

## VYKONÁVACIE NARIADENIE KOMISIE (EÚ) č. 1249/2012

z 19. decembra 2012,

ktorým sa stanovujú vykonávacie technické normy, pokiaľ ide o formát záznamov uchovávaných centrálnymi protistranami podľa nariadenia Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 648/2012 o mimoburzových derivátoch, centrálnych protistranách a archívoch obchodných údajov

(Text s významom pre EHP)

EURÓPSKA KOMISIA,

strany pokiaľ možno čo najviac používali štandardizované postupy a formáty údajov.

so zreteľom na Zmluvu o fungovaní Európskej únie,

- (5) Podkladové aktívum by sa malo identifikovať pomocou jedného identifikátora, v súčasnosti však na identifikovanie podkladových aktív v rámci koša neexistuje štandardizovaný kód pre celý trh. Centrálna protistrana by preto mali uviesť aspoň to, že podkladovým aktívom je kôš a tam, kde je to možné, by pre štandardizované indexy mali použiť medzinárodné identifikačné čísla cenných papierov (ISIN).

so zreteľom na stanovisko Európskej centrálnej banky <sup>(1)</sup>,

- (6) Toto nariadenie vychádza z návrhu vykonávacích technických noriem, ktoré Komisii predložil Európsky orgán pre cenné papiere a trhy (ESMA).

so zreteľom na nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 648/2012 zo 4. júla 2012 o mimoburzových derivátoch, centrálnych protistranách a archívoch obchodných údajov <sup>(2)</sup>, a najmä na jeho článok 29 ods. 5,

keďže:

- (1) V súlade s článkom 29 ods. 4 nariadenia (EÚ) č. 648/2012, článkami 13, 14 a 15 delegovaného aktu, pokiaľ ide o regulačné technické normy, ktorými sa spresňujú údaje o záznamoch a informáciách, ktoré majú uchovávať centrálna protistrana, prijaté podľa článku 29 ods. 4 nariadenia (EÚ) č. 648/2012, by sa mali stanoviť aj pravidlá na spresnenie formátu záznamov a informácií uchovávaných v súlade s týmito článkami.

- (7) V súlade s článkom 15 nariadenia Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 1095/2010 z 24. novembra 2010, ktorým sa zriaďuje Európsky orgán dohľadu (Európsky orgán pre cenné papiere a trhy) <sup>(3)</sup>, orgán ESMA pred predložením návrhu vykonávacích technických noriem, z ktorého toto nariadenie vychádza, uskutočnil otvorené verejné konzultácie, analyzoval možné súvisiace náklady a prínosy a požiadal o stanovisko Skupinu zainteresovaných strán v oblasti cenných papierov a trhov ustanovenú v súlade s článkom 37 nariadenia (EÚ) č. 1095/2010,

- (2) Príslušným orgánom by sa na účinné a konzistentné plnenie ich povinností mali poskytnúť údaje, ktoré sú porovnateľné v rámci centrálnych protistrán. Používaním spoločných formátov sa zároveň uľahčuje zosúladovanie údajov medzi centrálnymi protistranami.

PRIJALA TOTO NARIADENIE:

## Článok 1

## Formáty záznamov

- (3) Od centrálnej protistrany by sa malo vyžadovať, aby na účely uchovávania záznamov zachovávala údaje vo formáte, ktorý je zlučiteľný s formátom, v ktorom sa uchovávajú údaje v archívoch obchodných údajov, s prihliadnutím na skutočnosť, že za určitých okolností musia centrálna protistrana a archívy obchodných údajov uchovávať alebo ohlasovať rovnaké informácie. Používaním spoločného formátu v jednotlivých infraštruktúrach finančného trhu sa uľahčí rozsiahlejšie využívanie týchto formátov celým radom účastníkov trhu, čím sa podporí štandardizácia.
- (4) Na uľahčenie priameho spracúvania a znižovania nákladov účastníkov trhu je dôležité, aby centrálna proti-

1. Centrálna protistrana uchováva záznamy uvedené v článku 20 delegovaného aktu, pokiaľ ide o regulačné technické normy o požiadavkách spresňujúcich údaje o záznamoch a informáciách, ktoré majú uchovávať centrálna protistrana, prijaté podľa článku 29 ods. 4 nariadenia (EÚ) č. 648/2012, pre každú spracúvanú zmluvu vo formáte stanovenom v tabuľke 1 v prílohe.

2. Centrálna protistrana uchováva záznamy uvedené v článku 21 delegovaného aktu, pokiaľ ide o regulačné technické normy o požiadavkách spresňujúcich údaje o záznamoch a informáciách, ktoré majú uchovávať centrálna protistrana, prijaté podľa článku 29 ods. 4 nariadenia (EÚ) č. 648/2012, pre každú pozíciu vo formáte stanovenom v tabuľke 2 v prílohe.

<sup>(1)</sup> Zatiaľ neuverejnená v úradnom vestníku.

<sup>(2)</sup> Ú. v. EÚ L 201, 27.7.2012, s. 1.

<sup>(3)</sup> Ú. v. EÚ L 331, 15.12.2010, s. 84.

3. Centrálna protistrana uchováva záznamy uvedené v článku 22 delegovaného aktu, pokiaľ ide o regulačné technické normy o požiadavkách spresňujúcich údaje o záznamoch a informáciách, ktoré majú uchovávať centrálna protistrana, prijatého podľa článku 29 ods. 4 nariadenia (EÚ) č. 648/2012, pre činnosti súvisiace s jej obchodnou a vnútornou organizáciou vo formáte stanovenom v tabuľke 3 v prílohe.

4. Centrálna protistrana predloží príslušnému orgánu záznamy a informácie podľa odseku 1, 2 a 3 vo formáte,

ktorý umožňuje priamy tok údajov medzi centrálnou protistranou a príslušným orgánom. Centrálna protistrana vytvorí tento tok údajov do šiestich mesiacov od žiadosti príslušného orgánu.

#### Článok 2

#### **Nadobudnutie účinnosti**

Toto nariadenie nadobúda účinnosť dvadsiatym dňom po jeho uverejnení v *Úradnom vestníku Európskej únie*.

Toto nariadenie je záväzné v celom rozsahu a priamo uplatniteľné vo všetkých členských štátoch.

V Bruseli 19. decembra 2012

Za Komisiu  
predseda  
José Manuel BARROSO

## PRÍLOHA

## Tabuľky polí, ktoré sa majú zaznamenať podľa článku 1

Tabuľka 1

## Záznamy o spracúvaných transakciách

	Pole	Formát	Opis
1	Časová pečiatka ohlásenia	Formát dátumu podľa ISO 8601/formát času podľa UTC.	Dátum a čas ohlásenia.
2	Cena/sadzba	Maximálne 20 číslíc vo formáte xxxx.yyyyy.	Cena za cenný papier alebo zmluvu o derivátoch bez provízie a (prípadne) vzniknutého úroku. V prípade dlhového nástroja sa cena môže vyjadriť z hľadiska meny alebo ako percento.
2a	Označenie ceny	Napr. kód meny podľa ISO 4217, 3 abecedné znaky, percento.	Spôsob, akým je vyjadrená cena.
3	Nominálna mena	Kód meny podľa ISO 4217, 3 abecedné znaky.	Mena, v ktorej je vyjadrená cena. Ak je cena v prípade dlhopisu alebo inej formy sekuritizovaného dlhu vyjadrená ako percento, toto percento sa musí uviesť.
3a	Mena dodania	Kód meny podľa ISO 4217, 3 abecedné znaky.	Mena, ktorá sa má dodať.
4	Množstvo	Maximálne 10 číslíc.	Počet jednotiek finančných nástrojov, nominálna hodnota dlhopisov alebo počet zmlúv o derivátoch zahrnutých do transakcie.
5	Označenie množstva	Maximálne 10 číslíc.	Údaj o tom, či množstvo predstavuje počet jednotiek finančných nástrojov, nominálnu hodnotu dlhopisov alebo počet zmlúv o derivátoch.
6	Strana centrálnej protistrany	B = Nákupca / S = Predajca.	
7	ID produktu	Dočasná taxonómia v súlade s informáciou v článku 4 nariadenia (ES) xx/2012 [návrh vykonávacích technických noriem týkajúcich sa formátu a frekvencie obchodných hlásení pre archívy obchodných údajov], číslo ISIN alebo a jedinečný identifikátor produktu (UPI).	Zmluva sa identifikuje prostredníctvom identifikátora produktu, ak je k dispozícii.
8	ID zúčtovacieho člena	Identifikátor právneho subjektu (LEI) (20 alfanumerických znakov), identifikátor dočasného subjektu (20 alfanumerických znakov), kód BIC (11 alfanumerických znakov) alebo kód klienta (50 alfanumerických znakov).	V prípade, že oznamujúca protistrana nie je zúčtovacím členom, jej zúčtovací člen sa identifikuje v tomto poli jedinečným kódom. V prípade jednotlivca sa použije kód klienta, aký bol priradený centrálnou protistranou.

	Pole	Formát	Opis
9	ID príjemcu	Identifikátor právneho subjektu (LEI) (20 alfanumerických znakov), identifikátor dočasného subjektu (20 alfanumerických znakov), kód BIC (11 alfanumerických znakov) alebo kód klienta (50 alfanumerických znakov).	Ak príjemcom v rámci zmluvy nie je protistrana tejto zmluvy, musí sa identifikovať jedinečným kódom alebo v prípade jednotlivcov kódom klienta, aký mu bol pridelený právnym subjektom, ktorý jednotlivec využíva.
10	Strana, ktorá previedla zmluvu (v prípade prenechania)	Identifikátor právneho subjektu (LEI) (20 alfanumerických znakov), identifikátor dočasného subjektu (20 alfanumerických znakov), kód BIC (11 alfanumerických znakov) alebo kód klienta (50 alfanumerických znakov).	
11	Miesto vykonávania	Identifikačný kód trhu (MIC) podľa ISO 10383 v prípade potreby, XOFF pre deriváty kótované na burze, s ktorými sa obchoduje mimo burzy alebo XXXX pre mimoburzové deriváty.	Identifikácia miesta, kde sa transakcia vykonala. V prípade zmluvy uzatvorenej mimo burzy sa musí identifikovať, či je príslušný nástroj prijatý na obchodovanie, ale je obchodovaný mimo burzy, alebo nie je prijatý na obchodovanie a je obchodovaný mimo burzy.
12	Dátum interpozície	Formát dátumu podľa ISO 8601.	Deň, kedy sa vykonala interpozícia centrálnej protistrany.
13	Čas interpozície	Formát času podľa UTC.	Čas, keď sa vykonala interpozícia centrálnej protistrany v zmluve, oznámený v miestnom čase príslušného orgánu, ktorému sa transakcia bude oznamovať, a základ, v ktorom sa transakcia oznamuje, vyjadrený ako koordinovaný svetový čas (UTC) +/- hodiny.
14	Dátum ukončenia zmluvy	Formát dátumu podľa ISO 8601.	Deň, v ktorý došlo k ukončeniu zmluvy.
15	Čas ukončenia zmluvy	Formát času podľa UTC.	Čas ukončenia zmluvy oznámený v miestnom čase príslušného orgánu, ktorému sa transakcia bude oznamovať, a základ, v ktorom sa transakcia oznamuje, vyjadrený ako koordinovaný svetový čas (UTC) +/- hodiny.
16	Typ dodania	C = hotovosť, P = fyzické, O = voliteľné pre protistranu.	Údaj o tom, či je zmluva vyrovnaná fyzicky alebo v hotovosti.
17	Dátum vyrovnania	Formát dátumu podľa ISO 8601.	Deň, keď sa vykonáva vyrovnanie alebo nákup podľa zmluvy. Ak ide o viac ako jeden deň, môžu sa identifikovať ďalšie polia.
18	Čas vyrovnania alebo nákupu v zmluve	Formát času podľa UTC.	Deň, keď sa vykonáva vyrovnanie alebo nákup podľa zmluvy, oznámený v miestnom čase príslušného orgánu, ktorému sa transakcia bude oznamovať a základ, v ktorom sa transakcia oznamuje, vyjadrený ako koordinovaný svetový čas (UTC) +/- hodiny.

	Pole	Formát	Opis
Podrobné údaje o pôvodných podmienkach zúčtovaných zmlúv sa poskytnú v rozsahu, v akom sú uplatniteľné.			
19	Dátum	Formát dátumu podľa ISO 8601.	Deň pôvodného uzatvorenia zmluvy.
20	Čas	Formát času podľa UTC.	Čas uzatvorenia pôvodnej zmluvy oznámený v miestnom čase príslušného orgánu, ktorému sa transakcia bude oznamovať, a základ, v ktorom sa transakcia oznamuje, vyjadrený ako koordinovaný svetový čas (UTC) +/- hodiny.
21	ID produktu	Dočasná taxonómia v súlade s informáciou v článku 4 nariadenia (ES) xx/2012 [návrh vykonávacích technických noriem týkajúcich sa formátu a frekvencie obchodných hlásení pre archívy obchodných údajov], číslo ISIN alebo a jedinečný identifikátor produktu (UPI).	Zmluva sa identifikuje prostredníctvom jedinečného identifikátora produktu, ak je k dispozícii.
22	Podkladové aktívum	Jedinečný identifikátor produktu, číslo ISIN (12 alfanumerických znakov) a CFI (6 alfanumerických znakov). Identifikátor právneho subjektu (LEI) (20 alfanumerických znakov), identifikátor dočasného subjektu (20 alfanumerických znakov), B = Kôš alebo I = Index.	Identifikácia nástroja uplatniteľná na cenný papier, ktorý je podkladovým aktívom v zmluve o deriváte, ako aj prevoditeľný cenný papier, ktorý patrí pod článok 4 ods.1 bod 18 písm. c) smernice 2004/39/ES.
23	Druh derivátu (v prípade zmluvy o derivátoch)	Harmonizovaný opis druhu derivátu by sa mal uskutočniť v súlade s jednou z kategórií najvyššej úrovne, ako ich stanovuje jednotný medzinárodne uznávaný štandard klasifikácie finančných nástrojov.	
24	Začlenenie nástroja do registra zmlúv orgánu ESMA, ktoré podliehajú zúčtovacej povinnosti (v prípade zmluvy o deriváte)	Y = Áno / N = Nie.	
Iné informácie, ktoré sa poskytnú v rozsahu, v akom sú uplatniteľné.			
25	Identifikácia interoperabilnej centrálnej protistrany, ktorá účtuje jednu časť transakcie	Identifikátor právneho subjektu (LEI) (20 alfanumerických znakov), identifikátor dočasného subjektu (20 alfanumerických znakov), kód BIC (11 alfanumerických znakov) alebo kód klienta (50 alfanumerických znakov).	

Tabuľka 2

## Záznamy o pozícií

	Pole	Formát
1	ID zúčtovacieho člena	Identifikátor právneho subjektu (LEI), identifikátor dočasného subjektu alebo kód BIC
2	ID príjemcu	Identifikátor právneho subjektu (LEI), identifikátor dočasného subjektu, kód BIC alebo kód klienta
3	Interoperabilná centrálna protistrana zachováajúca pozíciu	Identifikátor právneho subjektu (LEI), identifikátor dočasného subjektu, kód BIC alebo kód klienta
4	Znamienko pozície	B = Nákupca / S = Predajca
5	Hodnota pozície	Maximálne 10 číslíc (xxxx.yy).
6	Cena, ktorou sa hodnotia zmluvy	Maximálne 10 číslíc (xxxx.yy).
7	Mena	Kód meny podľa ISO.
8	Iné dôležité informácie	Voľný text
9	Výška marží centrálnej protistrany	Maximálne 10 číslíc (xxxx.yy).
10	Výška príspevkov do fondu pre prípad zlyhania, ktoré si uplatňuje centrálna protistrana	Maximálne 10 číslíc (xxxx.yy).
11	Výška iných finančných zdrojov centrálnej protistrany	Maximálne 10 číslíc (xxxx.yy).
12A	Výška marží zložených zo strany zúčtovacieho člena s odkazom na klientsky účet A	Maximálne 10 číslíc (xxxx.yy).
13A	Výška príspevkov do fondu pre prípad zlyhania zložených zo strany zúčtovacieho člena s odkazom na klientsky účet A	Maximálne 10 číslíc (xxxx.yy).
14A	Výška iných finančných zdrojov zložených zo strany zúčtovacieho člena s odkazom na klientsky účet A	Maximálne 10 číslíc (xxxx.yy).
15B	Výška marží zložených zo strany zúčtovacieho člena s odkazom na klientsky účet B	Maximálne 10 číslíc (xxxx.yy).
16B	Výška príspevkov do fondu pre prípad zlyhania zložených zo strany zúčtovacieho člena s odkazom na klientsky účet B	Maximálne 10 číslíc (xxxx.yy).
17B	Výška iných finančných zdrojov zložených zo strany zúčtovacieho člena s odkazom na klientsky účet B	Maximálne 10 číslíc (xxxx.yy).

Tabuľka 3

## Záznamy o podnikateľskej činnosti

	Pole	Formát	Opis
1	Organizačná schéma	Voľný text	Rada a príslušné výbory, zúčtovacie oddelenie, oddelenie riadenia rizík a všetky ostatné relevantné oddelenia alebo divízie.

Akcionári alebo členovia, ktorí majú kvalifikovanú účasť (pridať polia pre každého príslušného akcionára/člena)

2	Typ	S = Akcionár / M = Člen.	
3	Typ kvalifikovanej účasti	D = priama / I = nepriama.	
4	Typ subjektu	N = fyzická osoba / L = právnická osoba.	
5	Výška účasti	Maximálne 10 číslic (xxxx,yyyyy).	

Iné dokumenty

6	Politiky, postupy, procesy vyžadované podľa organizačných požiadaviek	Dokumenty	
7	Zápisnice zo zasadnutí rady, zasadnutia podvýborov (v prípade potreby) a výborov vrcholového manažmentu (v prípade potreby)	Dokumenty	
8	Zápisnice zo zasadnutia výboru pre riziká	Dokumenty	
9	Zápisnice konzultačnej skupiny so zúčtovacími členmi a klientmi (ak existujú)	Dokumenty	
10	Správy z vnútorného a vonkajšieho auditu, riadenia rizík, správy o zhode a správy konzultanta	Dokumenty	
11	Politika kontinuity podnikateľskej činnosti a plán obnovy po havárii	Dokumenty	
12	Plán likvidity a denné správy o likvidite	Dokumenty	
13	Dokumenty s uvedením všetkých aktív a pasív a kapitálových účtov	Dokumenty	

	Pole	Formát	Opis
14	Prijaté sťažnosti	Voľný text	Každá sťažnosť obsahuje: názov sťažnosti, adresu a číslo účtu; dátum prijatia sťažnosti; mená všetkých osôb identifikovaných v sťažnosti; opis charakteru sťažnosti; dispozícia sťažnosti; dátum vybavenia sťažnosti.
15	Informácia o prerušení služieb alebo zlom fungovaní	Voľný text	Informácia o akomkoľvek prerušení služieb alebo zlom fungovaní vrátane podrobnej správy o čase, účinkoch a nápravných opatreniach.
16	Výsledky uskutočnených spätných a stresových testov	Voľný text	
17	Písomná komunikácia s príslušnými orgánmi, orgánom ESMA a príslušnými členmi ESCB	Dokumenty	
18	Právne stanoviská prijaté súlade s organizačnými požiadavkami	Dokumenty	
19	Dohody o interoperabilite s inými centrálnymi protistranami (v prípade potreby)	Dokumenty	
20	Zoznam všetkých zúčtovacích členov (článok 17 nariadenia (EÚ) XXX/2012)	Voľný text / Dokument	Zoznam v súlade s článkom 17 nariadenia (EÚ) XXX/2012.
21	Informácie vyžadované článkom 17 nariadenia (EÚ) XXX/2012	Voľný text/Dokumenty	Zákony a predpisy, ktorými sa riadi (i) prístup k centrálnej protistrane, (ii) zmluvy, ktoré centrálna protistrana uzatvorila so zúčtovacími členmi a v prípade potreby s klientmi, (iii) zmluvy, ktoré centrálna protistrana prijme na zúčtovanie, (iv) všetky dohody o interoperabilite, (v) používanie kolaterálu a príspevkov do fondu pre prípad zlyhania vrátane likvidácie pozícií a kolaterálu a rozsah, v akom je kolaterál chránený pred nárokmi tretej strany (úroveň oddeľovania).
22	Vývoj procesov novej iniciatívy	Voľný text	V prípade poskytovania nových služieb.