do sprzedaży danego składnika aktywów bazowych) lub czy w chwili wykonania kontraktu pochodnego nie można stwierdzić, czy chodzi o opcję kupna czy opcję sprzedaży.</p> <p>W przypadku opcji na swapy jest to:</p> <ul style="list-style-type: none"> – opcja sprzedaży w przypadku otrzymującej opcji na swapy, w której nabywca ma prawo do zawierania transakcji swap jako odbiorca według stałej stopy procentowej. – opcja kupna w przypadku płacącej opcji na swapy, w której nabywca ma prawo do zawierania transakcji swap jako płatnik według stałej stopy procentowej. <p>W przypadku górnych i dolnych limitów jest to:</p> <ul style="list-style-type: none"> – opcja sprzedaży w przypadku dolnego limitu. – opcja kupna w przypadku górnego limitu.
133	Sekcja 21 – Opcje	Model opcji	<p>Wskazanie, czy opcja może zostać wykonana jedynie w jednym określonym terminie (opcja europejska), w jednym z wielu z góry określonych terminów (opcja bermudzka) lub</p>

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			w dowolnej chwili w trakcie obowiązywania kontraktu (opcja amerykańska).
134	Sekcja 21 – Opcje	Kurs wykonania	<ul style="list-style-type: none"> • W przypadku opcji innych niż opcje walutowe, opcje na swapy i podobne produkty – cena, po której właściciel opcji może nabyć lub sprzedać bazowy składnik aktywów opcji. • W przypadku opcji walutowych, kurs wymiany, po którym opcja może zostać wykonana, wyrażony jako kurs wymiany z przeliczenia waluty bazowej na walutę kwotowaną. W przykładzie 0,9426 USD/EUR, USD jest walutą bazową, a EUR jest walutą kwotowaną; 1 USD = 0,9426 EUR. W przypadku gdy kurs wykonania nie jest znany w chwili zgłoszenia nowej transakcji, jest on aktualizowany w miarę dostępności. • W przypadku swapów zmienności i wariacji oraz podobnych produktów w tym elemencie danych zgłasza się kurs wykonania oparty na zmienności.
	Pola 135–137 są powtarzalne i wypełnia się je w przypadku instrumentów pochodnych obejmujących harmonogramy		

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
	zmian kursu wykonania		
135	Sekcja 21 – Opcje	Data rozpoczęcia obowiązywania kursu wykonania	Nieskorygowana data rozpoczęcia obowiązywania kursu wykonania.
136	Sekcja 21 – Opcje	Data zakończenia obowiązywania kursu wykonania	Nieskorygowana data końcowa kursu wykonania (nie ma zastosowania, jeżeli nieskorygowana data zakończenia obowiązywania danego harmonogramu przypada bezpośrednio przed nieskorygowaną datą rozpoczęcia obowiązywania dotyczącą następnego okresu).
137	Sekcja 21 – Opcje	Kurs wykonania obowiązujący w powiązanej dacie rozpoczęcia obowiązywania	Kurs wykonania obowiązujący między nieskorygowaną datą rozpoczęcia obowiązywania a nieskorygowaną datą zakończenia, z tą ostatnią włącznie.
138	Sekcja 21 – Opcje	Waluta/para walutowa, w jakiej wyrażono cenę wykonania	W przypadku opcji na akcje, opcji towarowych i podobnych produktów – waluta, w której wyrażony jest kurs wykonania. W przypadku opcji walutowych: Para walutowa i kolejność wyrażające kurs wykonania. Jest ona wyrażona w walucie bazowej w stosunku do waluty kwotowanej.

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
139	Sekcja 2l – Opcje	Kwota premii opcyjnej	W przypadku opcji i opcji na swapy wszystkich klas aktywów, kwota pieniężna płacona przez nabywcę opcji. Ten element danych nie ma zastosowania w przypadku gdy instrument nie jest opcją lub nie zawiera żadnych cech opcjonalności.
140	Sekcja 2l – Opcje	Waluta, w jakiej wyrażono premię opcyjną	W przypadku opcji i opcji na swapy wszystkich klas aktywów, waluta, w której denominowana jest premia opcyjna. Ten element danych nie ma zastosowania w przypadku gdy instrument nie jest opcją lub nie zawiera żadnych cech opcjonalności.
141	Sekcja 2l – Opcje	Data płatności premii opcyjnej	Nieskorygowana data, w której wypłaca się premię opcyjną.
142	Sekcja 2i – Opcje	Termin zapadalności instrumentu bazowego	W przypadku opcji na swapy jest to termin zapadalności swapu bazowego.
143	Sekcja 2m – Kredytowe instrumenty pochodne	Uprzywilejowanie	Wskazanie uprzywilejowania dłużnego papieru wartościowego, koszyka dłużnych papierów wartościowych lub indeksu bazowego instrumentu pochodnego.
144	Sekcja 2m – Kredytowe instrumenty pochodne	Podmiot referencyjny	Określenie bazowego podmiotu referencyjnego.

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
145	Sekcja 2m – Kredytowe instrumenty pochodne	Seria	W stosownych przypadkach numer serii elementów składowych indeksu.
146	Sekcja 2m – Kredytowe instrumenty pochodne	Wersja	Jeżeli dojdzie do niewykonania zobowiązania w związku z jednym z elementów składowych indeksu, co będzie wiązało się z koniecznością jego skorygowania, aby wziąć pod uwagę nową łączną liczbę jego elementów składowych, publikuje się nową wersję serii.
147	Sekcja 2m – Kredytowe instrumenty pochodne	Współczynnik indeksu	Współczynnik stosuje się do kwoty nominalnej (pole 55 w tabeli), aby dostosować ją do wszystkich wcześniejszych zdarzeń kredytowych w tej serii indeksu.
148	Sekcja 2m – Kredytowe instrumenty pochodne	Transza	Wskazanie, czy kontrakt pochodny jest podzielony na transze.
149	Sekcja 2m – Kredytowe instrumenty pochodne	Punkt inicjujący indeksu swapów ryzyka kredytowego (CDS)	Określony dolny punkt, w którym poziom strat w portfelu bazowym obniża kwotę nominalną transzy. Na przykład kwota nominalna transzy z punktem inicjującym w wysokości 3 % zostanie obniżona po wystąpieniu 3 % strat w portfelu. Ten element danych nie ma zastosowania, jeżeli transakcja nie dotyczy transzy swapu ryzyka kredytowego (indeksu lub

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			koszyka strukturyzowanego).
150	Sekcja 2m – Kredytowe instrumenty pochodne	Punkt kończący indeksu CDS	Określony punkt, powyżej którego straty w portfelu bazowym nie obniżają już kwoty nominalnej transzy. Na przykład kwota nominalna w transzy z punktem inicjującym w wysokości 3 % i punktem kończącym w wysokości 6 % zostanie obniżona po wystąpieniu 3 % strat w portfelu. 6 % straty w portfelu zmniejszają kwotę nominalną transzy. Ten element danych nie ma zastosowania, jeżeli transakcja nie dotyczy transzy swapu ryzyka kredytowego (indeksu lub koszyka strukturyzowanego).
151	Sekcja 2n – Zmiany kontraktu na instrument pochodny	Rodzaj operacji	<ul style="list-style-type: none"> • Nowy: Zgłoszenie instrumentu pochodnego na poziomie transakcji lub pozycji po raz pierwszy. • Zmiana: Zmiana warunków lub szczegółowych informacji dotyczących wcześniej zgłoszonego, na poziomie transakcji lub pozycji, instrumentu pochodnego, ale nie korekta zgłoszenia. • Korekta: Zgłoszenie korygujące błędne pola danych w poprzednio złożonym zgłoszeniu. • Rozwiązanie: Rozwiązanie istniejącego instrumentu pochodnego

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			<p>na poziomie transakcji lub pozycji.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Błąd: Anulowanie błędnie złożonego całego zgłoszenia w przypadku, gdy instrument pochodny, na poziomie transakcji lub pozycji, nigdy nie powstał lub nie podlegał wymogom dotyczącym zgłaszania przewidzianym w rozporządzeniu (UE) nr 648/2012, ale został zgłoszony do repozytorium transakcji przez pomyłkę, lub anulowanie zdublowanego zgłoszenia. • Wznowienie: Ponowne otwarcie instrumentu pochodnego, na poziomie transakcji lub pozycji, który anulowano za pomocą rodzaju operacji „Błąd” lub rozwiązano przez pomyłkę. • Wycena: Aktualizacja wyceny instrumentu pochodnego na poziomie transakcji lub pozycji • Składnik pozycji: Zgłoszenie nowego instrumentu pochodnego, który jest włączony do osobnego zgłoszenia dotyczącego pozycji w tym samym dniu.
152	Sekcja 2n – Zmiany kontraktu na instrument pochodny	Rodzaj zdarzenia	<ul style="list-style-type: none"> • Transakcja: Zawarcie instrumentu pochodnego lub renegocjacja jego warunków, która nie skutkuje zmianą kontrahenta • Wstąpienie w prawa: Zdarzenie, w ramach którego część lub całość instrumentu pochodnego

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			<p>zostaje przeniesiona na kontrahenta 2 (i zgłoszona jako nowy instrument pochodny), a istniejący instrument pochodny zostaje rozwiązany albo jego kwota nominalna ulega zmianie.</p> <ul style="list-style-type: none"> • PTRR: Działanie posttransakcyjne w zakresie redukcji ryzyka • Przedterminowe rozwiązanie: Rozwiązanie instrumentu pochodnego na poziomie transakcji lub pozycji • Rozliczanie: Rozliczanie zgodnie z definicją zawartą w art. 2 pkt (3) rozporządzenia (UE) nr 648/2012 • Wykonanie: Wykonanie w całości lub częściowo opcji lub opcji na swapy przez jednego z kontrahentów transakcji. • Przepisanie: Zdarzenie polegające na przypisaniu, w ramach którego istniejący instrument pochodny zostaje przypisany do innych kontrahentów i zgłoszony jako nowy instrument pochodny o obniżonej kwocie nominalnej. • Zdarzenia kredytowe: Ma zastosowanie wyłącznie do kredytowych instrumentów pochodnych. Zdarzenie kredytowe, które skutkuje zmianą instrumentu pochodnego na poziomie transakcji lub pozycji <p>Zdarzenie korporacyjne: Zdarzenie korporacyjne dotyczące akcji bazowych,</p>

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			<p>które ma wpływ na instrumenty pochodne na te akcje</p> <ul style="list-style-type: none"> • Włączenie do pozycji: Włączenie rozliczanego przez CCP instrumentu pochodnego lub kontraktu różnic kursowych do pozycji, gdy istniejący instrument pochodny zostaje rozwiązany i albo tworzona jest nowa pozycja, albo kwota nominalna istniejącej pozycji ulega zmianie. <p>Aktualizacja – aktualizacja nierozliczonego instrumentu pochodnego przeprowadzona w okresie przejściowym w celu zapewnienia zgodności ze zmienionymi wymogami dotyczącymi zgłaszania</p>
153	Sekcja 2n – Zmiany kontraktu na instrument pochodny	Data zdarzenia	Data, w której miało miejsce podlegające zgłoszeniu i ujęte w zgłoszeniu zdarzenie dotyczące kontraktu pochodnego lub, w przypadku zmiany, data rozpoczęcia obowiązywania zmiany.
154	Sekcja 2n – Zmiany kontraktu na instrument pochodny	Poziom	Wskazanie, czy zgłoszenie zostało sporządzone na poziomie transakcji czy pozycji. Zgłoszenie na poziomie pozycji może być wykorzystywane jedynie jako uzupełnienie zgłaszania na poziomie transakcji w celu zgłoszenia zdarzenia posttransakcyjnego i tylko wtedy, gdy poszczególne

	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			transakcje na produktach zamiennych zostały zastąpione pozycją.

Tabela 3

Pozycja	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
1	Strony kontraktu na instrument pochodny	Znacznik czasu zgłoszenia	Data i godzina przekazania zgłoszenia do repozytorium transakcji.
2	Strony kontraktu na instrument pochodny	Identyfikator podmiotu przekazującego zgłoszenie	W przypadku gdy podmiot odpowiedzialny za dokonanie zgłoszenia delegował obowiązek dokonania zgłoszenia do osoby trzeciej lub drugiego kontrahenta, podmiot ten musi zostać zidentyfikowany w tym polu za pomocą niepowtarzalnego kodu. W przeciwnym razie w tym polu należy wskazać podmiot odpowiedzialny za zgłaszanie.
3	Strony kontraktu na instrument pochodny	Podmiot odpowiedzialny za zgłaszanie	Jeżeli wyłączną odpowiedzialność i odpowiedzialność prawną za sprawozdawczość w imieniu obu kontrahentów zgodnie z art. 9 ust. 1a rozporządzenia (UE) nr 648/2012 ponosi kontrahent finansowy, a kontrahent niefinansowy nie decyduje się na zgłoszenie we własnym zakresie szczegółowych informacji na temat swoich kontraktów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, niepowtarzalny kod identyfikujący tego kontrahenta finansowego. W przypadku gdy za dokonywanie zgłoszeń w imieniu przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania w zbywalne papiery wartościowe (UCITS) zgodnie z art. 9 ust. 1b tego rozporządzenia odpowiedzialna i prawnie odpowiedzialna

Pozycja	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			<p>jest spółka zarządzająca, niepowtarzalny kod identyfikujący tę spółkę zarządzającą.</p> <p>W przypadku gdy za dokonywanie zgłoszeń w imieniu alternatywnego funduszu inwestycyjnego (AFI) zgodnie z art. 9 ust. 1c tego rozporządzenia odpowiedzialny i prawnie odpowiedzialny jest zarządzający alternatywnym funduszem inwestycyjnym (ZAFI), niepowtarzalny kod identyfikujący tego ZAFI. W przypadku gdy upoważniony podmiot, który jest odpowiedzialny za zarządzanie IORP i działanie w jej imieniu, jest odpowiedzialny i prawnie odpowiedzialny za dokonywanie zgłoszeń w jej imieniu zgodnie z art. 9 ust. 1d tego rozporządzenia, niepowtarzalny kod identyfikujący ten podmiot.</p> <p>Niniejsze pole ma zastosowanie wyłącznie do instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym.</p>
4	Strony kontraktu na instrument pochodny	Kontrahent 1 (kontrahent dokonujący zgłoszenia)	<p>Identyfikator kontrahenta transakcji na instrumentach pochodnych, który wypełnia swój obowiązek zgłaszania za pośrednictwem danego zgłoszenia.</p> <p>W przypadku przypisanej transakcji na instrumentach pochodnych realizowanej przez zarządzającego funduszem w imieniu funduszu, jako kontrahenta zgłasza się fundusz, a nie zarządzającego funduszem.</p>
5	Strony kontraktu na instrument pochodny	Rodzaj identyfikatora kontrahenta 2	Wskazanie, czy do identyfikacji kontrahenta 2 wykorzystano LEI.
6	Strony kontraktu na instrument pochodny	Kontrahent 2	<p>Identyfikator drugiego kontrahenta transakcji na instrumentach pochodnych.</p> <p>W przypadku przypisanej transakcji na instrumentach pochodnych realizowanej przez zarządzającego funduszem w imieniu funduszu, jako kontrahenta zgłasza się</p>

Pozycja	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			fundusz, a nie zarządzającego funduszem.
7	Zabezpieczenie	Znacznik czasu zabezpieczenia	Data i godzina, od której zgłaszane są wartości depozytów zabezpieczających.
8	Zabezpieczenie	Wskazanie, czy zabezpieczenie wniesiono na poziomie portfela	Wskazanie dotyczący tego, czy zabezpieczenie wniesiono na poziomie portfela. Określenie „na poziomie portfela” oznacza zbiór transakcji podlegających obowiązkowi wniesienia wspólnego depozytu zabezpieczającego (w ujęciu netto albo brutto) w przeciwieństwie do scenariusza, w którym depozyt zabezpieczający jest obliczany i księgowany oddzielnie dla każdej pojedynczej transakcji.
9	Zabezpieczenie	Kod portfela, dla którego wniesiono zabezpieczenie	Jeżeli zabezpieczenie jest zgłaszane na poziomie portfela, niepowtarzalny kod przypisany portfelowi przez kontrahenta 1. Ten element danych nie ma zastosowania, jeżeli zabezpieczenie wniesiono na poziomie transakcji lub jeżeli nie zawarto umowy zabezpieczającej, lub jeżeli nie wniesiono ani nie otrzymano żadnego zabezpieczenia.
10	Zabezpieczenie	UTI	Unikatowy identyfikator transakcji, o którym mowa w art. 7 [<i>Do Urzędu Publikacji: proszę wstawić odniesienie do C(2022) 3588</i>].
11	Zabezpieczenie	Kategoria zabezpieczenia	Wskazanie, czy między kontrahentami zawarto umowę zabezpieczającą. Ten element danych podaje się dla każdej transakcji lub każdego portfela, w zależności od tego, czy zabezpieczenie jest dokonywane na poziomie transakcji czy portfela, i ma on zastosowanie zarówno do transakcji rozliczonych, jak i nierozliczonych.

Pozycja	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
12	Zabezpieczenie	Wniesiony przez kontrahenta 1 początkowy depozyt zabezpieczający (przed redukcją wartości)	<p>Wartość pieniężna początkowego depozytu zabezpieczającego, który został wniesiony przez kontrahenta 1, łącznie z depozytem zabezpieczającym w trakcie przekazywania i oczekującym na rozrachunek.</p> <p>Jeżeli zabezpieczenia dokonuje się na poziomie portfela, wniesiony początkowy depozyt zabezpieczający odnosi się do całego portfela; jeżeli zabezpieczenia dokonuje się na poziomie pojedynczych transakcji, wniesiony początkowy depozyt zabezpieczający odnosi się do takiej pojedynczej transakcji.</p> <p>Pole to odnosi się do całkowitej bieżącej wartości początkowego depozytu zabezpieczającego, a nie do dziennej zmiany jego wartości.</p> <p>Ten element danych odnosi się zarówno do transakcji nierozliczonych, jak i rozliczonych centralnie.</p> <p>W przypadku transakcji rozliczonych centralnie ten element danych nie obejmuje składek na fundusz na wypadek niewykonania zobowiązania ani zabezpieczenia wniesionego na poczet rezerw płynności na rzecz CCP, tj. przyznanych linii kredytowych.</p> <p>Jeśli wniesiony początkowy depozyt zabezpieczający jest denominowany w więcej niż jednej walucie, kwoty te są przeliczane na jedną walutę wybraną przez kontrahenta 1 i zgłaszane jako jedna łączna wartość.</p>
13	Zabezpieczenie	Wniesiony przez kontrahenta 1 początkowy depozyt zabezpieczający (po redukcji wartości)	<p>Wartość pieniężna początkowego depozytu zabezpieczającego, który został wniesiony przez kontrahenta 1, łącznie z depozytem zabezpieczającym w trakcie przekazywania i oczekującym na rozrachunek.</p> <p>Jeżeli zabezpieczenia dokonuje się na poziomie portfela, wniesiony początkowy depozyt zabezpieczający odnosi się do całego portfela; jeżeli zabezpieczenia dokonuje się</p>

Pozycja	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			<p>na poziomie pojedynczych transakcji, wniesiony początkowy depozyt zabezpieczający odnosi się do takiej pojedynczej transakcji.</p> <p>Pole to odnosi się do całkowitej bieżącej wartości początkowego depozytu zabezpieczającego po zastosowaniu redukcji wartości (w stosownych przypadkach), a nie do dziennej zmiany wartości depozytu.</p> <p>Ten element danych odnosi się zarówno do transakcji nierozliczonych, jak i rozliczonych centralnie. W przypadku transakcji rozliczonych centralnie ten element danych nie obejmuje składek na fundusz na wypadek niewykonania zobowiązania ani zabezpieczenia wniesionego na poczet rezerw płynności na rzecz CCP, tj. przyznanych linii kredytowych.</p> <p>Jeśli wniesiony początkowy depozyt zabezpieczający jest denominowany w więcej niż jednej walucie, kwoty te są przeliczane na jedną walutę wybraną przez kontrahenta 1 i zgłaszane jako jedna łączna wartość.</p>
14	Zabezpieczenie	Waluta wniesionego początkowego depozytu zabezpieczającego	<p>Waluta, w której denominowany jest wniesiony początkowy depozyt zabezpieczający.</p> <p>Jeśli wniesiony początkowy depozyt zabezpieczający jest denominowany w więcej niż jednej walucie, ten element danych odzwierciedla jedną z tych walut, na którą kontrahent 1 zdecydował się przeliczyć wszystkie wartości wniesionych początkowych depozytów zabezpieczających.</p>

Pozycja	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
15	Zabezpieczenie	Wniesiony przez kontrahenta 1 zmienny depozyt zabezpieczający (przed redukcją wartości)	<p>Wartość pieniężna zmiennego depozytu zabezpieczającego wniesionego przez kontrahenta 1, łącznie z depozytem zabezpieczającym rozliczanym w środkach pieniężnych i wszelkimi depozytami zabezpieczającymi w trakcie przekazywania i oczekującymi na rozrachunek. Nie obejmuje to warunkowego zmiennego depozytu zabezpieczającego. Jeżeli zabezpieczenia dokonuje się na poziomie portfela, wniesiony zmienny depozyt zabezpieczający odnosi się do całego portfela; jeżeli zabezpieczenia dokonuje się na poziomie pojedynczych transakcji, wniesiony zmienny depozyt zabezpieczający odnosi się do takiej pojedynczej transakcji. Pole to odnosi się do całkowitej bieżącej wartości zmiennego depozytu zabezpieczającego, zgromadzonej od chwili pierwszego zgłoszenia zmiennych depozytów zabezpieczających wniesionych w odniesieniu do danego portfela lub transakcji. Jeśli wniesiony zmienny depozyt zabezpieczający jest denominowany w więcej niż jednej walucie, kwoty te są przeliczane na jedną walutę wybraną przez kontrahenta 1 i zgłaszane jako jedna łączna wartość.</p>
16	Zabezpieczenie	Wniesiony przez kontrahenta 1 zmienny depozyt zabezpieczający (po redukcji wartości)	<p>Wartość pieniężna zmiennego depozytu zabezpieczającego wniesionego przez kontrahenta 1, łącznie z depozytem zabezpieczającym rozliczanym w środkach pieniężnych i wszelkimi depozytami zabezpieczającymi w trakcie przekazywania i oczekującymi na rozrachunek. Nie obejmuje to warunkowego zmiennego depozytu zabezpieczającego. Jeżeli zabezpieczenia dokonuje się na poziomie portfela, wniesiony zmienny depozyt zabezpieczający odnosi się do całego portfela; jeżeli zabezpieczenia dokonuje się</p>

Pozycja	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			<p>na poziomie pojedynczych transakcji, wniesiony zmienny depozyt zabezpieczający odnosi się do takiej pojedynczej transakcji. Pole to odnosi się do całkowitej bieżącej wartości zmiennego depozytu zabezpieczającego po zastosowaniu – w stosownych przypadkach – redukcji wartości, zgromadzonej od chwili pierwszego zgłoszenia zmiennych depozytów zabezpieczających wniesionych w odniesieniu do danego portfela lub transakcji.</p> <p>Jeśli wniesiony zmienny depozyt zabezpieczający jest denominowany w więcej niż jednej walucie, kwoty te są przeliczane na jedną walutę wybraną przez kontrahenta 1 i zgłaszane jako jedna łączna wartość.</p>
17	Zabezpieczenie	Waluta wniesionego zmiennego depozytu zabezpieczającego	<p>Waluta, w której denominowany jest wniesiony zmienny depozyt zabezpieczający. Jeśli wniesiony zmienny depozyt zabezpieczający jest denominowany w więcej niż jednej walucie, ten element danych odzwierciedla jedną z tych walut, na którą kontrahent 1 zdecydował się przeliczyć wszystkie wartości wniesionych zmiennych depozytów zabezpieczających.</p>
18	Zabezpieczenie	Nadwyżka zabezpieczenia wniesionego przez kontrahenta 1	<p>Wartość pieniężna każdego dodatkowego zabezpieczenia wniesionego przez kontrahenta 1, oddzielnego i niezależnego od początkowego i zmiennego depozytu zabezpieczającego. Pole to odnosi się do całkowitej bieżącej wartości nadwyżki wniesionego zabezpieczenia przed zastosowaniem redukcji wartości (w stosownych przypadkach), a nie do dziennej zmiany wartości zabezpieczenia.</p> <p>Każda kwota wniesionego początkowego lub zmiennego depozytu zabezpieczającego, która przekracza wymagany początkowy depozyt zabezpieczający lub wymagany</p>

Pozycja	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			<p>zmienny depozyt zabezpieczający, jest zgłaszana jako część odpowiednio wniesionego początkowego depozytu zabezpieczającego lub zmiennego depozytu zabezpieczającego, a nie ujmowana jako nadwyżka wniesionego zabezpieczenia. W przypadku transakcji rozliczanych centralnie nadwyżka zabezpieczenia jest zgłaszana tylko w takim zakresie, w jakim można ją przypisać do konkretnego portfela lub transakcji.</p>
19	Zabezpieczenie	Waluta nadwyżki wniesionego zabezpieczenia	<p>Waluta, w której denominowana jest nadwyżka wniesionego zabezpieczenia. Jeśli nadwyżka wniesionego zabezpieczenia jest denominowana w więcej niż jednej walucie, ten element danych odzwierciedla jedną z tych walut, na którą kontrahent 1 zdecydował się przeliczyć wszystkie wartości wniesionych nadwyżek zabezpieczenia.</p>
20	Zabezpieczenie	Otrzymany przez kontrahenta 1 początkowy depozyt zabezpieczający (przed redukcją wartości)	<p>Wartość pieniężna początkowego depozytu zabezpieczającego, który został otrzymany przez kontrahenta 1, łącznie z depozytem zabezpieczającym w trakcie przekazywania i oczekującym na rozrachunek. Jeżeli zabezpieczenia dokonuje się na poziomie portfela, otrzymany początkowy depozyt zabezpieczający odnosi się do całego portfela; jeżeli zabezpieczenia dokonuje się na poziomie pojedynczych transakcji, otrzymany początkowy depozyt zabezpieczający odnosi się do takiej pojedynczej transakcji. Pole to odnosi się do całkowitej bieżącej wartości początkowego depozytu zabezpieczającego, a nie do dziennej zmiany jego wartości. Ten element danych odnosi się zarówno do transakcji nierozliczonych, jak i rozliczonych centralnie. W przypadku transakcji rozliczonych centralnie ten element danych nie obejmuje zabezpieczenia otrzymanego</p>

Pozycja	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			<p>przez CCP w ramach prowadzonej przez niego działalności inwestycyjnej. Jeśli otrzymany początkowy depozyt zabezpieczający jest denominowany w więcej niż jednej walucie, kwoty te są przeliczane na jedną walutę wybraną przez kontrahenta 1 i zgłaszane jako jedna łączna wartość.</p>
21	Zabezpieczenie	Otrzymany przez kontrahenta 1 początkowy depozyt zabezpieczający (po redukcji wartości)	<p>Wartość pieniężna początkowego depozytu zabezpieczającego, który został otrzymany przez kontrahenta 1, łącznie z depozytem zabezpieczającym w trakcie przekazywania i oczekującym na rozrachunek. Jeżeli zabezpieczenia dokonuje się na poziomie portfela, otrzymany początkowy depozyt zabezpieczający odnosi się do całego portfela; jeżeli zabezpieczenia dokonuje się na poziomie pojedynczych transakcji, otrzymany początkowy depozyt zabezpieczający odnosi się do takiej pojedynczej transakcji.</p> <p>Pole to odnosi się do całkowitej bieżącej wartości początkowego depozytu zabezpieczającego po zastosowaniu redukcji wartości (w stosownych przypadkach), a nie do dziennej zmiany wartości depozytu. Ten element danych odnosi się zarówno do transakcji nierozliczonych, jak i rozliczonych centralnie. W przypadku transakcji rozliczonych centralnie ten element danych nie obejmuje zabezpieczenia otrzymanego przez CCP w ramach prowadzonej przez niego działalności inwestycyjnej. Jeśli otrzymany początkowy depozyt zabezpieczający jest denominowany</p>

Pozycja	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			w więcej niż jednej walucie, kwoty te są przeliczane na jedną walutę wybraną przez kontrahenta 1 i zgłaszane jako jedna łączna wartość.
22	Zabezpieczenie	Waluta otrzymanego początkowego depozytu zabezpieczającego	Waluta, w której denominowany jest otrzymany początkowy depozyt zabezpieczający. Jeśli otrzymany początkowy depozyt zabezpieczający jest denominowany w więcej niż jednej walucie, ten element danych odzwierciedla jedną z tych walut, na którą kontrahent 1 zdecydował się przeliczyć wszystkie wartości otrzymanych początkowych depozytów zabezpieczających.
23	Zabezpieczenie	Otrzymany przez kontrahenta 1 zmienny depozyt zabezpieczający (przed redukcją wartości)	Wartość pieniężna zmiennego depozytu zabezpieczającego otrzymanego przez kontrahenta 1, łącznie z depozytem zabezpieczającym rozliczanym w środkach pieniężnych i wszelkimi depozytami zabezpieczającymi w trakcie przekazywania i oczekującymi na rozrachunek. Nie obejmuje to warunkowego zmiennego depozytu zabezpieczającego. Jeżeli zabezpieczenia dokonuje się na poziomie portfela, otrzymany zmienny depozyt zabezpieczający odnosi się do całego portfela; jeżeli zabezpieczenia dokonuje się na poziomie pojedynczych transakcji, otrzymany zmienny depozyt zabezpieczający odnosi się do takiej pojedynczej transakcji. Pole to odnosi się do całkowitej bieżącej

Pozycja	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			<p>wartości zmiennego depozytu zabezpieczającego, zgromadzonej od chwili pierwszego zgłoszenia zmiennych depozytów zabezpieczających otrzymanych dla danego portfela/transakcji.</p> <p>Jeśli otrzymany zmienny depozyt zabezpieczający jest denominowany w więcej niż jednej walucie, kwoty te są przeliczane na jedną walutę wybraną przez kontrahenta 1 i zgłaszane jako jedna łączna wartość.</p>
24	Zabezpieczenie	Otrzymany przez kontrahenta 1 zmienny depozyt zabezpieczający (po redukcji wartości)	<p>Wartość pieniężna zmiennego depozytu zabezpieczającego otrzymanego przez kontrahenta 1, łącznie z depozytem zabezpieczającym rozliczanym w środkach pieniężnych i wszelkimi depozytami zabezpieczającymi w trakcie przekazywania i oczekującymi na rozrachunek.</p> <p>Nie obejmuje to warunkowego zmiennego depozytu zabezpieczającego.</p> <p>Jeżeli zabezpieczenia dokonuje się na poziomie portfela, otrzymany zmienny depozyt zabezpieczający odnosi się do całego portfela; jeżeli zabezpieczenia dokonuje się na poziomie pojedynczych transakcji, otrzymany zmienny depozyt zabezpieczający odnosi się do takiej pojedynczej transakcji.</p> <p>Pole to odnosi się do całkowitej bieżącej wartości otrzymanego zmiennego depozytu zabezpieczającego po zastosowaniu – w stosownych przypadkach – redukcji wartości, zgromadzonej od chwili pierwszego zgłoszenia zmiennych depozytów zabezpieczających otrzymanych dla danego portfela lub transakcji.</p> <p>Jeśli otrzymany zmienny depozyt zabezpieczający jest denominowany</p>

Pozycja	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
			w więcej niż jednej walucie, kwoty te są przeliczane na jedną walutę wybraną przez kontrahenta 1 i zgłaszane jako jedna łączna wartość.
25	Zabezpieczenie	Waluta otrzymanego zmiennego depozytu zabezpieczającego	Waluta, w której denominowany jest otrzymany zmienny depozyt zabezpieczający. Jeśli otrzymany zmienny depozyt zabezpieczający jest denominowany w więcej niż jednej walucie, ten element danych odzwierciedla jedną z tych walut, na którą kontrahent 1 zdecydował się przeliczyć wszystkie wartości otrzymanych zmiennych depozytów zabezpieczających.
26	Zabezpieczenie	Nadwyżka zabezpieczenia otrzymanego przez kontrahenta 1	Wartość pieniężna każdego dodatkowego zabezpieczenia otrzymanego przez kontrahenta 1, oddzielnego i niezależnego od początkowego i zmiennego depozytu zabezpieczającego. Ten element danych odnosi się do całkowitej bieżącej wartości nadwyżki zabezpieczenia przed zastosowaniem redukcji wartości (w stosownych przypadkach), a nie do dziennej zmiany wartości zabezpieczenia. Każda kwota otrzymanego początkowego lub zmiennego depozytu zabezpieczającego, która przekracza wymagany początkowy depozyt zabezpieczający lub wymagany zmienny depozyt zabezpieczający, jest zgłaszana jako część odpowiednio otrzymanego początkowego depozytu zabezpieczającego lub zmiennego depozytu zabezpieczającego, a nie ujmowana jako nadwyżka otrzymanego zabezpieczenia. W przypadku transakcji rozliczanych centralnie nadwyżka zabezpieczenia jest zgłaszana tylko w takim zakresie, w jakim można ją przypisać do konkretnego portfela lub transakcji.

Pozycja	Sekcja	Pole	Szczegółowe informacje podlegające zgłoszeniu
27	Zabezpieczenie	Waluta nadwyżki otrzymanego zabezpieczenia	Waluta, w której denominowana jest nadwyżka otrzymanego zabezpieczenia. Jeśli nadwyżka otrzymanego zabezpieczenia jest denominowana w więcej niż jednej walucie, ten element danych odzwierciedla jedną z tych walut, na którą kontrahent 1 zdecydował się przeliczyć wszystkie wartości otrzymanych nadwyżek zabezpieczenia.
28	Zabezpieczenie	Rodzaj operacji	Zgłoszenie zawiera jeden z następujących rodzajów operacji: a) nowe saldo depozytów zabezpieczających lub zmiana szczegółowych informacji dotyczących depozytów zabezpieczających są oznaczane jako „Aktualizacja depozytów zabezpieczających”; b) korekta pól danych, które zostały błędnie przekazane w poprzednim zgłoszeniu, oznaczana jest jako „Korekta”.
29	Zabezpieczenie	Data zdarzenia	Data, w której miało miejsce podlegające zgłoszeniu i ujęte w zgłoszeniu zdarzenie dotyczące kontraktu pochodnego. W przypadku aktualizacji zabezpieczeń – data, na którą przekazywane są informacje zawarte w zgłoszeniu.