

REGULAMENTUL DELEGAT (UE) 2019/358 AL COMISIEI**din 13 decembrie 2018**

de completare a Regulamentului (UE) 2015/2365 al Parlamentului European și al Consiliului în ceea ce privește standardele tehnice de reglementare privind colectarea, verificarea, agregarea, compararea și publicarea datelor privind operațiunile de finanțare prin instrumente financiare (SFT) de către registrele centrale de tranzacții

(Text cu relevanță pentru SEE)

COMISIA EUROPEANĂ,

având în vedere Tratatul privind funcționarea Uniunii Europene,

având în vedere Regulamentul (UE) 2015/2365 al Parlamentului European și al Consiliului din 25 noiembrie 2015 privind transparența operațiunilor de finanțare prin instrumente financiare și transparența reutilizării și de modificare a Regulamentului (UE) nr. 648/2012 ⁽¹⁾, în special articolul 5 alineatul (7) litera (a) și articolul 12 alineatul (3) literele (a) și (b),

întrucât:

- (1) Pentru a garanta calitatea ridicată a detaliilor privind SFT-urile raportate către registrele centrale de tranzacții, registrele centrale de tranzacții ar trebui să verifice identitatea entităților care prezintă rapoartele, integritatea logică a ordinii în care sunt raportate detaliile privind SFT-urile, precum și caracterul complet și acuratețea acestor detalii privind SFT-urile.
- (2) Din același motiv, registrele centrale de tranzacții ar trebui să reconcilieze detaliile fiecărui raport SFT pe care îl primesc. Ar trebui stabilit un proces standardizat care să le permită registrelor centrale de tranzacții să realizeze reconcilierile în mod consecvent și să reducă riscul ca unele detalii privind SFT-urile să nu fie reconciliate. Cu toate acestea, este posibil ca anumite detalii privind SFT-urile să nu fie identice din cauza particularităților sistemelor informatice utilizate de către entitățile care prezintă rapoartele. Prin urmare, ar trebui aplicate anumite limite de toleranță, astfel încât diferențele minore dintre detaliile raportate privind SFT-urile să nu împiedice autoritățile să analizeze datele cu un nivel adecvat de încredere.
- (3) Este de așteptat ca entitățile care prezintă rapoarte să își îmbunătățească cu timpul calitatea raportării, atât în ceea ce privește reducerea numărului de rapoarte respinse, cât și în ceea ce privește rapoartele reconciliate. Cu toate acestea, entităților ar trebui să li se acorde timp suficient pentru a se adapta la cerințele în materie de raportare, în special pentru a preveni acumularea de tranzacții nereconciliate imediat după ce obligația de raportare va începe să se aplice. Prin urmare, este necesar ca, într-o primă etapă, numai un set redus de câmpuri să fie reconciliate.
- (4) Entitățile care prezintă rapoarte și entitățile responsabile cu raportarea, dacă este cazul, ar trebui să fie în măsură să își monitorizeze conformitatea cu obligațiile de raportare prevăzute în Regulamentul (UE) 2015/2365. Prin urmare, acestea ar trebui să aibă zilnic acces la anumite informații privind rapoartele respective, inclusiv în ceea ce privește rezultatul verificării rapoartelor, precum și în ceea ce privește progresele înregistrate în reconcilierea datelor raportate. Este deci necesar să se precizeze informațiile pe care registrele centrale de tranzacții ar trebui să le pună la dispoziția acestor entități la sfârșitul fiecărei zile lucrătoare.
- (5) Pentru a facilita integritatea detaliilor privind SFT-urile, accesul direct și imediat menționat la articolul 12 alineatul (2) din Regulamentul (UE) 2015/2365 ar trebui furnizat într-un mod armonizat și consecvent. Pentru a standardiza raportarea, a reduce la minimum costurile pentru sector și a asigura comparabilitatea și agregarea consecventă a datelor între registrele centrale de tranzacții, este necesar ca toate rapoartele de feedback și schimburile să se realizeze prin intermediul unor modele în format XML și să respecte o metodologie care este utilizată pe scară largă în sectorul financiar.
- (6) Accesul la datele la nivel de poziție privind expunerile între două contrapărți este esențial pentru a permite entităților menționate la articolul 12 alineatul (2) din Regulamentul (UE) 2015/2365 să determine sursele potențiale de riscuri sistemice sau nesistemice pentru stabilitatea financiară.
- (7) Pentru a asigura un nivel adecvat de transparență față de public în ceea ce privește SFT-urile, criteriile utilizate pentru agregarea pozițiilor ar trebui să permită publicului larg să înțeleagă funcționarea piețelor SFT-urilor, fără însă a submina confidențialitatea datelor raportate către registrele centrale de tranzacții. Frecvența și detaliile

⁽¹⁾ JO L 337, 23.12.2015, p. 1.

privind publicarea de către registrele centrale de tranzacții a pozițiilor agregate în temeiul articolului 12 alineatul (1) din Regulamentul (UE) 2015/2365 ar trebui să fie precizate într-un mod care să se bazeze pe cadrul corespunzător prevăzut de Regulamentul (UE) nr. 648/2012 al Parlamentului European și al Consiliului ⁽²⁾ în ceea ce privește contractele derivate.

- (8) Prezentul regulament se bazează pe proiectul de standarde tehnice de reglementare prezentat Comisiei de către Autoritatea Europeană pentru Valori Mobiliare și Piețe (ESMA) în conformitate cu procedura prevăzută la articolul 10 din Regulamentul (UE) nr. 1095/2010 al Parlamentului European și al Consiliului ⁽³⁾.
- (9) Dispozițiile din prezentul regulament se referă la standardele operaționale pentru colectarea, agregarea și compararea datelor de către registrele centrale de tranzacții, precum și la procedurile care trebuie aplicate de registrele centrale de tranzacții pentru a verifica caracterul complet și acuratețea detaliilor privind SFT-urile care le sunt raportate. Pentru a asigura coerența între respectivele dispoziții și pentru a facilita o imagine cuprinzătoare pentru registrele centrale de tranzacții, este de dorit ca standardele tehnice de reglementare corespunzătoare să fie incluse într-un singur regulament.
- (10) ESMA a organizat consultări publice deschise cu privire la acest proiect de standarde tehnice de reglementare, a analizat eventualele costuri și beneficii aferente și a solicitat punctul de vedere al Grupului părților interesate din domeniul valorilor mobiliare și piețelor din cadrul ESMA, instituit în conformitate cu articolul 37 din Regulamentul (UE) nr. 1095/2010,

ADOPTĂ PREZENTUL REGULAMENT:

Articolul 1

Verificarea rapoartelor SFT de către registrele centrale de tranzacții

- (1) Registrele centrale de tranzacții verifică toate caracteristicile următoare într-un raport SFT:
 - (a) identitatea entității care a prezentat raportul, astfel cum se menționează în tabelul 1 câmpul 2 din anexa I la Regulamentul de punere în aplicare (UE) 2019/363 al Comisiei ⁽⁴⁾;
 - (b) că modelul XML folosit la raportarea unui SFT respectă metodologia ISO 20022 în conformitate cu Regulamentul de punere în aplicare (UE) 2019/363;
 - (c) că entitatea care a prezentat raportul, în cazul în care este diferită de contrapartea raportoare menționată în tabelul 1 câmpul 3 din anexa I la Regulamentul de punere în aplicare (UE) 2019/363 este autorizată în mod corespunzător să raporteze în numele contrapărții raportoare, cu excepția cazului prevăzut la articolul 4 alineatul (3) din Regulamentul (UE) 2015/2365;
 - (d) că un anumit raport SFT nu a mai fost deja prezentat;
 - (e) că un raport SFT cu tipul de acțiune „Modificare” se referă la un raport SFT prezentat anterior;
 - (f) că un raport SFT cu tipul de acțiune „Modificare” nu se referă la un raport SFT care a fost raportat ca fiind anulat;
 - (g) că raportul SFT nu include tipul de acțiune „Nou” în ceea ce privește un SFT care a fost deja raportat;
 - (h) că raportul SFT nu include tipul de acțiune „Componentă a poziției” în ceea ce privește un SFT care a fost deja raportat;

⁽²⁾ 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 (JO L 201, 27.7.2012, p. 1).

⁽³⁾ 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), de modificare a Deciziei nr. 716/2009/CE și de abrogare a Deciziei 2009/77/CE a Comisiei (JO L 331, 15.12.2010, p. 84).

⁽⁴⁾ Regulamentul de punere în aplicare (UE) 2019/363 al Comisiei din 13 decembrie 2018 de stabilire a unor standarde tehnice de punere în aplicare în ceea ce privește formatul și frecvența rapoartelor referitoare la detaliile operațiunilor de finanțare prin instrumente financiare (SFT) transmise către registrele centrale de tranzacții în conformitate cu Regulamentul (UE) 2015/2365 al Parlamentului European și al Consiliului și de modificare a Regulamentului de punere în aplicare (UE) nr. 1247/2012 al Comisiei în ceea ce privește utilizarea codurilor de raportare în raportarea contractelor derivate (a se vedea pagina 85 din prezentul Jurnal Oficial).

- (i) că raportul SFT nu își propune să modifice detaliile entității care a prezentat raportul, ale contrapărții raportoare sau ale celeilalte contrapărți la un SFT raportat anterior;
- (j) că raportul SFT nu își propune să modifice un raport SFT existent specificând o dată a valutei ulterioară datei scadenței SFT-ului care a fost raportată;

(k) caracterul complet și acuratețea raportului SFT.

(2) Registrele centrale de tranzacții verifică dacă au fost raportate informații despre garanțiile reale în tabelul 2 câmpurile 73-96 din anexa I la Regulamentul de punere în aplicare (UE) 2019/363 pentru SFT-urile în cazul cărora câmpul 72 „Codul «SL» pentru împrumuturi cu titluri de valoare negarantate” din același tabel este raportat ca „fals”. Registrul central de tranzacții notifică rezultatul verificării, în conformitate cu articolul 3 din prezentul regulament, entității care a prezentat raportul și contrapărții raportoare, precum și entității responsabile cu raportarea, dacă este cazul.

(3) Registrele centrale de tranzacții resping orice raport SFT care nu respectă una dintre cerințele stabilite la alineatul (1) și îi atribuie una dintre categoriile de respingere stabilite în tabelul 2 din anexa I la prezentul regulament.

(4) Registrele centrale de tranzacții furnizează entității care a prezentat raportul și contrapărții raportoare, precum și entității responsabile cu raportarea, dacă este cazul, informații detaliate privind rezultatele verificării datelor menționate la alineatul (1) în termen de 60 de minute după ce au primit un raport SFT. Registrele centrale de tranzacții furnizează aceste rezultate în format XML și pe baza unui model elaborat în conformitate cu metodologia ISO 20022. Rezultatele includ, după caz, motivele specifice ale respingerii unui raport SFT în conformitate cu alineatul (3).

Articolul 2

Reconcilierea datelor de către registrele centrale de tranzacții

(1) Registrele centrale de tranzacții încearcă să reconcilieze un SFT raportat efectuând pașii prevăzuți la alineatul (2), dacă toate condițiile de mai jos sunt îndeplinite:

- (a) registrul central de tranzacții a efectuat verificările prevăzute la articolul 1 alineatele (1) și (2);
- (b) ambele contrapărți la SFT-ul raportat au o obligație de raportare;
- (c) registrul central de tranzacții nu a primit un raport ulterior cu tipul de acțiune „Eroare” în ceea ce privește SFT-ul raportat.

(2) În cazul în care sunt îndeplinite condițiile de la alineatul (1), registrul central de tranzacții parcurge pașii următori, utilizând cele mai recente valori raportate pentru fiecare dintre câmpurile specificate în tabelul 1 din anexa I la prezentul regulament:

- (a) un registru central de tranzacții care a primit un raport SFT verifică dacă a primit un raport SFT corespunzător din partea sau în numele celeilalte contrapărți;
- (b) un registru central de tranzacții care nu a primit un raport SFT corespunzător, astfel cum este menționat la litera (a), încearcă să identifice registrul central de tranzacții care a primit raportul SFT corespunzător, comunicând către toate registrele centrale de tranzacții înregistrate valorile următoarelor câmpuri ale SFT-ului raportat: „Identificatorul unic al tranzacției”, „Contrapartea raportoare”, „Cealaltă contraparte” și „Tipul de acord-cadru”;
- (c) un registru central de tranzacții care stabilește că un alt registru central de tranzacții a primit raportul SFT corespunzător, astfel cum este menționat la litera (a), comunică cu registrul respectiv privind detaliile SFT-ului raportat, în format XML și pe baza unui model elaborat în conformitate cu metodologia ISO 20022;
- (d) sub rezerva literei (e), registrele centrale de tranzacții tratează un SFT raportat ca fiind reconciliat în cazul în care detaliile referitoare la SFT-ul respectiv se corelează cu detaliile raportului SFT corespunzător, astfel cum se menționează la prezentul alineat litera (a);
- (e) un registru central de tranzacții încearcă să coreleze separat câmpurile referitoare la datele privind împrumuturile și câmpurile referitoare la datele privind garanțiile reale ale unui SFT raportat în conformitate cu limitele de toleranță și cu datele relevante de aplicare stabilite în tabelul 1 din anexa I la prezentul regulament;

- (f) un registru central de tranzacții atribuie ulterior anumite valori categoriilor de reconciliere pentru fiecare SFT raportat, astfel cum se prevede în tabelul 3 din anexa I la prezentul regulament;
 - (g) un registru central de tranzacții parcurge pașii de la prezentul alineat literele (a)-(f) în cel mai scurt timp posibil și nu mai întreprinde astfel de pași după ora 18:00 UTC a unei anumite zile lucrătoare;
 - (h) un registru central de tranzacții care nu poate reconcilia un SFT raportat încearcă să coreleze în ziua lucrătoare următoare detaliile respectivului SFT raportat. După treizeci de zile calendaristice de la scadența raportată a SFT-ului sau după ce registrul central de tranzacții a primit un raport cu privire la acesta cu tipul de acțiune „Încetare” sau „Componentă a poziției”, registrul central de tranzacții nu mai încearcă să reconcilieze SFT-ul raportat.
- (3) La sfârșitul fiecărei zile lucrătoare, registrele centrale de tranzacții confirmă numărul total de SFT-uri raportate care au fost reconciliate fiecărui registru central de tranzacții cu care au reconciliat SFT-uri raportate.
- (4) În termen de cel mult 60 de minute de la încheierea procesului de reconciliere, astfel cum se prevede la alineatul (2) litera (g), registrele centrale de tranzacții furnizează entității care a prezentat raportul și contrapărții raportoare, precum și entității responsabile cu raportarea, dacă este cazul, rezultatele procesului de reconciliere pe care l-au efectuat cu privire la SFT-urile raportate. Registrele centrale de tranzacții furnizează aceste rezultate în format XML și pe baza unui model elaborat în conformitate cu metodologia ISO 20022, incluzând informații cu privire la câmpurile care nu au fost reconciliate.

Articolul 3

Mecanisme de răspuns de la sfârșitul zilei

Înainte de sfârșitul fiecărei zi lucrătoare, registrele centrale de tranzacții pun la dispoziția entității care a prezentat raportul și contrapărții raportoare, precum și entității responsabile cu raportarea, dacă este cazul, următoarele informații privind SFT-urile relevante în format XML și pe baza unui model elaborat în conformitate cu metodologia ISO 20022:

- (a) SFT-urile raportate în cursul zilei respective;
- (b) cele mai recente stadii de tranzacționare ale SFT-urilor care nu au ajuns la scadență sau care nu au făcut obiectul unui raport cu tipul de acțiune „Eroare”, „Încetare” sau „Componentă a poziției”;
- (c) identificatorii unici ai tranzacțiilor („UTI”) aferenți SFT-urilor în cazul cărora câmpul 72 din tabelul 2 din anexa I la Regulamentul de punere în aplicare (UE) 2019/363 este raportat ca „fals” și în cazul cărora nu au fost încă raportate informații despre garanțiile reale în câmpurile 73-96 din același tabel;
- (d) rapoartele SFT care au fost respinse în cursul zilei respective;
- (e) statutul reconcilierii aferent tuturor SFT-urilor raportate, cu excepția SFT-urilor care au expirat sau pentru care au fost primite rapoarte cu tipul de acțiune „Încetare” sau „Componentă a poziției” cu mai mult de o lună înainte de acea zi lucrătoare.

Articolul 4

Accesul la detaliile privind SFT-urile

Registrele centrale de tranzacții asigură entităților enumerate la articolul 12 alineatul (2) din Regulamentul (UE) 2015/2365 accesul direct și imediat, inclusiv în cazul delegării în temeiul articolului 28 din Regulamentul (UE) nr. 1095/2010, la detaliile privind SFT-urile, într-un format electronic care poate fi citit automat, în conformitate cu Regulamentul delegat (UE) 2019/357 al Comisiei ⁽⁵⁾.

În sensul primului paragraf, un registru central de tranzacții trebuie să utilizeze un format XML și un model elaborat în conformitate cu metodologia ISO 20022.

⁽⁵⁾ Regulamentul delegat (UE) 2019/357 al Comisiei din 13 decembrie 2018 de completare a Regulamentului (UE) 2015/2365 al Parlamentului European și al Consiliului în ceea ce privește standardele tehnice de reglementare referitoare la accesul la informații detaliate privind operațiunile de finanțare prin instrumente financiare (*securities financing transactions* – SFT) stocate de registrele centrale de tranzacții (a se vedea pagina 22 din prezentul Jurnal Oficial).

Articolul 5

Calcularea datelor la nivel de poziție și accesul la acestea

(1) Registrele centrale de tranzacții calculează datele la nivel de poziție cu privire la expunerile între contrapărți în ceea ce privește împrumuturile și garanțiile reale. Calcularea datelor la nivel de poziție se bazează pe următoarele criterii:

- (a) valorile pentru categoriile de reconciliere, în conformitate cu tabelul 3 din anexa I la prezentul regulament;
- (b) tipul de SFT;
- (c) sectorul contrapărților;
- (d) statutul compensării;
- (e) dacă SFT-ul a fost încheiat sau nu într-un loc de tranzacționare;
- (f) tipul de garanție reală;
- (g) moneda operațiunii aferente transferurilor fondurilor bănești;
- (h) tranșa de scadență;
- (i) tranșa marjei de ajustare;
- (j) registrele centrale de tranzacții cărora cealaltă contraparte le-a raportat detaliile privind SFT-ul.

(2) Registrele centrale de tranzacții se asigură că entitățile menționate la articolul 12 alineatul (2) din Regulamentul (UE) 2015/2365 au acces la datele la nivel de poziție în conformitate cu accesul la date specificat în Regulamentul delegat (UE) 2019/357.

(3) Datele la nivel de poziție menționate la alineatul (1) se furnizează într-un format electronic care poate fi citit automat, utilizând un format XML și un model elaborat în conformitate cu metodologia ISO 20022.

(4) Accesul menționat la alineatul (2) se acordă în cel mai scurt timp posibil și cel târziu în ziua lucrătoare care urmează primirii unui raport SFT în temeiul articolului 4 alineatul (1) din Regulamentul (UE) 2015/2365.

(5) Registrele centrale de tranzacții asigură entităților menționate la articolul 12 alineatul (2) din Regulamentul (UE) 2015/2365 accesul la datele la nivel agregat, în conformitate cu accesul la date specificat în Regulamentul delegat (UE) 2019/357, calculate în conformitate cu standardele și cu procesele pentru colectarea și agregarea globală a datelor privind SFT-urile stabilite de comun acord.

Articolul 6

Calcularea datelor agregate privind pozițiile în scopul publicării

(1) Registrele centrale de tranzacții agregă datele privind pozițiile în conformitate cu criteriile menționate la alineatele (2) și (3) în ceea ce privește următoarele valori:

- (a) valoarea principalului din acordurile repo, tranzacțiile de tipul „buy-sell back” sau „sellbuy back”, cantitatea agregată a titlurilor de valoare sau a mărfurilor date sau luate cu împrumut și cuantumul împrumuturilor în marjă;
- (b) numărul de UTI referitori la SFT-urile relevante;
- (c) valoarea de piață a garanțiilor reale.

(2) Registrele centrale de tranzacții agregă datele privind pozițiile pentru toate SFT-urile raportate cu tipul de acțiune „Nou” între ziua de sâmbătă, ora 00.00.00 UTC, și ziua de vineri, ora 23.59.59 UTC, pe baza criteriilor de mai jos și a valorilor aferente stabilite în tabelul 1 din anexa II la prezentul regulament:

- (a) localizarea contrapărții raportoare sau, după caz, a sucursalei relevante;
- (b) localizarea celeilalte contrapărți sau, după caz, a sucursalei relevante;
- (c) tipul de SFT;
- (d) statutul reconcilierii SFT-ului, astfel cum se prevede în tabelul 3 din anexa I la prezentul regulament;

- (e) tipul locului în care a fost încheiat SFT-ul;
 - (f) dacă SFT-ul a fost lichidat sau nu;
 - (g) metoda prin care garanțiile reale au fost transferate;
 - (h) fiecare indice utilizat ca referință în cadrul unui SFT, tranzacționat într-un loc de executare diferit de „XXXX”, în cazul în care valoarea nominală agregată raportată către registrul central de tranzacții în indice este mai mare de 5 miliarde EUR și dacă există cel puțin șase contrapărți diferite care au raportat SFT-urile relevante registrului central de tranzacții.
- (3) Registrele centrale de tranzacții agregă datele privind pozițiile pentru toate SFT-urile care nu au ajuns la scadență sau care nu au făcut obiectul unui raport cu tipul de acțiune „Eroare”, „Încetare” sau „Componentă a poziției”, până în ziua de vineri, ora 23.59.59 UTC, pe baza criteriilor de mai jos și a valorilor aferente stabilite în tabelul 1 din anexa II la prezentul regulament:
- (a) localizarea contrapărții raportoare sau, după caz, a sucursalei relevante;
 - (b) localizarea celeilalte contrapărți sau, după caz, a sucursalei relevante;
 - (c) tipul de SFT;
 - (d) statutul reconcilierii SFT-ului, astfel cum se prevede în tabelul 3 din anexa I la prezentul regulament;
 - (e) tipul locului în care a fost încheiat SFT-ul;
 - (f) dacă SFT-ul a fost lichidat sau nu;
 - (g) metoda prin care au fost transferate garanțiile reale;
 - (h) fiecare indice utilizat ca referință în cadrul unui SFT, tranzacționat într-un loc de executare diferit de „XXXX”, în cazul în care valoarea nominală agregată raportată către registrul central de tranzacții în indice este mai mare de 5 miliarde EUR și dacă există cel puțin șase contrapărți diferite care au raportat SFT-ul relevant registrului central de tranzacții.
- (4) Registrele centrale de tranzacții trebuie să dispună de o procedură prin care să identifice valorile extraordinare referitoare la datele agregate privind pozițiile.
- (5) Registrele centrale de tranzacții trebuie să dispună de o procedură prin care să aducă corecturi datelor agregate privind pozițiile și să notifice aceste corecturi, inclusiv pe cele provenind din rapoarte cu tipul de acțiune „Eroare”, și să publice agregările de date originale și pe cele corectate.

Articolul 7

Publicarea datelor agregate privind pozițiile

- (1) Registrele centrale de tranzacții publică pe site-ul lor web datele agregate privind pozițiile, calculate în conformitate cu articolul 6, săptămânal și cel târziu până în ziua de marți la prânz pentru SFT-urile raportate înainte de ora 23.59.59 UTC din ziua de vineri anterioară.
- (2) Registrele centrale de tranzacții publică toate datele agregate privind pozițiile în euro și utilizează ratele de schimb publicate pe site-ul web al BCE în ziua de vineri care precede publicarea acestor date.
- (3) Registrele centrale de tranzacții se asigură că datele agregate privind pozițiile sunt publicate în formatul tabelar care este prevăzut în anexa II la prezentul regulament și care permite descărcarea datelor.
- (4) Datele agregate privind pozițiile pe care un registru central de tranzacții le-a publicat pe site-ul său web rămân pe site-ul respectiv timp de cel puțin 104 săptămâni.

Articolul 8

Intrarea în vigoare

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

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

Adoptat la Bruxelles, 13 decembrie 2018.

Pentru Comisie
Președintele
Jean-Claude JUNKER

ANEXA I

Tabelul 1

Câmpurile de reconciliere, nivelurile de toleranță și data de începere a etapei de reconciliere

Tabel	Secțiune	Câmp	Toleranță	Data de începere menționată la:
Date privind contrapărțile	N/A	Contraparte raportoare	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind contrapărțile	N/A	Calitatea contrapărții	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind contrapărțile	N/A	Alte contrapărți	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Identificatorul unic al tranzacției	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Tipul de SFT	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Compensat	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Marca temporală a compensării	O oră	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Împrumut	CPC	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Loc de tranzacționare	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Tipul de acord-cadru	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Marca temporală a executării	o oră	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Data valutei (Data de începere)	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Data scadenței (Data expirării)	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Data încetării	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Perioada minimă de preaviz	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Prima dată de rambursare anticipată	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Indicatorul garanțiilor generale	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni

Tabel	Secțiune	Câmp	Toleranță	Data de începere menționată la:
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Indicatorul mecanismului „Delivery By Value” (DBV)	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Metoda utilizată pentru a oferi garanțiile reale	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Termen deschis	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Opționalitate privind încetarea	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Rată fixă	Până la a treia zecimală după virgulă	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Convenția de numărare a zilelor	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Rată variabilă	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Perioada de referință pentru rata variabilă – perioadă de timp	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Perioada de referință pentru rata variabilă – multiplicator	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Frecvența de plată a ratei variabile – perioadă de timp	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Frecvența de plată a ratei variabile – multiplicator	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Frecvența de revizuire a ratei variabile – perioada de timp	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Frecvența de revizuire a ratei variabile - multiplicator	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Marjă	Până la a treia zecimală după virgulă	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Valoarea monetară a creditării în marjă	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Moneda creditării în marjă	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365

Tabel	Secțiune	Câmp	Toleranță	Data de începere menționată la:
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Rata ajustată	Până la a treia zecimală după virgulă	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Data de aplicare a ratei	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Valoarea principalului la data valutei	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Valoarea principalului la data scadenței	0,0005 %	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Moneda în care este exprimată valoarea principalului	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Tipul activului	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Identificatorul titlului de valoare	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Clasificarea unui titlu de valoare	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Produs de bază	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Subprodus	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Detalii subprodus	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Cantitatea sau valoarea nominală	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Unitate de măsură	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Moneda în care este exprimată valoarea nominală	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Prețul titlului de valoare sau al mărfii	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Moneda în care este exprimat prețul	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Calitatea titlului de valoare	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Scadența titlului de valoare	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365

Tabel	Secțiune	Câmp	Toleranță	Data de începere menționată la:
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Jurisdicția emitentului	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Codul LEI al emitentului	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Tipul de titlu de valoare	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Valoarea împrumutului	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Valoarea de piață	0,0005 %	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Rata de rebate fixă	Până la a treia zecimală după virgulă	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Rata de rebate variabilă	Până la a treia zecimală după virgulă	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Perioada de referință pentru rata de rebate variabilă – perioadă de timp	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Perioada de referință pentru rata de rebate variabilă – multiplicator	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Frecvența de plată a ratei de rebate variabile – perioadă de timp	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Frecvența de plată a ratei de rebate variabile – multiplicator	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Frecvența de revizuire a ratei de rebate variabile – perioadă de timp	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Frecvența de revizuire a ratei de rebate variabile – multiplicator	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Marja ratei de rebate	Până la a treia zecimală după virgulă	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Taxa de împrumut	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365

Tabel	Secțiune	Câmp	Toleranță	Data de începere menționată la:
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Acorduri de exclusivitate	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Împrumut în marjă acordat	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Moneda de bază în care este exprimat împrumutul în marjă acordat	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Valoarea de piață a pozițiilor scurte	0,0005 %	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Garanții reale	Codul „SL” (<i>Securities Lending</i>) pentru împrumuturi de titluri de valoare negarantate	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Garanții reale	Colateralizarea expunerii nete	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Garanții reale	Data valutei garanției reale	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Garanții reale	Tipul de componentă a garanției reale	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Garanții reale	Cuantumul garanției în numerar	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Garanții reale	Moneda garanției în numerar	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Garanții reale	Identificarea unui titlu de valoare utilizat ca garanție reală	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Garanții reale	Clasificarea unui titlu de valoare utilizat ca garanție reală	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Garanții reale	Produs de bază	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Garanții reale	Subprodus	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Garanții reale	Detalii subprodus	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (iv) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Garanții reale	Cantitatea sau valoarea nominală a garanției reale	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Garanții reale	Unitatea de măsură a garanției reale	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni

Tabel	Secțiune	Câmp	Toleranță	Data de începere menționată la:
Date privind tranzacțiile	Garanții reale	Moneda în care este exprimată valoarea nominală a garanției reale	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Garanții reale	Moneda în care este exprimat prețul	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Garanții reale	Preț unitar	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Garanții reale	Valoarea de piață a garanției reale	0,0005 %	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365 + 24 de luni
Date privind tranzacțiile	Garanții reale	Marja de ajustare sau marja	Până la a treia zecimală după virgulă	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Garanții reale	Calitatea garanției reale	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Garanții reale	Data scadenței titlului de valoare	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Garanții reale	Jurisdicția emitentului	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Garanții reale	Codul LEI al emitentului	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Garanții reale	Tipul de garanție reală	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Garanții reale	Disponibilitatea reutilizării garanțiilor reale	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Garanții reale	Identificatorul portofoliului de garanții reale	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365
Date privind tranzacțiile	Împrumut	Nivel	Nu	Articolul 33 alineatul (2) litera (a) punctul (i) din Regulamentul (UE) 2015/2365

Tabelul 2

Motivele respingerii unui raport SFT

Categorii de respingere	Motiv
Schemă	— SFT-ul a fost respins din cauza unei scheme neconforme
Permișiune	— SFT-ul a fost respins deoarece entitatea care a prezentat raportul nu are permișiunea de a raporta în numele contrapărții raportoare
Logică	— SFT-ul a fost respins deoarece tipul de acțiune aferent SFT-ului nu este corect din punct de vedere logic
Activitate economică	— SFT-ul a fost respins deoarece nu respectă una sau mai multe validări privind conținutul.

Tabelul 3

Rezultatele procesului de reconciliere

Categorii de reconciliere	Valori de reconciliere
Tip de raportare	O singură parte/două părți
Obligație de raportare pentru ambele contrapărți	Da/Nu
Realizarea punerii în corespondență	Realizat/Nerealizat
Statutul reconcilierii împrumutului	Reconciliat/Nereconciliat
Statutul reconcilierii garanției reale	Reconciliat/Nereconciliat
Modificări suplimentare	Da/Nu

ANEXA II

Tabelul 1

Date publice

Tabelul A. Agregare

Data	Registru central de tran- zacții (TR)	Tip de agregare	Tip de loc	Localizarea contrapărții raportoare	Localizarea celeilalte contrapărți	Reconciliere	Tip de SFT	Compen- sat	Metoda de transfer al garanțiilor reale	Indice utilizat drept refe- rință ⁽¹⁾	Cuantumul agregat împrumutat	Numărul agregat al tranzacțiilor	Valoarea agregată a garanției reale
20161007	TR UE	Raportat	XXXX	SEE	SEE	Două părți, împru- mut – reconciliat, garanție reală – ne- reconciliat	Repo	Da	TTCA		...		...
...	...	În curs	XOFF	În afara SEE	În afara SEE	Două părți, împru- mut – reconciliat, garanție reală – re- conciliat	BSB/SBB	Nu	SICA		...		...
...	...	...	MIC SEE	...	...	O singură parte SEE, împrumut – recon- ciliat, garanție reală – reconciliat	Dare sau luare cu împrumut de titluri de valoare și mărfuri	...	SIUR		...		...
...	...	...	MIC din afara SEE	...	...	...	Creditare în marjă	...			...		...
...	...	...	...	...	...	...	...	...	...	...	...	...	...

⁽¹⁾ A se completa cu indicii relevanți incluși în câmpul 25 din tabelul 2 „Date privind împrumuturile și garanțiile reale” din anexa I la Regulamentul de punere în aplicare (UE) 2019/363.