

ΚΑΤ' ΕΞΟΥΣΙΟΔΟΤΗΣΗ ΚΑΝΟΝΙΣΜΟΣ (ΕΕ) 2019/358 ΤΗΣ ΕΠΙΤΡΟΠΗΣ**της 13ης Δεκεμβρίου 2018****για τη συμπλήρωση του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου όσον αφορά τα ρυθμιστικά τεχνικά πρότυπα για τη συλλογή, επαλήθευση, συγκέντρωση, σύγκριση και δημοσίευση δεδομένων για συναλλαγές χρηματοδότησης τίτλων (ΣΧΤ) από αρχεία καταγραφής συναλλαγών****(Κείμενο που παρουσιάζει ενδιαφέρον για τον ΕΟΧ)**

Η ΕΥΡΩΠΑΪΚΗ ΕΠΙΤΡΟΠΗ,

Έχοντας υπόψη τη Συνθήκη για τη λειτουργία της Ευρωπαϊκής Ένωσης,

Έχοντας υπόψη τον κανονισμό (ΕΕ) 2015/2365 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 25ης Νοεμβρίου 2015, περί διαφάνειας των συναλλαγών χρηματοδότησης τίτλων και επαναχρησιμοποίησης, και περί τροποποίησης του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012 ⁽¹⁾, και ιδίως το άρθρο 5 παράγραφος 7 στοιχεία α) και το άρθρο 12 παράγραφος 3 στοιχεία α) και β),

Εκτιμώντας τα ακόλουθα:

- (1) Για να διασφαλιστεί η υψηλή ποιότητα των λεπτομερών στοιχείων των ΣΧΤ που γνωστοποιούνται σε αρχεία καταγραφής συναλλαγών, τα αρχεία καταγραφής συναλλαγών θα πρέπει να επαληθεύουν την ταυτότητα των οντοτήτων που υποβάλλουν την αναφορά, τη λογική συνοχή της σειράς με την οποία υποβάλλονται τα λεπτομερή στοιχεία των ΣΧΤ, και την πληρότητα και ορθότητα των εν λόγω λεπτομερών στοιχείων των ΣΧΤ.
- (2) Για τον ίδιο λόγο, τα αρχεία καταγραφής συναλλαγών θα πρέπει να συμφωνούν τα λεπτομερή στοιχεία κάθε αναφοράς ΣΧΤ που λαμβάνουν. Θα πρέπει να καθοριστεί μια τυποποιημένη διαδικασία που θα επιτρέπει στα αρχεία καταγραφής συναλλαγών να διενεργούν τη συμφωνία με συνεπή τρόπο και να περιορίζουν τον κίνδυνο να μην συμφωνούνται τα λεπτομερή στοιχεία των ΣΧΤ. Ωστόσο, κάποια λεπτομερή στοιχεία των ΣΧΤ ενδέχεται να μην είναι ταυτόσημα λόγω ιδιαιτεροτήτων των τεχνολογικών συστημάτων που χρησιμοποιούν οι οντότητες που υποβάλλουν την αναφορά. Θα πρέπει επομένως να προβλέπονται κάποιες ανοχές, ώστε τυχόν δευτερεύουσες διαφορές στα λεπτομερή στοιχεία των ΣΧΤ που υποβάλλονται να μην αποτρέπουν την ανάλυση των δεδομένων από τις αρχές κατά τρόπο που εξασφαλίζει ικανοποιητικό επίπεδο αξιοπιστίας.
- (3) Θεωρείται αναμενόμενο ότι οι οντότητες που υποβάλλουν την αναφορά θα βελτιώσουν με την πάροδο του χρόνου τη διαδικασία γνωστοποίησης, τόσο από την άποψη της μείωσης του αριθμού των αναφορών που δεν γίνονται δεκτές όσο και από την άποψη των αναφορών που συμφωνούνται. Θα πρέπει, ωστόσο, να τους δοθεί επαρκής χρόνος να προσαρμοστούν στις απαιτήσεις γνωστοποίησης, ιδίως προκειμένου να αποτραπεί η συσσώρευση μη συμφωνημένων συναλλαγών αμέσως μετά την έναρξη ισχύος της υποχρέωσης γνωστοποίησης. Επομένως είναι σκόπιμο σε πρώτη φάση να συμφωνείται περιορισμένο σύνολο πεδίων.
- (4) Οι οντότητες που υποβάλλουν την αναφορά και οι οντότητες που είναι υπεύθυνες για τη γνωστοποίηση, εφόσον συντρέχει περίπτωση, θα πρέπει να είναι σε θέση να παρακολουθούν τη συμμόρφωσή τους με την υποχρέωση γνωστοποίησης που υπέχουν βάσει του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365. Θα πρέπει επομένως να είναι σε θέση να έχουν πρόσβαση σε συγκεκριμένες πληροφορίες, σε καθημερινή βάση, σε σχέση με τις εν λόγω αναφορές, όπως μεταξύ άλλων το αποτέλεσμα της επαλήθευσης των εν λόγω αναφορών, καθώς και η εξέλιξη της διαδικασίας συμφωνημένων συναλλαγών αναφερόμενων δεδομένων. Είναι επομένως αναγκαίο να διευκρινιστούν οι πληροφορίες τις οποίες ένα αρχείο καταγραφής συναλλαγών θα πρέπει να κοινοποιεί στις εν λόγω οντότητες στο τέλος κάθε εργάσιμης ημέρας.
- (5) Για να διευκολυνθεί η αξιοπιστία των λεπτομερών στοιχείων των ΣΧΤ, η άμεση και ταχεία πρόσβαση που αναφέρεται στο άρθρο 12 παράγραφος 2 του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 θα πρέπει να παρέχεται κατά εναρμονισμένο και συνεπή τρόπο. Για να τυποποιηθεί η διαδικασία γνωστοποίησης, να ελαχιστοποιηθεί το κόστος για τον κλάδο και να διασφαλιστεί η συγκρισιμότητα και η συνεπής συγκέντρωση των δεδομένων από όλα τα αρχεία καταγραφής συναλλαγών, είναι σκόπιμο για την επίδοση του συνόλου των αναφορών και ανταλλαγών των αποτελεσμάτων να χρησιμοποιούνται υποδείγματα σε μορφότυπο XML και να ακολουθείται μεθοδολογία που χρησιμοποιείται ευρέως στον χρηματοπιστωτικό κλάδο.
- (6) Η πρόσβαση σε δεδομένα σε επίπεδο θέσης που αφορούν τα ανοίγματα μεταξύ δύο δεδομένων αντισυμβαλλομένων είναι απαραίτητη ώστε οι οντότητες που αναφέρονται στο άρθρο 12 παράγραφος 2 του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 να είναι σε θέση να εντοπίζουν δυνητικές πηγές συστημικών και μη κινδύνων για τη χρηματοπιστωτική σταθερότητα.
- (7) Για να εξασφαλιστεί ικανοποιητικό επίπεδο δημόσιας διαφάνειας όσον αφορά τις ΣΧΤ, τα κριτήρια που χρησιμοποιούνται για τη συγκέντρωση των θέσεων θα πρέπει να παρέχουν στο ευρύ κοινό τη δυνατότητα να κατανοεί τη λειτουργία των

⁽¹⁾ ΕΕ L 337 της 23.12.2015, σ. 1.

αγορών ΣΧΤ, χωρίς να υπονομεύεται ο εμπιστευτικός χαρακτήρας των δεδομένων που γνωστοποιούνται στα αρχεία καταγραφής συναλλαγών. Η συχνότητα και τα λεπτομερή στοιχεία της δημοσίευσης των συνολικών θέσεων από τα αρχεία καταγραφής συναλλαγών σύμφωνα με το άρθρο 12 παράγραφος 1 του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 θα πρέπει να διευκρινιστούν κατά τρόπο που να αξιοποιεί το σχετικό πλαίσιο που θεσπίστηκε με τον κανονισμό (ΕΕ) αριθ. 648/2012 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου ⁽²⁾ για τις συμβάσεις παραγώγων.

- (8) Ο παρών κανονισμός βασίζεται στα σχέδια κανονιστικών τεχνικών προτύπων που υπέβαλε η Ευρωπαϊκή Αρχή Κινητών Αξιών και Αγορών (ESMA) στην Επιτροπή προς έγκριση από την Επιτροπή, σύμφωνα με τη διαδικασία του άρθρου 10 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 1095/2010 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου ⁽³⁾.
- (9) Οι διατάξεις του παρόντος κανονισμού αφορούν λειτουργικά πρότυπα για τη συλλογή, συγκέντρωση και σύγκριση δεδομένων από τα αρχεία καταγραφής συναλλαγών, καθώς και διαδικασίες που πρέπει να εφαρμόζουν τα αρχεία καταγραφής συναλλαγών προκειμένου να εξακριβώνονται η πληρότητα και η ορθότητα των λεπτομερών στοιχείων που τους υποβάλλονται. Για να διασφαλιστεί η συνοχή μεταξύ αυτών των διατάξεων και να διευκολυνθεί η συνολική θεώρηση των αρχείων καταγραφής συναλλαγών, είναι επιθυμητό να συμπεριληφθούν τα σχετικά ρυθμιστικά τεχνικά πρότυπα σε έναν ενιαίο κανονισμό.
- (10) Η ESMA πραγματοποίησε επίσης ανοιχτές δημόσιες διαβουλεύσεις για τα εν σχέδια ρυθμιστικών τεχνικών προτύπων, ανέλυσε τα δυνητικά συναφή κόστη και οφέλη και ζήτησε τη γνώμη της Ομάδας Συμφεροντούχων Κινητών Αξιών και Αγορών της ESMA που συστάθηκε σύμφωνα με το άρθρο 37 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 1095/2010,

ΕΞΕΔΩΣΕ ΤΟΝ ΠΑΡΟΝΤΑ ΚΑΝΟΝΙΣΜΟ:

Άρθρο 1

Επαλήθευση αναφορών ΣΧΤ από τα αρχεία καταγραφής συναλλαγών

1. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών εξακριβώνει όλα τα παρακάτω σε σχέση σε μια ληφθείσα αναφορά ΣΧΤ:
- α) την ταυτότητα της οντότητας που υποβάλλει την αναφορά, όπως αναφέρεται στο πεδίο 2 του πίνακα 1 του παραρτήματος Ι του εκτελεστικού κανονισμού (ΕΕ) 2019/363 της Επιτροπής ⁽⁴⁾.
- β) ότι το υπόδειγμα XML που χρησιμοποιείται για τη γνωστοποίηση μιας ΣΧΤ συμμορφώνεται με τη μεθοδολογία ISO 20022 σύμφωνα με τον εκτελεστικό κανονισμό (ΕΕ) 2019/363.
- γ) ότι η οντότητα που υποβάλλει την αναφορά, εφόσον διαφέρει από τον αντισυμβαλλόμενο που υπόκειται στην υποχρέωση γνωστοποίησης, όπως αναφέρεται στο πεδίο 3 του πίνακα 1 του παραρτήματος Ι του εκτελεστικού κανονισμού (ΕΕ) 2019/363, είναι δόντως εξουσιοδοτημένη να προβάλει στη γνωστοποίηση για λογαριασμό του αντισυμβαλλόμενου που υπόκειται στην υποχρέωση γνωστοποίησης, με την εξαίρεση της περίπτωσης που προβλέπεται στο άρθρο 4 παράγραφος 3 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 2015/2365.
- δ) ότι δεν έχει υποβληθεί ξανά στο παρελθόν η ίδια αναφορά ΣΧΤ.
- ε) ότι αναφορά με τύπο ενέργειας «Modification» («τροποποίηση») σχετίζεται με ήδη υποβληθείσα αναφορά ΣΧΤ.
- στ) ότι αναφορά ΣΧΤ με τύπο ενέργειας «Modification» («τροποποίηση») δεν σχετίζεται με ΣΧΤ που έχει γνωστοποιηθεί ως ακυρωθείσα.
- ζ) ότι η αναφορά ΣΧΤ δεν περιλαμβάνει τον τύπο ενέργειας «New» («νέο») εφόσον πρόκειται για ΣΧΤ που έχει ήδη γνωστοποιηθεί.
- η) ότι η αναφορά ΣΧΤ δεν περιλαμβάνει τον τύπο ενέργειας «Position component» («στοιχείο θέσεων») εφόσον πρόκειται για ΣΧΤ που έχει ήδη γνωστοποιηθεί.

⁽²⁾ Κανονισμός (ΕΕ) αριθ. 648/2012 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 4ης Ιουλίου 2012, για τα εξωχρηματιστηριακά παράγωγα, τους κεντρικούς αντισυμβαλλομένους και τα αρχεία καταγραφής συναλλαγών (ΕΕ L 201 της 27.7.2012, σ. 1).

⁽³⁾ Κανονισμός (ΕΕ) αριθ. 1095/2010 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 24ης Νοεμβρίου 2010, σχετικά με τη σύσταση Ευρωπαϊκής Εποπτικής Αρχής (Ευρωπαϊκή Αρχή Κινητών Αξιών και Αγορών), την τροποποίηση της απόφασης αριθ. 716/2009/ΕΚ και την κατάργηση της απόφασης 2009/77/ΕΚ (ΕΕ L 331 της 15.12.2010, σ. 84).

⁽⁴⁾ Εκτελεστικός κανονισμός (ΕΕ) 2019/363 της Επιτροπής, της 13ης Δεκεμβρίου 2018, για τη θέπιση εκτελεστικών τεχνικών προτύπων όσον αφορά τον μορφότυπο και τη συχνότητα των αναφορών για τα λεπτομερή στοιχεία των συναλλαγών χρηματοδότησης τίτλων (ΣΧΤ) σε αρχεία καταγραφής συναλλαγών, σύμφωνα με τον κανονισμό (ΕΕ) 2015/2365 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, και για την τροποποίηση του εκτελεστικού κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 1247/2012 της Επιτροπής όσον αφορά τη χρήση κωδικών αναφοράς για την αναφορά συμβάσεων παραγώγων (βλέπε σ. 85 της παρούσας Επίσημης Εφημερίδας).

- θ) ότι η αναφορά ΣΧΤ δεν αποσκοπεί στην τροποποίηση των στοιχείων της οντότητας που υποβάλλει την αναφορά, του αντισυμβαλλόμενου που υπόκειται στην υποχρέωση γνωστοποίησης ή του άλλου αντισυμβαλλόμενου σε ΣΧΤ που έχει γνωστοποιηθεί προγενέστερα·
- ι) ότι η αναφορά ΣΧΤ δεν αποσκοπεί στην τροποποίηση υφιστάμενης αναφοράς ΣΧΤ μέσω του προσδιορισμού ημερομηνίας αξίας που είναι μεταγενέστερη της αναφερόμενης ημερομηνίας λήξης της ΣΧΤ·
- ια) την ορθότητα και την πληρότητα της αναφοράς ΣΧΤ.
2. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών εξακριβώνει εάν έχουν καταχωριστεί πληροφορίες σχετικά με τις ασφάλειες στα πεδία 73 έως 96 του πίνακα 2 του παραρτήματος I του εκτελεστικού κανονισμού (ΕΕ) 2019/363 στις περιπτώσεις ΣΧΤ όπου στο πεδίο 72 «Uncollateralised SL flag» («προειδοποίηση πράξης δανεισμού τίτλων χωρίς παροχή ασφάλειας») του εν λόγω πίνακα έχει επιλεγεί τιμή «false» («ψευδές»). Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών γνωστοποιεί, σύμφωνα με το άρθρο 3 του παρόντος κανονισμού, το αποτέλεσμα της επαλήθευσης στην οντότητα που υποβάλλει την αναφορά και στον αντισυμβαλλόμενο που υπόκειται στην υποχρέωση γνωστοποίησης, καθώς και στην οντότητα που είναι υπεύθυνη για τη γνωστοποίηση, εφόσον συντρέχει περίπτωση.
3. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών δεν κάνει δεκτή αναφορά ΣΧΤ η οποία δεν συμμορφώνεται με μία από τις απαιτήσεις που ορίζονται στην παράγραφο 1 και της εκχωρεί μία από τις κατηγορίες अपараδέκτου που παρατίθενται στον πίνακα 2 του παραρτήματος I του παρόντος κανονισμού.
4. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών κοινοποιεί στην οντότητα που υποβάλλει την αναφορά και στον αντισυμβαλλόμενο που υπόκειται στην υποχρέωση γνωστοποίησης, καθώς και στην οντότητα που είναι υπεύθυνη για τη γνωστοποίηση, εφόσον συντρέχει περίπτωση, λεπτομερείς πληροφορίες σχετικά με τα αποτελέσματα της επαλήθευσης των δεδομένων κατά τα αναφερόμενα στην παράγραφο 1 εντός εξήντα λεπτών από τη λήψη της αναφοράς ΣΧΤ. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών κοινοποιεί τα εν λόγω αποτελέσματα χρησιμοποιώντας μορφότυπο XML και υπόδειγμα σχεδιασμένο σύμφωνα με τη μεθοδολογία ISO 20022. Τα αποτελέσματα περιλαμβάνουν, κατά περίπτωση, τους συγκεκριμένους λόγους για τους οποίους δεν γίνεται δεκτή η αναφορά ΣΧΤ σύμφωνα με την παράγραφο 3.

Άρθρο 2

Πραγματοποίηση συμφωνίας δεδομένων από αρχεία καταγραφής συναλλαγών

1. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών επιχειρεί να συμφωνήσει τα δεδομένα της αναφερόμενης ΣΧΤ προβαίνοντας στις ενέργειες που περιγράφονται στην παράγραφο 2, εφόσον πληρούνται οι εξής προϋποθέσεις στο σύνολό τους::
- α) το αρχείο καταγραφής συναλλαγών έχει ολοκληρώσει τις επαληθεύσεις που ορίζονται στις παραγράφους 1 και 2 του άρθρου 1·
- β) αμφότεροι οι αντισυμβαλλόμενοι στην αναφερόμενη ΣΧΤ φέρουν υποχρέωση γνωστοποίησης·
- γ) το αρχείο καταγραφής συναλλαγών δεν έχει λάβει μεταγενέστερη αναφορά με τύπο ενέργειας «Error» («σφάλμα») σε σχέση με την αναφερόμενη ΣΧΤ.
2. Εφόσον πληρούνται όλες οι προϋποθέσεις της παραγράφου 1, το αρχείο καταγραφής συναλλαγών προβαίνει στις ακόλουθες ενέργειες, χρησιμοποιώντας την πλέον πρόσφατα αναφερθείσα τιμή για κάθε ένα από τα πεδία του πίνακα 1 του παραρτήματος I του παρόντος κανονισμού:
- α) το αρχείο καταγραφής συναλλαγών που λαμβάνει αναφορά ΣΧΤ εξακριβώνει εάν έχει λάβει αντίστοιχη αναφορά ΣΧΤ από τον άλλο αντισυμβαλλόμενο ή για λογαριασμό του·
- β) το αρχείο καταγραφής συναλλαγών που δεν έχει λάβει αντίστοιχη αναφορά ΣΧΤ κατά τα αναφερόμενα στο σημείο α) επιχειρεί να εντοπίσει το αρχείο καταγραφής συναλλαγών που έχει λάβει την αντίστοιχη αναφορά ΣΧΤ κοινοποιώντας σε όλα τα καταχωρισμένα αρχεία συναλλαγών τις τιμές των ακόλουθων πεδίων των αναφερόμενων ΣΧΤ: «Unique Transaction Identifier» («μοναδικός αναγνωριστικός κωδικός συναλλαγής»), «Reporting counterparty» («αντισυμβαλλόμενος που υπόκειται στην υποχρέωση γνωστοποίησης»), «Other counterparty» («άλλος αντισυμβαλλόμενος») και «Master agreement type» («τύπος κύριας συμφωνίας»)·
- γ) το αρχείο καταγραφής συναλλαγών που διαπιστώνει ότι κάποιο άλλο αρχείο καταγραφής συναλλαγών έχει λάβει την αντίστοιχη αναφορά ΣΧΤ κατά τα αναφερόμενα στο σημείο α) ανταλλάσσει με το εν λόγω αρχείο καταγραφής συναλλαγών τα λεπτομερή στοιχεία της αναφερόμενης ΣΧΤ χρησιμοποιώντας μορφότυπο XML και υπόδειγμα σχεδιασμένο σύμφωνα με τη μεθοδολογία ISO 20022·
- δ) με την επιφύλαξη του σημείου ε), το αρχείο καταγραφής συναλλαγών θεωρεί ότι τα δεδομένα της αναφερόμενης ΣΧΤ έχουν συμφωνηθεί όταν τα λεπτομερή στοιχεία της εν λόγω ΣΧΤ αντιστοιχούν με τα λεπτομερή στοιχεία της αντίστοιχης αναφοράς ΣΧΤ κατά τα αναφερόμενα στο σημείο α) της παρούσας παραγράφου·
- ε) το αρχείο καταγραφής συναλλαγών προβαίνει σε χωριστή αντιστοίχιση των πεδίων που αφορούν τα δεδομένα του δανεισμού και των πεδίων που αφορούν τα δεδομένα της ασφάλειας της αναφερόμενης ΣΧΤ σύμφωνα με τα όρια ανοχής και τις σχετικές ημερομηνίες εφαρμογής που ορίζονται στον πίνακα 1 του παραρτήματος I του παρόντος κανονισμού·

- στ) το αρχείο καταγραφής συναλλαγών εν συνεχεία εκχωρεί τιμές για τις κατηγορίες συμφωνίας δεδομένων για κάθε αναφερόμενη ΣΧΤ, όπως ορίζονται στον πίνακα 3 του παραρτήματος Ι του παρόντος κανονισμού·
- ζ) το αρχείο καταγραφής συναλλαγών πραγματοποιεί τις ενέργειες των σημείων α) έως στ) της παρούσας παραγράφου το συντομότερο δυνατό, και δεν προβαίνει σε καμία τέτοια ενέργεια μετά τις 18:00 (διεθνή ώρα UTC) μιας δεδομένης εργάσιμης ημέρας·
- η) αρχείο καταγραφής συναλλαγών που δεν δύναται να συμφωνήσει τα δεδομένα μιας αναφερόμενης ΣΧΤ επιχειρεί να προβεί σε αντιστοίχιση των λεπτομερών στοιχείων της εν λόγω αναφερόμενης ΣΧΤ την επόμενη εργάσιμη ημέρα. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών παύει να επιχειρεί να συμφωνήσει τα δεδομένα μιας αναφερόμενης ΣΧΤ τριάντα ημερολογιακές ημέρες μετά την αναφερόμενη ληκτότητα της ΣΧΤ ή μετά τη λήψη από το αρχείο καταγραφής συναλλαγών σχετικής με αυτή αναφοράς με τύπο ενέργειας «Termination» («καταγγελία») ή «Position component» («στοιχείο θέσεων»).
3. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών διασταυρώνει στο τέλος κάθε εργάσιμης ημέρας τον συνολικό αριθμό των αναφερόμενων ΣΧΤ τα δεδομένα των οποίων έχουν συμφωνηθεί, με κάθε αρχείο καταγραφής με το οποίο έχει συμφωνήσει τα δεδομένα αναφερόμενων ΣΧΤ.
4. Το αργότερο εντός εξήντα λεπτών μετά την ολοκλήρωση της διαδικασίας της συμφωνίας δεδομένων κατά τα αναφερόμενα στο σημείο ζ) της παραγράφου 2, το αρχείο καταγραφής συναλλαγών κοινοποιεί στην οντότητα που υποβάλλει την αναφορά και στον αντισυμβαλλόμενο που υπόκειται στην υποχρέωση γνωστοποίησης, καθώς και στην οντότητα που είναι υπεύθυνη για τη γνωστοποίηση, εφόσον συντρέχει περίπτωση, τα αποτελέσματα της διαδικασίας της συμφωνίας δεδομένων που διενήργησε σε σχέση με τις αναφερόμενες ΣΧΤ. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών κοινοποιεί τα εν λόγω αποτελέσματα χρησιμοποιώντας μορφότυπο XML και υπόδειγμα σχεδιασμένο σύμφωνα με τη μεθοδολογία ISO 20022, συμπεριλαμβανομένων πληροφοριών σχετικά με τα πεδία για τα οποία δεν επιτεύχθηκε συμφωνία δεδομένων.

Άρθρο 3

Μηχανισμοί κοινοποιήσεων στο τέλος της ημέρας

Στο τέλος κάθε εργάσιμης ημέρας, το αρχείο καταγραφής συναλλαγών κοινοποιεί στην οντότητα που υποβάλλει την αναφορά και στον αντισυμβαλλόμενο που υπόκειται στην υποχρέωση γνωστοποίησης, καθώς και στην οντότητα που είναι υπεύθυνη για τη γνωστοποίηση, εφόσον συντρέχει περίπτωση, τις ακόλουθες πληροφορίες για τις σχετικές ΣΧΤ χρησιμοποιώντας μορφότυπο XML και υπόδειγμα σχεδιασμένο σύμφωνα με τη μεθοδολογία ISO 20022:

- α) τις ΣΧΤ που γνωστοποιήθηκαν στη διάρκεια της συγκεκριμένης ημέρας·
- β) τις πλέον πρόσφατες καταστάσεις των ΣΧΤ που δεν έχουν φτάσει στη λήξη τους ή οι οποίες δεν έχουν αποτελέσει αντικείμενο αναφοράς με τύπο ενέργειας «Error» («σφάλμα»), «Termination» («καταγγελία») ή «Position component» («στοιχείο θέσεων»)
- γ) τους μοναδικούς αναγνωριστικούς κωδικούς συναλλαγής των ΣΧΤ για τις οποίες στο πεδίο 72 του πίνακα 2 του παραρτήματος Ι του εκτελεστικού κανονισμού (ΕΕ) 2019/363 έχει επιλεγεί τιμή «false» («ψευδές»), και για τις οποίες δεν έχουν καταχωριστεί πληροφορίες σχετικές με τις ασφάλειες στα πεδία 73 έως 96 του ίδιου πίνακα·
- δ) τις αναφορές ΣΧΤ που δεν έχουν γίνει δεκτές στη διάρκεια της συγκεκριμένης ημέρας·
- ε) την κατάσταση του συνόλου των αναφερόμενων ΣΧΤ από την άποψη της συμφωνίας δεδομένων, εξαιρουμένων των ΣΧΤ που έχουν λήξει ή των ΣΧΤ για τις οποίες ελήφθησαν αναφορές ΣΧΤ με τύπο ενέργειας «Termination» («καταγγελία») ή «Position component» («στοιχείο θέσεων») τουλάχιστον έναν μήνα πριν από τη συγκεκριμένη ημέρα.

Άρθρο 4

Πρόσβαση σε λεπτομερή στοιχεία των ΣΧΤ

Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών παρέχει στις οντότητες που παρατίθενται στο άρθρο 12 παράγραφος 2 του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 άμεση και ταχεία πρόσβαση, μεταξύ άλλων και σε περιπτώσεις όπου υφίσταται συμφωνία ανάθεσης βάσει του άρθρου 28 του κανονισμού (ΕΕ) 1095/2010, στα λεπτομερή στοιχεία των ΣΧΤ σε ηλεκτρονική και μηχανικώς αναγνώσιμη μορφή σύμφωνα με τον κατ' εξουσιοδότηση κανονισμό (ΕΕ) 2019/357 της Επιτροπής^(*).

Για τους σκοπούς του πρώτου εδαφίου, το αρχείο καταγραφής συναλλαγών χρησιμοποιεί μορφότυπο XML και ένα υπόδειγμα σχεδιασμένο σύμφωνα με τη μεθοδολογία ISO 20022.

(*) Κατ' εξουσιοδότηση κανονισμός (ΕΕ) 2019/357 της Επιτροπής, της 13ης Δεκεμβρίου 2018, για τη συμπλήρωση του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου όσον αφορά ρυθμιστικά τεχνικά πρότυπα για την πρόσβαση σε λεπτομερή στοιχεία των συναλλαγών χρηματοδότησης τίτλων (ΣΧΤ) που τηρούνται σε αρχεία καταγραφής συναλλαγών (βλέπε σ. 22 της παρούσας Επίσημης Εφημερίδας).

Άρθρο 5

Υπολογισμός των δεδομένων σε επίπεδο θέσης και πρόσβαση σε αυτά

1. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών υπολογίζει τα δεδομένα σε επίπεδο θέσης που αφορούν τα ανοίγματα μεταξύ των αντισυμβαλλομένων από την άποψη του δανεισμού και των ασφαλειών. Ο υπολογισμός των δεδομένων σε επίπεδο θέσης βασίζεται στα ακόλουθα κριτήρια:

- α) τις τιμές των κατηγοριών συμφωνίας δεδομένων, κατά τον πίνακα 3 του παραρτήματος I του παρόντος κανονισμού·
- β) τον τύπο της ΣΧΤ·
- γ) τον τομέα στον οποίο ανήκουν οι αντισυμβαλλόμενοι·
- δ) την κατάσταση της εκκαθάρισης·
- ε) εάν η συναλλαγή πραγματοποιείται εντός ή εκτός τόπου διαπραγμάτευσης·
- στ) τον τύπο της ασφάλειας·
- ζ) το νόμισμα του χρηματικού σκέλους·
- η) το κλιμάκιο ληκτότητας·
- θ) το κλιμάκιο περικοπών·
- ι) τα αρχεία καταγραφής συναλλαγών στα οποία ο άλλος αντισυμβαλλόμενος γνωστοποίησε λεπτομερή στοιχεία της ΣΧΤ.

2. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών διασφαλίζει ότι οι οντότητες που παρατίθενται στο άρθρο 12 παράγραφος 2 του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 έχουν πρόσβαση σε δεδομένα σε επίπεδο θέσης σύμφωνα με τα οριζόμενα στον κατ' εξουσιοδότηση κανονισμό (ΕΕ) 2019/357 σχετικά με την πρόσβαση σε δεδομένα.

3. Τα δεδομένα σε επίπεδο θέσης που αναφέρονται στην παράγραφο 1 παρέχονται σε ηλεκτρονική και μηχανικώς αναγνώσιμη μορφή και με τη χρήση μορφοτύπου XML και υποδείγματος σχεδιασμένου σύμφωνα με τη μεθοδολογία ISO 20022.

4. Η πρόσβαση που αναφέρεται στην παράγραφο 2 παρέχεται το συντομότερο δυνατό και το αργότερο την επομένη της παραλαβής της αναφοράς ΣΧΤ δυνάμει του άρθρου 4 παράγραφος 1 του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365.

5. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών παρέχει στις οντότητες που αναφέρονται στο άρθρο 12 παράγραφος 2 του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 πρόσβαση σε συγκεντρωτικά δεδομένα, σύμφωνα με τα οριζόμενα στον κατ' εξουσιοδότηση κανονισμό (ΕΕ) 2019/357 σχετικά με την πρόσβαση σε δεδομένα, ο δε υπολογισμός των οποίων γίνεται σύμφωνα με από κοινού συμφωνημένα πρότυπα και διεργασίες για τη συλλογή και συγκέντρωση δεδομένων ΣΧΤ σε καθολικό επίπεδο.

Άρθρο 6

Υπολογισμός δεδομένων συνολικών θέσεων προς δημοσίευση

1. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών συγκεντρώνει τα δεδομένα θέσεων βάσει των κριτηρίων των παραγράφων 2 και 3 όσον αφορά τις ακόλουθες τιμές:

- α) την ονομαστική αξία των συμφωνιών επαναγοράς, συναλλαγών αγοράς-επαναπώλησης ή πώλησης-επαναγοράς, τη συνολική ποσότητα των τίτλων ή εμπορευμάτων που αποτέλεσαν αντικείμενο δανειοδοσίας ή δανειοληψίας και το ύψος των πράξεων δανεισμού σε λογαριασμό περιθωρίου ασφάλισης·
- β) τον αριθμό των μοναδικών αναγνωριστικών κωδικών συναλλαγής που αφορούν τις σχετικές ΣΧΤ·
- γ) την αγοραία αξία της ασφάλειας.

2. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών συγκεντρώνει δεδομένα θέσεων για το σύνολο των αναφερόμενων ΣΧΤ με τύπο ενέργειας «New» («νέο») από το Σάββατο και ώρα 00:00:00 (διεθνή ώρα UTC) έως την Παρασκευή και ώρα 23:59:59 (διεθνή ώρα UTC), στη βάση των ακόλουθων κριτηρίων και των σχετικών τιμών που παρατίθενται στον πίνακα 1 του παραρτήματος II του παρόντος κανονισμού:

- α) την τοποθεσία του αντισυμβαλλομένου που υπόκειται στην υποχρέωση γνωστοποίησης ή, κατά περίπτωση, του σχετικού υποκαταστήματος·
- β) την τοποθεσία του άλλου αντισυμβαλλομένου ή, κατά περίπτωση, του σχετικού υποκαταστήματος·
- γ) τον τύπο της ΣΧΤ·
- δ) την κατάσταση της ΣΧΤ από την άποψη της συμφωνίας δεδομένων, κατά τον πίνακα 3 του παραρτήματος I του παρόντος κανονισμού·

- ε) τον τύπο του τόπου διαπραγμάτευσης όπου συνήφθη η ΣΧΤ·
- στ) το κατά πόσο η ΣΧΤ έχει εκκαθαριστεί·
- ζ) τη μέθοδο με την οποία μεταβιβάστηκε η ασφάλεια·
- η) κάθε δείκτη που χρησιμοποιείται ως δείκτης αναφοράς σε μια ΣΧΤ, η διαπραγμάτευση του οποίου γίνεται σε τόπο εκτέλεσης που δεν συμπίπτει με «XXXX», εφόσον το συγκεντρωτικό ονομαστικό ποσό που γνωστοποιείται στο αρχείο καταγραφής συναλλαγών στο πλαίσιο του δείκτη υπερβαίνει τα 5 δισ. EUR και εφόσον οι σχετικές ΣΧΤ έχουν γνωστοποιηθεί στο αρχείο καταγραφής συναλλαγών από έξι τουλάχιστον διαφορετικούς αντισυμβαλλομένους.
3. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών συγκεντρώνει δεδομένα θέσεων για το σύνολο των αναφερόμενων ΣΧΤ που δεν έχουν φτάσει στη λήξη τους ή οι οποίες δεν έχουν αποτελέσει αντικείμενο αναφοράς με τύπο ενέργειας «Egto» («σφάλμα»), «Termination» («καταγγελία») ή «Position component» («στοιχείο θέσεων») έως την Παρασκευή και ώρα 23:59:59 (διεθνή ώρα UTC), στη βάση των ακόλουθων κριτηρίων και των σχετικών τιμών που παρατίθενται στον πίνακα 1 του παραρτήματος II του παρόντος κανονισμού:
- α) την τοποθεσία του αντισυμβαλλομένου που υπόκειται στην υποχρέωση γνωστοποίησης ή, κατά περίπτωση, του σχετικού υποκαταστήματος·
- β) την τοποθεσία του άλλου αντισυμβαλλομένου ή, κατά περίπτωση, του σχετικού υποκαταστήματος·
- γ) τον τύπο της ΣΧΤ·
- δ) την κατάσταση της ΣΧΤ από την άποψη της συμφωνίας δεδομένων, κατά τον πίνακα 3 του παραρτήματος I του παρόντος κανονισμού·
- ε) τον τύπο του τόπου διαπραγμάτευσης όπου συνήφθη η ΣΧΤ·
- στ) το κατά πόσο η ΣΧΤ έχει εκκαθαριστεί·
- ζ) τη μέθοδο με την οποία μεταβιβάστηκε η ασφάλεια·
- η) κάθε δείκτη που χρησιμοποιείται ως δείκτης αναφοράς σε μια ΣΧΤ, η διαπραγμάτευση του οποίου γίνεται σε τόπο εκτέλεσης που δεν συμπίπτει με «XXXX», εφόσον το συγκεντρωτικό ονομαστικό ποσό που γνωστοποιείται στο αρχείο καταγραφής συναλλαγών στο πλαίσιο του δείκτη υπερβαίνει τα 5 δισ. EUR και οι σχετικές ΣΧΤ έχουν γνωστοποιηθεί στο αρχείο καταγραφής συναλλαγών από έξι τουλάχιστον διαφορετικούς αντισυμβαλλομένους.
4. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών διαθέτει διαδικασία για τον εντοπισμό ασυνήθιστων τιμών σε σχέση με τα δεδομένα συνολικών θέσεων.
5. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών διαθέτει διαδικασία για την πραγματοποίηση και κοινοποίηση διορθώσεων στα δεδομένα συνολικών θέσεων, συμπεριλαμβανομένων όσων απορρέουν από αναφορές με τύπο ενέργειας «Egto» («σφάλμα»), και για τη δημοσίευση των αρχικών και διορθωμένων συγκεντρωτικών δεδομένων.

Άρθρο 7

Δημοσίευση δεδομένων συνολικών θέσεων

1. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών δημοσιεύει στον ιστότοπό του δεδομένα συνολικών θέσεων, υπολογιζόμενα σύμφωνα με το άρθρο 6, σε εβδομαδιαία βάση και το αργότερο έως την Τρίτη το μεσημέρι για τις ΣΧΤ που έχουν γνωστοποιηθεί έως τις 23:59:59 (διεθνή ώρα UTC) της προηγούμενης Παρασκευής.
2. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών δημοσιεύει το σύνολο των δεδομένων συνολικών θέσεων σε ευρώ και χρησιμοποιεί τις συναλλαγματικές ισοτιμίες που δημοσιεύονται στον ιστότοπο της ΕΚΤ την Παρασκευή που προηγείται της δημοσίευσης των εν λόγω δεδομένων.
3. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών διασφαλίζει τη δημοσίευση των δεδομένων συνολικών θέσεων σε μορφή πίνακα όπως καθορίζεται στο παράρτημα II και κατά τρόπο που καθιστά δυνατή την τηλεφόρτωση των δεδομένων.
4. Τα δεδομένα συνολικών θέσεων που δημοσιεύει το αρχείο καταγραφής συναλλαγών στον ιστότοπό του παραμένουν αναρτημένα στον εν λόγω ιστότοπο για τουλάχιστον 104 εβδομάδες.

Άρθρο 8

Έναρξη ισχύος

Ο παρών κανονισμός αρχίζει να ισχύει την εικοστή ημέρα από τη δημοσίευσή του στην *Επίσημη Εφημερίδα της Ευρωπαϊκής Ένωσης*.

Ο παρών κανονισμός είναι δεσμευτικός ως προς όλα τα μέρη του και ισχύει άμεσα σε κάθε κράτος μέλος.

Βρυξέλλες, 13 Δεκεμβρίου 2018.

Για την Επιτροπή
Ο Πρόεδρος
Jean-Claude JUNCKER

ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ Ι

Πίνακας 1

Πεδία συμφωνίας, επίπεδα ανοχής και ημερομηνία έναρξης της φάσης συμφωνίας

Πίνακας	Τμήμα	Πεδίο	Όριο ανοχής	Ημερομηνία έναρξης που αναφέρεται στο:
Δεδομένα αντισυμβαλλομένου	Α.Α.	Αντισυμβαλλόμενος που υπόκειται στην υποχρέωση γνωστοποίησης	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα αντισυμβαλλομένου	Α.Α.	Πλευρά αντισυμβαλλομένου	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα αντισυμβαλλομένου	Α.Α.	Άλλος αντισυμβαλλόμενος	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Μοναδικός αναγνωριστικός κωδικός συναλλαγής («UTI»)	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Είδος ΣΧΤ	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Εκκαθαρισμένη	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Χρονοσφραγίδα εκκαθάρισης	μία ώρα	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Κεντρικός αντισυμβαλλόμενος	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Τόπος διαπραγμάτευσης	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Τύπος κύριας συμφωνίας	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Χρονοσφραγίδα εκτέλεσης	μία ώρα	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Ημερομηνία αξίας (ημερομηνία έναρξης)	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Ημερομηνία ληκτότητας (ημερομηνία λήξης)	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Ημερομηνία καταγγελίας	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Ελάχιστη περίοδος προειδοποίησης	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Νωρίτερη ημερομηνία εξαγοράς	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Γενικός δείκτης ασφαλειών	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες

Πίνακας	Τμήμα	Πεδίο	Όριο ανοχής	Ημερομηνία έναρξης που αναφέρεται στο:
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Δείκτης παράδοσης βάσει αξίας (<i>delivery by value - «DBV»</i>)	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Μέθοδος που χρησιμοποιείται για την παροχή ασφαλειών	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Ανοικτή προθεσμία	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Δικαιώματα προαίρεσης για καταγγελία	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Σταθερό επιτόκιο	Μέχρι το τρίτο δεκαδικό ψηφίο	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Σύμβαση υπολογισμού αριθμού ημερών	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Κυμαινόμενο επιτόκιο	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Περίοδος αναφοράς κυμαινόμενου επιτοκίου - χρονική περίοδος	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Περίοδος αναφοράς κυμαινόμενου επιτοκίου - πολλαπλασιαστής	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Συχνότητα πληρωμής κυμαινόμενου επιτοκίου - χρονική περίοδος	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Συχνότητα πληρωμής κυμαινόμενου επιτοκίου - πολλαπλασιαστής	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Συχνότητα επαναπροσδιορισμού κυμαινόμενου επιτοκίου - χρονική περίοδος	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Συχνότητα επαναπροσδιορισμού κυμαινόμενου επιτοκίου - πολλαπλασιαστής	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Απόκλιση (<i>spread</i>)	Μέχρι το τρίτο δεκαδικό ψηφίο	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Ποσό νομίσιματος δανεισμού σε λογαριασμό περιθωρίου ασφάλισης	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Νόμισμα δανεισμού σε λογαριασμό περιθωρίου ασφάλισης	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365

Πίνακας	Τμήμα	Πεδίο	Όριο ανοχής	Ημερομηνία έναρξης που αναφέρεται στο:
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Προσαρμοσμένο επιτόκιο	Μέχρι το τρίτο δεκαδικό ψηφίο	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Ημερομηνία εφαρμογής επιτοκίου	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Ονομαστική αξία την ημερομηνία αξίας	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Ονομαστική αξία την ημερομηνία λήξης	0,0005 %	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Νόμισμα του ποσού της ονομαστικής αξίας	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Είδος περιουσιακού στοιχείου	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Αναγνωριστικός κωδικός τίτλου	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Ταξινόμηση τίτλου	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Βασικό προϊόν	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Υπο-προϊόν	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Περατέρω υπο-προϊόν	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Ποσότητα ή ονομαστικό ποσό	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Μονάδα μέτρησης	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Νόμισμα του ονομαστικού ποσού	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Τιμή τίτλου ή βασικού εμπορεύματος	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Νόμισμα της τιμής	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Ποιότητα του τίτλου	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Ληκτότητα του τίτλου	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365

Πίνακας	Τμήμα	Πεδίο	Όριο ανοχής	Ημερομηνία έναρξης που αναφέρεται στο:
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Δικαιοδοσία του εκδότη	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Αναγνωριστικός κωδικός νομικής οντότητας (LEI) του εκδότη	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Είδος τίτλου	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Αξία δανείου	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Αγοραία αξία	0,0005 %	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Σταθερό ποσοστό επιστροφής (rebate)	Μέχρι το τρίτο δεκαδικό ψηφίο	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Κυμαινόμενο ποσοστό επιστροφής (rebate)	Μέχρι το τρίτο δεκαδικό ψηφίο	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Περίοδος αναφοράς κυμαινόμενου ποσοστού επιστροφής - χρονική περίοδος	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Περίοδος αναφοράς κυμαινόμενου ποσοστού επιστροφής - πολλαπλασιαστής	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Συχνότητα πληρωμής κυμαινόμενου ποσοστού επιστροφής - χρονική περίοδος	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Συχνότητα πληρωμής κυμαινόμενου ποσοστού επιστροφής - πολλαπλασιαστής	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Συχνότητα επαναπροσδιορισμού κυμαινόμενου ποσοστού επιστροφής - χρονική περίοδος	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Συχνότητα επαναπροσδιορισμού κυμαινόμενου ποσοστού επιστροφής - πολλαπλασιαστής	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Απόκλιση (<i>spread</i>) του ποσοστού επιστροφής	Μέχρι το τρίτο δεκαδικό ψηφίο	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Τέλος δανεισμού	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365

Πίνακας	Τμήμα	Πεδίο	Όριο ανοχής	Ημερομηνία έναρξης που αναφέρεται στο:
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Αποκλειστικές ρυθμίσεις	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Οφειλόμενο δάνειο σε λογαριασμό περιθωρίου ασφάλισης	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Βασικό νόμισμα του οφειλόμενου δανείου σε λογαριασμό περιθωρίου ασφάλισης	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Αρνητική αγοραία αξία	0,0005 %	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Ασφάλεια	Προειδοποίηση πράξης δανεισμού τίτλων χωρίς παροχή ασφάλειας («SL»)	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Ασφάλεια	Εξασφάλιση του καθαρού ανοίγματος	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Ασφάλεια	Ημερομηνία αξίας της εξασφάλισης	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Ασφάλεια	Είδος συνιστώσας της ασφάλειας	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Ασφάλεια	Ποσό ασφάλειας σε χρηματικά διαθέσιμα	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Ασφάλεια	Νόμισμα ασφάλειας σε χρηματικά διαθέσιμα	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Ασφάλεια	Ταυτοποίηση τίτλου που χρησιμοποιείται ως ασφάλεια	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Ασφάλεια	Ταξινόμηση τίτλου που χρησιμοποιείται ως ασφάλεια	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Ασφάλεια	Βασικό προϊόν	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Ασφάλεια	Υπο-προϊόν	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Ασφάλεια	Περαιτέρω υπο-προϊόν	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο iv) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Ασφάλεια	Ποσότητα ή ονομαστικό ποσό της ασφάλειας	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Ασφάλεια	Μονάδα μέτρησης της ασφάλειας	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο i) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες

Πίνακας	Τμήμα	Πεδίο	Όριο ανοχής	Ημερομηνία έναρξης που αναφέρεται στο:
Δεδομένα συναλλαγής	Ασφάλεια	Νόμισμα του ονομαστικού ποσού της ασφάλειας	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο ι) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Ασφάλεια	Νόμισμα της τιμής	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο ι) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Ασφάλεια	Τιμή ανά μονάδα	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο ι) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Ασφάλεια	Αγοραία αξία της ασφάλειας	0,0005 %	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο ι) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365 + 24 μήνες
Δεδομένα συναλλαγής	Ασφάλεια	Περικοπή ή περιθώριο	Μέχρι το τρίτο δεκαδικό ψηφίο	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο ι) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Ασφάλεια	Ποιότητα της ασφάλειας	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο ι) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Ασφάλεια	Ημερομηνία λήξης του τίτλου	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο ι) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Ασφάλεια	Δικαιοδοσία του εκδότη	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο ι) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Ασφάλεια	Αναγνωριστικός κωδικός νομικής οντότητας (LEI) του εκδότη	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο ι) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Ασφάλεια	Είδος της ασφάλειας	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο ι) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Ασφάλεια	Διαθεσιμότητα επαναχρησιμοποίησης της ασφάλειας	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο ι) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Ασφάλεια	Αναγνωριστικός κωδικός καλαθιού ασφαλειών	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο ι) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365
Δεδομένα συναλλαγής	Δάνειο	Επίπεδο	Όχι	Άρθρο 33 παράγραφος 2 στοιχείο α) σημείο ι) του κανονισμού (ΕΕ) 2015/2365

Πίνακας 2

Λόγοι απόρριψης μιας αναφοράς ΣΧΤ

Κατηγορίες απόρριψης	Αιτιολογία
Σχήμα	— η ΣΧΤ δεν έγινε δεκτή λόγω μη συμμορφούμενου σχήματος
Άδεια	— η ΣΧΤ δεν έγινε δεκτή επειδή η οντότητα που υποβάλλει την έκθεση δεν έχει την άδεια να υποβάλει αναφορά εξ ονόματος του αντισυμβαλλομένου που υπόκειται στην υποχρέωση γνωστοποίησης
Λογική	— η ΣΧΤ δεν έγινε δεκτή επειδή ο τύπος ενέργειας για την ΣΧΤ δεν είναι λογικά ορθός
Επιχειρηματικοί κανόνες	— η ΣΧΤ δεν έγινε δεκτή επειδή η ΣΧΤ δεν συμμορφώνεται με μία ή περισσότερες επικυρώσεις περιεχομένου.

Πίνακας 3

Αποτελέσματα της διαδικασίας συμφωνίας

Κατηγορίες συμφωνιών	Αξίες συμφωνιών
Είδος αναφοράς	Μονόπλευρη/Αμφίπλευρη
Απαιτήση υποβολής αναφορών και για τους δύο αντισυμβαλλομένους	Ναι/Όχι
Καθεστώς σύζευξης	Συζευγμένη/Μη συζευγμένη
Καθεστώς συμφωνίας δανείου	Έχει/Δεν έχει συμφωνηθεί
Καθεστώς συμφωνίας ασφάλειας	Έχει/Δεν έχει συμφωνηθεί
Περατέρω τροποποιήσεις	Ναι/Όχι

ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ ΙΙ

Πίνακας 1

Δημόσια δεδομένα

Πίνακας Α. Συγκέντρωση

Ημερομηνία	TR	Είδος συγκέντρωσης	Είδος τύπου διαπραγμάτευσης	Τοποθεσία του αντισυμβαλλομένου που υπόκειται στην υποχρέωση γνωστοποίησης	Τοποθεσία του άλλου αντισυμβαλλομένου	Συμφωνία	Είδος ΣΧΤ	Εκκαθαρισθείσα	Μέθοδος μεταβίβασης ασφαλείων	Δείκτες που χρησιμοποιούνται ως στοιχεία αναφοράς (1)	Συγκεντρωτικό ποσό χορηγηθέντων δανείων	Συγκεντρωτικός αριθμός συναλλαγών	Συγκεντρωτική αξία ασφαλείων
20161007	EU TR	Αναφερθείσα	XXXX	EOX	EOX	Αμφίπλευρη, δάνειο που έχει συμφωνηθεί, ασφάλεια που δεν έχει συμφωνηθεί	Συμφωνία επαναγοράς (Repo)	Ναι	TTCA	
...	...	Εκκρεμύσα	XOFF	Εκτός EOX	Εκτός EOX	Αμφίπλευρη, δάνειο που έχει συμφωνηθεί, ασφάλεια που έχει συμφωνηθεί	BSB/SBB	Όχι	SICA	
...	MIC EOX	Μονόπλευρη EOX, δάνειο που έχει συμφωνηθεί, ασφάλεια που έχει συμφωνηθεί	Δανειοδοσία και δανειολημία τίτλων ή βασικών εμπορευμάτων	...	SIUR	
...	MIC εκτός EOX	Δανεισμός σε λογαριασμό περιθωρίου ασφάλισης
...

(1) Συμπληρώνεται με τους σχετικούς δείκτες που περιλαμβάνονται στο πεδίο 25 του πίνακα 2 «Δεδομένα δανείων και ασφαλείων» του παραρτήματος Ι του εκτελεστικού κανονισμού (ΕΕ) 2019/363