

DELEGOVANÉ NARIADENIE KOMISIE (EÚ) č. 151/2013

z 19. decembra 2012,

ktorým sa dopĺňa nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 648/2012 o mimoburzových derivátoch, centrálnych protistranách a archívoch obchodných údajov, pokiaľ ide o regulačné technické normy bližšie určujúce údaje, ktoré majú archívy obchodných údajov zverejniť a sprístupniť, a prevádzkové normy na agregáciu a porovnávanie údajov a prístup k týmto údajom

(Text s významom pre EHP)

EURÓPSKA KOMISIA,

svojich príslušných úloh v tejto súvislosti prístup k údajom o transakciách všetkých protistrán.

so zreteľom na Zmluvu o fungovaní Európskej únie,

(5) Orgány dohľadu a dozoru nad centrálnymi protistranami potrebujú mať prístup na umožnenie účinného výkonu svojich povinností vo vzťahu k takýmto subjektom, a mali by preto mať prístup ku všetkým informáciám potrebným pre tento mandát.

so zreteľom na stanovisko Európskej centrálnej banky ⁽¹⁾,

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 ⁽²⁾, a najmä na jeho článok 81 ods. 5,

(6) Prístup príslušných členov ESCB slúži na plnenie ich základných úloh, najmä funkcií emitujúcej centrálnej banky, ich mandátu v súvislosti s finančnou stabilitou a v niektorých prípadoch prudenciálneho dohľadu nad niektorými protistranami. Keďže určití členovia ESCB majú na základe vnútroštátnych právnych predpisov rôzne mandáty, mal by sa im udeliť prístup k údajom v súlade s rôznymi mandátmi uvedenými v článku 81 ods. 3 nariadenia (EÚ) č. 648/2012.

keďže:

(1) Je dôležité jasne identifikovať relevantné zmluvy a ich príslušné protistrany. Na základe funkčného prístupu by sa subjekty prístupujúce k údajom archívov obchodných údajov mali posudzovať podľa svojich právomocí a funkcií, ktoré vykonávajú.

(7) Hlavnou povinnosťou príslušných orgánov Únie pre cenné papiere a trhy je ochrana investorov v ich príslušných jurisdikciách a mal by sa im udeliť prístup k transakčným údajom o trhoch, účastníkoch, produktoch a podkladových aktívach, na ktoré sa vzťahujú ich mandáty v oblasti dohľadu a presadzovania predpisov.

(2) Európsky orgán pre cenné papiere a trhy (ESMA) by mal mať prístup k všetkým údajom o jednotlivých transakciách vedeným archívmi obchodných údajov na účely dohľadu nad archívmi obchodných údajov, aby bol schopný žiadať o informácie, prijímať primerané opatrenia v oblasti dohľadu a takisto kontrolovať, či by sa registrácia archívu obchodných údajov mala ponechať alebo zrušiť.

(8) Orgánom vymenovaným podľa článku 4 smernice Európskeho parlamentu a Rady 2004/25/ES z 21. apríla 2004 o ponukách na prevzatie ⁽⁴⁾ by sa mal udeliť prístup k transakciám s akciovými derivátmi, ak sa podkladové aktívum buď prijme na obchodovanie na regulovanom trhu v ich jurisdikcii, má adresu sídla v ich jurisdikcii, alebo je ponúkajúcou stranou pre takúto spoločnosť a protiplnenie, ktoré ponúka, zahŕňa cenné papiere.

(3) Vzhľadom na svoje zodpovednosti v rámci 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) ⁽³⁾, a nariadenia (EÚ) č. 648/2012 by mal ESMA dostať prístup na základe rôznych mandátov. Prístup jednotlivých pracovníkov ESMA k údajom by mal byť v súlade s každým z uvedených konkrétnych mandátov.

(9) Agentúre pre spoluprácu regulačných orgánov v oblasti energetiky (ACER) by sa mal udeliť prístup na účely monitorovania veľkoobchodného trhu s energiou s cieľom odhaliť a zabrániť zneužívaniu trhu v spolupráci s vnútroštátnymi regulačnými orgánmi a na účely monitorovania veľkoobchodných trhov s energiou na odhalenie a zabránenie zneužívaniu trhu podľa nariadenia Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 1227/2011 z 25. októbra 2011 o integrite a transparentnosti veľkoobchodného trhu s energiou (REMIT) ⁽⁵⁾. ACER by preto mala mať prístup k všetkým údajom vedeným archívom obchodných údajov, pokiaľ ide o energetické deriváty.

⁽¹⁾ Zatiaľ neuverejnené v úradnom vestníku.

⁽²⁾ Ú. v. EÚ L 201, 27.7.2012, s. 1.

⁽³⁾ Ú. v. EÚ L 331, 15.12.2010, s. 84.

⁽⁴⁾ Ú. v. EÚ L 142, 30.4.2004, s. 12.

⁽⁵⁾ Ú. v. EÚ L 326, 8.12.2011, s. 1.

- (10) Nariadenie (EÚ) č. 648/2012 sa vzťahuje len na obchodné údaje a nie na údaje, pred uskutočnením obchodu, ako napríklad pokyny na obchodovanie podľa nariadenia (EÚ) č. 1227/2011. Archívy obchodných údajov by sa preto v tomto ohľade pre ACER nemali považovať za vhodný zdroj informácií.
- (11) V rámci funkčného postupu pre prístup k údajom vedeným archívami obchodných údajov je prudenciálny dohľad dôležitým prvkom. Podobne môžu mať rôzne orgány mandát na prudenciálny dohľad. Prístup k údajom o transakciách príslušných subjektov by sa preto mal zabezpečiť všetkým orgánom uvedeným v článku 81 ods. 3 nariadenia (EÚ) č. 648/2012.
- (12) Subjekty s prístupom k údajom archívov obchodných údajov podľa článku 81 ods. 3 nariadenia (EÚ) č. 648/2012 by mali zabezpečiť zachovávanie a presadzovanie politik s cieľom zabezpečiť, že k informáciám majú prístup len príslušné osoby na riadne vymedzený a právne podložený účel, pričom budú jasne uvádzať prípadné ďalšie osoby oprávnené pristupovať k týmto údajom.
- (13) Prístup k údajom by sa mal zvažovať na troch úrovniach agregácie. Údaje o transakciách by mali zahŕňať podrobnosti o jednotlivých obchodoch; údaje o pozíciách by sa mali týkať údajov o agregovaných pozíciách podľa podkladového aktíva/produktu pre jednotlivé protistrany a agregované nominálne údaje by mali zodpovedať celkovým pozíciám podľa podkladového aktíva/produktu bez podrobností o protistrane. Prístup k údajom o transakciách by takisto zahŕňal prístup k údajom o jednotlivých pozíciách a k agregovaným údajom. Prístup k údajom o pozíciách by takisto zahŕňal prístup k agregovaným údajom, ale nie k údajom o jednotlivých transakciách. Naopak, prístup k agregovaným nominálnym údajom by mal byť menej podrobnou kategóriou a nemal by umožňovať prístup k údajom o pozíciách alebo údajom o jednotlivých transakciách.
- (14) Toto nariadenie vychádza z návrhu regulačných technických noriem, ktoré Európsky orgán pre cenné papiere a trhy predložil Komisii.
- (15) Pred predložením návrhu regulačných technických noriem, z ktorých toto nariadenie vychádza, ESMA konzultoval príslušné orgány a členov Európskeho systému centrálnych bánk (ESCB) v súlade s článkom 10 nariadenia (EÚ) č. 1095/2010. ESMA takisto uskutočnil otvorenú verejnú konzultáciu o týchto návrhoch regulačných technických noriem, vykonal analýzu potenciálnych súvisiacich nákladov a prínosov a vyžiadal si stanovisko skupiny zainteresovaných strán v oblasti cenných papierov a trhov orgánu ESMA zriadenej v súlade s článkom 37 uvedeného nariadenia,
- a) rozpis agregovaných otvorených pozícií podľa tried derivátov takto:
- i) komoditné;
 - ii) úverové;
 - iii) devízové;
 - iv) akciové;
 - v) úrokové;
 - vi) iné;
- b) rozpis agregovaných objemov transakcií podľa tried derivátov takto:
- i) komoditné;
 - ii) úverové;
 - iii) devízové;
 - iv) akciové;
 - v) úrokové;
 - vi) iné;
- c) rozpis agregovaných hodnôt podľa tried derivátov takto:
- i) komoditné;
 - ii) úverové;
 - iii) devízové;
 - iv) akciové;
 - v) úrokové;
 - vi) iné.
2. Údaje sa zverejnia na webovej lokalite alebo online portáli, ktoré sú ľahko dostupné pre verejnosť a aktualizované aspoň raz za týždeň.

PRIJALA TOTO NARIADENIE:

Článok 1

Zverejňovanie agregovaných údajov

1. Archívy obchodných údajov zverejňujú údaje podľa článku 81 ods. 1 nariadenia (EÚ) č. 648/2012 zahŕňajúce aspoň:

Článok 2

Prístup k údajom zo strany príslušných orgánov

1. Archív obchodných údajov poskytne Európskemu orgánu pre cenné papiere a trhy (ESMA) prístup k všetkým údajom o transakciách na účely výkonu jeho právomocí v oblasti dohľadu.

2. ESMA stanoví vnútorné postupy s cieľom zabezpečiť primeraný prístup zamestnancov a akékoľvek príslušné obmedzenia prístupu, pokiaľ ide o činnosti v rámci mandátu ESMA, ktoré nesúvisia s dohľadom.

3. Archív obchodných údajov poskytne Agentúre pre spoluprácu regulačných orgánov v oblasti energetiky (ACER) prístup k všetkým údajom o transakciách týkajúcim sa derivátov, ak ich podkladovým aktívom je energia alebo emisné kvóty.

4. Archív obchodných údajov poskytne príslušnému orgánu vykonávajúcemu dohľad nad centrálnou protistranou a prípadne príslušnému členovi Európskeho systému centrálnych bánk (ESCB), ktorý vykonáva dozor nad centrálnou protistranou, prístup k všetkým údajom o transakciách, ktoré centrálna protistrana zúčtovala alebo ohlásila.

5. Archív obchodných údajov poskytne príslušnému orgánu vykonávajúcemu dohľad nad miestami výkonu ohlásených zmlúv prístup k všetkým údajom o transakciách týkajúcich sa zmlúv vykonaných na uvedených miestach.

6. Archív obchodných údajov poskytne orgánu dohľadu vymenovanému podľa článku 4 smernice 2004/25/ES prístup k všetkým údajom o transakciách týkajúcich sa derivátov, ktorých podkladovým aktívom je cenný papier vydaný spoločnosťou, ktorá spĺňa jednu z týchto podmienok:

- a) je prijatá na obchodovanie na regulovanom trhu v rámci jeho jurisdikcie;
- b) má registrované sídlo, alebo ak nemá registrované sídlo, má ústredie v jeho jurisdikcii;
- c) je ponúkajúcou stranou pre subjekty stanovené v písmene a) alebo b) a protiplnenie, ktoré ponúka, zahŕňa cenné papiere.

7. Údaje, ktoré sa majú poskytnúť v súlade s odsekom 6, zahŕňajú informácie o:

- a) podkladových cenných papieroch;
- b) triedach derivátov;
- c) znamienku pozície;
- d) počte referenčných cenných papierov;
- e) protistranách derivátu.

8. Archív obchodných údajov poskytne príslušným orgánom Únie pre cenné papiere a trhy uvedeným v článku 81 ods. 3 písm. h) nariadenia (EÚ) č. 648/2012 prístup k všetkým údajom

o transakciách týkajúcich sa trhov, účastníkov, zmlúv a podkladových aktív, ktoré patria do rozsahu pôsobnosti uvedeného orgánu podľa jeho príslušných zodpovedností a mandátov v oblasti dohľadu.

9. Archív obchodných údajov poskytne Európskemu výboru pre systémové riziká, ESMA a príslušným členom ESCB údaje o jednotlivých transakciách:

- a) za všetky protistrany v ich príslušných jurisdikciách;
- b) za derivátové zmluvy, ak sa referenčný subjekt derivátovej zmluvy nachádza v ich príslušnej jurisdikcii alebo ak je referenčným záväzkom štátny dlhopis príslušnej jurisdikcie.

10. Archív obchodných údajov poskytne príslušnému členovi ESCB prístup k údajom o pozíciách derivátových zmlúv v mene, v ktorej emituje uvedený člen.

11. Archív obchodných údajov na účely prudenciálneho dohľadu nad protistranami, na ktoré sa vzťahuje ohlasovacia povinnosť, poskytne príslušným subjektom uvedeným v článku 81 ods. 3 nariadenia (EÚ) č. 648/2012 prístup k všetkým údajom o transakciách takýchto protistrán.

Článok 3

Orgány tretích krajín

1. Vo vzťahu k príslušnému orgánu tretej krajiny, ktorý s Úniou uzatvoril medzinárodnú dohodu podľa článku 75 nariadenia (EÚ) č. 648/2012, poskytne archív obchodných údajov prístup k údajom s prihliadnutím na mandát a zodpovednosť orgánu tretej krajiny a v súlade s ustanoveniami príslušnej medzinárodnej dohody.

2. Vo vzťahu k príslušnému orgánu tretej krajiny, ktorý s ESMA uzatvoril dohodu o spolupráci podľa článku 76 nariadenia (EÚ) č. 648/2012, poskytne archív obchodných údajov prístup k údajom s prihliadnutím na mandát a zodpovednosť orgánu tretej krajiny a v súlade s ustanoveniami príslušnej dohody o spolupráci.

Článok 4

Prevádzkové normy na agregáciu a porovnávanie údajov

1. Archív obchodných údajov poskytne prístup subjektom uvedeným v článku 81 ods. 3 nariadenia (EÚ) č. 648/2012 v súlade s komunikačnými postupmi, normami pre zasielanie správ a referenčné údaje, ktoré sa bežne používajú na medzinárodnej úrovni.

2. Protistrany obchodu pre každú derivátovú zmluvu vygenerujú jedinečný identifikátor obchodu, aby archívom obchodných údajov umožnili agregovať a porovnávať údaje medzi rôznymi archívmi obchodných údajov.

Článok 5**Prevádzkové normy pre prístup k údajom**

1. Archív obchodných údajov zaznamenáva informácie týkajúce sa prístupu k údajom poskytnutým subjektom uvedeným v článku 81 ods. 3 nariadenia (EÚ) č. 648/2012.

2. Informácie uvedené v odseku 1 zahŕňajú:

a) rozsah sprístupnených údajov;

b) odkaz na právne ustanovenia, na základe ktorých sa udeľuje prístup k takýmto údajom podľa nariadenia (EÚ) č. 648/2012 a tohto nariadenia.

Článok 6**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