

ROZPORZĄDZENIE DELEGOWANE KOMISJI (UE) 2017/1800

z dnia 29 czerwca 2017 r.

zmieniające rozporządzenie delegowane (UE) nr 151/2013 uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012

(Tekst mający znaczenie dla EOG)

KOMISJA EUROPEJSKA,

uwzględniając Traktat o funkcjonowaniu Unii Europejskiej,

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 ⁽¹⁾, w szczególności jego art. 81 ust. 5,

a także mając na uwadze, co następuje:

- (1) Stosowanie rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) nr 151/2013 ⁽²⁾ pozwoliło stwierdzić, że brak szczegółowych standardów dotyczących dostępu do danych oraz agregowania i porównywania danych prowadzi do strukturalnych uchybień. Brak ustandaryzowanych danych, jednolitej funkcjonalności oraz ustandaryzowanego formatu komunikatów stanowił przeszkodę w bezpośrednim i natychmiastowym dostępie do danych i – w konsekwencji – uniemożliwiał podmiotom, o których mowa w art. 81 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012, przeprowadzanie skutecznej oceny ryzyka systemowego, a tym samym wykonywanie ich odnośnych obowiązków i uprawnień.
- (2) W celu usunięcia tych przeszkód konieczna jest zmiana rozporządzenia delegowanego (UE) nr 151/2013 poprzez doprecyzowanie standardów operacyjnych niezbędnych do celów agregowania i porównywania danych z różnych repozytoriów transakcji, tak aby zapewnić podmiotom, o których mowa w art. 81 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012, możliwość dostępu do informacji niezbędnych im do wykonywania ich odnośnych obowiązków i uprawnień.
- (3) Aby umożliwić skuteczne i efektywne porównywanie i agregowanie danych z różnych repozytoriów transakcji, na potrzeby dostępu do danych oraz komunikacji między podmiotami, o których mowa w art. 81 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012, a repozytoriami transakcji powinny być wykorzystywane wzory w formacie XML i komunikaty XML opracowane zgodnie z metodyką ISO 20022. Nie powinno to jednak wykluczać możliwości osiągnięcia między repozytoriami transakcji a odpowiednimi podmiotami porozumienia przewidującego zapewnienie dostępu i prowadzenie komunikacji z wykorzystaniem innego – obok XML – formatu.
- (4) Wzory w formacie XML należy stosować do przekazywania danych odpowiednim podmiotom w sposób, który ułatwia ich agregację, natomiast komunikaty XML należy wykorzystywać w celu usprawnienia procesu wymiany danych między repozytoriami transakcji a odpowiednimi podmiotami. W rozporządzeniu delegowanym (UE) nr 151/2013 nie wykluczono możliwości dodatkowego odrębnego stosowania wzorów w formatach innych niż XML, takich jak pliki w formacie csv (wartości rozdzielone przecinkiem) lub pliki tekstowe (txt), o ile umożliwiają one odpowiednim podmiotom wykonywanie swoich obowiązków i uprawnień. Repozytoriami transakcji należy zatem zezwolić na dalsze korzystanie z tych formatów obok – ale nigdy w zastępstwie – wzorów w formacie XML. Jako minimum wzory w formacie XML i komunikaty XML oparte o metodologię ISO 20022 należy stosować na potrzeby wszystkich sprawozdań wynikowych i wymian danych w celu zapewnienia porównywalności i agregacji danych z różnych repozytoriów transakcji.
- (5) Podmioty wymienione w art. 81 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012 mogą delegować na rzecz ESMA swoje zadania i kompetencje, w tym dostęp do danych zgłaszanych do repozytoriów transakcji, na mocy art. 28 rozporządzenia (UE) nr 1095/2010 ⁽³⁾. Skorzystanie z tego uprawnienia nie powinno w żadnym wypadku wpływać na spoczywający na repozytoriach transakcji obowiązek udzielenia podmiotom wymienionym w art. 81 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012 bezpośredniego i natychmiastowego dostępu do tych danych.
- (6) Aby zapewnić poufność, każdy rodzaj wymiany danych między repozytoriami transakcji a odpowiednimi podmiotami powinien być realizowany za pośrednictwem bezpiecznego połączenia maszyna-maszyna przy użyciu protokołów szyfrowania danych. W celu zapewnienia wspólnych minimalnych standardów wymiana

⁽¹⁾ Dz.U. L 201 z 27.7.2012, s. 1.

⁽²⁾ 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 (Dz.U. L 52 z 23.2.2013, s. 33).

⁽³⁾ 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).

danych między repozytoriami transakcji a podmiotami wymienionymi w art. 81 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012 powinna przebiegać przy użyciu protokołu komunikacyjnego *SSH File Transfer Protocol* (SFTP). Nie powinno to jednak wykluczać możliwości osiągnięcia między repozytoriami transakcji a odpowiednimi podmiotami porozumienia przewidującego zestawianie bezpiecznego połączenia maszyna-maszyna przy użyciu dodatkowego – innego niż SFTP – kanału komunikacji. Repozytoriom transakcji należy zatem zezwolić na dalsze korzystanie z innych bezpiecznych połączeń maszyna-maszyna obok – ale nigdy w zastępstwie – protokołu SFTP.

- (7) Dane dotyczące aktualnego statusu transakcyjnego otwartych kontraktów pochodnych mają zasadnicze znaczenie dla monitorowania stabilności finansowej i ryzyka systemowego. Dlatego też odpowiednie podmioty powinny mieć dostęp do tych danych.
- (8) Należy ułatwić bezpośredni i natychmiastowy dostęp do konkretnych zbiorów danych, a zatem należy sformułować zestaw możliwych do zadawania w różnej konfiguracji zapytań *ad hoc* dotyczących stron transakcji, warunków ekonomicznych, klasyfikacji i identyfikacji kontraktu pochodnego, horyzontu czasowego realizacji, sprawozdawczości i terminu zapadalności oraz zdarzeń biznesowych i zdarzeń mających miejsce w trakcie cyklu życia kontraktu.
- (9) Terminy przekazywania danych odpowiednim podmiotom przez repozytoria transakcji należy ujednoczyć, aby usprawnić bezpośredni i natychmiastowy dostęp do danych przechowywanych w repozytoriach transakcji oraz umożliwić odpowiednim podmiotom i repozytoriom transakcji usprawnienie harmonogramu realizacji swoich wewnętrznych procesów przetwarzania danych.
- (10) Rozporządzenie delegowane (UE) nr 151/2013 należy zatem zmienić w celu doprecyzowania i poprawy ram operacyjnych regulujących dostęp, agregowanie i porównywanie danych z różnych repozytoriów transakcji.
- (11) Stosowanie przepisów ustanowionych w niniejszym rozporządzeniu delegowanym należy odroczyć, aby ułatwić repozytoriom transakcji dostosowanie systemów do ustanowionych w nim specyfikacji.
- (12) Podstawę niniejszego rozporządzenia stanowi projekt regulacyjnych standardów technicznych przedstawiony Komisji przez Europejski Urząd Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych.
- (13) Zgodnie z art. 10 rozporządzenia (UE) nr 1095/2010 ESMA przeprowadził otwarte konsultacje publiczne na temat projektu regulacyjnych standardów technicznych, który stanowi podstawę niniejszego rozporządzenia, oraz dokonał analizy potencjalnych kosztów i korzyści z nimi związanych. Konsultacje te pozwoliły ESMA poznać opinie właściwych organów oraz członków Europejskiego Systemu Banków Centralnych (ESBC), które zostały przedstawione przez EBC. Dodatkowo ESMA zasięgnęła opinii Grupy Interesariuszy z Sektora Giełd i Papierów Wartościowych ustanowionej zgodnie z art. 37 rozporządzenia (UE) nr 1095/2010,

PRZYJMUJE NINIEJSZE ROZPORZĄDZENIE:

Artykuł 1

Zmiany w rozporządzeniu delegowanym (UE) nr 151/2013

1. W art. 4 wprowadza się następujące zmiany:

a) ust. 1 otrzymuje brzmienie:

„1. Repozytorium transakcji zapewnia podmiotom wymienionym w art. 81 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012 bezpośredni i natychmiastowy dostęp – w tym również wówczas, gdy miało miejsce delegowanie zadań lub kompetencji zgodnie z art. 28 rozporządzenia (UE) nr 1095/2010 – do szczegółowych informacji dotyczących kontraktów pochodnych zgodnie z art. 2 i 3 niniejszego rozporządzenia.

Do celów akapitu pierwszego repozytorium transakcji stosuje format XML oraz wzór opracowany zgodnie z metodyką ISO 20022. Repozytorium transakcji może ponadto – po uzgodnieniu tej kwestii z zainteresowanym podmiotem – zapewnić dostęp do szczegółowych informacji dotyczących kontraktów pochodnych w innym wzajemnie uzgodnionym formacie.”;

b) skreśla się ust. 2.

2. W art. 5 dodaje się ust. 3–9 w brzmieniu:

„3. Repozytorium transakcji ustanawia i utrzymuje niezbędne rozwiązania techniczne umożliwiające podmiotom wymienionym w art. 81 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012 nawiązanie połączenia przy użyciu bezpiecznego interfejsu maszyna-maszyna w celu przesyłania zapytań o dane i otrzymywania danych.

Do celów akapitu pierwszego repozytorium transakcji stosuje protokół komunikacyjny *File Transfer Protocol SSH*. Repozytorium transakcji stosuje znormalizowane komunikaty XML opracowane zgodnie z metodyką ISO 20022 do celów komunikacji za pośrednictwem wspomnianego interfejsu. Repozytorium transakcji może ponadto – po uzgodnieniu tej kwestii z zainteresowanym podmiotem – zestawiać połączenie z zastosowaniem innego wzajemnie uzgodnionego protokołu.

4. Zgodnie z art. 2 i 3 niniejszego rozporządzenia repozytorium transakcji zapewnia podmiotom wymienionym w art. 81 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012 dostęp do następujących informacji:

- a) wszystkich zgłoszeń dotyczące kontraktów pochodnych;
- b) aktualnego statusu transakcyjnego kontraktów pochodnych, które nie osiągnęły terminu zapadalności lub które nie były przedmiotem zgłoszenia zawierającego wyszczególnienie rodzajów czynności »E«, »C«, »P« lub »Z«, o których mowa w polu 93 w tabeli 2 w załączniku do rozporządzenia wykonawczego Komisji (UE) nr 1247/2012 (*).

5. Repozytorium transakcji ustanawia i utrzymuje niezbędne rozwiązania techniczne umożliwiające podmiotom wymienionym w art. 81 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012 ustanowienie z góry określonych okresowych zapytań pozwalających uzyskać dostęp do szczegółowych informacji dotyczących kontraktów pochodnych wyszczególnionych w ust. 4, co jest konieczne, aby umożliwić tym podmiotom wykonywanie ich obowiązków i uprawnień.

6. Na żądanie repozytorium transakcji zapewnia podmiotom wymienionym w art. 81 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012 dostęp do szczegółowych informacji dotyczących kontraktów pochodnych w oparciu o dowolną konfigurację poniższych pól zawartych w załączniku do rozporządzenia wykonawczego (UE) nr 1247/2012:

- a) znacznik czasu zgłoszenia;
- b) identyfikator kontrahenta dokonującego zgłoszenia;
- c) identyfikator drugiego kontrahenta;
- d) sektor przedsiębiorstw, w którym działa kontrahent dokonujący zgłoszenia;
- e) charakter kontrahenta dokonującego zgłoszenia;
- f) identyfikator brokera;
- g) identyfikator podmiotu dokonującego zgłoszenia;
- h) identyfikator beneficjenta;
- i) klasa aktywów;
- j) klasyfikacja produktu;
- k) identyfikator produktu;
- l) identyfikator instrumentu bazowego;
- m) miejsce realizacji transakcji;
- n) znacznik czasu realizacji transakcji;
- o) termin zapadalności;
- p) data rozwiązania;
- q) CCP; oraz
- r) rodzaj czynności.

7. Repozytorium transakcji ustanawia i utrzymuje zdolność techniczną do zapewnienia bezpośredniego i natychmiastowego dostępu do szczegółowych informacji dotyczących kontraktów pochodnych, których podmioty wymienione w art. 81 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012 potrzebują do wykonywania swoich uprawnień i obowiązków. Dostęp ten zapewnia się w następujący sposób:

- a) jeżeli podmiot wymieniony w art. 81 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012 wystąpi z wnioskiem o dostęp do szczegółowych informacji dotyczących otwartych kontraktów pochodnych lub kontraktów pochodnych, które osiągnęły termin zapadalności bądź w stosunku do których dokonano zgłoszeń zawierających wyszczególnienie rodzajów czynności »E«, »C«, »Z« lub »P«, o których mowa w polu 93 w tabeli 2 w załączniku do rozporządzenia wykonawczego (UE) nr 1247/2012, nie więcej niż rok przed datą wystąpienia ze wspomnianym wnioskiem, repozytorium transakcji realizuje ten wniosek nie później niż o godz. 12.00 czasu UTC pierwszego dnia kalendarzowego następującego po dniu, w którym wystąpiono z wnioskiem o dostęp;

- b) jeżeli podmiot wymieniony w art. 81 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012 wystąpi z wnioskiem o dostęp do szczegółowych informacji dotyczących kontraktów pochodnych, które osiągnęły termin zapadalności bądź w stosunku do których dokonano zgłoszeń zawierających wyszczególnienie rodzajów czynności »E«, »C«, »Z« lub »P«, o których mowa w polu 93 w tabeli 2 w załączniku do rozporządzenia wykonawczego (UE) nr 1247/2012, więcej niż rok przed datą wystąpienia ze wspomnianym wnioskiem, repozytorium transakcji realizuje ten wniosek nie później niż w terminie trzech dni roboczych od dnia, w którym wystąpiono z wnioskiem o dostęp;
- c) jeżeli wniosek o dostęp do danych, z którym wystąpił podmiot wymieniony w art. 81 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012, dotyczy kontraktów pochodnych wchodzących w zakres zarówno lit. a), jak i lit. b), repozytorium transakcji przekazuje szczegółowe informacje dotyczące tych kontraktów pochodnych nie później niż w terminie trzech dni roboczych od dnia, w którym wystąpiono z wnioskiem o dostęp.

8. Repozytorium transakcji potwierdza odbiór oraz weryfikuje poprawność i kompletność wszystkich wniosków o dostęp do danych, z którymi wystąpiły podmioty wymienione w art. 81 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012. Powiadamia ono te podmioty o wyniku tej weryfikacji nie później niż sześćdziesiąt minut od przekazania wniosku.

9. Repozytorium transakcji stosuje podpis elektroniczny i protokoły szyfrowania danych w celu zapewnienia poufności, integralności i ochrony danych udostępnionych podmiotom wymienionym w art. 81 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012.

(*) Rozporządzenie wykonawcze Komisji (UE) nr 1247/2012 z dnia 19 grudnia 2012 r. ustanawiające wykonawcze standardy techniczne w odniesieniu do formatu i częstotliwości dokonywania zgłoszeń dotyczących transakcji do repozytoriów transakcji 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 (Dz.U. L 352 z 21.12.2012, s. 20), zmienione rozporządzeniem wykonawczym (UE) 2017/105 (Dz.U. L 17 z 21.1.2017, s. 17)."

Artykuł 2

Wejście w życie i stosowanie

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

Niniejsze rozporządzenie stosuje się od dnia 1 listopada 2017 r.

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

Sporządzono w Brukseli dnia 29 czerwca 2017 r.

W imieniu Komisji
Jean-Claude JUNCKER
Przewodniczący