

REGULAMENTUL DE PUNERE ÎN APLICARE (UE) NR. 1249/2012 AL COMISIEI**din 19 decembrie 2012**

de stabilire a standardelor tehnice de punere în aplicare în ceea ce privește formatul evidențelor care trebuie păstrate de contrapărțile centrale în conformitate cu Regulamentul (UE) nr. 648/2012 al Parlamentului European și al Consiliului privind instrumentele financiare derivate extrabursiere, contrapărțile centrale și registrele centrale de tranzacții

(Text cu relevanță pentru SEE)

COMISIA EUROPEANĂ,

având în vedere Tratatul privind funcționarea Uniunii Europene,

având în vedere avizul Băncii Centrale Europene ⁽¹⁾,având în vedere Regulamentul (UE) nr. 648/2012 al Parlamentului European și al Consiliului din 4 iulie 2012 privind instrumentele financiare derivate extrabursiere, contrapărțile centrale și registrele centrale de tranzacții ⁽²⁾, în special articolul 29 alineatul (5),

întrucât:

- (1) În conformitate cu articolul 29 alineatul (4) din Regulamentul (UE) nr. 648/2012 și cu articolele 13, 14 și 15 din actul delegat privind standardele tehnice de reglementare prin care se precizează detaliile evidențelor și ale informațiilor care trebuie păstrate de contrapărțile centrale (CPC), adoptat în temeiul articolului 29 alineatul (4) din Regulamentul (UE) nr. 648/2012, ar trebui de asemenea stabilite norme pentru precizarea formatului evidențelor și al informațiilor păstrate în conformitate cu respectivele articole.
- (2) Pentru a-și îndeplini îndatoririle cu eficacitate și consecvență, ar trebui să li se furnizeze autorităților relevante date care să fie comparabile între CPC. Utilizarea unor formate comune facilitează, de asemenea, reconcilierea datelor între CPC.
- (3) O CPC ar trebui să aibă obligația de a păstra datele în scopul ținerii evidenței într-un format compatibil cu formatul în care sunt păstrate datele de către registrele centrale de tranzacții, ținând cont de faptul că în anumite împrejurări CPC și registrele centrale de tranzacții au obligația de a păstra sau de a raporta aceleași informații. Utilizarea unui format comun la nivelul diverselor infrastructuri ale piețelor financiare facilitează răspândirea utilizării acestor formate de către o mai mare varietate de participanți la piață, promovând astfel standardizarea.
- (4) Pentru a facilita prelucrarea automatizată și reducerea costurilor pentru participanții la piață, este importantă utilizarea în cât mai mare măsură a procedurilor și a formatelor de date standardizate la nivelul CPC.

- (5) Activul suport ar trebui identificat prin utilizarea unui identificator unic, dar în prezent nu există niciun cod standardizat la nivelul întregii piețe pentru identificarea activelor suport din cadrul unui coș. Prin urmare, CPC ar trebui să indice cel puțin că activul suport este un coș și să utilizeze codurile internaționale de identificare a valorilor mobiliare (ISIN) pentru indici standardizați, în cazul în care este posibil.
- (6) Prezentul regulament se bazează pe proiectele de standarde tehnice de punere în aplicare transmise Comisiei de Autoritatea europeană pentru valori mobiliare și piețe (AEVMP).
- (7) În conformitate cu articolul 15 din Regulamentul (UE) nr. 1095/2010 al Parlamentului European și al Consiliului din 24 noiembrie 2010 de instituire a Autorității europene de supraveghere (Autoritatea europeană pentru valori mobiliare și piețe) ⁽³⁾, AEVMP a organizat o consultare publică deschisă înainte de transmiterea proiectelor de standarde tehnice pe care se bazează prezentul regulament, a analizat potențialele costuri și beneficii aferente și a solicitat avizul Grupului părților interesate din domeniul valorilor mobiliare și piețelor, înființat în conformitate cu articolul 37 din Regulamentul (UE) nr. 1095/2010,

ADOPTĂ PREZENTUL REGULAMENT:

*Articolul 1***Formatul evidențelor**

1. Pentru fiecare contract pe care îl procesează, CPC păstrează evidențele menționate la articolul 20 din actul delegat privind standardele tehnice de reglementare prin care se precizează detaliile evidențelor și ale informațiilor care trebuie păstrate de contrapărțile centrale (CPC), adoptat în temeiul articolului 29 alineatul (4) din Regulamentul (UE) nr. 648/2012, în formatul prezentat în tabelul 1 din anexă.
2. Pentru fiecare poziție, CPC păstrează evidențele menționate la articolul 21 din actul delegat privind standardele tehnice de reglementare prin care se precizează detaliile evidențelor și ale informațiilor care trebuie păstrate de contrapărțile centrale (CPC), adoptat în temeiul articolului 29 alineatul (4) din Regulamentul (UE) nr. 648/2012, în formatul prezentat în tabelul 2 din anexă.

⁽¹⁾ Nepublicată încă în Jurnalul Oficial.⁽²⁾ JO L 201, 27.7.2012, p. 1.⁽³⁾ JO L 331, 15.12.2010, p.84.

3. Pentru activitățile referitoare la organizarea lor comercială și internă, CPC păstrează evidențele menționate la articolul 22 din actul delegat privind standardele tehnice de reglementare prin care se precizează detaliile evidențelor și ale informațiilor care trebuie păstrate de contrapărțile centrale (CPC), adoptat în temeiul articolului 29 alineatul (4) din Regulamentul (UE) nr. 648/2012, în formatul prezentat în tabelul 3 din anexă.

4. CCP furnizează autorității competente evidențele și informațiile prevăzute la alineatele (1), (2) și (3) într-un format care

să permită un flux direct de date între CPC și autoritatea competentă. CPC creează acest flux de date în termen de șase luni de la cererea înaintată de autoritatea competentă.

Articolul 2

Intrarea în vigoare

Prezentul regulament intră în vigoare în a douăzecea zi de la data publicării în *Jurnalul Oficial al Uniunii Europene*.

Prezentul regulament este obligatoriu în toate elementele sale și se aplică direct în toate statele membre.

Adoptat la Bruxelles, 19 decembrie 2012.

Pentru Comisie
Președintele
José Manuel BARROSO

ANEXĂ

Tabel cu câmpurile care trebuie înregistrate în conformitate cu articolul 1

Tabelul 1

Evidența tranzacțiilor prelucrate

	Câmp	Format	Descriere
1	Marca temporală a raportării	Data în format ISO 8601/ora în format UTC.	Data și ora raportării.
2	Preț/rată	Până la 20 de caractere numerice în formatul xxxx,yyyyy.	Prețul pe titlu de valoare sau contract derivat excluzând comisionul și (după caz) dobânda acumulată. În cazul unui titlu de creanță, prețul poate fi exprimat în moneda respectivă sau ca procent.
2a	Notarea prețului	De exemplu codul monedei în format ISO 4217, 3 caractere alfanumerice, procentaj.	Modalitatea de exprimare a prețului.
3	Moneda noțională	Codul monedei în format ISO 4217, 3 caractere alfabetic.	Moneda în care este exprimat prețul. Dacă, în cazul unei obligațiuni sau al unei alte forme de titlu de creanță, prețul este exprimat procentual, se include procentajul respectiv.
3a	Moneda de livrat	Codul monedei în format ISO 4217, 3 caractere alfabetic.	Moneda care trebuie livrată.
4	Cantitate	Până la 10 caractere numerice.	Numărul unităților instrumentului financiar, valoarea nominală a obligațiunilor sau numărul contractelor derivate incluse în tranzacție.
5	Notarea cantității	Până la 10 caractere numerice.	Se indică dacă cantitatea reprezintă numărul unităților instrumentului financiar, valoarea nominală a obligațiunilor sau numărul contractelor derivate.
6	Calitatea CPC	B = cumpărător / S = vânzător.	
7	Identificatorul produsului	Taxonomie interimară în conformitate cu informațiile de la articolul 4 din Regulamentul (CE) xx/2012 [proiect de standarde tehnice de punere în aplicare privind formatul și frecvența rapoartelor de tranzacție efectuate către registrele centrale de tranzacții], ISIN sau un identificator unic de produs (UPI).	Contractul este identificat prin utilizarea unui identificator de produs, dacă este disponibil.
8	Identificatorul membrului compensator	Identificator al entității juridice (LEI) (20 de caractere alfanumerice), identificator interimar al entității (20 de caractere alfanumerice), BIC (11 caractere alfanumerice) sau un cod de client (50 de caractere alfanumerice).	În cazul în care contrapartea raportoare nu este un membru compensator, membrul compensator al acesteia este identificat în acest câmp printr-un cod unic. În cazul unei persoane fizice se utilizează un cod de client atribuit de CPC.

	Câmp	Format	Descriere
9	Identificatorul beneficiarului	Identificator al entității juridice (LEI) (20 de caractere alfanumerice), identificator interimar al entității (20 de caractere alfanumerice), BIC (11 caractere alfanumerice) sau un cod de client (50 de caractere alfanumerice).	Dacă beneficiarul contractului nu este contraparte la acest contract, acesta trebuie identificat printr-un cod unic sau, în cazul unei persoane fizice, printr-un cod de client atribuit de entitatea juridică la care a recurs aceasta.
10	Partea care a transferat contractul (în cazul unei renunțări)	Identificator al entității juridice (LEI) (20 de caractere alfanumerice), identificator interimar al entității (20 de caractere alfanumerice), BIC (11 caractere alfanumerice) sau un cod de client (50 de caractere alfanumerice).	
11	Locul de executare	Codul de identificare de piață (MIC) ISO 10383, în cazul în care este relevant, codul XOFF pentru instrumentele financiare derivate cotate care sunt tranzacționate pe piața extrabursieră sau XXXX pentru instrumentele financiare derivate extrabursiere.	Identificarea locului în care a fost executată tranzacția. În cazul unui contract extrabursier, trebuie stabilit dacă respectivul instrument este acceptat la tranzacționare, dar tranzacționat extrabursier, sau nu este acceptat la tranzacționare și tranzacționat extrabursier.
12	Data interpunerii	Data în format ISO 8601.	Data la care s-a executat interpunerea CPC în contract.
13	Ora interpunerii	Ora în format UTC.	Ora la care a fost executată interpunerea CPC în contract, exprimată ca oră locală a autorității competente căreia i se raportează tranzacția, și fusul orar în care se raportează tranzacția, exprimat ca timp universal coordonat (UTC) +/- x ore.
14	Data încetării contractului	Data în format ISO 8601.	Data la care a avut loc încetarea contractului
15	Ora încetării contractului	Ora în format UTC.	Ora la care a avut loc încetarea contractului, exprimată ca oră locală a autorității competente căreia i se raportează tranzacția, și fusul orar în care se raportează tranzacția, exprimat ca timp universal coordonat (UTC) +/- x ore.
16	Tipul de livrare	C = numerar, P = fizică, O = opțională pentru contraparte.	Dacă contractul este decontat fizic sau în numerar.
17	Data decontării	Data în format ISO 8601.	Data la care se execută decontarea sau cumpărarea impusă (buy-in) a contractului. Dacă există mai multe date, se pot adăuga câmpuri suplimentare.
18	Ora decontării sau a cumpărării impuse (buy-in) a contractului	Ora în format UTC.	Ora la care a fost executată decontarea sau cumpărarea impusă (buy-in), exprimată ca oră locală a autorității competente căreia i se raportează tranzacția, și fusul orar în care se raportează tranzacția, exprimat ca timp universal coordonat (UTC) +/- x ore.

	Câmp	Format	Descriere
Detalii privind condițiile inițiale ale contractelor compensate, care trebuie furnizate în măsura în care sunt aplicabile			
19	Data	Data în format ISO 8601.	Ziua în care a fost încheiat inițial contractul.
20	Ora	Ora în format UTC.	Ora la care a fost încheiat inițial contractul, exprimată ca oră locală a autorității competente căreia i se raportează tranzacția, și fusul orar în care se raportează tranzacția, exprimat ca timp universal coordonat (UTC) +/- x ore.
21	Identificatorul produsului	Taxonomie interimară în conformitate cu informațiile de la articolul 4 din Regulamentul (CE) xx/2012 [proiect de standarde tehnice de punere în aplicare privind formatul și frecvența rapoartelor de tranzacție efectuate către registrele centrale de tranzacții], ISIN sau un identificator unic de produs (UPI).	Contractul este identificat prin utilizarea unui identificator unic de produs, dacă este disponibil.
22	Activ suport	Un identificator unic de produs, ISIN (12 caractere alfanumerice) și CFI (6 caractere alfanumerice). Identificator al entității juridice (LEI) (20 de caractere alfanumerice), identificator interimar al entității (20 de caractere alfanumerice), B = coș sau I = indice..	Identificarea instrumentului care se aplică titlului de valoare care reprezintă activul suport într-un contract derivat, precum și valoarea mobilă care intră sub incidența articolului 4 alineatul (1) punctul (18) litera (c) din Directiva 2004/39/CE.
23	Tipul de instrument financiar derivat (în cazul contractelor derivate)	Descrierea armonizată a instrumentului derivat ar trebui efectuată în funcție de una dintre categoriile de nivel superior prevăzute de un standard uniform și acceptat la nivel internațional de clasificare a instrumentelor financiare.	
24	Includerea instrumentului în registrul AEVMP cu contracte care fac obiectul obligației de compensare (în cazul contractelor derivate)	Y = da, N = nu.	
Alte informații care trebuie furnizate în măsura în care sunt aplicabile			
25	Identificarea CPC interoperabile care compensează un segment al tranzacției	Identificator al entității juridice (LEI) (20 de caractere alfanumerice), identificator interimar al entității (20 de caractere alfanumerice), BIC (11 caractere alfanumerice) sau un cod de client (50 de caractere alfanumerice).	

Tabelul 2

Evidența pozițiilor

	Câmp	Format
1	Identificatorul membrului compensator	Identificator al entității juridice, identificator interimar al entității sau BIC
2	Identificatorul beneficiarului	Identificator al entității juridice, identificator interimar al entității, BIC sau cod de client
3	CPC interoperabilă care păstrează poziția	Identificator al entității juridice, identificator interimar al entității, BIC sau cod de client
4	Semnul poziției	B = cumpărător / S = vânzător.
5	Valoarea poziției	Până la 10 caractere numerice (xxxx,yy).
6	Prețul la care sunt evaluate contractele	Până la 10 caractere numerice (xxxx,yy).
7	Moneda	Codul monedei în format ISO.
8	Alte informații relevante	Text liber
9	Valoarea marjelor solicitate de CPC	Până la 10 caractere numerice (xxxx,yy).
10	Valoarea contribuțiilor la fondul de garantare solicitate de CPC	Până la 10 caractere numerice (xxxx,yy).
11	Valoarea altor resurse financiare solicitate de CPC	Până la 10 caractere numerice (xxxx,yy).
12A	Valoarea marjelor depuse de membrul compensator cu referire la contul de client A	Până la 10 caractere numerice (xxxx,yy).
13A	Valoarea contribuțiilor la fondul de garantare depuse de membrul compensator cu referire la contul de client A	Până la 10 caractere numerice (xxxx,yy).
14A	Valoarea altor resurse financiare depuse de membrul compensator cu referire la contul de client A	Până la 10 caractere numerice (xxxx,yy).
15B	Valoarea marjelor depuse de membrul compensator cu referire la contul de client B	Până la 10 caractere numerice (xxxx,yy).
16B	Valoarea contribuțiilor la fondul de garantare depuse de membrul compensator cu referire la contul de client B	Până la 10 caractere numerice (xxxx,yy).
17B	Valoarea altor resurse financiare depuse de membrul compensator cu referire la contul de client B	Până la 10 caractere numerice (xxxx,yy).

Tabelul 3

Evidența comercială

	Câmp	Format	Descriere
1	Organigrame	<i>Text liber</i>	Consiliul de administrație și comitetele relevante, unitatea de compensare, unitatea de gestionare a riscurilor și toate celelalte unități sau divizii relevante.

Aționarii sau membrii care dețin participații calificate (se adaugă câmpuri pentru fiecare acționar/membru)

2	Tip	<i>S = acționar/M = membru.</i>	
3	Tipul de participație calificată	<i>D = directă/I = indirectă.</i>	
4	Tipul entității	<i>N = persoană fizică/L = persoană juridică.</i>	
5	Cuantumul participației	<i>Până la 10 caractere numerice (xxxx,yyyyy).</i>	

Alte documente

6	Politici, proceduri și procese obligatorii în conformitate cu cerințele organizatorice	<i>Documente</i>	
7	Procese-verbale ale ședințelor consiliului de administrație, ale subcomitetelor (dacă este cazul) și ale comitetelor conducerii superioare (dacă este cazul)	<i>Documente</i>	
8	Procese-verbale ale ședințelor comitetului de risc;	<i>Documente</i>	
9	Procese-verbale ale grupului de consultare cu membrii compensatori și clienții (dacă există)	<i>Documente</i>	
10	Rapoarte de audit intern și extern, de gestionare a riscurilor, de conformitate și de consultanță	<i>Documente</i>	
11	Politica de continuitate a activității și planul de recuperare în caz de dezastru	<i>Documente</i>	
12	Planul în materie de lichiditate și rapoartele zilnice privind lichiditatea	<i>Documente</i>	
13	Documente care reflectă toate activele, pasivele și conturile de capital	<i>Documente</i>	

	Câmp	Format	Descriere
14	Reclamații primite	<i>Text liber</i>	Pentru fiecare reclamație: informații privind numele, adresa și numele de cont aferente reclamației; data primirii reclamației; numele tuturor persoanelor identificate în reclamație; o descriere a naturii reclamației; soluționarea reclamației; data la care a fost soluționată reclamația.
15	Informații privind întreruperea serviciilor sau disfuncționalități	<i>Text liber</i>	Informații privind orice întrerupere a serviciilor sau orice disfuncționalitate, inclusiv un raport detaliat privind calendarul, efectele și acțiunile de remediere;
16	Rezultatele testelor ex-post și ale simulărilor de criză efectuate	<i>Text liber</i>	
17	Comunicări scrise cu autoritățile competente, AEVMP și membrii relevanți ai SEBC;	<i>Documente</i>	
18	Avize juridice primite în conformitate cu cerințele organizatorice	<i>Documente</i>	
19	Măsuri de interoperabilitate cu alte CPC (dacă este cazul)	<i>Documente</i>	
20	Lista tuturor membrilor compensatori (articolul 17 din Regulamentul (UE) nr. XXX/2012)	<i>Text liber/Document</i>	Lista în conformitate cu articolul 17 din Regulamentul (UE) nr. XXX/2012.
21	Informațiile a căror comunicare este impusă prin articolul 17 din Regulamentul (UE) nr. XXX/2012.	<i>Text liber/Documente</i>	Legislația și normele care reglementează (i) accesul la CPC, (ii) contractele încheiate de CPC cu membrii compensatori și, dacă este cazul, cu clienții, (iii) contractele acceptate de CPC pentru compensare, (iv) orice acorduri de interoperabilitate, (v) utilizarea garanțiilor și a contribuțiilor la fondul de garantare, inclusiv lichidarea pozițiilor și a garanțiilor și măsura în care garanțiile sunt protejate împotriva pretențiilor terților (nivelul de segregare).
22	Procese referitoare la elaborarea de noi inițiative	<i>Text liber</i>	În cazul prestării unor servicii noi.