

## KOMMISSIONENS GENNEMFØRELSESFORORDNING (EU) Nr. 1249/2012

af 19. december 2012

om gennemførelsesmæssige tekniske standarder for formatet for de optegnelser, der skal opbevares af centrale modparter i henhold til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 648/2012 om OTC-derivater, centrale modparter og transaktionsregistre

(EØS-relevant tekst)

EUROPA-KOMMISSIONEN HAR —

under henvisning til traktaten om Den Europæiske Unions funktionsmåde,

under henvisning til udtalelse fra Den Europæiske Centralbank <sup>(1)</sup>,under henvisning til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 648/2012 af 4. juli 2012 om OTC-derivater, centrale modparter og transaktionsregistre <sup>(2)</sup>, særlig artikel 29, stk. 5, og

ud fra følgende betragtninger:

- (1) I overensstemmelse med artikel 29, stk. 4, i forordning (EU) nr. 648/2012 og artikel 13, 14 og 15 i den delegerede retsakt for så vidt angår reguleringsmæssige tekniske standarder, som præciserer de optegnelser og oplysninger, som centrale modparter (CCP'er) skal opbevare, der er vedtaget i henhold til artikel 29, stk. 4, i forordning (EU) nr. 648/2012, bør der også fastsættes bestemmelser, der præciserer i hvilken form optegnelserne og oplysningerne skal opbevares i henhold til nævnte artikler.
- (2) For at de relevante myndigheder kan udføre deres opgaver på en effektiv og konsekvent måde, bør de data, som de får forelagt, være sammenlignelige mellem CCP'er. Anvendelsen af fælles formater gør det også lettere at sammenholde data mellem CCP'er.
- (3) Det bør kræves, at en CCP opbevarer data til registreringsformål i et format, der er kompatibelt med det format, der anvendes i transaktionsregistre, idet CCP'er og transaktionsregistre under visse omstændigheder skal opbevare eller indberette de samme oplysninger. Anvendelsen af et fælles format på tværs af forskellige finansielle markedsinfrastrukturer gør det lettere for en lang række markedsdeltagere at gøre større brug af disse formater, hvilket fremmer en standardisering.
- (4) For at fremme en fuldautomatisk behandling og reduktion af omkostningerne for markedsdeltagerne er det vigtigt, at der i størst muligt omfang anvendes standardiserede procedurer og dataformater i alle CCP'er.

(5) Det underliggende aktiv bør identificeres ved anvendelse af en entydig identifikator, men der findes i øjeblikket ikke nogen markedsomfattende standardiserede koder til identifikation af de underliggende aktiver i en kurv. CCP'er bør derfor som minimum angive, at det underliggende aktiv er en kurv, og om muligt anvende International Securities Identification Numbers (ISIN-koder) for standardiserede indeks.

(6) Denne forordning er baseret på det udkast til gennemførelsesmæssige tekniske standarder, som Den Europæiske Værdipapir- og Markedstilsynsmyndighed (ESMA) har fremsendt til Kommissionen.

(7) I overensstemmelse med artikel 15 i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 1095/2010 af 24. november 2010 om oprettelse af en europæisk tilsynsmyndighed (Den Europæiske Værdipapir- og Markedstilsynsmyndighed) <sup>(3)</sup> har ESMA afholdt åbne offentlige høringer før forelæggelse af udkastet til reguleringsmæssige tekniske standarder, som denne forordning er baseret på, analyseret de potentielle omkostninger og fordele samt indhentet en udtalelse fra interessentgruppen for værdipapirer og markeder, der er nedsat i henhold til artikel 37 i forordning (EU) nr. 1095/2010 —

VEDTAGET DENNE FORORDNING:

## Artikel 1

## Formatet for optegnelser

1. En CCP skal for hver aftale, der behandles, opbevare de optegnelser, der er angivet i artikel 20 i den delegerede retsakt for så vidt angår reguleringsmæssige tekniske standarder vedrørende krav, som præciserer de optegnelser og oplysninger, som skal opbevares af centrale modparter (CCP'er), der er vedtaget i henhold til artikel 29, stk. 4, i forordning (EU) nr. 648/2012, i det format, der er fastsat i tabel 1 i bilaget.

2. En CCP skal for hver position opbevare de optegnelser, der er angivet i artikel 21 i den delegerede retsakt for så vidt angår reguleringsmæssige tekniske standarder vedrørende krav, som præciserer de optegnelser og oplysninger, som skal opbevares af centrale modparter (CCP'er), der er vedtaget i henhold til artikel 29, stk. 4, i forordning (EU) nr. 648/2012, i det format, der er fastsat i tabel 2 i bilaget.

<sup>(1)</sup> Endnu ikke offentliggjort i EUT.

<sup>(2)</sup> EUT L 201 af 27.7.2012, s. 1.

<sup>(3)</sup> EUT L 331 af 15.12.2010, s. 84.

3. En CCP skal for aktiviteter i forbindelse med sine forretninger og sin interne organisation opbevare de optegnelser, der er angivet i artikel 22 i den delegerede retsakt for så vidt angår reguleringsmæssige tekniske standarder vedrørende krav, som præciserer de optegnelser og oplysninger, som skal opbevares af centrale modparter (CCP'er), der er vedtaget i henhold til artikel 29, stk. 4, i forordning (EU) nr. 648/2012, i det format, der er fastsat i tabel 3 i bilaget.

4. En CCP skal forelægge optegnelserne og oplysningerne i stk. 1, 2 og 3 for den kompetente myndighed i et format, der

tillader direkte data feed mellem CCP'en og den kompetente myndighed. En CCP etablerer denne data feed senest seks måneder efter den kompetente myndigheds anmodning.

#### Artikel 2

#### **Ikrafttræden**

Denne forordning træder i kraft på tyvendedagen efter offentliggørelsen i *Den Europæiske Unions Tidende*.

Denne forordning er bindende i alle enkeltheder og gælder umiddelbart i hver medlemsstat.

Udfærdiget i Bruxelles, den 19. december 2012.

På Kommissionens vegne

José Manuel BARROSO

Formand

---

## BILAG

## Tabeller med optegnelser og oplysninger, der skal opbevares, jf. artikel 1

Tabel 1

## Optegnelser over behandlede transaktioner

	Felt	Format	Beskrivelse
1	Tidsstempel for indberetningen	ISO 8601-datoformat/UTC-klokkeslætsformat.	Dato og klokkeslæt for indberetningen.
2	Pris/kurs	Op til 20 numeriske tegn i formatet xxxx.yyyyy.	Pris pr. værdipapir eller derivataftale eksklusive provision og (hvis relevant) påløbne renter. Når der er tale om et gældsinstrument, kan prisen enten udtrykkes i en valuta eller som en procentsats.
2a	Prisnotering	F.eks. ISO 4217-valutakode, bogstavkode bestående af 3 tegn, procent.	Den måde, hvorpå prisen er angivet.
3	Notionel valuta	ISO 4217-valutakode, bogstavkode bestående af 3 tegn.	Den valuta, i hvilken prisen er angivet. Hvis prisen er udtrykt som en procentsats, skal den procentsats også angives, når der er tale om en obligation eller en anden form for gældsinstrument.
3a	Leveringsvaluta	ISO 4217-valutakode, bogstavkode bestående af 3 tegn.	Den valuta, der skal leveres i.
4	Mængde	Op til 10 numeriske tegn.	Antallet af andele i de finansielle instrumenter, obligationers nominelle værdi eller antallet af derivataftaler, der indgår i transaktionen.
5	Kvantitetsnotering	Op til 10 numeriske tegn.	En angivelse af, om kvantiteten er antallet af andele i finansielle instrumenter, obligationers nominelle værdi eller antallet af derivataftaler.
6	CCP-side	B = køber, S = sælger.	
7	Produkt-id	Foreløbig taksonomi i overensstemmelse med oplysningerne i artikel 4 i forordning (EU) nr. xx/2012 [udkast til gennemførelsesmæssige tekniske standarder for formatet for og hyppigheden af handelsindberetninger til transaktionsregistre], ISIN eller en entydig produktidentifikator (UPI).	Aftalen identificeres ved hjælp af en produktidentifikator, hvis en sådan foreligger.
8	Id for clearingmedlem	Identifikator for juridiske enheder (20 alfanumeriske tegn), foreløbig identifikator for enheder (20 alfanumeriske tegn), BIC (11 alfanumeriske tegn) eller kundekode (50 alfanumeriske tegn).	Hvis den indberettende modpart ikke er et clearingmedlem, skal der anføres en entydig identifikationskode for dennes clearingmedlem i dette felt. Hvis der er tale om en fysisk person, anvendes den kundekode, der er tildelt af CCP'en.

	Felt	Format	Beskrivelse
9	Id for berettiget modtager	<i>Identifikator for juridiske enheder (20 alfanumeriske tegn), foreløbig identifikator for enheder (20 alfanumeriske tegn), BIC (11 alfanumeriske tegn) eller kundekode (50 alfanumeriske tegn).</i>	Hvis den berettigede modtager for aftalen ikke er en modpart i aftalen, skal den berettigede modtager identificeres ved en entydig identifikationskode eller, hvis der er tale om fysiske personer, den kundekode, der er tildelt af den juridiske person, som den fysiske person anvender.
10	Part, som har overført aftalen (ved "give-up")	<i>Identifikator for juridiske enheder (20 alfanumeriske tegn), foreløbig identifikator for enheder (20 alfanumeriske tegn), BIC (11 alfanumeriske tegn) eller kundekode (50 alfanumeriske tegn).</i>	
11	Handelssted	<i>ISO 10383-markedsidentifikatorkode (MIC) hvis relevant, XOFF for børsnote-rede derivater, der handles uden for børsen, eller XXXX for OTC-derivater</i>	Angivelse af det sted, hvor transaktionen blev udført. Hvis der er tale om en OTC-aftale, skal det anføres, hvorvidt det pågældende instrument er optaget til handel, men handles OTC, eller ikke er optaget til handel og handles OTC.
12	Dato for mellemkomst	<i>ISO 8601-datoformat</i>	Den dag, hvor CCP'ens mellemkomst i aftalen fandt sted.
13	Klokkeslæt for mellemkomsten	<i>UTC-klokkeslætsformat</i>	Det tidspunkt, hvor CCP'ens mellemkomst i aftalen fandt sted. Det skal angives i lokal tid for den kompetente myndighed, hvortil transaktionen vil blive indberettet, samt det grundlag, hvorpå transaktionen blev indberettet, udtrykt i koordineret verdenstid (UTC) +/- timer.
14	Dato for aftalens udløb	<i>ISO 8601-datoformat</i>	Den dag, hvor aftalen udløb.
15	Klokkeslæt for aftalens udløb	<i>UTC-klokkeslætsformat</i>	Det tidspunkt, hvor aftalen udløb. Det skal angives i lokal tid for den kompetente myndighed, hvortil transaktionen vil blive indberettet, samt det grundlag, hvorpå transaktionen blev rapporteret, udtrykt i koordineret verdenstid (UTC) +/- timer.
16	Leveringstype	<i>C = kontant, P = fysisk, O = fakultativt for modpart.</i>	Angiver, hvorvidt aftalen afvikles fysisk eller kontant.
17	Afviklingsdato	<i>ISO 8601-datoformat</i>	Den dag, hvor afviklingen eller dækningskøbet for aftalen foretages. Hvis der er mere end en afviklingsdato, kan der tilføjes yderligere felter.
18	Klokkeslæt for afvikling eller dækningskøb for aftalen	<i>UTC-klokkeslætsformat</i>	Det tidspunkt, hvor afviklingen eller dækningskøbet for aftalen foretages. Det skal angives i lokal tid for den kompetente myndighed, hvortil transaktionen vil blive indberettet, samt det grundlag, hvorpå transaktionen indberettes, udtrykt i koordineret verdenstid (UTC) +/- timer.

	Felt	Format	Beskrivelse
Oplysninger om de clearede aftalers oprindelige vilkår. Skal indgives i det omfang, de finder anvendelse.			
19	Dato	ISO 8601-datoformat.	Den dag, hvor aftalen oprindeligt blev indgået.
20	Klokkeslæt	UTC-klokkeslætsformat	Det tidspunkt, hvor aftalen oprindeligt blev indgået. Det skal angives i lokal tid for den kompetente myndighed, hvortil transaktionen vil blive indberettet, samt det grundlag, hvorpå transaktionen blev rapporteret, udtrykt i koordineret verdenstid (UTC) +/- timer.
21	Produkt-id	Foreløbig taksonomi i overensstemmelse med oplysningerne i artikel 4 i forordning (EU) nr. xx/2012 [udkast til gennemførelsesmæssige tekniske standarder for formatet for og hyppigheden af handelsindberetninger til transaktionsregistre], ISIN eller en entydig produktidentifikator (UPI).	Aftalen angives ved hjælp af en entydig produktidentifikator, hvis en sådan foreligger.
22	Underliggende aktiv	En entydig produktidentifikator, ISIN (12 alfanumeriske tegn og CFI (6 alfanumeriske tegn). Identifikator for juridiske enheder (20 alfanumeriske tegn), foreløbig identifikator for enheder (20 alfanumeriske tegn), B= Kurv eller I=Indeks.	Instrumentidentificering for det værdipapir, der er det underliggende aktiv i en derivataftale, og for omsættelige værdipapirer, der er omfattet af artikel 4, stk. 1, nr. 18), litra c), i direktiv 2004/39/EF.
23	Derivattype (hvis der er tale om en derivataftale)	Den harmoniserede beskrivelse af derivattypen skal ske i henhold til en af topkategorierne i en ensartet, internationalt anerkendt standard for klassificering af finansielle instrumenter.	
24	Indførelse af instrumentet i ESMA-registret over aftaler, der er omfattet af clearingforpligtelsen (hvis der er tale om en derivataftale)	Y = ja/N = nej.	
Andre oplysninger, der skal forelægges i det omfang, de finder anvendelse			
25	Angivelse af den interoperable CCP, der har clearet et ben af transaktionen.	Identifikator for juridiske enheder (20 alfanumeriske tegn), foreløbig identifikator for enheder (20 alfanumeriske tegn), BIC (11 alfanumeriske tegn) eller kundekode (50 alfanumeriske tegn).	

Tabel 2

**Positionsoptegnelser**

	Felt	Format
1	Id for clearingmedlem	Identifikator for juridiske enheder, foreløbig identifikator for enheder eller BIC
2	Id for berettiget modtager	Identifikator for juridiske enheder, foreløbig identifikator for enheder, BIC eller kundekode
3	Interoperabel CCP, der opretholder positionen	Identifikator for juridiske enheder, foreløbig identifikator for enheder, BIC eller kundekode
4	Positionens fortegn	B = køber/S = sælger
5	Positionens værdi	Op til 10 numeriske tegn (xxxx,yy).
6	Prisen, som aftalerne er værdiansat til	Op til 10 numeriske tegn (xxxx,yy).
7	Valuta	ISO-valutakode.
8	Andre relevante oplysninger	Fri tekst
9	Størrelsen af de marginer, som opkræves af CCP'en	Op til 10 numeriske tegn (xxxx,yy).
10	Størrelsen af de bidrag til misligholdelsesfonde, som opkræves af CCP'en	Op til 10 numeriske tegn (xxxx,yy).
11	Størrelsen af andre finansielle ressourcer, som opkræves af CCP'en	Op til 10 numeriske tegn (xxxx,yy).
12A	Størrelsen af de marginer, som indbetales af clearingmedlemmet i forbindelse med kundekonto A	Op til 10 numeriske tegn (xxxx,yy).
13A	Størrelsen af de bidrag til misligholdelsesfonde, som indbetales af clearingmedlemmet i forbindelse med kundekonto A	Op til 10 numeriske tegn (xxxx,yy).
14A	Størrelsen af andre finansielle ressourcer, som indbetales af clearingmedlemmet i forbindelse med kundekonto A	Op til 10 numeriske tegn (xxxx,yy).
15B	Størrelsen af de marginer, som indbetales af clearingmedlemmet i forbindelse med kundekonto B	Op til 10 numeriske tegn (xxxx,yy).
16B	Størrelsen af de bidrag til misligholdelsesfonde, som indbetales af clearingmedlemmet i forbindelse med kundekonto B	Op til 10 numeriske tegn (xxxx,yy).
17B	Størrelsen af andre finansielle ressourcer, som indbetales af clearingmedlemmet i forbindelse med kundekonto B	Op til 10 numeriske tegn (xxxx,yy).

Tabel 3  
Forretningspapirer

	Felt	Format	Beskrivelse
1	Organisationsdiagrammer	<i>Fri tekst</i>	Bestyrelse og relevante udvalg, clearingenhed, risikostyringsenhed og alle andre relevante enheder eller afdelinger.

Kapitalejere eller medlemmer med en kvalificeret andel (felter, der skal tilføjes for hver af de relevante kapitalejere/medlemmer)

2	Type	<i>S=kapitalejer/M=medlem.</i>	
3	Type kvalificeret andel	<i>D=direkte/I=indirekte.</i>	
4	Type enhed	<i>N=fysisk person/L=juridisk person.</i>	
5	Den kvalificerede andels størrelse	<i>Op til 10 numeriske tegn (xxxx,yyyyy).</i>	

Andre dokumenter

6	Regler, procedurer, processer i henhold til organisatoriske krav	<i>Dokumenter</i>	
7	Referater af bestyrelsesmøder, møder i underudvalg (hvis relevant) og møder i udvalg under den øverste ledelse (hvis relevant)	<i>Dokumenter</i>	
8	Referater af risikoudvalgets møder	<i>Dokumenter</i>	
9	Eventuelle referater fra høringsgruppen med clearingmedlemmer og kunder	<i>Dokumenter</i>	
10	Interne og eksterne revisionsrapporter, risikostyringsrapporter, compliance-rapporter og konsulentrapporter	<i>Dokumenter</i>	
11	Forretningskontinuitetspolitik og katastrofeberedskabsplan	<i>Dokumenter</i>	
12	Likviditetsplan og daglige likviditetsrapporter	<i>Dokumenter</i>	
13	Dokumenter, der viser alle aktiver og passiver og kapitalkonti	<i>Dokumenter</i>	

	Felt	Format	Beskrivelse
14	Indkomne klager	<i>Fri tekst</i>	For hver klage: oplysninger om klagers navn, adresse og kontonummer, dato for modtagelse af klagen, navne på alle personer, der nævnes i klagen, beskrivelse af klagens art, afgørelse af klagen, dato for færdigbehandling af klagen.
15	Oplysninger om afbrydelse af tjenester eller funktionsforstyrrelser	<i>Fri tekst</i>	Oplysninger om eventuelle afbrydelser af tjenester eller funktionsforstyrrelser, herunder en detaljeret rapport om tidspunkter, følger og afhjælpende foranstaltninger.
16	Resultater af de udførte stresstest og backtest	<i>Fri tekst</i>	
17	Skriftlig kommunikation med kompetente myndigheder, ESMA og de relevante medlemmer af ESCB	<i>Dokumenter</i>	
18	Indkomne udtalelser i forbindelse med juridisk rådgivning i overensstemmelse med de organisatoriske krav	<i>Dokumenter</i>	
19	Interoperabilitetsordninger med andre CCP'er (hvis relevant)	<i>Dokumenter</i>	
20	Liste over alle clearingmedlemmer (artikel 17 i forordning (EU) nr. XXX/2012)	<i>Fri tekst/dokumenter</i>	Liste i overensstemmelse med artikel 17 i forordning (EU) nr. XXX/2012
21	Oplysninger i henhold til artikel 17 i forordning (EU) nr. XXX/2012	<i>Fri tekst/dokumenter</i>	Love og bestemmelser vedrørende i) adgangen til CCP'en, ii) de aftaler, som CCP'en har indgået med clearingmedlemmer og, hvis det er praktisk muligt, kunder, iii) de aftaler, som CCP'en accepterer til clearing, iv) eventuelle interoperabilitetsordninger, v) anvendelse af sikkerhedsstillelse og bidrag til misligholdelsesfonde, herunder ophævelse af positioner og sikkerhedsstillelse, samt i hvilket omfang sikkerhedsstillelsen er beskyttet mod krav fra tredjemand (adskillelsesniveau).
22	Udvikling af nye forretningsinitiativer	<i>Fri tekst</i>	Ved levering af nye tjenester.