

DELEGIERTE VERORDNUNG (EU) 2017/1800 DER KOMMISSION**vom 29. Juni 2017****zur Änderung der Delegierten Verordnung (EU) Nr. 151/2013 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates****(Text von Bedeutung für den EWR)**

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

gestützt auf die Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 4. Juli 2012 über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister ⁽¹⁾, insbesondere auf Artikel 81 Absatz 5,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) Bei der Anwendung der Delegierten Verordnung (EU) Nr. 151/2013 der Kommission ⁽²⁾ hat sich gezeigt, dass die fehlenden Standards für den Datenzugang sowie für die Zusammenstellung und den Vergleich von Daten strukturelle Mängel bewirken. Das Fehlen standardisierter Daten, eines einheitlichen Funktionsumfangs und eines standardisierten Nachrichtenformats erschwert den direkten und sofortigen Datenzugang und hindert die in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Stellen daran, das Systemrisiko wirksam zu bewerten und damit ihre jeweiligen Aufgaben und Mandate zu erfüllen.
- (2) Um diese Hemmnisse zu beseitigen, muss die Delegierte Verordnung (EU) Nr. 151/2013 durch eine weitere Präzisierung der operationellen Standards, die für die Zusammenstellung und den Vergleich der Daten verschiedener Transaktionsregister erforderlich sind, in der Weise geändert werden, dass die in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Stellen Zugang zu den Daten erhalten, die sie für die Erfüllung ihrer jeweiligen Aufgaben und Mandate benötigen.
- (3) Damit der Vergleich und die Zusammenstellung der Daten der einzelnen Transaktionsregister in wirksamer und effizienter Weise erfolgen können, sollten für den Datenzugang und die Kommunikation zwischen den in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Stellen und den Transaktionsregistern nach der Methodik von ISO 20022 entwickelte XML-Formatvorlagen und XML-Nachrichten verwendet werden. Dies sollte nicht die Möglichkeit ausschließen, dass die Transaktionsregister und einzelne Stellen vereinbaren können, für Datenkommunikation oder Kommunikation zusätzlich zu XML ein anderes Format zu verwenden.
- (4) Die XML-Formatvorlagen sollten verwendet werden, um den jeweiligen Stellen die Daten in einer Weise zur Verfügung zu stellen, die die Datenzusammenstellung erleichtert, während die Verwendung der XML-Nachrichten darauf abzielen sollte, den Datenaustausch zwischen den Transaktionsregistern und den jeweiligen Stellen zu optimieren. Die Delegierte Verordnung (EU) Nr. 151/2013 schließt die zusätzliche separate Verwendung von Nicht-XML-Formatvorlagen, wie etwa CSV-Dateien (CSV: Comma Separated Values) oder TXT-Dateien (TXT: Text), nicht aus, sofern diese es den jeweiligen Stellen erlauben, ihre Aufgaben und Mandate zu erfüllen. Die Transaktionsregister sollten die genannten Formate daher weiterhin zusätzlich zu den XML-Formatvorlagen verwenden dürfen, nicht jedoch an deren Stelle. Um die Vergleichbarkeit und Zusammenstellung von Daten der einzelnen Transaktionsregister zu gewährleisten, sollten die auf der Methodik von ISO 20022 basierenden XML-Formatvorlagen und XML-Nachrichten mindestens für alle Outputmeldungen und Austausche verwendet werden.
- (5) Die in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Stellen können nach Artikel 28 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 ⁽³⁾ Aufgaben und Pflichten an die ESMA delegieren, darunter auch den Zugang zu Daten, die den Transaktionsregistern gemeldet wurden. Eine solche Delegation sollte die Verpflichtung der Handelsregister, den in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Stellen direkten und sofortigen Zugang zu diesen Daten zu gewähren, in keiner Weise berühren.
- (6) Zur Wahrung der Vertraulichkeit sollte jede Art des Datenaustauschs zwischen den Transaktionsregistern und den jeweiligen Stellen unter Verwendung von Datenverschlüsselungsprotokollen über eine sichere Maschine-to-machine-Verbindung erfolgen. Um gemeinsame Mindeststandards zu gewährleisten, sollte zwischen den

⁽¹⁾ ABl. L 201 vom 27.7.2012, S. 1.

⁽²⁾ Delegierte Verordnung (EU) Nr. 151/2013 der Kommission vom 19. Dezember 2012 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister im Hinblick auf technische Regulierungsstandards für die von Transaktionsregistern zu veröffentlichenden und zugänglich zu machenden Daten sowie operationelle Standards für die Zusammenstellung und den Vergleich von Daten sowie den Datenzugang (ABl. L 52 vom 23.2.2013, S. 33).

⁽³⁾ Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde), zur Änderung des Beschlusses Nr. 716/2009/EG und zur Aufhebung des Beschlusses 2009/77/EG der Kommission (ABl. L 331 vom 15.12.2010, S. 84).

Transaktionsregistern und den in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Stellen ein SSH-Dateiübertragungsprotokoll (SFTP) eingesetzt werden. Dies sollte die Möglichkeit nicht ausschließen, dass die Transaktionsregister und die jeweiligen Stellen vereinbaren können, über einen zum SFTP hinzukommenden separaten Kanal eine sichere Machine-to-Machine-Verbindung einzurichten. Die Transaktionsregister sollten daher zusätzlich zu SFTP weiterhin andere sichere Machine-to-Machine-Verbindungen verwenden dürfen, die SFTP allerdings nicht ersetzen dürfen.

- (7) Daten zum letzten Handelsstand von Open-Interest-Derivatekontrakten sind für die Überwachung von Finanzstabilität und Systemrisiko von großer Bedeutung. Daher sollten die jeweiligen Stellen Zugang zu diesen Daten haben.
- (8) Mit Blick auf das wesentliche Ziel einer Erleichterung des direkten und sofortigen Zugangs zu bestimmten Datensätzen sollte ein Satz kombinierbarer Ad-hoc-Anträge geschaffen werden, die sich auf die an der Transaktion beteiligten Parteien, die wirtschaftlichen Bedingungen, die Klassifizierung und Identifizierung der Derivatekontrakte, den Zeitrahmen für Ausführung, Berichterstattung und Fälligkeit sowie die Geschäfts- und Lebenszykluseignisse beziehen.
- (9) Die Fristen, innerhalb derer die Transaktionsregister den jeweiligen Stellen die Daten zugänglich machen, sollten harmonisiert werden, um den direkten und sofortigen Zugang zu den Daten der Transaktionsregister zu verbessern und die jeweiligen Stellen und die Transaktionsregister in die Lage zu versetzen, die zeitliche Planung ihrer internen Datenverarbeitung zu optimieren.
- (10) Vor diesem Hintergrund sollte die Delegierte Verordnung (EU) Nr. 151/2013 geändert werden, um den operationellen Rahmen für den Datenzugang sowie für die Zusammenstellung und den Vergleich von Daten der einzelnen Transaktionsregister weiter zu präzisieren und zu verbessern.
- (11) Die Bestimmungen der vorliegenden delegierten Verordnung sollten erst zu einem späteren Zeitpunkt anwendbar werden, um den Transaktionsregistern die Anpassung der Systeme an die Bestimmungen der vorliegenden delegierten Verordnung zu erleichtern.
- (12) Diese Verordnung stützt sich auf die Entwürfe technischer Regulierungsstandards, die der Kommission von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde vorgelegt wurden.
- (13) Im Einklang mit Artikel 10 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 hat die ESMA offene öffentliche Konsultationen zu den Entwürfen technischer Regulierungsstandards, auf die sich die vorliegende Verordnung stützt, durchgeführt und die damit verbundenen potenziellen Kosten- und Nutzeneffekte analysiert. Im Rahmen dieser öffentlichen Konsultationen erhielt die ESMA Rückmeldungen von den zuständigen Behörden und den Mitgliedern des Europäischen Systems der Zentralbanken (ESZB), die von der EZB vorgelegt wurden. Darüber hinaus holte die ESMA die Stellungnahme der nach Artikel 37 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 eingerichteten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte ein —

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

Artikel 1

Änderung der Delegierten Verordnung (EU) Nr. 151/2013

- (1) Artikel 4 wird wie folgt geändert:

- (a) Absatz 1 erhält folgende Fassung:

„(1) Ein Transaktionsregister verschafft den in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Stellen gemäß den Artikeln 2 und 3 direkten und sofortigen Zugang zu den Einzelheiten von Derivatekontrakten; dies gilt auch in Fällen, in denen eine Delegation nach Artikel 28 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 vorliegt.

Für die Zwecke von Unterabsatz 1 verwendet ein Transaktionsregister ein XML-Format und eine XML-Vorlage, die nach der Methodik von ISO 20022 entwickelt wurden. Im Einvernehmen mit einzelnen Stellen kann ein Transaktionsregister in einem gemeinsam festgelegten zusätzlichen Format Zugang zu den Einzelheiten von Derivatekontrakten gewähren.“

- (b) Absatz 2 wird gestrichen.

- (2) In Artikel 5 werden die folgenden Absätze 3 bis 9 hinzugefügt:

„(3) Ein Transaktionsregister schafft und erhält die technischen Voraussetzungen aufrecht, die erforderlich sind, um die in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Stellen in die Lage zu versetzen, unter Verwendung einer sicheren Machine-to-Machine-Schnittstelle eine Verbindung einzurichten, über die Anträge auf Datenzugang sowie Daten übermittelt werden können.

Für die Zwecke von Unterabsatz 1 verwendet das Transaktionsregister das SSH-Dateiübertragungsprotokoll. Für die Kommunikation über diese Schnittstelle verwendet das Transaktionsregister im Einklang mit der Methode nach ISO 20022 entwickelte standardisierte XML-Nachrichten. Im Einvernehmen mit einzelnen Stellen kann ein Transaktionsregister zusätzlich eine Verbindung einrichten, die auf einem anderen vereinbarten Protokoll basiert.

(4) Gemäß den Artikeln 2 und 3 verschafft ein Transaktionsregister den in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Stellen Zugang zu:

- (a) allen Meldungen über Derivatekontrakte;
- (b) dem letzten Handelsstand von Derivatekontrakten, die noch nicht fällig sind oder die nicht Gegenstand einer Meldung mit der Maßnahmenart ‚E‘, ‚C‘, ‚P‘ oder ‚Z‘ nach Feld 93 in Tabelle 2 des Anhangs zur Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1247/2012 der Kommission (*) waren.

(5) Ein Transaktionsregister schafft und erhält die technischen Voraussetzungen aufrecht, die erforderlich sind, um die in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Stellen in die Lage zu versetzen, vordefinierte regelmäßige Anträge auf Zugang zu den in Absatz 4 aufgeführten Details von Derivatekontrakten einzurichten, die diese Stellen benötigen, um ihre Aufgaben und Mandate zu erfüllen.

(6) Auf Antrag verschafft ein Transaktionsregister den in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Stellen in Bezug auf eine beliebige Kombination der folgenden, im Anhang der Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1247/2012 aufgeführten Felder Zugang zu den Einzelheiten von Derivatekontrakten:

- (a) Meldezeitstempel;
- (b) ID der meldenden Gegenpartei;
- (c) ID der anderen Gegenpartei;
- (d) Sparte, in der die meldende Gegenpartei tätig ist;
- (e) Art der meldenden Gegenpartei;
- (f) Makler-ID;
- (g) ID der meldenden Stelle;
- (h) ID des Begünstigten;
- (i) Vermögensklasse;
- (j) Produktklassifizierung;
- (k) Produktkennziffer;
- (l) Identifizierung der Basiswerte;
- (m) Ausführungsplatz;
- (n) Ausführungszeitstempel;
- (o) Fälligkeitstermin;
- (p) Kontraktende;
- (q) CCP und
- (r) Art der Maßnahme.

(7) Ein Transaktionsregister schafft und erhält die technischen Voraussetzungen aufrecht, die erforderlich sind, um den in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Stellen den direkten und sofortigen Zugang zu den Einzelheiten von Derivatekontrakten zu gewähren, den die genannten Stellen im Hinblick auf die Erfüllung ihrer Aufgaben und Mandate benötigen. Dieser Zugang wird in folgender Weise gewährt:

- (a) Hat eine in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannte Stelle Zugang beantragt zu den Einzelheiten von noch ausstehenden Derivatekontrakten oder von Derivatekontrakten, die entweder fällig geworden sind oder für die nicht mehr als ein Jahr vor dem Datum der Übermittlung des Antrags Meldungen mit der Maßnahmenart ‚E‘, ‚C‘, ‚Z‘ oder ‚P‘ nach Feld 93 in Tabelle 2 des Anhangs der Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1247/2012 abgegeben wurden, kommt ein Transaktionsregister diesem Antrag am ersten Kalendertag nach dem Tag, an dem der Antrag auf Zugang übermittelt wurde, bis spätestens 12:00 koordinierter Weltzeit nach.

- (b) Hat eine in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannte Stelle Zugang beantragt zu den Einzelheiten von Derivatekontrakten, die entweder fällig geworden sind oder für die mehr als ein Jahr vor dem Datum der Übermittlung des Antrags Meldungen mit der Maßnahmenart ‚E‘, ‚C‘, ‚Z‘ oder ‚P‘ nach Feld 93 in Tabelle 2 des Anhangs der Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1247/2012 abgegeben wurden, kommt ein Transaktionsregister diesem Antrag innerhalb von drei Arbeitstagen nach dem Tag, an dem der Antrag auf Zugang übermittelt wurde, nach.
- (c) Bezieht sich der Antrag auf Datenzugang einer in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Stelle auf Derivatekontrakte, die sowohl unter den Buchstaben a als auch unter den Buchstaben b fallen, übermittelt das Transaktionsregister die Einzelheiten zu den jeweiligen Derivatekontrakten innerhalb von drei Arbeitstagen nach dem Tag, an dem der jeweilige Antrag auf Zugang übermittelt wurde.
- (8) Ein Transaktionsregister bestätigt den Empfang und prüft die Korrektheit und Vollständigkeit der von den in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Stellen übermittelten Anträge auf Datenzugang. Es informiert die genannten Stellen innerhalb von sechzig Minuten nach der Übermittlung des Antrags über das Ergebnis dieser Prüfung.
- (9) Ein Transaktionsregister verwendet eine elektronische Signatur und Datenverschlüsselungsprotokolle, um die Vertraulichkeit, die Integrität und den Schutz der Daten, die den in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Stellen zugänglich gemacht werden, zu gewährleisten.
- (*) Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1247/2012 der Kommission vom 19. Dezember 2012 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards im Hinblick auf das Format und die Häufigkeit von Transaktionsmeldungen an Transaktionsregister gemäß der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister (ABl. L 352 vom 21.12.2012, S. 20), geändert durch die Durchführungsverordnung (EU) 2017/105 (ABl. L 17 vom 21.1.2017, S. 17).“

Artikel 2

Inkrafttreten und Geltungsbeginn

Diese Verordnung tritt am zwanzigsten Tag nach ihrer Veröffentlichung im *Amtsblatt der Europäischen Union* in Kraft.

Sie gilt ab dem 1. November 2017.

Diese Verordnung ist in allen ihren Teilen verbindlich und gilt unmittelbar in jedem Mitgliedstaat.

Brüssel, den 29. Juni 2017

Für die Kommission
Der Präsident
Jean-Claude JUNCKER