

**ROZPORZĄDZENIE DELEGOWANE KOMISJI (UE) 2019/358****z dnia 13 grudnia 2018 r.****uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych w zakresie gromadzenia, weryfikacji, agregacji, porównywania i publikacji danych dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przez repozytoria transakcji****(Tekst mający znaczenie dla EOG)**

KOMISJA EUROPEJSKA,

uwzględniając Traktat o funkcjonowaniu Unii Europejskiej,

uwzględniając rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 z dnia 25 listopada 2015 r. w sprawie przejrzystości transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ponownego wykorzystania oraz zmiany rozporządzenia (UE) nr 648/2012 <sup>(1)</sup>, w szczególności jego art. 5 ust. 7 lit. a) i art. 12 ust. 3 lit. a) i b),

a także mając na uwadze, co następuje:

- (1) Aby zapewnić wysoką jakość szczegółowych informacji dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych zgłaszanych do repozytoriów transakcji, repozytoria transakcji powinny weryfikować tożsamość podmiotów zgłaszających, logiczną integralność kolejności zgłaszania szczegółowych informacji dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz kompletność i prawidłowość przedmiotowych szczegółowych informacji dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych.
- (2) Z tego samego powodu repozytoria transakcji powinny uzgadniać szczegółowe informacje dotyczące każdego otrzymanego zgłoszenia transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych. Należy określić standardowy proces umożliwiający repozytoriom transakcji prowadzenie uzgodnień w spójny sposób i ograniczenie ryzyka braku uzgodnienia szczegółowych informacji dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych. Niektóre szczegółowe informacje dotyczące transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych mogą się jednak różnić ze względu na szczególne właściwości systemów technologicznych wykorzystywanych przez podmioty przedkładające zgłoszenie. Należy stosować zatem pewien stopień tolerancji, aby niewielkie różnice w zgłoszonych szczegółowych informacjach dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych nie uniemożliwiały organom analizowania danych przy zachowaniu odpowiedniego poziomu zaufania.
- (3) Należy się spodziewać, że podmioty przedkładające zgłoszenia usprawnią z czasem swoje zgłoszenia zarówno pod kątem ograniczenia liczby odrzuconych zgłoszeń, jak i uzgodnionych zgłoszeń. Powinno się im jednak przyznać wystarczającą ilość czasu na dostosowanie się do wymogów dotyczących zgłaszania, w szczególności aby zapobiec nagromadzeniu nieuzgodnionych transakcji bezpośrednio po wejściu w życie obowiązku zgłaszania. W związku z tym stosowne jest, aby na pierwszym etapie uzgadnianie dotyczyło tylko ograniczonego zbioru pól.
- (4) Podmioty przedkładające zgłoszenia i podmioty odpowiedzialne za zgłaszanie powinny, w stosownych przypadkach, mieć możliwość monitorowania przestrzegania przez nie ich obowiązku zgłaszania wynikającego z rozporządzenia (UE) 2015/2365. Powinny zatem mieć codzienny dostęp do niektórych informacji dotyczących tych zgłoszeń, w tym do wyników ich weryfikacji, a także do postępów w uzgadnianiu zgłaszanych danych. W związku z tym konieczne jest określenie informacji, które repozytorium transakcji powinno udostępniać tym podmiotom na koniec każdego dnia roboczego.
- (5) Aby ułatwić utrzymanie integralności szczegółowych informacji dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, należy zapewnić bezpośredni i natychmiastowy dostęp, o którym mowa w art. 12 ust. 2 rozporządzenia (UE) 2015/2365, w zharmonizowany i spójny sposób. W celu standaryzacji zgłaszania, zminimalizowania kosztów dla sektora i zapewnienia porównywalności i spójności agregacji danych w repozytoriach transakcji, wszystkie sprawozdania dotyczące wyników i wymiana informacji powinny być dokonywane na formularzach w formacie XML i z zastosowaniem metodyki powszechnie stosowanej w sektorze finansowym.
- (6) Kwestia dostępu do danych na poziomie pozycji dotyczących ekspozycji między dwoma kontrahentami ma kluczowe znaczenie dla umożliwienia podmiotom, o których mowa w art. 12 ust. 2 rozporządzenia (UE) 2015/2365, określenia potencjalnych źródeł ryzyka systemowego lub niesystemowego zagrażającego stabilności finansowej.
- (7) Aby zapewnić społeczeństwu odpowiedni stopień przejrzystości w zakresie transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, kryteria stosowane do celów agregacji pozycji powinny umożliwiać obywatelom zrozumienie funkcjonowania rynków transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, nie

<sup>(1)</sup> Dz.U. L 337 z 23.12.2015, s. 1.

zagrożając poufności danych zgłaszanych do repozytoriów transakcji. Częstotliwość i szczegółowość publikacji przez repozytorium transakcji zagregowanych pozycji zgodnie z art. 12 ust. 1 rozporządzenia (UE) 2015/2365 powinny być określone w sposób oparty na powiązanych ramach ustanowionych w rozporządzeniu Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 <sup>(2)</sup> dotyczących kontraktów pochodnych.

- (8) Podstawą niniejszego rozporządzenia są projekty regulacyjnych standardów technicznych przedłożone Komisji przez Europejski Urząd Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych (ESMA) zgodnie z procedurą określoną w art. 10 rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 1095/2010 <sup>(3)</sup>.
- (9) W przepisach niniejszego rozporządzenia określono standardy operacyjne dotyczące gromadzenia, agregacji i porównywania danych przez repozytoria transakcji, a także procedury, które mają stosować repozytoria transakcji w celu sprawdzenia kompletności i prawidłowości zgłaszanych im szczegółowych informacji dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych. Aby zapewnić spójność tych przepisów oraz aby ułatwić repozytoriom transakcji całościowy wgląd w te przepisy, skazane jest uwzględnienie w jednym rozporządzeniu powiązanych regulacyjnych standardów technicznych.
- (10) ESMA przeprowadził otwarte konsultacje publiczne na temat tych projektów regulacyjnych standardów technicznych, przeanalizował potencjalne związane z nimi koszty i korzyści oraz zasięgnął opinii Grupy Interesariuszy z Sektora Giełd i Papierów Wartościowych ESMA powołanej zgodnie z art. 37 rozporządzenia (UE) nr 1095/2010,

PRZYJMUJE NINIEJSZE ROZPORZĄDZENIE:

#### Artykuł 1

### **Weryfikacja zgłoszeń transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przez repozytoria transakcji**

1. Repozytorium transakcji dokonuje weryfikacji otrzymanego zgłoszenia dotyczącego transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych pod wszystkimi następującymi względami:
  - a) tożsamości podmiotu przedkładającego zgłoszenie, o którym mowa w polu 2 w tabeli 1 w załączniku I do rozporządzenia wykonawczego Komisji (UE) 2019/363 <sup>(4)</sup>;
  - b) zgodności formularza w formacie XML stosowanego do zgłaszania transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych z metodyką ISO 20022 zgodnie z rozporządzeniem wykonawczym (UE) 2019/363;
  - c) należytego uprawnienia podmiotu przedkładającego zgłoszenie, jeżeli jest to inny podmiot niż kontrahent dokonujący zgłoszenia, o którym mowa w polu 3 w tabeli 1 w załączniku I do rozporządzenia wykonawczego (UE) 2019/363, do dokonania zgłoszenia w imieniu kontrahenta dokonującego zgłoszenia, z wyjątkiem przypadków przewidzianych w art. 4 ust. 3 rozporządzenia (UE) 2015/2365;
  - d) czy to samo zgłoszenie transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych nie zostało już wcześniej przedłożone;
  - e) czy zgłoszenie transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych oznaczone rodzajem działania „zmiana” odnosi się do uprzednio przedłożonego zgłoszenia transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych;
  - f) czy zgłoszenie transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych oznaczone rodzajem działania „zmiana” nie odnosi się do transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych, którą anulowano;
  - g) czy zgłoszenie transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych nie jest oznaczone rodzajem działania „nowa” w przypadku transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych, która została już zgłoszona;
  - h) czy zgłoszenie transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych nie jest oznaczone rodzajem działania „składnik pozycji” w przypadku transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych, która została już zgłoszona;

<sup>(2)</sup> 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).

<sup>(3)</sup> Rozporządzenie 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), zmiany decyzji nr 716/2009/WE i uchylenia decyzji Komisji 2009/77/WE (Dz.U. L 331 z 15.12.2010, s. 84).

<sup>(4)</sup> Rozporządzenie wykonawcze Komisji (UE) 2019/363 z dnia 13 grudnia 2018 r. ustanawiające wykonawcze standardy techniczne w odniesieniu do formatu i częstotliwości dokonywania zgłoszeń szczegółowych informacji dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych do repozytoriów transakcji zgodnie z rozporządzeniem Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 oraz zmieniające rozporządzenie wykonawcze (UE) nr 1247/2012 w odniesieniu do stosowania kodów sprawozdawczych w zgłoszeniach dotyczących instrumentów pochodnych (zob. s. 85 niniejszego Dziennika Urzędowego).

- i) czy zgłoszenie transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych nie służy zmianie szczegółowych informacji dotyczących podmiotu przedkładającego zgłoszenie, kontrahenta dokonującego zgłoszenia lub innego kontrahenta wcześniej dokonanego zgłoszenia;
  - j) czy zgłoszenie transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych nie służy zmianie istniejącego zgłoszenia transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych poprzez określenie późniejszej daty waluty niż zgłoszony termin zapadalności transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych;
  - k) prawidłowości i kompletności zgłoszenia transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych.
2. Repozytorium transakcji weryfikuje, czy zgłoszono informacje na temat zabezpieczenia w polach 73–96 w tabeli 2 w załączniku I do rozporządzenia wykonawczego (UE) 2019/363 w odniesieniu do transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, w przypadku których w polu 72 „Oznakowanie niezabezpieczonego udzielania pożyczek papierów wartościowych” w tej samej tabeli zgłoszono jako „nieprawda”. Zgodnie z art. 3 niniejszego rozporządzenia repozytorium transakcji powiadamia podmiot przedkładający zgłoszenie i kontrahenta dokonującego zgłoszenia, a także, w stosownych przypadkach, podmiot odpowiedzialny za dokonanie zgłoszenia o wynikach weryfikacji.
3. Repozytorium transakcji odrzuca zgłoszenie transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, które nie spełniają jednego z wymogów określonych w ust. 1 i przypisuje mu jedną z kategorii odrzucenia określonych w tabeli 2 w załączniku I do niniejszego rozporządzenia.
4. Repozytorium transakcji dostarcza podmiotowi przedkładającemu zgłoszenie i kontrahentowi dokonującemu zgłoszenia, jak również, w stosownych przypadkach, podmiotowi odpowiedzialnemu za dokonanie zgłoszenia szczegółowe informacje dotyczące wyników weryfikacji danych, o której mowa w ust. 1, w ciągu sześćdziesięciu minut od momentu otrzymania zgłoszenia transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych. Repozytorium transakcji dostarcza przedmiotowe wyniki w formacie XML na formularzu opracowanym zgodnie z metodyką ISO 20022. Wyniki obejmują w stosownych przypadkach szczególnie powody odrzucenia zgłoszenia transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych zgodnie z ust. 3.

#### Artykuł 2

##### Uzgadnianie danych przez repozytoria transakcji

1. Repozytorium transakcji dąży do uzgodnienia zgłoszonej transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych, podejmując kroki określone w ust. 2, pod warunkiem że spełnione są wszystkie następujące warunki:
  - a) repozytorium transakcji zakończyło weryfikacje określone w art. 1 ust. 1 i 2;
  - b) obydwaj kontrahenci zgłoszonej transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych podlegają obowiązkowi zgłaszania;
  - c) repozytorium transakcji nie otrzymało późniejszego zgłoszenia oznaczonego rodzajem działania „błąd” odnoszącego się do zgłoszonej transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych.
2. Jeżeli spełnione są wszystkie warunki określone w ust. 1, repozytorium transakcji podejmuje następujące działania, korzystając z ostatniej zgłoszonej wartości dla każdego z pól w tabeli 1 w załączniku I do niniejszego rozporządzenia:
  - a) po otrzymaniu zgłoszenia transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych repozytorium transakcji weryfikuje, czy otrzymało odpowiadające zgłoszenie transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych od innego kontrahenta lub w jego imieniu;
  - b) repozytorium transakcji, które nie otrzymało odpowiadającego zgłoszenia transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych, o którym mowa w lit. a), podejmuje próbę zidentyfikowania repozytorium transakcji, które otrzymało odpowiadające zgłoszenie transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych, przekazując wszystkim zarejestrowanym repozytoriom transakcji wartości dotyczące zgłoszonej transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych figurujące w następujących polach: „Niepowtarzalny identyfikator transakcji”, „Kontrahent dokonujący zgłoszenia”, „Inny kontrahent” i „Rodzaj umowy ramowej”;
  - c) repozytorium transakcji, które ustali, że inne repozytorium transakcji otrzymało odpowiadające zgłoszenie transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych, o którym mowa w lit. a), wymienia z tym repozytorium transakcji szczegółowe informacje dotyczące zgłoszonej transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych w formacie XML na formularzu opracowanym zgodnie z metodyką ISO 20022;
  - d) z zastrzeżeniem lit. e) repozytorium transakcji uznaje zgłoszoną transakcję finansowaną z użyciem papierów wartościowych za uzgodnioną, jeżeli szczegółowe informacje dotyczące tej transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych pokrywają się ze szczegółowymi informacjami dotyczącymi odpowiadającego zgłoszenia transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych, o którym mowa w lit. a) niniejszego ustępu;
  - e) repozytorium transakcji dokłada starań, aby w przypadku zgłoszonej transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych osobno dopasowywać pola dotyczące danych o pożyczce i pola dotyczące danych o zabezpieczeniu zgodnie z granicami tolerancji i odpowiednimi terminami stosowania określonymi w tabeli 1 w załączniku I do niniejszego rozporządzenia;

- f) repozytorium transakcji przypisuje następnie wartości kategoriom uzgodnienia w odniesieniu do każdej zgłoszonej transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych, jak określono w tabeli 3 w załączniku I do niniejszego rozporządzenia;
- g) repozytorium transakcji kończy działania określone w lit. a)–f) niniejszego ustępu w najwcześniejszym możliwym terminie i nie podejmuje żadnych takich działań po godzinie 18:00 czasu UTC w danym dniu roboczym;
- h) repozytorium transakcji, które nie może dokonać uzgodnienia zgłoszonej transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych, dokłada starań, aby dopasować szczegółowe informacje dotyczące przedmiotowej zgłoszonej transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych następnego dnia roboczego. Repozytorium transakcji nie musi już dokładać starań w celu uzgodnienia zgłoszonej transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych po upływie trzydziestu dni kalendarzowych od zgłoszonego terminu zapadalności transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych lub po otrzymaniu odnoszącego się do niej zgłoszenia oznaczonego rodzajem działania „zakończenie” lub „składnik pozycji”.
3. Na koniec każdego dnia roboczego repozytorium transakcji potwierdza łączną liczbę uzgodnionych, zgłoszonych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych u każdego repozytorium transakcji, z którym uzgadniał zgłoszone transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych.
4. Najpóźniej sześćdziesiąt minut po zakończeniu procesu uzgadniania określonego w ust. 2 lit. g) repozytorium transakcji dostarcza podmiotowi przedkładającemu zgłoszenie i kontrahentowi dokonującemu zgłoszenia, jak również, w stosownych przypadkach, podmiotowi odpowiedzialnemu za dokonanie zgłoszenia wyniki przeprowadzonego przez nie procesu uzgadniania zgłoszonych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych. Repozytorium transakcji dostarcza przedmiotowe wyniki w formacie XML na formularzu opracowanym zgodnie z metodyką ISO 20022, w tym informacje dotyczące pól, które nie zostały uzgodnione.

### Artykuł 3

#### **Mechanizm reagowania na koniec dnia**

Na koniec każdego dnia roboczego repozytorium transakcji udostępnia podmiotowi przedkładającemu zgłoszenie i kontrahentowi dokonującemu zgłoszenia, a także, w stosownych przypadkach, podmiotowi odpowiedzialnemu za dokonanie zgłoszenia następujące informacje dotyczące odpowiednich transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych w formacie XML na formularzu opracowanym zgodnie z metodyką ISO 20022:

- a) transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych zgłoszone w danym dniu;
- b) ostatnie stany transakcji odnoszące się do transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, które nie osiągnęły jeszcze terminu zapadalności lub względem których nie dokonano zgłoszeń oznaczonych rodzajami działania „błąd”, „zakończenie” lub „składnik pozycji”;
- c) niepowtarzalne identyfikatory transakcji odnoszące się do transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, w odniesieniu do których w polu 72 w tabeli 2 w załączniku I do rozporządzenia wykonawczego (UE) 2019/363 zgłoszono „nieprawda” i nie zgłoszono jeszcze informacji dotyczących zabezpieczenia w polach 73–96 w tej samej tabeli;
- d) zgłoszenia transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, które danego dnia odrzucono;
- e) status uzgodnienia w odniesieniu do wszystkich zgłoszonych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, z wyjątkiem transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, które utraciły ważność, lub w przypadku których ponad miesiąc przed danym dniem roboczym otrzymano zgłoszenia transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oznaczone rodzajem działania „zakończenie” lub „składnik pozycji”.

### Artykuł 4

#### **Dostęp do szczegółowych informacji dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych**

Repozytorium transakcji zapewnia podmiotom wskazanym w art. 12 ust. 2 rozporządzenia (UE) 2015/2365 bezpośredni i natychmiastowy dostęp, w tym w przypadku gdy obowiązuje delegowanie na podstawie art. 28 rozporządzenia (UE) nr 1095/2010, do szczegółowych informacji dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych w formie elektronicznej i nadającej się do przetwarzania automatycznego, zgodnie z rozporządzeniem delegowanym Komisji (UE) 2019/357 <sup>(<sup>5</sup>)</sup>.

Do celów akapitu pierwszego repozytorium transakcji stosuje format XML i formularz opracowany zgodnie z metodyką ISO 20022.

<sup>(5)</sup> Rozporządzenie delegowane Komisji (UE) 2019/357 z dnia 13 grudnia 2018 r. uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych w sprawie dostępu do szczegółowych informacji dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywanych w repozytoriach transakcji (zob. s. 22 niniejszego Dziennika Urzędowego).

## Artykuł 5

**Obliczanie danych na poziomie pozycji i dostęp do tych danych**

1. Repozytorium transakcji oblicza dane na poziomie pozycji dotyczące ekspozycji między kontrahentami w zakresie pożyczki i zabezpieczenia. Obliczenia danych na poziomie pozycji dokonuje się na podstawie następujących kryteriów:
  - a) wartości kategorii uzgodnienia jak określono w tabeli 3 w załączniku I do niniejszego rozporządzenia;
  - b) rodzaju transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych;
  - c) sektora kontrahentów;
  - d) statusu rozliczenia;
  - e) giełdowego lub pozagiełdowego systemu obrotu;
  - f) rodzaju zabezpieczenia;
  - g) waluty składnika pieniężnego;
  - h) klasy zapadalności;
  - i) koszyka redukcji wartości;
  - j) repozytoriów transakcji, do których inni kontrahenci zgłosili szczegółowe informacje dotyczące transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych.
2. Repozytorium transakcji zapewnia, aby podmioty ujęte w wykazie w art. 12 ust. 2 rozporządzenia (UE) 2015/2365 miały dostęp do danych na poziomie pozycji zgodnie z dostępem do danych określonym w rozporządzeniu delegowanym (UE) 2019/357.
3. Dane na poziomie pozycji, o których mowa w ust. 1, są dostarczane w formie elektronicznej i nadającej się do przetwarzania automatycznego i w formacie XML i na formularzu opracowanym zgodnie z metodyką ISO 20022.
4. Dostępu, o którym mowa w ust. 2, udziela się w najwcześniejszym możliwym terminie a najpóźniej w dniu roboczym następującym po dniu otrzymania zgłoszenia transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych zgodnie z art. 4 ust. 1 rozporządzenia (UE) 2015/2365.
5. Repozytorium transakcji zapewnia, aby podmioty, o których mowa w art. 12 ust. 2 rozporządzenia (UE) 2015/2365 miały dostęp do danych na poziomie zagregowanym zgodnie z dostępem do danych określonym w rozporządzeniu delegowanym Komisji (UE) 2019/357 i obliczonych zgodnie z powszechnie uzgodnionymi standardami i procesami w zakresie globalnego gromadzenia i agregowania danych dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych.

## Artykuł 6

**Obliczanie zagregowanych danych dotyczących pozycji na potrzeby publikacji**

1. Repozytorium transakcji dokonuje agregacji danych dotyczących pozycji zgodnie z kryteriami określonymi w ust. 2 i 3 w odniesieniu do następujących wartości:
  - a) kwoty głównej umów z udzielonym przyrzeczeniem odkupu, transakcji zwrotnych kupno-sprzedaż (buy-sell back) lub transakcji zwrotnych sprzedaż-kupno (sell-buy back), zagregowanej ilości papierów wartościowych lub towarów będących przedmiotem udzielania lub zaciągania pożyczek i liczby transakcji z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego;
  - b) liczby niepowtarzalnych identyfikatorów transakcji dotyczących odpowiednich transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych;
  - c) wartości rynkowej zabezpieczenia.
2. Repozytorium transakcji dokonuje agregacji danych dotyczących pozycji w odniesieniu do wszystkich zgłoszonych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oznaczonych rodzajem działania „nowa” od soboty, godz. 00:00:00 czasu UTC, do piątku, godz. 23:59:59 czasu UTC, na podstawie następujących kryteriów i powiązanych wartości określonych w tabeli 1 w załączniku II do niniejszego rozporządzenia:
  - a) lokalizacji kontrahenta dokonującego zgłoszenia lub, w stosownych przypadkach, odpowiedniego oddziału;
  - b) lokalizacji drugiego kontrahenta lub, w stosownych przypadkach, odpowiedniego oddziału;
  - c) rodzaju transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych;
  - d) statusu uzgodnienia transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych, jak określono w tabeli 3 w załączniku I do niniejszego rozporządzenia;

- e) rodzaju systemu obrotu, w ramach którego zawarto transakcję finansowaną z użyciem papierów wartościowych;
  - f) czy transakcja finansowana z użyciem papierów wartościowych została rozliczona;
  - g) metody przeniesienia zabezpieczenia;
  - h) każdy wskaźnik stosowany jako punkt odniesienia w transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych, będący przedmiotem obrotu w systemie obrotu, w którym transakcja jest realizowana, innym niż „XXXX”, jeżeli zagregowana kwota nominalna zgłoszona do repozytorium transakcji w ramach wskaźnika przewyższa 5 mld EUR i jeżeli jest co najmniej sześciu różnych kontrahentów, którzy zgłosili odpowiednie transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych do repozytorium transakcji.
3. Repozytorium transakcji dokonuje agregacji danych dotyczących pozycji w odniesieniu do wszystkich zgłoszonych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, które nie osiągnęły jeszcze terminu zapadalności lub względem których nie otrzymano zgłoszeń oznaczonych rodzajami działania „błąd”, „zakończenie”, „składnik pozycji”, przed piątkiem, godz. 23:59:59 czasu UTC na podstawie następujących kryteriów i powiązanych wartości określonych w tabeli 1 w załączniku II do niniejszego rozporządzenia:
- a) lokalizacji kontrahenta dokonującego zgłoszenia lub, w stosownych przypadkach, odpowiedniego oddziału;
  - b) lokalizacji drugiego kontrahenta lub, w stosownych przypadkach, odpowiedniego oddziału;
  - c) rodzaju transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych;
  - d) statusu uzgodnienia transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych, jak określono w tabeli 3 w załączniku I do niniejszego rozporządzenia;
  - e) rodzaju systemu obrotu, w ramach którego zawarto transakcję finansowaną z użyciem papierów wartościowych;
  - f) czy transakcja finansowana z użyciem papierów wartościowych została rozliczona;
  - g) metody przeniesienia zabezpieczenia;
  - h) każdy wskaźnik stosowany jako punkt odniesienia w transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych, będący przedmiotem obrotu w systemie obrotu, w którym transakcja jest realizowana, innym niż „XXXX”, jeżeli zagregowana kwota nominalna zgłoszona do repozytorium transakcji w ramach wskaźnika przewyższa 5 mld EUR i jeżeli jest co najmniej sześciu różnych kontrahentów, którzy zgłosili odpowiednie transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych do repozytorium transakcji.
4. Repozytorium transakcji dysponuje procedurą służącą identyfikowaniu nadzwyczajnych wartości związanych z zagregowanymi danymi dotyczącymi pozycji.
5. Repozytorium transakcji dysponuje procedurą służącą korygowaniu zagregowanych danych dotyczących pozycji i powiadamianiu o korektach, w tym korektach wynikających ze zgłoszeń oznaczonych rodzajem działania „błąd”, oraz publikowaniu pierwotnych i skorygowanych zagregowanych danych.

#### Artykuł 7

##### **Publikacja zagregowanych danych dotyczących pozycji**

1. Repozytorium transakcji publikuje co tydzień na swojej stronie internetowej zagregowane dane dotyczące pozycji, obliczone zgodnie z art. 6, nie później niż do wtorku do południa w odniesieniu do transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych zgłoszonych w poprzedzający piątek do godz. 23:59:59 czasu UTC.
2. Repozytorium transakcji publikuje wszystkie zagregowane dane dotyczące pozycji w EUR i stosuje kurs wymiany opublikowany na stronie internetowej EBC w piątek poprzedzający publikację tych danych.
3. Repozytorium transakcji zapewnia, aby zagregowane dane dotyczące pozycji były publikowane w formie tabelarycznej, jak określono w załączniku II do niniejszego rozporządzenia, oraz w sposób który pozwala na pobieranie danych.
4. Zagregowane dane dotyczące pozycji, które repozytorium transakcji publikuje na swojej stronie internetowej, należy przechowywać na tej stronie internetowej przez co najmniej 104 tygodnie.

#### Artykuł 8

##### **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 13 grudnia 2018 r.

*W imieniu Komisji*  
Jean-Claude JUNCKER  
*Przewodniczący*

---

## ZAŁĄCZNIK I

Tabela 1

**Pola uzgadniania, poziomy tolerancji i termin rozpoczęcia etapu uzgadniania**

Tabela	Dział	Pole	Tolerancja	Termin rozpoczęcia wskazany w:
Dane dotyczące kontrahenta	Nie dotyczy	Kontrahent dokonujący zgłoszenia	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące kontrahenta	Nie dotyczy	Strona kontrahenta	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące kontrahenta	Nie dotyczy	Inny kontrahent	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Niepowtarzalny identyfikator transakcji („UTI”)	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Rodzaj transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Rozliczona	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Znacznik czasu rozliczenia	1 godzina	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Kontrahent centralny	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	System obrotu	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Rodzaj umowy ramowej	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Znacznik czasu wykonania	1 godzina	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Data waluty (termin rozpoczęcia)	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Termin wymagalności (termin zakończenia)	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Data zakończenia transakcji	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Minimalny okres wypowiedzenia	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Najwcześniejszy termin wypowiedzenia	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Ogólny wskaźnik zabezpieczenia	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące



Tabela	Dział	Pole	Tolerancja	Termin rozpoczęcia wskazany w:
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Wskaźnik dostawy według wartości („DBV”)	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Metoda przekazania zabezpieczenia	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Bezterminowa	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Tryb rozwiązania umowy	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Stała stopa procentowa	Do trzeciego miejsca po przecinku	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Wzór obliczania dni	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Zmienna stopa procentowa	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Okres odniesienia dla zmiennej stopy procentowej – okres czasu	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Okres odniesienia dla zmiennej stopy procentowej – mnożnik	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Częstotliwość płatności według zmiennej stopy procentowej – okres czasu	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Częstotliwość płatności według zmiennej stopy procentowej – mnożnik	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Częstotliwość aktualizacji zmiennej stopy procentowej – okres czasu	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Częstotliwość aktualizacji zmiennej stopy procentowej – mnożnik	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Spread	Do trzeciego miejsca po przecinku	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Kwota w walucie uzupełnienia depozytu zabezpieczającego	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Waluta uzupełnienia depozytu zabezpieczającego	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365

Tabela	Dział	Pole	Tolerancja	Termin rozpoczęcia wskazany w:
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Korygowana stopa procentowa	Do trzeciego miejsca po przecinku	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Okres stosowania stopy procentowej	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Kwota główna w dniu waluty	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Kwota główna w terminie zapadalności	0,0005 %	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Waluta kwoty głównej	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Rodzaj składnika aktywów	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Identyfikator papieru wartościowego	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Klasyfikacja papieru wartościowego	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Produkt podstawowy	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Podprodukt	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Następny podprodukt	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Ilość lub kwota nominalna	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Jednostka pomiaru	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Waluta kwoty nominalnej	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Cena papieru wartościowego lub towaru	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Waluta, w jakiej wyrażona jest cena	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Jakość papieru wartościowego	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Termin zapadalności papieru wartościowego	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365

Tabela	Dział	Pole	Tolerancja	Termin rozpoczęcia wskazany w:
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Jurysdykcja emitenta	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Identyfikator podmiotu prawnego emitenta	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Rodzaj papieru wartościowego	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Wartość pożyczki	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Wartość rynkowa	0,0005 %	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Stała stawka rabatu	Do trzeciego miejsca po przecinku	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Zmienna stawka rabatu	Do trzeciego miejsca po przecinku	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Okres odniesienia dla zmiennej stawki rabatu – okres czasu	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Okres odniesienia dla zmiennej stawki rabatu – mnożnik	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Częstotliwość płatności według zmiennej stawki rabatu – okres czasu	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Płatność według zmiennej stawki rabatu – mnożnik	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Częstotliwość aktualizacji zmiennej stawki rabatu – okres czasu	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Aktualizacja zmiennej stawki rabatu – mnożnik	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Spread stawki rabatu	Do trzeciego miejsca po przecinku	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Opłata za udzielenie pożyczki	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365

Tabela	Dział	Pole	Tolerancja	Termin rozpoczęcia wskazany w:
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Wyłączne ustalenia	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Nierozliczone transakcje z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Waluta podstawowa pożyczki pozostałej do spłaty	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Wartość pozycji krótkich na rynku	0,0005 %	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Zabezpieczenie	Oznakowanie niezabezpieczonego udzielania pożyczek papierów wartościowych	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Zabezpieczenie	Zabezpieczenie ekspozycji netto	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Zabezpieczenie	Data waluty zabezpieczenia	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Zabezpieczenie	Rodzaj składnika zabezpieczenia	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Zabezpieczenie	Kwota zabezpieczenie gotówkowego	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Zabezpieczenie	Waluta zabezpieczenia gotówkowego	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Zabezpieczenie	Identyfikacja papieru wartościowego wykorzystanego jako zabezpieczenie	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Zabezpieczenie	Klasyfikacja papieru wartościowego wykorzystanego jako zabezpieczenie	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Zabezpieczenie	Produkt podstawowy	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Zabezpieczenie	Podprodukt	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Zabezpieczenie	Dalszy podprodukt	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (iv) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Zabezpieczenie	Ilość zabezpieczeń lub kwota nominalna zabezpieczenia	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Zabezpieczenie	Jednostka miary zabezpieczenia	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące

Tabela	Dział	Pole	Tolerancja	Termin rozpoczęcia wskazany w:
Dane dotyczące transakcji	Zabezpieczenie	Waluta nominalnej wartości zabezpieczenia	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Zabezpieczenie	Waluta, w jakiej wyrażona jest cena	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Zabezpieczenie	Cena jednostki	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Zabezpieczenie	Wartość rynkowa zabezpieczenia	0,0005 %	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365 + 24 miesiące
Dane dotyczące transakcji	Zabezpieczenie	Redukcja wartości lub depozyt zabezpieczający	Do trzeciego miejsca po przecinku	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Zabezpieczenie	Jakość zabezpieczenia	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Zabezpieczenie	Termin wymagalności papieru wartościowego	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Zabezpieczenie	Jurysdykcja emitenta	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Zabezpieczenie	Identyfikator podmiotu prawnego emitenta	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Zabezpieczenie	Rodzaj zabezpieczenia	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Zabezpieczenie	Dostępność zabezpieczenia do ponownego wykorzystania	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Zabezpieczenie	Identyfikator koszyka zabezpieczeń	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365
Dane dotyczące transakcji	Pożyczka	Poziom	Nie	Art. 33 ust. 2 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2015/2365

Tabela 2

### Powody odrzucenia zgłoszenia transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych

Kategorie odrzucenia	Powód
Schemat	— odrzucono transakcję finansowaną z użyciem papierów wartościowych ze względu na brak zgodności schematu
Zezwolenie	— odrzucono transakcję finansowaną z użyciem papierów wartościowych ponieważ podmiot przedkładający zgłoszenie nie posiada zezwolenia do dokonywania zgłoszeń w imieniu kontrahenta zgłaszającego
Logika	— odrzucono transakcję finansowaną z użyciem papierów wartościowych, ponieważ rodzaj działania w odniesieniu do transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych nie jest poprawny po względem logicznym
Działalność	— odrzucono transakcję finansowaną z użyciem papierów wartościowych ze względu na brak zgodności z co najmniej jedną walidacją treści

Tabela 3

**Wyniki procesu uzgadniania**

Kategorie uzgodnienia	Wartości uzgodnienia
Rodzaj zgłoszenia	Jednostronne/dwustronne
Wymóg zgłaszania dotyczący obu kontrahentów	Tak/nie
Status zestawiania par	Z parą/bez pary
Status uzgodnienia pożyczki	Uzgodniona/nieuzgodniona
Status uzgodnienia zabezpieczenia	Uzgodnione/nieuzgodnione
Dalsze zmiany	Tak/nie

## ZAŁĄCZNIK II

Tabela 1

## Dane publiczne

Tabela A. Agregacja

Data	RT	Rodzaj agregacji	Rodzaj systemu obrotu	Lokalizacja kontrahenta dokonującego zgłoszenia	Lokalizacja drugiego kontrahenta	Uzgodnienie	Rodzaj transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych	Rozliczona	Metoda przeniesienia zabezpieczenia	Wskaźnik stosowany jako punkt odniesienia (!)	Zagregowana pożyczona kwota	Zagregowana liczba transakcji	Zagregowana wartość zabezpieczenia
20161007	RT UE	Zgłoszona	XXXX	EOG	EOG	Dwustronne, uzgodniona pożyczka, nieuzgodnione zabezpieczenie	Repo	Tak	TTCA		...		...
...	...	Niedokonana	XOFF	Poza EOG	Poza EOG	Dwustronne, uzgodniona pożyczka, uzgodnione zabezpieczenie	Transakcja zwrotna kupno-sprzedaż/transakcja zwrotna sprzedaż-kupno	Nie	SICA		...		...
...	...	...	kod MIC EOG	...	...	Jednostronne z obrębu EOG, uzgodniona pożyczka, uzgodnione zabezpieczenie	Udzielanie lub zaciąganie pożyczek papierów wartościowych lub towarów	...	SIUR		...		...
...	...	...	kod MIC spoza EOG	...	...	...	Uzupełnienie depozytu zabezpieczającego	...			...		...
...	...	...	...	...	...	...	...	...	...		...		...

(!) Należy wypełnić odpowiednimi wskaźnikami znajdującymi się w polu 25 w tabeli 2 „Dane dotyczące pożyczki i zabezpieczenia” w załączniku I do rozporządzenia wykonawczego Komisji (UE) 2019/363.