

## ROZPORZĄDZENIE DELEGOWANE KOMISJI (UE) NR 151/2013

z dnia 19 grudnia 2012 r.

uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i repozytoriów transakcji w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych określających dane, które mają być publikowane i udostępniane przez repozytoria transakcji, a także standardy operacyjne dotyczące agregowania i porównywania danych oraz dostępu do tych danych

(Tekst mający znaczenie dla EOG)

KOMISJA EUROPEJSKA,

uwzględniając Traktat o funkcjonowaniu Unii Europejskiej,

uwzględniając opinię Europejskiego Banku Centralnego <sup>(1)</sup>,uwzględniając rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 z dnia 4 lipca 2012 r. w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i repozytoriów transakcji <sup>(2)</sup>, w szczególności jego art. 81 ust. 5,

a także mając na uwadze, co następuje:

- (1) Jasne określenie właściwych kontraktów i ich odpowiednich kontrahentów ma podstawowe znaczenie. Zgodnie z podejściem funkcjonalnym w przypadku podmiotów mających dostęp do danych przechowywanych przez repozytoria transakcji należy uwzględnić posiadane przez nie kompetencje i pełnione przez nie funkcje.
- (2) Aby sprawować nadzór nad repozytoriami transakcji, Europejski Urząd Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych (EUNGiPW) powinien mieć dostęp do wszystkich danych transakcyjnych przechowywanych przez repozytoria, tak by móc zwracać się o informacje, podejmować właściwe środki nadzorcze oraz monitorować, czy należy utrzymać, czy też wycofać rejestrację jako repozytorium transakcji.
- (3) Uwzględniając kompetencje EUNGiPW na mocy rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 1095/2010 z dnia 24 listopada 2010 r. w sprawie ustanowienia Europejskiego Urzędu Nadzoru (Europejskiego Urzędu Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych) <sup>(3)</sup> oraz rozporządzenia (UE) nr 648/2012, EUNGiPW należy przyznać dostęp w odniesieniu do szeregu zadań. Dostęp do danych dla poszczególnych członków personelu EUNGiPW powinien być zgodny z każdym z tych szczególnych zadań.
- (4) Europejskiej Radzie ds. Ryzyka Systemowego (ERRS), EUNGiPW oraz odpowiednim członkom Europejskiego Systemu Banków Centralnych (ESBC), w tym niektórym krajowym bankom centralnym i odpowiednim organom nadzoru papierów wartościowych i rynków w Unii, powierzono zadanie monitorowania i zapewniania stabilności finansowej w Unii, a zatem organy te powinny mieć dostęp do danych transakcyjnych w odniesieniu do wszystkich kontrahentów do celów wykonywania ich zadań w tym zakresie.

- (5) Organy nadzoru i dozoru nad partnerami centralnymi (CCP) muszą mieć dostęp do danych, aby móc skutecznie wykonywać swoje obowiązki wobec takich podmiotów, a zatem powinny mieć dostęp do wszystkich informacji koniecznych do realizacji tego zadania.
- (6) Umożliwienie odpowiednim członkom ESBC dostępu do danych umożliwi im wykonywanie ich podstawowych zadań, przede wszystkim funkcji centralnego banku emisyjnego, zapewniania stabilności finansowej i – w pewnych przypadkach – nadzoru ostrożnościowego nad niektórymi kontrahentami. Ponieważ niektórzy członkowie ESBC na mocy ustawodawstwa krajowego mają różne zadania, należy umożliwić im dostęp do danych zgodnie z wykazem określonym w art. 81 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012.
- (7) Najważniejszym obowiązkiem odpowiednich organów nadzoru papierów wartościowych i rynków w Unii jest ochrona inwestorów w ich poszczególnych jurysdykcjach, a zatem należy przyznać im dostęp do danych transakcyjnych na temat rynków, uczestników, produktów i instrumentów bazowych objętych ich obowiązkami nadzorczymi i wykonawczymi.
- (8) Organom wyznaczonym zgodnie z art. 4 dyrektywy 2004/25/WE Parlamentu Europejskiego i Rady z dnia 21 kwietnia 2004 r. w sprawie ofert przejęcia <sup>(4)</sup> należy przyznać dostęp do informacji na temat transakcji dotyczących instrumentów pochodnych na akcje, jeżeli instrument bazowy jest dopuszczony do obrotu na rynku regulowanym w ich jurysdykcji lub posiada siedzibę prawną w ich jurysdykcji, bądź też jest oferentem dla spółki w odniesieniu do takiego przedsiębiorstwa i świadczenie przez niego oferowane obejmuje papiery wartościowe.
- (9) Agencji ds. Współpracy Organów Regulacji Energetyki (ACER) należy przyznać dostęp do danych w celu monitorowania hurtowych rynków energii, tak by we współpracy z krajowymi organami regulacyjnymi wykrywać nadużycia na rynku oraz im zapobiegać, a także w celu monitorowania hurtowych rynków energii, by wykrywać nadużycia na rynku oraz im zapobiegać zgodnie z rozporządzeniem Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 1227/2011 z dnia 25 października 2011 r. w sprawie integralności i przejrzystości hurtowego rynku energii (REMIT) <sup>(5)</sup>. ACER powinna zatem posiadać dostęp do wszystkich danych przechowywanych przez repozytoria transakcji w odniesieniu do instrumentów pochodnych na produkty energetyczne.

<sup>(1)</sup> Dotychczas nieopublikowana w Dzienniku Urzędowym.

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

<sup>(3)</sup> Dz.U. L 331 z 15.12.2010, s. 84.

<sup>(4)</sup> Dz.U. L 142 z 30.4.2004, s. 12.

<sup>(5)</sup> Dz.U. L 326 z 8.12.2011, s. 1.

- (10) Rozporządzenie (UE) nr 648/2012 obejmuje wyłącznie dane dotyczące transakcji, nie obejmuje natomiast danych dotyczących operacji przed zawarciem transakcji, takich jak złożenie zamówienia zgodnie z wymogami rozporządzenia (UE) nr 1227/2011. Dlatego w tym zakresie repozytoria transakcji nie powinny być uznawane za właściwe źródła informacji dla ACER.
- (11) W ramach podejścia funkcjonalnego do dostępu do danych przechowywanych przez repozytoria transakcji kluczowym elementem jest nadzór ostrożnościowy. Podobnie różnym organom mogą zostać powierzone zadania w zakresie nadzoru ostrożnościowego. W związku z tym wszystkim organom wymienionym w art. 81 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012 należy zapewnić dostęp do danych transakcyjnych na temat odpowiednich podmiotów.
- (12) Podmioty, które zgodnie z art. 81 ust. 3 rozporządzenia (UE) 648/2012 uzyskały dostęp do danych przechowywanych przez repozytorium transakcji, powinny zapewnić posiadanie i egzekwowanie zasad gwarantujących, że tylko odpowiednie osoby mają dostęp do informacji dla dobrze określonych i prawnie uzasadnionych celów, a także jasno określających możliwość uprawnienia innych osób do dostępu do tych danych.
- (13) Dostęp do danych powinien być rozpatrywany na trzech poziomach agregowania. Dane transakcyjne powinny obejmować szczegóły dotyczące poszczególnych transakcji, dane o pozycjach powinny dotyczyć zagregowanych danych o pozycjach dla poszczególnych instrumentów bazowych/produktów dla poszczególnych kontrahentów, a zagregowane dane nominalne powinny odpowiadać ogólnym pozycjom dla poszczególnych instrumentów bazowych/produktów bez podawania szczegółowych informacji o kontrahencie. Dostęp do danych transakcyjnych umożliwiłby również dostęp do danych o pozycjach i zagregowanych danych. Dostęp do danych o pozycjach umożliwiłby również dostęp do zagregowanych danych, ale nie do danych transakcyjnych. Z drugiej strony dostęp do zagregowanych danych referencyjnych powinien być najbardziej wąską kategorią dostępu i nie powinien umożliwiać dostępu do danych o pozycjach lub danych transakcyjnych.
- (14) Podstawę niniejszego rozporządzenia stanowi projekt regulacyjnych standardów technicznych przedłożony Komisji przez Europejski Urząd Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych.
- (15) Zgodnie z art. 10 rozporządzenia (UE) nr 1095/2010 EUNGiPW konsultował się z właściwymi organami oraz członkami Europejskiego Systemu Banków Centralnych (ESBC) przed przedłożeniem projektu regulacyjnych standardów technicznych, który stanowi podstawę niniejszego rozporządzenia. EUNGiPW przeprowadził również otwarte konsultacje społeczne na temat tego projektu regulacyjnych standardów technicznych, przeanalizował potencjalne związane z nimi koszty i korzyści oraz

zasięgnął opinii Grupy Interesariuszy z Sektora Giełd i Papierów Wartościowych powołanej zgodnie z art. 37 wspomnianego rozporządzenia,

PRZYJMUJE NINIEJSZE ROZPORZĄDZENIE:

#### Artykuł 1

##### Publikacja zagregowanych danych

1. Repozytoria transakcji publikują dane zgodnie z art. 81 ust. 1 rozporządzenia (UE) nr 648/2012, w tym co najmniej:

- a) podział zagregowanych pozycji otwartych według następujących klas instrumentów pochodnych:
- (i) towarowe instrumenty pochodne;
  - (ii) kredytowe instrumenty pochodne;
  - (iii) walutowe instrumenty pochodne;
  - (iv) instrumenty pochodne na akcje;
  - (v) instrumenty pochodne na stopę procentową;
  - (vi) inne;
- b) podział zagregowanych wolumenów transakcji według następujących klas instrumentów pochodnych:
- (i) towarowe instrumenty pochodne;
  - (ii) kredytowe instrumenty pochodne;
  - (iii) walutowe instrumenty pochodne;
  - (iv) instrumenty pochodne na akcje;
  - (v) instrumenty pochodne na stopę procentową;
  - (vi) inne;
- c) podział zagregowanych wartości według następujących klas instrumentów pochodnych:
- (i) towarowe instrumenty pochodne;
  - (ii) kredytowe instrumenty pochodne;
  - (iii) walutowe instrumenty pochodne;
  - (iv) instrumenty pochodne na akcje;
  - (v) instrumenty pochodne na stopę procentową;
  - (vi) inne.

2. Dane publikowane są na stronie internetowej lub na portalu internetowym, które są łatwo dostępne dla ogółu społeczeństwa, i uaktualniane przynajmniej raz na tydzień.

#### Artykuł 2

##### Dostęp do danych dla właściwych organów

1. Repozytorium transakcji zapewnia dostęp do wszystkich danych transakcyjnych Europejskiemu Urzędowi Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych (EUNGiPW) do celów realizacji jego uprawnień nadzorczych.

2. EUNGiPW przyjmuje wewnętrzne procedury w celu zapewnienia właściwego dostępu pracowników i wszelkich odpowiednich ograniczeń dostępu w odniesieniu do działań innych niż nadzorcze w ramach zadań EUNGiPW.

3. Repozytorium transakcji zapewnia Agencji ds. Współpracy Organów Regulacji Energetyki (ACER) dostęp do wszystkich danych transakcyjnych dotyczących instrumentów pochodnych, w których instrumentem bazowym jest energia lub uprawnienia do emisji.

4. Repozytorium transakcji udostępnia wszystkie dane dotyczące transakcji rozliczonych lub zgłoszonych przez CCP właściwemu organowi sprawującemu nadzór nad danym CCP oraz odpowiedniemu członkowi Europejskiego Systemu Banków Centralnych (ESCB) sprawującemu dozór nad danym CCP.

5. Repozytorium transakcji udostępnia właściwemu organowi sprawującemu nadzór nad systemami obrotu, w których realizowane są zgłaszane kontrakty, wszystkie dane transakcyjne na temat kontraktów zrealizowanych w ramach tych systemów obrotu.

6. Repozytorium transakcji udostępnia organowi nadzoru wyznaczonemu zgodnie z art. 4 dyrektywy 2004/25/WE wszystkie dane transakcyjne dotyczące instrumentów pochodnych, w których instrumentem bazowym jest papier wartościowy wyemitowany przez przedsiębiorstwo spełniające jeden z następujących warunków:

- a) jest dopuszczone do obrotu na rynku regulowanym w jurysdykcji tego organu;
- b) posiada siedzibę statutową lub, w przypadku nieposiadania siedziby statutowej, siedzibę zarządu w jurysdykcji tego organu;
- c) jest oferentem w odniesieniu do podmiotów określonych w lit. a) lub b) i świadczenie przez nie oferowane obejmuje papiery wartościowe.

7. Dane, które mają zostać udostępnione zgodnie z ust. 6, obejmują informacje dotyczące następujących kwestii:

- a) papiery wartościowe stanowiące instrument bazowy;
- b) klasa instrumentu pochodnego;
- c) znak pozycji;
- d) liczba referencyjnych papierów wartościowych;
- e) kontrahenci instrumentu pochodnego.

8. Repozytorium transakcji udostępnia odpowiednim organom nadzoru papierów wartościowych i rynków w Unii, o których mowa w art. 81 ust. 3 lit. h) rozporządzenia (UE)

nr 648/2012, wszystkie dane transakcyjne dotyczące rynków, uczestników, kontraktów i instrumentów bazowych, które podlegają kompetencjom danego organu zgodnie z jego odpowiednimi obowiązkami i uprawnieniami nadzorczymi.

9. Repozytorium transakcji udostępnia Europejskiej Radzie ds. Ryzyka Systemowego, EUNGiPW oraz odpowiednim członkom ESBC dane transakcyjne dotyczące:

- a) wszystkich kontrahentów w ich poszczególnych jurysdykcjach;
- b) kontraktów pochodnych, jeżeli podmiot referencyjny kontraktu pochodnego ma siedzibę w danej jurysdykcjach lub jeżeli zobowiązanie referencyjne jest długiem państwowym danej jurysdykcji.

10. Repozytorium transakcji udostępnia odpowiednim członkom ESBC dane o pozycjach w odniesieniu do kontraktów pochodnych w walucie emitowanej przez tego członka.

11. Do celów nadzoru ostrożnościowego nad kontrahentami podlegającymi obowiązkowi zgłaszania, repozytorium transakcji udostępnia odpowiednim podmiotom wymienionym w art. 81 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012 dane transakcyjne na temat tych kontrahentów.

### Artykuł 3

#### Organy państwa trzeciego

1. W odniesieniu do właściwego organu państwa trzeciego, które zawarło z Unią umowę międzynarodową, o której mowa w art. 75 rozporządzenia (UE) nr 648/2012, repozytorium transakcji udostępnia dane, uwzględniając uprawnienia i obowiązki organu państwa trzeciego oraz zgodnie z postanowieniami danej umowy międzynarodowej.

2. W odniesieniu do właściwego organu państwa trzeciego, które zawarło z EUNGiPW uzgodnienia o współpracy, o których mowa w art. 76 rozporządzenia (UE) nr 648/2012, repozytorium transakcji udostępnia dane, uwzględniając uprawnienia i obowiązki organu państwa trzeciego oraz zgodnie z postanowieniami danych uzgodnień o współpracy.

### Artykuł 4

#### Standardy operacyjne dotyczące agregowania i porównywania danych

1. Repozytorium transakcji udostępnia dane podmiotom wymienionym w art. 81 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012 zgodnie z powszechnie stosowanymi na poziomie międzynarodowym procedurami komunikacji i standardami dotyczącymi komunikatów oraz z danymi referencyjnymi.

2. Kontrahenci transakcji nadają niepowtarzalny identyfikator transakcji każdemu kontraktowi pochodnemu, aby umożliwić repozytorium transakcji agregowanie i porównywanie danych z różnych repozytoriów transakcji.

*Artykuł 5***Standardy operacyjne dotyczące dostępu do danych**

1. Repozytorium transakcji rejestruje informacje na temat dostępu do danych udzielonego podmiotom wymienionym w art. 81 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012.

2. Informacje, o których mowa w ust. 1, obejmują:

a) zakres danych, do których udzielono dostępu;

b) odesłanie do przepisów przyznających dostęp do takich danych zgodnie z rozporządzeniem (UE) nr 648/2012 i niniejszym rozporządzeniem.

*Artykuł 6***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*

---