

IZVEDBENA UREDBA KOMISIJE (EU) št. 1249/2012

z dne 19. decembra 2012

o določitvi izvedbenih tehničnih standardov glede oblike evidenc, ki jih morajo v skladu z Uredbo (EU) št. 648/2012 Evropskega parlamenta in Sveta o izvedenih finančnih instrumentih OTC, centralnih nasprotnih strankah in repozitorijih sklenjenih poslov hraniti centralne nasprotne stranke

(Besedilo velja za EGP)

EVROPSKA KOMISIJA JE –

ob upoštevanju Pogodbe o delovanju Evropske unije,

ob upoštevanju mnenja Evropske centralne banke ⁽¹⁾,ob upoštevanju Uredbe (EU) št. 648/2012 Evropskega parlamenta in Sveta z dne 4. julija 2012 o izvedenih finančnih instrumentih OTC, centralnih nasprotnih strankah in repozitorijih sklenjenih poslov ⁽²⁾, zlasti člena 29(5) Uredbe,

ob upoštevanju naslednjega:

(1) V skladu s členom 29(4) Uredbe (EU) št. 648/2012, členi 13, 14 in 15 delegiranega akta o regulativnih tehničnih standardih, ki opredeljujejo podrobnosti evidenc in informacij, ki jih morajo hraniti centralne nasprotne stranke (CNS), sprejetega v skladu s členom 29(4) Uredbe (EU) št. 648/2012, bi bilo treba določiti tudi pravila glede opredelitve oblike evidenc in informacij, ki se hranijo v skladu z navedenimi členi.

(2) Da bi lahko zadevni organi svoje naloge opravljali učinkovito in dosledno, bi morali imeti podatke, ki so primerljivi med CNS. Tudi uporaba enotnih oblik olajšuje usklajevanje podatkov med CNS.

(3) Od CNS bi bilo treba zahtevati, da podatke za namene vodenja evidence hrani v obliki, ki je skladna z obliko, v kateri podatke hranijo repozitoriji sklenjenih poslov, ob upoštevanju, da morajo v določenih okoliščinah CNS in repozitoriji sklenjenih poslov hraniti in poročati enake informacije. Uporaba enotne oblike v različnih infrastrukturah finančnega trga omogoča večjo uporabo teh oblik s strani različnih udeležencev na trgu, s čimer se spodbuja standardizacija.

(4) Za olajšanje samodejne obdelave plačil in spodbujanje zmanjšanja stroškov udeležencev na trgu je pomembno v CNS v največji meri uporabljati standardizirane postopke in oblike podatkov.

(5) Osnovno sredstvo je treba določiti z uporabo enotnega identifikatorja, vendar trenutno na trgu ni standardiziranega pravilnika za določanje osnovnih sredstev znotraj košarice. CNS bi zato morali vsaj navesti, da je osnovno sredstvo košarica, in za standardizirane kazalnike, kadar je mogoče, uporabiti mednarodne identifikacijske številke vrednostnih papirjev (kode ISIN).

(6) Ta uredba temelji na osnutkih izvedbenih tehničnih standardov, ki jih je Evropski organ za vrednostne papirje in trge (ESMA) predložil Komisiji.

(7) V skladu s členom 15 Uredbe (EU) št. 1095/2010 Evropskega parlamenta in Sveta z dne 24. novembra 2010 o ustanovitvi Evropskega nadzornega organa (Evropski organ za vrednostne papirje in trge) ⁽³⁾ je organ ESMA pred predložitvijo osnutkov izvedbenih tehničnih standardov, na katerih temelji ta uredba, opravil odprto javno posvetovanje, analiziral morebitne s tem povezane stroške in koristi ter zahteval mnenje interesne skupine za vrednostne papirje in trge, ustanovljene v skladu s členom 37 Uredbe (EU) št. 1095/2010 –

SPREJELA NASLEDNJO UREDBO:

Člen 1

Oblike evidenc

1. CNS vodi evidence, opredeljene v členu 20 delegiranega akta o regulativnih tehničnih standardih glede zahtev, ki opredeljujejo podrobnosti evidenc in informacij, ki jih morajo hraniti centralne nasprotne stranke (CNS), sprejetega v skladu s členom 29(4) Uredbe (EU) št. 648/2012, za vsako obdelano pogodbo v obliki iz razpredelnice 1 Priloge.

2. CNS vodi evidence, opredeljene v členu 21 delegiranega akta o regulativnih tehničnih standardih glede zahtev, ki opredeljujejo podrobnosti evidenc in informacij, ki jih morajo hraniti centralne nasprotne stranke (CNS), sprejetega v skladu s členom 29(4) Uredbe (EU) št. 648/2012, za vsako pozicijo v obliki iz razpredelnice 2 Priloge.

⁽¹⁾ še ni objavljeno v Uradnem listu.

⁽²⁾ UL L 201, 27.7.2012, str. 1.

⁽³⁾ UL L 331, 15.12.2010, str. 84.

3. CNS vodi evidence, opredeljene v členu 22 delegiranega akta o regulativnih tehničnih standardih glede zahtev, ki opredeljujejo podrobnosti evidenc in informacij, ki jih morajo hraniti CNS, sprejetega v skladu s členom 29(4) Uredbe (EU) št. 648/2012, za dejavnosti, ki so povezane z njihovim poslovanjem in notranjo organizacijo, v obliki iz razpredelnice 3 Priloge.

4. CNS pristojnemu organu zagotovi evidence in informacije iz odstavkov 1, 2 in 3 v obliki, ki omogoča neposredno izme-

njava podatkov med CNS in pristojnim organom. CNS takšno izmenjavo podatkov vzpostavi v šestih mesecih po prejemu zahtevka pristojnega organa.

Člen 2

Začetek veljavnosti

Ta uredba začne veljati dvajseti dan po objavi v *Uradnem listu Evropske unije*.

Ta uredba je zavezujoča v celoti in se neposredno uporablja v vseh državah članicah.

V Bruslju, 19. decembra 2012

Za Komisijo
Predsednik
José Manuel BARROSO

PRILOGA

Razpredelnice s polji, ki jih je treba evidentirati v skladu s členom 1

Razpredelnica 1
evidence obdelanih transakcij

	Polje	Oblika	Opis
1	Časovni žig poročanja	Oblika podatkov ISO 8601/oblika zapisa časa UTC.	Datum in čas poročanja.
2	Cena/mera	Do 20 števk, zapisanih v obliki xxxx,yyyyy.	Cena posameznega vrednostnega papirja ali pogodbe o izvedenih finančnih instrumentih brez provizije in (če je primerno) obračunanih obresti. V primeru dolžniškega instrumenta je lahko cena izražena v valuti ali odstotkih.
2a	Zapis cene	Npr. oznaka valute ISO 4217, 3 črke, odstotek.	Način, na katerega je izražena cena.
3	Nominalna valuta	Oznaka valute ISO 4217, 3 črke.	Valuta, v kateri je izražena cena. Če je na primer pri obveznici ali drugi obliki listinjenega dolga cena izražena v odstotkih, se tudi ti navedejo.
3a	Valuta poravnave	Oznaka valute ISO 4217, 3 črke.	Valuta, v kateri se izvede poravnava.
4	Količina	Do 10 števk.	Število enot finančnih instrumentov, nominalna vrednost obveznic ali število pogodb o izvedenih finančnih instrumentih, vključenih v transakcijo.
5	Zapis količine	Do 10 števk.	Navedba, ali je količina število enot finančnih instrumentov, nominalna vrednost obveznic ali število pogodb o izvedenih finančnih instrumentih.
6	Stran CNS	B=kupec/S=prodajalec.	
7	ID produkta	Začasna taksonomska razvrstitev v skladu z informacijami iz člena 4 Uredbe (ES) xx/2012 [osnutek izvedbenih tehničnih standardov glede oblike in pogostosti poročanja o trgovanju repozitorijem sklenjenih poslov], oznaka ISIN ali edinstveni identifikator produkta (UPI).	Pogodba se navede z uporabo identifikatorja produkta, kadar je na voljo.
8	ID klirinškega člana	Identifikator pravne osebe (LEI) (20 črk in števk), začasni identifikator subjekta (20 črk in števk), oznaka BIC (11 črk in števk) ali oznaka stranke (50 črk in števk).	Če centralna nasprotna stranka, ki poroča, ni klirinški član, se njen klirinški član v tem polju navede z edinstveno oznako. V primeru posameznikov se uporabi oznaka stranke, ki jim jo dodeli CNS.

	Polje	Oblika	Opis
9	ID upravičenca	<i>Identifikator pravne osebe (LEI) (20 črk in števk), začasni identifikator subjekta (20 črk in števk), oznaka BIC (11 črk in števk) ali oznaka stranke (50 črk in števk).</i>	Če upravičenec pogodbe ni nasprotna stranka te pogodbe, ga je treba navesti z edinstveno oznako, ali v primeru posameznikov z oznako stranke, ki jo dodeli pravni subjekt, ki ga uporablja posameznik.
10	Stranka, ki je prenesla pogodbo (v primeru posredovanja)	<i>Identifikator pravne osebe (LEI) (20 črk in števk), začasni identifikator subjekta (20 črk in števk), oznaka BIC (11 črk in števk) ali oznaka stranke (50 črk in števk).</i>	
11	Kraj izvedbe	<i>Oznaka identifikatorja trga (MIC) po ISO 10383 po potrebi, XOFF za kotirajoče izvedene finančne instrumente, s katerimi se trguje zunaj borze, ali XXXX za izvedene finančne instrumente OTC.</i>	Navedba kraja, kjer je bila izvedena transakcija. Če je pogodba sklenjena zunaj organiziranega trga, je treba določiti, ali je zadevni instrument sprejet v trgovanje, vendar se z njim trguje zunaj organiziranega trga, ali ni sprejet v trgovanje in se z njim trguje zunaj organiziranega trga.
12	Datum posredovanja:	<i>Zapis datuma po ISO 8601.</i>	Datum, na katerega je bilo izvedeno posredovanje CNS v pogodbi.
13	Čas posredovanja:	<i>Zapis časa po UTC.</i>	Čas, ko je bilo izvedeno posredovanje CNP v pogodbi, sporočen v lokalnem času pristojnega organa, kateremu se poroča o transakciji, in časovna cona, v kateri je bila transakcija izvedena, izražena kot mednarodni srednjeevropski čas (UTC) +/- ur.
14	Datum prekinitve pogodbe	<i>Zapis datuma po ISO 8601.</i>	Datum, na katerega je prišlo do prekinitve pogodbe.
15	Čas prekinitve pogodbe	<i>Zapis časa po UTC.</i>	Čas, ko je prišlo do prekinitve pogodbe, poročan v lokalnem času pristojnega organa, kateremu se poroča o transakciji, in časovna cona, v kateri je bila transakcija izvedena, izražena kot mednarodni srednjeevropski čas (UTC) +/- ur.
16	Način poravnave	<i>C = gotovinsko, P = fizično, O = po izbiri nasprotne stranke.</i>	Ali se pogodba poravna fizično ali v gotovini.
17	Datum poravnave	<i>Zapis datuma po ISO 8601.</i>	Datum izvedbe poravnave ali kritnega nakupa pogodbe. Če gre za več dni, se lahko dodajo polja.
18	Čas poravnave ali kritnega nakupa pogodbe	<i>Zapis časa po UTC.</i>	Čas, ko je prišlo do poravnave ali kritnega nakupa pogodbe, poročan v lokalnem času pristojnega organa, kateremu se poroča o transakciji, in časovna cona, v kateri je bila transakcija izvedena, izražena kot mednarodni srednjeevropski čas (UTC) +/- ur.

	Polje	Oblika	Opis
Podrobnosti o prvotnih pogojih pogodb, za katere se opravi kliring, ki se navedejo v ustreznem obsegu			
19	Datum	Zapis datuma po ISO 8601.	Datum, na katerega je prišlo do prvotne sklenitve pogodbe.
20	Čas	Zapis časa po UTC.	Čas, ko je prišlo do prvotne sklenitve prvotne pogodbe, poročan v lokalnem času pristojnega organa, kateremu se poroča o transakciji, in časovna cona, v kateri je bila transakcija izvedena, izražena kot mednarodni srednjeevropski čas (UTC) +/- ur.
21	ID produkta	Začasna taksonomska razvrstitev v skladu z informacijami iz člena 4 Uredbe (ES) xx/2012 [osnutek izvedbenih tehničnih standardov glede oblike in pogostosti poročanja o trgovanju repozitorijem sklenjenih poslov], oznaka ISIN ali edinstveni identifikator produkta (UPI).	Pogodba se navede z uporabo edinstvenega identifikatorja produkta, kadar je na voljo.
22	Osnovno sredstvo	Edinstveni identifikator produkta, ISIN (12 črk in števk) in CFI (6 črk in števk). Identifikator pravne osebe (LEI) (20 črk in števk), začasni identifikator subjekta (20 črk in števk), B=košarica ali I=indeks.	Identifikacija instrumenta, ki se uporablja za vrednostni papir, ki je osnovno sredstvo v pogodbi o izvedenih finančnih instrumentih, kakor tudi prenosljivi vrednostni papir, določen v členu 4(1)(18)(c) Direktive 2004/39/ES.
23	Vrsta izvedenega finančnega instrumenta (v primeru pogodbe o izvedenih finančnih instrumentih)	Usklajen opis vrste izvedenega finančnega instrumenta bi moral biti izveden v skladu z eno od najvišjih kategorij, določenih v enotnem mednarodno sprejetem standardu za razvrstitev finančnih instrumentov.	
24	Vključitev instrumenta v register organa ESMA, ki zajema pogodbe, za katere velja obveznost kliringa (v primeru pogodbe o izvedenih finančnih instrumentih)	Y=da/N=ne.	
Druge informacije, ki jih je treba navesti v ustreznem obsegu			
25	Identifikacija interoperabilnega CNS, ki opravlja kliring ene strani transakcije	Identifikator pravne osebe (LEI) (20 črk in števk), začasni identifikator subjekta (20 črk in števk), oznaka BIC (11 črk in števk) ali oznaka stranke (50 črk in števk).	

Razpredelnica 2

Evidence o pozicijah

	Polje	Oblika
1	ID klirinškega člana	Identifikator pravne osebe (LEI), začasni identifikator subjekta ali BIC.
2	ID upravičenca	Identifikator pravne osebe (LEI), začasni identifikator subjekta, BIC ali oznaka stranke.
3	Interoperabilni CNS, ki ohranja pozicijo	Identifikator pravne osebe (LEI), začasni identifikator subjekta, BIC ali oznaka stranke.
4	Oznaka pozicije	B=kupec/S=prodajalec.
5	Vrednost pozicije	Do 10 števk (xxxx,yy).
6	Cena, po kateri se vrednotijo pogodbe	Do 10 števk (xxxx,yy).
7	Valuta	Oznaka valute ISO.
8	Druge pomembne informacije	Prosto besedilo.
9	Znesek kritja na poziv CNS	Do 10 števk (xxxx,yy).
10	Znesek prispevkov v jamstveni sklad na poziv CNS	Do 10 števk (xxxx,yy).
11	Znesek drugih finančnih sredstev na poziv CNS	Do 10 števk (xxxx,yy).
12A	Znesek za kritje, ki ga klirinški član položi za račun stranke A	Do 10 števk (xxxx,yy).
13A	Znesek prispevkov v jamstveni sklad, ki ga klirinški član položi za račun stranke A	Do 10 števk (xxxx,yy).
14A	Znesek drugih finančnih sredstev, ki ga klirinški član položi za račun stranke A	Do 10 števk (xxxx,yy).
15B	Znesek za kritje, ki ga klirinški član položi za račun stranke B	Do 10 števk (xxxx,yy).
16B	Znesek prispevkov v jamstveni sklad, ki ga klirinški član položi za račun stranke B	Do 10 števk (xxxx,yy).
17B	Znesek drugih finančnih sredstev, ki ga klirinški član položi za račun stranke B	Do 10 števk (xxxx,yy).

Razpredelnica 3
Poslovne evidence

	Polje	Oblika	Opis
1	Organigrami	<i>Prosto besedilo.</i>	Upravni odbor in zadevni odbori, klirinška enota, enota za upravljanje tveganja ter vse druge zadevne enote ali oddelki.

Delničarji ali člani, ki imajo kvalificirane deleže (za vsakega zadevnega delničarja/člana se dodajo polja)

2	Vrsta	<i>S=delničar/M=član.</i>	
3	Vrsta kvalificiranega deleža	<i>D=neposreden/I=posreden.</i>	
4	Vrsta subjekta	<i>N=fizična oseba/L=pravna oseba.</i>	
5	Znesek deleža	<i>Do 10 števk (xxxx,yyyyy).</i>	

Drugi dokumenti

6	Politike, postopki, procesi, ki se zahtevajo v skladu z organizacijskimi zahtevami	<i>Dokumenti.</i>	
7	Zapisniki sestankov upravnega odbora, sestankov pododborov (če so na voljo) in sestankov odborov višjega vodstva (če so na voljo)	<i>Dokumenti.</i>	
8	Zapisniki sestankov odbora za upravljanje tveganja	<i>Dokumenti.</i>	
9	Zapisniki sestankov skupine za posvetovanje s klirinškimi člani in strankami (če obstajajo)	<i>Dokumenti.</i>	
10	Poročila notranje in zunanje revizije, upravljavcev tveganja, oddelka za zagotavljanje skladnosti in svetovalcev	<i>Dokumenti.</i>	
11	Politika neprekinjenega poslovanja in načrt ponovne vzpostavitve delovanja	<i>Dokumenti.</i>	
12	Likvidnostni načrt in dnevna poročila o likvidnosti	<i>Dokumenti.</i>	
13	Dokumenti, ki prikazujejo vsa sredstva in obveznosti ter kapitalne račune	<i>Dokumenti.</i>	

	Polje	Oblika	Opis
14	Prejete pritožbe	<i>Prosto besedilo.</i>	Za vsako pritožbo: informacije o imenu, naslovu in številki računa pritožnika, datum prejema pritožbe, imena vseh oseb, navedenih v pritožbi, opis značilnosti pritožbe, obravnava pritožbe, datum rešitve pritožbe.
15	Informacije o prekinitvi storitev ali motnjah pri delovanju	<i>Prosto besedilo.</i>	Informacije o prekinitvi storitev ali motnjah pri delovanju, vključno s podrobnim poročilom o času, učinkih in popravnih ukrepih.
16	Rezultati opravljenih stresnih testov in testov za nazaj	<i>Prosto besedilo.</i>	
17	Pisna komunikacija s pristojnimi organi, organom ESMA in zadevnimi člani ESCB	<i>Dokumenti.</i>	
18	Pravna mnenja, prejeta v skladu z organizacijskimi zahtevami	<i>Dokumenti.</i>	
19	Dogovori z drugimi CNS o interoperabilnosti (kadar obstajajo)	<i>Dokumenti.</i>	
20	Seznam klirinških članov (člen 17 Uredbe (EU) XXX/2012)	<i>Prosto besedilo/dokumenti.</i>	Seznam v skladu s členom 17 Uredbe (EU) XXX/2012
21	Informacije, ki se zahtevajo v skladu s členom 17 Uredbe (EU) XXX/2012	<i>Prosto besedilo/dokumenti.</i>	Zakoni in pravila, ki urejajo (i) dostop do CSN, (ii) pogodbe, ki jih CSN sklenejo s klirinškimi člani in, kadar je ustrezno, strankami, (iii) pogodbe, ki jih CSN sprejme za opravljanje kliringa, (iv) kakršne koli dogovore o interoperabilnosti, (v) uporabo zavarovanja in prispevkov v jamstveni sklad, vključno z likvidacijo pozicij in zavarovanja ter obsegom, v katerem je zavarovanje zaščiteno pred zahtevki tretje strani (stopnja ločevanja).
22	Razvoj novih inovativnih postopkov	<i>Prosto besedilo.</i>	V primeru opravljanja novih storitev.