

KOMISIJOS ĮGYVENDINIMO REGLAMENTAS (ES) Nr. 1249/2012

2012 m. gruodžio 19 d.

kuriuo nustatomi įrašų, kuriuos turi saugoti pagrindinės sandorio šalys pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (ES) Nr. 648/2012 dėl ne biržos išvestinių finansinių priemonių, pagrindinių sandorio šalių ir sandorių duomenų saugyklų, formato techniniai įgyvendinimo standartai

(Tekstas svarbus EEE)

EUROPOS KOMISIJA,

atsižvelgdama į Sutartį dėl Europos Sąjungos veikimo,

atsižvelgdama į Europos Centrinio Banko nuomonę ⁽¹⁾,atsižvelgdama į 2012 m. liepos 4 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (ES) Nr. 648/2012 dėl ne biržos išvestinių finansinių priemonių, pagrindinių sandorio šalių ir sandorių duomenų saugyklų ⁽²⁾, ypač į jo 29 straipsnio 5 dalį,

kadangi:

- (1) remiantis Reglamento (ES) Nr. 648/2012 29 straipsnio 4 dalimi, taip pat pagal Reglamento (ES) Nr. 648/2012 29 straipsnio 4 dalį priimamo deleguotojo akto dėl techninių reguliavimo standartų, kuriuose išsamiai nustatoma, kokius įrašus ir informaciją turi saugoti pagrindinės sandorio šalys, 13, 14 ir 15 straipsniais, turėtų būti nustatytos taisyklės, siekiant nustatyti pagal tuos straipsnius saugomų įrašų ir informacijos formatą;
- (2) kad atitinkamos institucijos galėtų veiksmingai ir nuosekliai vykdyti savo užduotis, joms turėtų būti teikiami tarpusavyje palyginami atskirų pagrindinių sandorio šalių duomenys. Naudojant bendrus formatus, atskirų pagrindinių sandorio šalių duomenis taip pat lengviau suderinti;
- (3) turėtų būti reikalaujama, kad įrašų saugojimo tikslais pagrindinė sandorio šalis saugotų duomenis tokiu formatu, kuris būtų suderinamas su sandorių duomenų saugyklų naudojamu duomenų formatu, turint omenyje tai, kad tam tikromis aplinkybėmis pagrindinės sandorio šalys ir sandorių duomenų saugyklos turi saugoti ar pateikti tokią pat informaciją. Skirtingose finansų rinkų infrastruktūrose naudojant bendrą formatą būtų lengviau užtikrinti, kad šiuos formatus plačiau naudotų įvairūs rinkos dalyviai, taip skatinant standartizavimą;
- (4) siekiant palengvinti automatinę nenutrūkstamą apdorojimą ir sumažinti rinkos dalyvių išlaidas, svarbu kiek įmanoma užtikrinti, kad visos pagrindinės sandorio šalys naudotų standartizuotas procedūras ir duomenų formatus;

(5) pagrindinė finansinė priemonė turėtų būti identifikuojama naudojant vieną identifikatorių, tačiau šiuo metu nėra visoje rinkoje naudojamo standartizuoto kodo, pagal kurį būtų galima identifikuoti krepšelyje esančias pagrindines finansines priemones. Todėl pagrindinės sandorio šalys turėtų bent nurodyti, kad pagrindinė finansinė priemonė yra krepšelis, ir standartizuotų indeksų atveju naudoti tarptautinius vertybinių popierių identifikavimo numerius (ISIN), kai įmanoma;

(6) šis reglamentas grindžiamas Europos vertybinių popierių ir rinkų institucijos (EVPRI) Komisijai pateiktais techninių įgyvendinimo standartų projektais;

(7) pagal 2010 m. lapkričio 24 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 1095/2010, kuriuo įsteigiama Europos priežiūros institucija (Europos vertybinių popierių ir rinkų institucija) ⁽³⁾, 15 straipsnį EVPRI, prieš pateikdama techninių įgyvendinimo standartų projektus, kuriais pagrįstas šis reglamentas, surengė atviras viešas konsultacijas, išnagrino galimas susijusias sąnaudas ir naudą ir paprašė, kad pagal Reglamento (ES) Nr. 1095/2010 37 straipsnį įsteigta Vertybinių popierių ir rinkų suinteresuotųjų subjektų grupė pateiktų savo nuomonę,

PRIĖMĖ ŠĮ REGLAMENTĄ:

1 straipsnis

Įrašų formatai

1. Pagrindinė sandorio šalis įrašus apie kiekvieną tvarkytą sutartį, nurodytus pagal Reglamento (ES) Nr. 648/2012 29 straipsnio 4 dalį priimamo deleguotojo akto dėl techninių reguliavimo standartų, kuriais išsamiai nustatoma, kokius įrašus ir informaciją turi saugoti pagrindinės sandorio šalys, 20 straipsnyje, saugo priedo 1 lentelėje nustatytu formatu.

2. Pagrindinė sandorio šalis kiekvienos pozicijos įrašus, nurodytus pagal Reglamento (ES) Nr. 648/2012 29 straipsnio 4 dalį priimamo deleguotojo akto dėl techninių reguliavimo standartų, kuriais išsamiai nustatoma, kokius įrašus ir informaciją turi saugoti pagrindinės sandorio šalys, 21 straipsnyje, saugo priedo 2 lentelėje nustatytu formatu.

⁽¹⁾ Dar nepaskelbta Oficialiajame leidinyje.

⁽²⁾ OL L 201, 2012 7 27, p. 1.

⁽³⁾ OL L 331, 2010 12 15, p. 84.

3. Pagrindinė sandorio šalis įrašus, susijusius su jos veikla ir vidaus organizacine struktūra, nurodytus pagal Reglamento (ES) Nr. 648/2012 29 straipsnio 4 dalį priimamo deleguotojo akto dėl techninių reguliavimo standartų, kuriais išsamiai nustatoma, kokius įrašus ir informaciją turi saugoti pagrindinės sandorio šalys, 22 straipsnyje, saugo priedo 3 lentelėje nustatytu formatu.

4. Pagrindinė sandorio šalis kompetentingai institucijai įrašus ir informaciją pagal 1, 2 ir 3 dalis pateikia tokiu formatu, kad

būtų galima užtikrinti tiesioginį duomenų srautą tarp pagrindinės sandorio šalies ir kompetentingos institucijos. Pagrindinė sandorio šalis užtikrina tokį duomenų srautą per šešis mėnesius nuo kompetentingos institucijos prašymo.

2 straipsnis

Įsigaliojimas

Šis reglamentas įsigalioja dvidešimtą dieną po jo paskelbimo *Europos Sąjungos oficialiajame leidinyje*.

Šis reglamentas privalomas visas ir tiesiogiai taikomas visose valstybėse narėse.

Priimta Briuselyje 2012 m. gruodžio 19 d.

Komisijos vardu
Pirmininkas
José Manuel BARROSO

PRIEDAS

Duomenų, kuriuos reikia registruoti pagal 1 straipsnį, lentelės

1 lentelė.

Įrašai apie tvarkytus sandorius

	Laukas	Formatas	Aprašymas
1	Pranešimo laiko žyma	ISO 8601 datos formatas / UTC laiko formatas.	Pranešimo data ir laikas.
2	Kaina / norma	Iki 20 skaitmenų formatu xxxx,yyyyy.	Vertybinio popieriaus ar išvestinės finansinės priemonės sutarties kaina, atėmus komisinį atlygį ir (jeigu reikia) sukauptas palūkanas. Skolos finansinės priemonės atveju kaina gali būti nurodyta valiuta ar išreikšta kaip procentinis dydis.
2a	Kainos žymėjimas	Pvz., ISO 4217 valiutos kodas, 3 raidiniai ženklai, procentai.	Būdas, kuriuo išreikšta kaina.
3	Nominalioji valiuta	ISO 4217 valiutos kodas, 3 raidiniai ženklai.	Valiuta, kuria išreikšta kaina. Jeigu obligacijos ar kitos formos skolos vertybinio popieriaus atveju buvo pateiktas procentinis kainos dydis, nurodomas šis procentinis dydis.
3a	Pristatymo valiuta	ISO 4217 valiutos kodas, 3 raidiniai ženklai.	Valiuta, kurią reikia pristatyti.
4	Kiekis	Iki 10 skaitmenų.	Finansinių priemonių vienetų skaičius, nominali obligacijų vertė arba į sandorį įtrauktų išvestinių finansinių priemonių sutarčių skaičius.
5	Kiekio žymėjimas	Iki 10 skaitmenų.	Nuoroda, ar kiekis žymi finansinių priemonių vienetų skaičių, nominalią obligacijų vertę ar išvestinių finansinių priemonių sutarčių skaičių.
6	Pagrindinės sandorio šalies pobūdis	B = pirkėjas / S = pardavėjas.	
7	Produkto identifikavimo duomenys	Laikina taksonomija, remiantis Reglamentu (ES) Nr. xx/2012 [pranešimų apie sandorius, teikiamų sandorių duomenų saugykloms, formato ir dažnumo TIS projektai] 4 straipsnyje pateikta informacija, ISIN arba unikalus produkto identifikatorius (UPI).	Sutartis identifikuojama naudojant produkto identifikatorių, jei yra.
8	Tarpuskaitos nario identifikavimo duomenys	Juridinio asmens identifikatorius (LEI) (20 raidinių skaitmeninių ženklų), laikinas subjekto identifikatorius (20 raidinių skaitmeninių ženklų), BIC (11 raidinių skaitmeninių ženklų) arba kliento kodas (50 raidinių skaitmeninių ženklų).	Jei pranešimą teikianti sandorio šalis nėra tarpuskaitos narė, šiame lauke nurodomas jos tarpuskaitos nario unikalus kodas. Fizinio asmens atveju naudojamas pagrindinės sandorio šalies suteiktas kliento kodas.

	Laukas	Formatas	Aprašymas
9	Naudos gavėjo identifikavimo duomenys	<i>Juridinio asmens identifikatorius (LEI) (20 raidinių skaitmeninių ženklų), laikinas subjekto identifikatorius (20 raidinių skaitmeninių ženklų), BIC (11 raidinių skaitmeninių ženklų) arba kliento kodas (50 raidinių skaitmeninių ženklų).</i>	Jei sutarties naudos gavėjas nėra šios sutarties šalis, jis turi būti identifikuojamas pagal unikalų kodą, o fizinio asmens atveju – pagal kliento kodą, suteiktą juridinio asmens, kurio paslaugomis naudojasi fizinis asmuo.
10	Sutartį perdavusi šalis (sandorio perdavimo atsiskaitymams atlikti (angl. give-up) atveju)	<i>Juridinio asmens identifikatorius (LEI) (20 raidinių skaitmeninių ženklų), laikinas subjekto identifikatorius (20 raidinių skaitmeninių ženklų), BIC (11 raidinių skaitmeninių ženklų) arba kliento kodas (50 raidinių skaitmeninių ženklų).</i>	
11	Įvykdymo vieta	<i>ISO 10383 rinkos identifikavimo kodas (MIC), kai tinka, į biržos sąrašus įtrauktų išvestinių finansinių priemonių, kuriomis prekiaujama ne biržoje, atveju nurodoma XOFF, o ne biržos išvestinių finansinių priemonių atveju – XXXX.</i>	Vietos, kurioje buvo įvykdytas sandoris, identifikavimas. Jei sutartis sudaryta ne biržoje, būtina nurodyti, ar atitinkama priemone leidžiama prekiauti biržoje, bet prekiaujama ne biržoje, ar ja neleidžiama prekiauti biržoje ir prekiaujama ne biržoje.
12	Įsiterpimo data	<i>ISO 8601 datos formatas.</i>	Diena, kurią pagrindinė sandorio šalis užėmė sutarties tarpininko padėtį.
13	Įsiterpimo laikas	<i>UTC laiko formatas.</i>	Laikas, kai pagrindinė sandorio šalis užėmė sutarties tarpininko padėtį, nurodomas kompetentingos institucijos, kuriai bus pranešta apie sandorį, vietos laiku, ir pagrindas, kuriuo remiantis pranešama apie sandorį, išreikštas suderintuoju pasauliniu laiku (UTC) +/- val.
14	Sutarties užbaigimo data	<i>ISO 8601 datos formatas.</i>	Diena, kurią sutartis užbaigta.
15	Sutarties užbaigimo laikas	<i>UTC laiko formatas.</i>	Laikas, kai sutartis užbaigta, nurodomas kompetentingos institucijos, kuriai bus pranešta apie sandorį, vietos laiku, ir pagrindas, kuriuo remiantis pranešama apie sandorį, išreikštas suderintuoju pasauliniu laiku (UTC) +/- val.
16	Pristatymo tipas	<i>C = pinigai, P = fizinis, O = sandorio šaliai pasirenkamas.</i>	Ar pagal sutartį atsiskaitoma fiziškai pristatant finansines priemones ar pinigais.
17	Atsiskaitymo data	<i>ISO 8601 datos formatas.</i>	Diena, kurią įvykdomas atsiskaitymas arba supirkimas pagal sutartį. Jei daugiau negu viena, galima pridėti daugiau laukų.
18	Atsiskaitymo arba supirkimo pagal sutartį laikas	<i>UTC laiko formatas.</i>	Laikas, kai įvykdomas atsiskaitymas arba supirkimas pagal sutartį, nurodomas kompetentingos institucijos, kuriai bus pranešta apie sandorį, vietos laiku, ir pagrindas, kuriuo remiantis pranešama apie sandorį, išreikštas suderintuoju pasauliniu laiku (UTC) +/- val.

	Laukas	Formatas	Aprašymas
Išsami informacija apie pradines sutarčių, kurių tarpuskaita atlikta, sąlygas, pateikiama, jei jos yra taikytinos			
19	Data	ISO 8601 datos formatas.	Diena, kurią sudaryta pradinė sutartis.
20	Laikas	UTC laiko formatas.	Pradinės sutarties sudarymo laikas, nurodomas kompetentingos institucijos, kuriai bus pranešta apie sandorį, vietos laiku, ir pagrindas, kuriuo remiantis pranešama apie sandorį, išreikštas suderintuoju pasauliniu laiku (UTC) +/- val.
21	Produkto identifikavimo duomenys	Laikina taksonomija, remiantis Reglamento (ES) Nr. xx/2012 [pranešimų apie sandorius, teikiamų sandorių duomenų saugykloms, formato ir dažnumo TĮS projektai] 4 straipsnyje pateikta informacija, ISIN arba unikalūs produkto identifikatoriai (UPI).	Sutartis identifikuojama naudojant unikalų produkto identifikatorių, jei yra.
22	Pagrindinė priemonė	Unikalūs produkto identifikatoriai, ISIN (12 raidinių skaitmeninių ženklų) ir CFI (6 raidiniai skaitmeniniai ženklai). Juridinio asmens identifikatoriai (LEI) (20 raidinių skaitmeninių ženklų), laikinas subjekto identifikatorius (20 raidinių skaitmeninių ženklų), B = krepšelis arba I = indeksas.	Priemonės identifikavimas, taikytinas vertybiniam popieriui, kuris yra pagrindinis turtas pagal išvestinių finansinių priemonių sutartį, taip pat perdžiamam vertybiniam popieriui, priskiriamam Direktyvos 2004/39/EB 4 straipsnio 1 dalies 18 punkto c papunkčiui.
23	Išvestinės finansinės priemonės rūšis (išvestinių finansinių priemonių sutarties atveju)	Išvestinės finansinės priemonės rūšies suderintas aprašymas turėtų būti pateikiamas remiantis viena iš aukščiausio lygio kategorijų, kaip nurodyta vieno-dame tarptautiniame finansinių priemonių klasifikavimo standarte.	
24	Priemonės ištraukimas iš EVPRI sutarčių, kurioms taikoma tarpuskaitos prievolė, registrą (išvestinių finansinių priemonių sutarties atveju)	Y = taip / N = ne.	
Kita informacija, kurią reikia pateikti, jei taikytina			
25	Sąveikios pagrindinės sandorio šalies, kuri atlieka vienos sandorio dalies tarpuskaitą, identifikavimo duomenys	Juridinio asmens identifikatorius (LEI) (20 raidinių skaitmeninių ženklų), laikinas subjekto identifikatorius (20 raidinių skaitmeninių ženklų), BIC (11 raidinių skaitmeninių ženklų) arba kliento kodas (50 raidinių skaitmeninių ženklų).	

2 lentelė.

Pozicijų įrašai

	Laukas	Formatas
1	Tarpuskaitos nario identifikavimo duomenys	Juridinio asmens identifikatorius (LEI), laikinas subjekto identifikatorius arba BIC
2	Naudos gavėjo identifikavimo duomenys	Juridinio asmens identifikatorius (LEI), laikinas subjekto identifikatorius, BIC arba kliento kodas
3	Poziciją turinti sąveiki pagrindinė sandorio šalis	Juridinio asmens identifikatorius (LEI), laikinas subjekto identifikatorius, BIC arba kliento kodas
4	Pozicijos ženklas	B = pirkėjas / S = pardavėjas.
5	Pozicijos vertė	Iki 10 skaitmenų (xxxx,yy).
6	Įvertinta sutarčių kaina	Iki 10 skaitmenų (xxxx,yy).
7	Valiuta	ISO valiutos kodas.
8	Kita susijusi informacija	Laisvos formos tekstas
9	Pagrindinės sandorio šalies pareikalautų garantinių įmokų suma	Iki 10 skaitmenų (xxxx,yy).
10	Pagrindinės sandorio šalies pareikalautų įmokų į išsipareigojimų neįvykdymo fondą suma	Iki 10 skaitmenų (xxxx,yy).
11	Pagrindinės sandorio šalies pareikalautų kitų finansinių išteklių suma	Iki 10 skaitmenų (xxxx,yy).
12A	Tarpuskaitos nario pateiktų garantinių įmokų, susijusių su A kliento sąskaita, suma	Iki 10 skaitmenų (xxxx,yy).
13A	Tarpuskaitos nario pateiktų įmokų į išsipareigojimų neįvykdymo fondą, susijusių su A kliento sąskaita, suma	Iki 10 skaitmenų (xxxx,yy).
14A	Kitų tarpuskaitos nario pateiktų finansinių išteklių, susijusių su A kliento sąskaita, suma	Iki 10 skaitmenų (xxxx,yy).
15B	Tarpuskaitos nario pateiktų garantinių įmokų, susijusių su B kliento sąskaita, suma	Iki 10 skaitmenų (xxxx,yy).
16B	Tarpuskaitos nario pateiktų įmokų į išsipareigojimų neįvykdymo fondą, susijusių su B kliento sąskaita, suma	Iki 10 skaitmenų (xxxx,yy).
17B	Kitų tarpuskaitos nario pateiktų finansinių išteklių, susijusių su B kliento sąskaita, suma	Iki 10 skaitmenų (xxxx,yy).

3 lentelė.

Veiklos įrašai

	Laukas	Formatas	Aprašymas
1	Organizacinės schemos	Laisvos formos tekstas	Valdyba ir atitinkami komitetai, tarpuskaitos padalinys, rizikos valdymo padalinys ir visi kiti atitinkami padaliniai ar skyriai.

Akcininkai ar nariai, turintys akcijų paketus (kiekvienam atitinkamam akcininkui ar nariui įterpti papildomą lauką)

2	Tipas	$S = \text{akcininkas} / M = \text{narys}$.	
3	Akcijų paketo tipas	$D = \text{tiesioginis} / I = \text{netiesioginis}$.	
4	Subjekto tipas	$N = \text{fizinis asmuo} / L = \text{juridinis asmuo}$.	
5	Akcijų paketo suma	Iki 10 skaitmenų (xxxx,yyyyy).	

Kiti dokumentai

6	Politika, procedūros ir procesai, būtini pagal organizacinius reikalavimus	Dokumentai	
7	Valdybos posėdžių, pakomitečių posėdžių (jei taikoma) ir vyresniosios vadovybės komitetų posėdžių (jei taikoma) protokolai	Dokumentai	
8	Rizikos komiteto posėdžių protokolai	Dokumentai	
9	Konsultacinės grupės susitikimų su tarpuskaitos nariais ir klientais (jei rengta) protokolai	Dokumentai	
10	Vidaus ir išorės audito, rizikos valdymo, atitikties užtikrinimo ir konsultanto ataskaitos	Dokumentai	
11	Veiklos tęstinumo politika ir veiklos atkūrimo planas	Dokumentai	
12	Likvidumo planas ir kasdienės likvidumo ataskaitos	Dokumentai	
13	Dokumentai, kuriuose parodomas visas turtas ir išipareigojimai ir kapitalo sąskaitos	Dokumentai	

	Laukas	Formatas	Aprašymas
14	Gauti skundai	<i>Laisvos formos tekstas</i>	Apie kiekvieną skundą: skundo teikėjo vardas, pavardė, adresas ir sąskaitos numeris; skundo gavimo data; visų skunde nurodytų asmenų vardai ir pavardės; skundo pobūdžio aprašymas; skundo sprendimas; data, kurią skundas išspręstas.
15	Informacija apie paslaugų teikimo sustabdymą arba sutrikimą	<i>Laisvos formos tekstas</i>	Informacija apie bet kokių paslaugų teikimo sustabdymą arba sutrikimą, įskaitant išsamią ataskaitą apie laiką, poveikį ir taisomuosius veiksmus.
16	Grįžtamojo patikrinimo ir testavimo nepalankiausiomis sąlygomis rezultatai	<i>Laisvos formos tekstas</i>	
17	Susirašinėjimas su kompetentingomis institucijomis, EVPRI ir atitinkamais ECBS nariais	<i>Dokumentai</i>	
18	Teisinės nuomonės, gautos vykdant organizacinius reikalavimus	<i>Dokumentai</i>	
19	Sąveikos susitarimai su kitomis pagrindinėmis sandorio šalimis (kai taikoma)	<i>Dokumentai</i>	
20	Visų tarpuskaitos narių sąrašas (Reglamento (ES) Nr. XXX/2012 17 straipsnis)	<i>Laisvos formos tekstas / Dokumentas</i>	Sąrašas pagal Reglamento (ES) Nr. XXX/2012 17 straipsnį
21	Informacija, kurios reikalaujama pagal Reglamento (ES) Nr. XXX/2012 17 straipsnį	<i>Laisvos formos tekstas / Dokumentai</i>	Teisės aktai ir taisyklės, reglamentuojantys: i) galimybę naudotis pagrindinės sandorio šalies paslaugomis; ii) sutartis, kurias pagrindinė sandorio šalis sudaro su tarpuskaitos nariais ir, kai tinka, klientais; iii) sutartis, kurių tarpuskaitą atlieka pagrindinė sandorio šalis; iv) visus sąveikos susitarimus; v) įkaito ir įmokų į išipareigojimų neįvykdymo fondą naudojimą, įskaitant pozicijų ir įkaito likvidavimą ir kokiu mastu įkaitas yra apsaugotas nuo trečiųjų šalių reikalavimų (atskyrimo lygis).
22	Informacija apie naujų iniciatyvų rengimą	<i>Laisvos formos tekstas</i>	Naujų paslaugų teikimo atveju.