

ROZPORZĄDZENIE WYKONAWCZE KOMISJI (UE) NR 1249/2012

z dnia 19 grudnia 2012 r.

ustanawiające wykonawcze standardy techniczne dotyczące formatu dokumentacji, która ma być zachowywana przez kontrahentów centralnych zgodnie z rozporządzeniem Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i repozytoriów transakcji

(Tekst mający znaczenie dla EOG)

KOMISJA EUROPEJSKA,

uwzględniając Traktat o funkcjonowaniu Unii Europejskiej,

uwzględniając opinię Europejskiego Banku Centralnego ⁽¹⁾,uwzględniając rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 z dnia 4 lipca 2012 r. w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i repozytoriów transakcji ⁽²⁾, w szczególności jego art. 29 ust. 5,

a także mając na uwadze, co następuje:

- (1) Zgodnie z art. 29 ust. 4 rozporządzenia (UE) nr 648/2012 art. 13, 14 i 15 aktu delegowanego dotyczącego regulacyjnych standardów technicznych określających szczegóły dotyczące dokumentacji i informacji, które muszą być przechowywane przez kontrahentów centralnych (CCP), przyjętych na mocy art. 29 ust. 4 rozporządzenia (UE) nr 648/2012, należy również ustanowić przepisy określające format dokumentacji i informacje przechowywane zgodnie z przepisami tych artykułów.
- (2) Aby móc wykonywać swoje obowiązki w sposób skuteczny i konsekwentny, odpowiednie organy powinny otrzymywać dane, które można porównywać w odniesieniu do wszystkich CCP. Również stosowanie wspólnych formatów ułatwia uzgadnianie danych pomiędzy CCP.
- (3) CCP powinien mieć obowiązek przechowywania danych w celach dokumentacyjnych w formacie zgodnym z formatem, w którym przechowują dane repozytoria transakcji, przy czym należy uwzględnić fakt, że w niektórych okolicznościach CCP i repozytoria transakcji mają obowiązek zachowywać lub zgłaszać te same informacje. Stosowanie jednolitego formatu w ramach różnych infrastruktur rynków finansowych ułatwia rozpowszechnienie się tych formatów wśród wielu różnych uczestników rynku, przyczyniając się w ten sposób do standaryzacji.
- (4) W celu ułatwienia przetwarzania bezpośredniego i zmniejszenia kosztów ponoszonych przez uczestników rynku ważne jest, aby standaryzowane procedury i formaty danych były jak najszerszej stosowane przez CCP.

(5) Instrument bazowy należy identyfikować za pomocą niepowtarzalnego identyfikatora, chociaż w obecnej chwili nie istnieje standaryzowany, wspólny dla całego rynku kod umożliwiający identyfikację instrumentów bazowych wchodzących w skład koszyka. CCP powinien zatem przynajmniej wskazywać, że dany instrument bazowy jest koszykiem instrumentów, a w przypadku standaryzowanych indeksów podawać, w miarę możliwości, międzynarodowe kody identyfikujące papiery wartościowe (kody ISIN).

(6) Podstawę niniejszego rozporządzenia stanowi projekt wykonawczych standardów technicznych przedłożony Komisji przez Europejski Urząd Nadzoru Giełd i Papierów wartościowych (EUNGiPW).

(7) Zgodnie z art. 15 rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 1095/2010 z dnia 24 listopada 2010 r. w sprawie ustanowienia Europejskiego Urzędu Nadzoru (Europejskiego Urzędu Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych) ⁽³⁾ przed przedłożeniem projektu wykonawczych standardów technicznych, na którym opiera się niniejsze rozporządzenie, EUNGiPW przeprowadził otwarte konsultacje społeczne, dokonał analizy potencjalnych kosztów i korzyści oraz zasięgnął opinii Grupy Interesariuszy z Sektora Giełd i Papierów Wartościowych ustanowionej zgodnie z art. 37 rozporządzenia (UE) nr 1095/2010,

PRZYJMUJE NINIEJSZE ROZPORZĄDZENIE:

Artykuł 1

Format dokumentacji

1. CCP przechowuje dokumentację określoną w art. 20 aktu delegowanego dotyczącego regulacyjnych standardów technicznych określających szczegóły dotyczące dokumentacji i informacji, które muszą być przechowywane przez kontrahentów centralnych (CCP), przyjętych na mocy art. 29 ust. 4 rozporządzenia (UE) nr 648/2012 w odniesieniu do każdego przetworzonego kontraktu w formacie określonym w tabeli 1 w załączniku.

2. CCP przechowuje dokumentację określoną w art. 21 aktu delegowanego dotyczącego regulacyjnych standardów technicznych określających szczegóły dotyczące dokumentacji i informacji, które muszą być przechowywane przez kontrahentów centralnych (CCP), przyjętych na mocy art. 29 ust. 4 rozporządzenia (UE) nr 648/2012 w odniesieniu do każdej pozycji w formacie określonym w tabeli 2 w załączniku.

⁽¹⁾ Dotychczas nieopublikowane w Dzienniku Urzędowym.

⁽²⁾ Dz.U. L 201 z 27.7.2012, s. 1.

⁽³⁾ Dz.U. L 331 z 15.12.2010, s. 84.

3. CCP przechowuje dokumentację określoną w art. 22 aktu delegowanego dotyczącego regulacyjnych standardów technicznych określających szczegóły dotyczące dokumentacji i informacji, które muszą być przechowywane przez kontrahentów centralnych (CCP), przyjętych na mocy art. 29 ust. 4 rozporządzenia (UE) nr 648/2012 w odniesieniu do działalności jego przedsiębiorstwa oraz organizacji wewnętrznej w formacie określonym w tabeli 3 w załączniku.

4. CCP przekazuje właściwemu organowi dokumentację i informacje, o których mowa w ust. 1, 2 i 3, w formacie

umożliwiającym bezpośredni przepływ danych pomiędzy CCP a właściwym organem. CCP ustanawia taki przepływ danych w terminie sześciu miesięcy od wniosku właściwego organu.

Artykuł 2

Wejście w życie

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

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

Sporządzono w Brukseli dnia 19 grudnia 2012 r.

W imieniu Komisji
José Manuel BARROSO
Przewodniczący

ZAŁĄCZNIK

Tabele określające informacje podlegające dokumentowaniu zgodnie z art. 1

Tabela 1

Dokumentacja przetworzonych transakcji

	Pole	Format	Opis
1	Znacznik czasu zgłoszenia	Zapis daty według normy ISO 8601 / czas UTC	Data i godzina zgłoszenia
2	Cena/stopa	Maks. 20 znaków numerycznych w formacie xxxx.yyyyy	Cena jednostkowa papieru wartościowego lub kontraktu pochodnego, bez prowizji i (w stosownych przypadkach) naliczonych odsetek. W przypadku instrumentu dłużnego cena może być wyrażona w walucie lub jako wartość procentowa.
2a	Oznaczenie ceny	Np. kod waluty według normy ISO 4217, 3 znaki alfabetyczne, wartość procentowa.	Sposób wyrażenia ceny.
3	Waluta nominalna	Kod waluty według normy ISO 4217, 3 znaki alfabetyczne.	Waluta, w której jest wyrażona cena. Jeżeli – w przypadku obligacji lub innej formy instrumentu dłużnego będącego wynikiem sekurytyzacji – cena jest wyrażona jako procent, podaje się także tę wartość procentową.
3a	Waluta dostawy	Kod waluty według normy ISO 4217, 3 znaki alfabetyczne.	Waluta, która ma zostać dostarczona.
4	Ilość	Maks. 10 znaków numerycznych	Liczba jednostek instrumentów finansowych, wartość nominalna obligacji, liczba kontraktów pochodnych będących przedmiotem transakcji
5	Oznaczenie ilości	Maks. 10 znaków numerycznych	Informacja, czy ilość jest wyrażona jako liczba jednostek instrumentów finansowych, wartość nominalna obligacji czy liczba kontraktów pochodnych
6	CCP jako strona	B = kupujący / S = sprzedający	
7	Kod identyfikacyjny produktu	Prześciowa klasyfikacja zgodnie z informacją wskazaną w art. 4 rozporządzenia (UE) nr xx/2012 [projekt wykonawczego standardu technicznego dotyczącego formatu informacji dotyczących obrotu i częstotliwości ich przedstawiania repozytorium transakcji], kod ISIN lub niepowtarzalny identyfikator produktu (UPI).	Kontrakt identyfikuje się za pomocą identyfikatora produktu, o ile jest on dostępny.
8	Kod identyfikacyjny członka rozliczającego	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) (20 znaków alfanumerycznych), tymczasowy identyfikator podmiotu (20 znaków alfanumerycznych), BIC (11 znaków alfanumerycznych) lub kod klienta (50 znaków alfanumerycznych)	Jeżeli kontrahent dokonujący zgłoszenia nie jest członkiem rozliczającym, w tym polu należy wskazać niepowtarzalny kod członka rozliczającego kontrahenta. W przypadku osoby fizycznej podaje się kod klienta nadany przez CCP.

	Pole	Format	Opis
9	Kod identyfikacyjny beneficjenta	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) (20 znaków alfanumerycznych), tymczasowy identyfikator podmiotu (20 znaków alfanumerycznych), BIC (11 znaków alfanumerycznych) lub kod klienta (50 znaków alfanumerycznych)	Jeżeli beneficjent kontraktu nie jest stroną tego kontraktu, identyfikuje się go za pomocą niepowtarzalnego kodu lub, w przypadku osób fizycznych, kodu klienta nadanego przez podmiot prawny, z którego usług korzysta ta osoba fizyczna.
10	Strona, która dokonała transferu kontraktu (w przypadku transferu typu „give up”)	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) (20 znaków alfanumerycznych), tymczasowy identyfikator podmiotu (20 znaków alfanumerycznych), BIC (11 znaków alfanumerycznych) lub kod klienta (50 znaków alfanumerycznych)	
11	Miejsce realizacji transakcji	W odpowiednich przypadkach kod identyfikacyjny rynku według normy ISO 10383 (MIC), XOFF w przypadku instrumentów pochodnych notowanych na rynku regulowanym, które są przedmiotem obrotu pozagiełdowego, lub XXXX w przypadku instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym.	Oznaczenie miejsca zawarcia transakcji. W przypadku kontraktu zawartego poza rynkiem regulowanym wskazuje się, czy dany instrument jest dopuszczony do obrotu na rynku regulowanym, ale jest przedmiotem obrotu poza tym rynkiem, czy też nie jest dopuszczony do obrotu na rynku regulowanym i jest przedmiotem obrotu poza tym rynkiem.
12	Data wstąpienia w prawa i obowiązki	Zapis daty według normy ISO 8601.	Dzień wstąpienia przez CCP w prawa i obowiązki wynikające z kontraktu.
13	Godzina wstąpienia w prawa i obowiązki	Czas UTC.	Godzina wstąpienia CCP w prawa i obowiązki wynikające z kontraktu – podaje się czas lokalny właściwego organu, któremu jest zgłaszana transakcja, w następującym zapisie: uniwersalny czas koordynowany (UTC) +/- liczba godzin.
14	Data rozwiązania kontraktu	Zapis daty według normy ISO 8601.	Dzień rozwiązania kontraktu.
15	Godzina rozwiązania kontraktu	Czas UTC.	Godzina rozwiązania kontraktu – podaje się czas lokalny właściwego organu, któremu jest zgłaszana transakcja, w następującym zapisie: uniwersalny czas koordynowany (UTC) +/- liczba godzin.
16	Typ dostawy	C = rozrachunek pieniężny, P = dostawa fizyczna, O = zgodnie z wyborem kontrahenta	Informacja, czy rozrachunek kontraktu następuje w postaci dostawy fizycznej czy też pieniężnie.
17	Data rozrachunku	Zapis daty według normy ISO 8601.	Dzień, w którym nastąpił rozrachunek kontraktu lub zakup instrumentu na otwartym rynku. W przypadku większej liczby dni można dodać nowe pola.
18	Godzina dokonania rozrachunku kontraktu lub zakupu instrumentu na otwartym rynku	Czas UTC.	Godzina dokonania rozrachunku kontraktu lub zakupu instrumentu na otwartym rynku – podaje się czas lokalny właściwego organu, któremu jest zgłaszana transakcja, w następującym zapisie: uniwersalny czas koordynowany (UTC) +/- liczba godzin.

	Pole	Format	Opis
Szczegółowe informacje dotyczące pierwotnych warunków rozliczonych kontraktów – wymagane w zakresie, w którym znajdują zastosowanie			
19	Data	Zapis daty według normy ISO 8601.	Dzień pierwotnego zawarcia kontraktu
20	Godzina	Czas UTC.	Godzina pierwotnego zawarcia pierwotnego kontraktu – podaje się czas lokalny właściwego organu, któremu jest zgłaszana transakcja, w następującym zapisie: uniwersalny czas koordynowany (UTC) +/- liczba godzin.
21	Kod identyfikacyjny produktu	Prześciowa klasyfikacja zgodnie z informacją wskazaną w art. 4 rozporządzenia (UE) nr xx/2012 [projekt wykonawczego standardu technicznego dotyczącego formatu informacji dotyczących obrotu i częstotliwości ich przedstawiania repozytorium transakcji], kod ISIN lub niepowtarzalny identyfikator produktu (UPI).	Kontrakt identyfikuje się za pomocą niepowtarzalnego identyfikatora produktu, o ile jest on dostępny.
22	Instrument bazowy	Niepowtarzalny identyfikator produktu, kod ISIN (12 znaków alfanumerycznych) i CFI (6 znaków alfanumerycznych) Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) (20 znaków alfanumerycznych), tymczasowy identyfikator podmiotu (20 znaków alfanumerycznych), B = koszyk lub I = indeks.	Oznaczenie instrumentu właściwe dla papieru wartościowego, który stanowi składnik aktywów bazowych kontraktu pochodnego oraz zbywalny papier wartościowy w rozumieniu art. 4 ust. 1 pkt 18) lit. c) dyrektywy 2004/39/WE.
23	Typ instrumentu pochodnego (w przypadku kontraktu pochodnego)	Zharmonizowany opis typu instrumentu pochodnego powinien być zgodny z jedną z kategorii najwyższego poziomu zgodnie z jednolitym międzynarodowym standardem klasyfikacji instrumentów finansowych.	
24	Włączenie instrumentu do prowadzonego przez EUNGiPW rejestru instrumentów podlegających obowiązkowi rozliczania (w przypadku kontraktu pochodnego)	Y = Tak / N = Nie	
Inne informacje – wymagane w zakresie, w którym znajdują zastosowanie			
25	Oznaczenie interoperacyjnego CCP rozliczającego jedną „nogę” transakcji	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) (20 znaków alfanumerycznych), tymczasowy identyfikator podmiotu (20 znaków alfanumerycznych), BIC (11 znaków alfanumerycznych) lub kod klienta (50 znaków alfanumerycznych)	

Tabela 2

Dokumentacja pozycji

	Pole	Format
1	Kod identyfikacyjny członka rozliczającego	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI), tymczasowy identyfikator podmiotu lub BIC
2	Kod identyfikacyjny beneficjenta	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI), tymczasowy identyfikator podmiotu, BIC lub kod klienta
3	Interoperacyjny CCP utrzymujący daną pozycję	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI), tymczasowy identyfikator podmiotu, BIC lub kod klienta
4	Znak pozycji	B = kupujący / S = sprzedający
5	Wartość pozycji	Maks. 10 znaków numerycznych (xxxx,yy).
6	Cena, na jaką są wyceniane instrumenty	Maks. 10 znaków numerycznych (xxxx,yy).
7	Waluta	Kod ISO waluty
8	Inne ważne informacje	Tekst dowolny
9	Kwota depozytów zabezpieczających żądana przez CCP	Maks. 10 znaków numerycznych (xxxx,yy).
10	Kwota składek na fundusz na wypadek niewykonania zobowiązania żądana przez CCP	Maks. 10 znaków numerycznych (xxxx,yy).
11	Kwota innych środków finansowych żądana przez CCP	Maks. 10 znaków numerycznych (xxxx,yy).
12A	Kwota depozytów zabezpieczających złożonych przez członka rozliczającego z tytułu rachunku klienta A	Maks. 10 znaków numerycznych (xxxx,yy).
13A	Kwota składek na fundusz na wypadek niewykonania zobowiązania wpłaconych przez członka rozliczającego z tytułu rachunku klienta A	Maks. 10 znaków numerycznych (xxxx,yy).
14A	Kwota innych środków finansowych zdeponowanych przez członka rozliczającego z tytułu rachunku klienta A	Maks. 10 znaków numerycznych (xxxx,yy).
15B	Kwota depozytów zabezpieczających złożonych przez członka rozliczającego z tytułu rachunku klienta B	Maks. 10 znaków numerycznych (xxxx,yy).
16B	Kwota składek na fundusz na wypadek niewykonania zobowiązania wpłaconych przez członka rozliczającego z tytułu rachunku klienta B	Maks. 10 znaków numerycznych (xxxx,yy).
17B	Kwota innych środków finansowych zdeponowanych przez członka rozliczającego z tytułu rachunku klienta B	Maks. 10 znaków numerycznych (xxxx,yy).

Tabela 3

Dokumentacja dotycząca przedsiębiorstwa

	Pole	Format	Opis
1	Schematy organizacyjne	<i>Tekst dowolny</i>	Zarząd i stosowne komisje, dział rozliczeń, dział zarządzania ryzykiem oraz wszystkie inne istotne działy lub piony.

Akcjonariusze lub udziałowcy posiadający znaczne pakiety akcji (należy dodać nową pozycję dla każdego takiego akcjonariusza lub udziałowca)

2	Forma własności kapitału spółki	<i>S = akcjonariusz / M = udziałowiec.</i>	
3	Typ znacznego pakietu akcji	<i>D = posiadane bezpośrednio / I = posiadane pośrednio.</i>	
4	Rodzaj podmiotu	<i>N = osoba fizyczna / L = osoba prawna</i>	
5	Wartość pakietu akcji	<i>Maks. 10 znaków numerycznych (xxxx,yyyy).</i>	

Inne dokumenty

6	Polityki, procedury i procesy określone w wymogach organizacyjnych	<i>Dokumenty</i>	
7	Protokoły posiedzeń zarządu, podkomisji (jeśli dotyczy) i komisji tworzonych przez kierownictwo wyższego szczebla (jeśli dotyczy)	<i>Dokumenty</i>	
8	Protokoły posiedzeń komisji ds. ryzyka	<i>Dokumenty</i>	
9	Protokoły posiedzeń grupy konsultacyjnej z udziałem członków rozliczających i klientów (jeśli istnieją)	<i>Dokumenty</i>	
10	Sprawozdania dotyczące audytu wewnętrznego i zewnętrznego, zarządzania ryzykiem, zgodności z przepisami i sprawozdania przygotowane przez firmy konsultingowe	<i>Dokumenty</i>	
11	Polityka ciągłości działania oraz plan przywrócenia gotowości do pracy po wystąpieniu sytuacji nadzwyczajnej	<i>Dokumenty</i>	
12	Plan zachowania płynności oraz dzienne sprawozdania ze stanu płynności	<i>Dokumenty</i>	
13	Dokumentacja zawierająca zestawienia wszystkich aktywów i zobowiązań oraz rachunków kapitałowych	<i>Dokumenty</i>	

	Pole	Format	Opis
14	Otrzymane skargi	<i>Tekst dowolny</i>	W przypadku każdej skargi podaje się: imię i nazwisko/nazwę skarżącego, adres i numer rachunku; datę otrzymania skargi; imiona i nazwiska wszystkich osób wskazanych w skardze; opis charakteru skargi; wynik rozpatrzenia skargi; datę rozpatrzenia skargi.
15	Informacje dotyczące przerw lub zakłóceń w świadczeniu usług	<i>Tekst dowolny</i>	Informacje dotyczące wszelkich przerw lub zakłóceń w świadczeniu usług, w tym szczegółowe sprawozdania na temat przebiegu czasowego incydentu, jego skutków oraz działań naprawczych.
16	Wyniki przeprowadzonych weryfikacji historycznych i testów warunków skrajnych	<i>Tekst dowolny</i>	
17	Pisemna korespondencja prowadzona z właściwymi organami, EUNGiPW i zainteresowanymi członkami ESBC	<i>Dokumenty</i>	
18	Opinie prawne otrzymane zgodnie z wymogami organizacyjnymi	<i>Dokumenty</i>	
19	Uzgodnienia interoperacyjne z innymi CCP (jeżeli dotyczy)	<i>Dokumenty</i>	
20	Wykaz wszystkich członków rozliczających (art. 17 rozporządzenia (UE) nr XXX/2012)	<i>Tekst dowolny / Dokument</i>	Wykaz zgodnie z art. 17 rozporządzenia (UE) nr XXX/2012
21	Informacje wymagane na mocy art. 17 rozporządzenia (UE) nr XXX/2012	<i>Tekst dowolny / Dokumenty</i>	Przepisy i zasady regulujące: (i) dostęp do CCP; (ii) umowy zawierane przez CCP z członkami rozliczającymi oraz, w miarę możliwości, z klientami; (iii) kontrakty przyjmowane przez CCP do rozliczania; (iv) wszelkie uzgodnienia interoperacyjne; (v) wykorzystanie zabezpieczenia i składek na fundusz na wypadek niewykonania zobowiązania, w tym likwidację pozycji i upłynianie zabezpieczenia oraz zakres, w jakim zabezpieczenie jest chronione przez roszczeniami osób trzecich (poziom wyodrębnienia).
22	Informacje na temat opracowywania nowych inicjatyw	<i>Tekst dowolny</i>	W przypadku świadczenia nowych usług.