

**FRAMKVÆMDARREGLUGERÐ FRAMKVÆMDASTJÓRNARINNAR
(ESB) nr. 1249/2012****2019/EES/25/14**

frá 19. desember 2012

**um tæknilega framkvæmdarstaðla að því er varðar framsetningu á skráum sem miðlægir mótaðilar
skulu viðhalda samkvæmt reglugerð Evrópuþingsins og ráðsins (ESB) nr. 648/2012 um OTC-
afleiður, miðlæga mótaðila og afleiðuviðskiptaskrár (*)**

FRAMKVÆMDASTJÓRN EVRÓPUSAMBANDSINS HEFUR,

með hliðsjón af sáttmálanum um starfshætti Evrópusambandsins,

með hliðsjón af álitum Seðlabanka Evrópu ⁽¹⁾,með hliðsjón af reglugerð Evrópuþingsins og ráðsins (ESB) nr. 648/2012 frá 4. júlí 2012 um OTC-afleiður, miðlæga mótaðila og afleiðuviðskiptaskrár ⁽²⁾, einkum 5. mgr. 29. gr.,*og að teknu tilliti til eftirfarandi:*

- 1) Í samræmi við 4. mgr. 29. gr. reglugerðar (ESB) nr. 648/2012, ákvæði 13., 14. og 15. gr. framseldu gerðarinnar um tæknilega eftirlitsstaðla, sem tilgreina skrárnar og upplýsingarnar sem miðlægir mótaðilar ættu að geyma, og eru samþykktir skv. 4. mgr. 29. gr. reglugerðar (ESB) nr. 648/2012, ætti einnig að mæla fyrir um reglur til að tilgreina framsetningu á skráum og upplýsingum í samræmi við þær greinar.
- 2) Til að viðkomandi yfirvöld geti sinnt verkefnum sínum á skilvirkan og samræmdan hátt ættu gögnin sem þeim eru látin í té að vera samanburðarhæf á milli miðlægra mótaðila. Notkun sameiginlegra sniða auðveldar einnig samanburð á gögnum á milli miðlægra mótaðila.
- 3) Gera ætti kröfu um að miðlægir mótaðilar varðveiti gögn í skráningarskyni á sambærilegu sniði og gögnin sem varveitt eru hjá afleiðuviðskiptaskráum vegna þess að í tilteknum aðstæðum er þess krafist að miðlægir mótaðilar og afleiðuviðskiptaskrár viðhaldi eða tilkynni sömu upplýsingar. Þegar sameiginlegt snið er notað þvert á mismunandi innviði fjármálamarkaða ýtir það undir víðtækari notkun þessara sniða af hálfu margskonar markaðsaðila og stuðlar þannig að stöðlun.
- 4) Til að auðvelda samfellda tæknivinnslu og draga úr kostnaði markaðsaðila er mikilvægt að nota staðlaða verkferla og stöðluð gagnasnið eins mikið og við verður komið þvert á miðlæga mótaðila.

5) Undirliggjandi eign ætti að auðkenna með einu auðkenni en um þessar mundir er þó enginn staðlaður kóði sem nær til alls markaðarins til að auðkenna undirliggjandi eign innan körfu. Því ættu miðlægir mótaðilar í það minnsta að gefa til kynna að undirliggjandi eign sé karfa og nota alþjóðlegt auðkennisnúmer verðbréfa (ISIN-númer) fyrir staðlaðar vísitölur þar sem hægt er.

6) Þessi reglugerð byggist á drögum að tæknilegum framkvæmdarstöðlum sem Evrópska verðbréfamarkaðs- eftirlitsstofnunin (ESMA) hefur lagt fyrir framkvæmdastjórnina.

7) Í samræmi við 15. gr. reglugerðar Evrópuþingsins og ráðsins (ESB) nr. 1095/2010 frá 24. nóvember 2010 um að koma á fót evrópski eftirlitsstofnun (Evrópska verðbréfamarkaðseftirlitsstofnunin) ⁽³⁾ hefur Evrópska verðbréfamarkaðseftirlitsstofnunin haft opið samráð við almenning um drögin að tæknilegu framkvæmdarstöðlunum áður en hún leggur það fram, greint mögulegan tengdan kostnað og ávinning og óskað eftir álitum hagsmunahóps á verðbréfamarkaði, sem komið var á fót í samræmi við 37. gr. reglugerðar (ESB) nr. 1095/2010.

SAMÞYKKT REGLUGERÐ ÞESSA:

*1. gr.***Snið skráa**

1. Miðlægur mótaðili skal varðveita skrárnar sem eru tilgreindar í 20. gr. framseldu gerðarinnar um tæknilega eftirlitsstaðla um kröfur sem tilgreina hvaða atriði skulu koma fram í skráum og upplýsingum sem miðlægum mótaðilum ber að geyma, og eru samþykktir skv. 4. mgr. 29. gr. reglugerðar (ESB) nr. 648/2012, fyrir hvern samning sem unnið er með, á því sniði sem greinir í töflu 1 í viðaukanum.

2. Miðlægur mótaðili skal varðveita skrárnar, sem eru tilgreindar í 21. gr. framseldu gerðarinnar, um tæknilega eftirlitsstaðla um kröfur, sem tilgreina hvaða atriði skulu koma fram í skránum og upplýsingunum sem miðlægum mótaðilum ber að geyma, og eru samþykktir skv. 4. mgr. 29. gr. reglugerðar (ESB) nr. 648/2012, fyrir hverja stöðu, á því sniði sem greinir í töflu 2 í viðaukanum.

(*) Þessi ESB-gerð birtist í Stjtið. ESB L 352, 21.12.2012, bls. 32. Hennar var getið í ákvörðun sameiginlegru EES-nefndarinnar nr. 112/2018 frá 31. maí 2018 um breytingu á IX. viðauka (Fjármálaþjónusta) við EES-samninginn (bíður birtingar).

(1) Hefur enn ekki verið birt í *Stjórnartíðindunum*.

(2) Stjtið. ESB L 201, 27.7.2012, bls. 1.

(3) Stjtið. ESB L 331, 15.12.2010, bls. 84.

3. Miðlægur mótaðili skal varðveita skrárnar, sem eru tilgreindar í 22. gr. framseldu gerðarinnar um tæknilega eftirlitsstaðla um kröfur sem tilgreina hvaða atriði skulu koma fram í skrá og upplýsingum sem miðlægum mótaðilum ber að geyma, og eru samþykktir í samræmi við 4. mgr. 29. gr. reglugerðar (ESB) nr. 648/2012, fyrir starfsemi sem tengist rekstri hans og innra skipulagi, á því sniði sem greinir í töflu 3 í viðaukanum.

4. Miðlægur mótaðili skal gera lögbærum yfirvöldum skrárnar og upplýsingarnar, skv. 1., 2. og 3. mgr., aðgengilegar

á sniði sem býður upp á beinan gagnaflutning (*e. direct data feed*) á milli miðlæga mótaðilans og lögbæra yfirvaldsins. Miðlægur mótaðili skal koma á slíkum gagnaflutningi innan sex mánaða frá beiðni lögbæra yfirvaldsins.

2. gr.

Gildistaka

Reglugerð þessi öðlast gildi á tuttugasta degi eftir að hún birtist í *Stjórnartíðindum Evrópusambandsins*.

Reglugerð þessi er bindandi í heild sinni og gildir í öllum aðildarríkjunum án frekari lögfestingar.

Gjört í Brussel 19. desember 2012.

Fyrir hönd framkvæmdastjórnarinnar,

José Manuel BARROSO

forseti.

VIÐAUKI

Tölur yfir reiti fyrir upplýsingar sem þarf að skrá skv. 1. gr.

Tafla 1

Skrár yfir afgreidd viðskipti

	Reitur	Snið	Lýsing
1	Tímastimpill skýrslugjafar	<i>ISO 8601 dagsetningarsnið / snið samræmnds heimstíma (UTC).</i>	Dagsetning og tími skýrslugjafar.
2	Verð/gengi	<i>Allt að 20 tölustafir á sniðinu .xxxx,yyyyy.</i>	Verð á hvert verðbréf eða afleiðusamning að undanskilinni þóknun og (þar sem við á) áföllnum vöxtum. Ef um er að ræða skuldagering má gefa upp verð í gjaldmiðli eða sem hundraðshluta.
2a	Verðframsetning	<i>T.d. ISO 4217 gjaldmiðilskóði, 3 bókstafir, hundraðshluti.</i>	Framsetningarmáti verðsins.
3	Undirliggjandi gjaldmiðill	<i>ISO 4217 gjaldmiðilskóði, 3 bókstafir.</i>	Gjaldmiðillinn sem verðið er gefið upp í. Ef um er að ræða skuldabréf eða annars konar verðbréfaða skuldageringa og verðið er gefið upp sem hundraðshluti skal einnig gefa upp hundraðshlutann.
3a	Gjaldmiðill til afhendingar	<i>ISO 4217 gjaldmiðilskóði, 3 bókstafir.</i>	Gjaldmiðillinn sem á að afhenda.
4	Magn	<i>Allt að 10 tölustafir.</i>	Fjöldi eininga fjármálagerningsins, nafnverð skuldabréfa eða fjöldi afleiðusamninga sem teljast til viðskiptanna.
5	Framsetningarform magns	<i>Allt að 10 tölustafir.</i>	Upplýsingar um hvort magnið sé gefið upp í fjölda eininga fjármálagerninga, nafnverði skuldabréfa eða fjölda afleiðusamninga.
6	Staða miðlægs mótaðila	<i>B=kaupandi/S=seljandi.</i>	
7	Afurðaaudkenni	<i>Bráðabirgðaflokkunarkerfi í samræmi við upplýsingar í 4. gr. reglugerðar (EB) xx/2012 [drög að tæknilegum framkvæmdarstaðli um framsetningu og tíðni skýrslna um viðskipti til afleiðuviðskiptaskráa], ISIN-númer eða einkvæmt afurðaaudkenni (e. UPI).</i>	Samningurinn skal auðkenndur með því að nota afurðaaudkenni, þegar það er tiltækt.
8	Audkenni stöðustofnunaradila	<i>Audkenni lögaðila (20 alstafir), bráðabirgðaaudkenni aðila (20 alstafir), audkenniskóði banka (11 alstafir) eða kóði viðskiptavinar (50 alstafir).</i>	Ef skýrslugjafarmótaðili er ekki stöðustofnunaraðili skal auðkenna stöðustofnunaraðila hans í þessum reit með einkvæmum kóða. Þegar um einstakling er að ræða skal nota kóða viðskiptavinar sem miðlægur mótaðili úthlutar.

	Reitur	Snið	Lýsing
9	Auðkenni rétthafa	<i>Auðkenni lögaðila (20 alstafir), bráða-birgðaauðkenni aðila (20 alstafir), auðkenniskóði banka (11 alstafir) eða kóði viðskiptavinar (50 alstafir).</i>	Ef rétthafi samningsins er ekki mótaðili í þessum samningi verður að auðkenna hann með einkvæmum kóða eða, ef um einstakling er að ræða, kóða viðskiptavinar sem úthlutað er af þeim lögaðila sem einstaklingurinn notar.
10	Aðili sem framseldi samninginn (ef um er að ræða staðgönguviðskipti)	<i>Auðkenni lögaðila (20 alstafir), bráða-birgðaauðkenni aðila (20 alstafir), auðkenniskóði banka (11 alstafir) eða kóði viðskiptavinar (50 alstafir).</i>	
11	Viðskiptastaður	<i>ISO 10383 markaðsauðkenniskóði þegar við á, XOFF fyrir skráðar afleiður sem viðskipti eru með utan kauphalla eða XXXX fyrir OTC-afleiður.</i>	Tilgreining á því hvar viðskiptin fara fram. Ef um er að ræða OTC-samning verður að tilgreina hvort viðkomandi gerningur er tekinn til viðskipta en verslað með hann yfir borðið (OTC), eða ekki tekinn til viðskipta og verslað með hann OTC.
12	Dagsetning milligöngu	<i>ISO 8601 dagsetningarsnið.</i>	Dagurinn þegar milliganga miðlæga mótaðilans í samningnum fór fram.
13	Tími milligöngu	<i>Snið samræmds heimstíma.</i>	Klukkan hvað milliganga miðlæga mótaðilans í samningnum fór fram, á staðartíma þess lögbæra yfirvalds sem tilkynnt er um viðskiptin til og á hvaða grundvelli tilkynnt er um viðskiptin miðað við samræmdan heimstíma (UTC) +/- klst.
14	Dagsetning samningsloka	<i>ISO 8601 dagsetningarsnið</i>	Dagsetningin þegar samningnum lauk.
15	Tími samningsloka	<i>Snið samræmds heimstíma.</i>	Klukkan hvað samningnum lauk, á staðartíma þess lögbæra yfirvalds sem tilkynnt er um viðskiptin til og á hvaða grundvelli tilkynnt er um viðskiptin miðað við samræmdan heimstíma (UTC) +/- klst.
16	Tegund afhendingar	<i>C=reiðufé, P=í áþreifanlegu formi, O=valkvætt fyrir mótaðila.</i>	Hvort samningurinn er gerður upp með afhendingu í áþreifanlegu formi eða með reiðufé.
17	Uppgjörsdagur	<i>ISO 8601 dagsetningarsnið.</i>	Dagsetningin þegar uppgjörin eða uppgjörskaupin á samningnum fara fram. Ef þær eru fleiri en ein er hægt að merkja í fleiri reiti.
18	Tími uppgjors eða uppgjörskaua á samningnum	<i>Snið samræmds heimstíma.</i>	Klukkan hvað uppgjör eða uppgjörskaup á samningnum fór fram, á staðartíma þess lögbæra yfirvalds sem tilkynnt er um viðskiptin til og á hvaða grundvelli tilkynnt er um viðskiptin miðað við samræmdan heimstíma (UTC) +/- klst.

	Reitur	Snið	Lýsing
Upplýsingar um upphaflega skilmála stöðustofnaðra samninga, sem veita á að því marki sem við á			
19	Dagsetning	<i>ISO 8601 dagsetningarsnið</i>	Dagsetningin þegar samningurinn var upprunalega gerður.
20	Tími	<i>Snið samræmds heimstíma.</i>	Klukkan hvað upprunalegi samningurinn var upprunalega gerður, á staðartíma þess lögbæra yfirvalds sem tilkynnt er um viðskiptin til og á hvaða grundvelli tilkynnt er um viðskiptin miðað við samræmdan heimstíma (UTC) +/- klst.
21	Afurðaaudkenni	<i>Bráðabirgðaflokkunarkerfi í samræmi við upplýsingar í 4. gr. reglugerðar (EB) xx/2012 [drög að tæknilegum framkvæmdarstaðli um framsetningu og tíðni skýrsla um viðskipti til afleiðuviðskiptaskráa], ISIN-númer eða einkvæmt afurðaaudkenni (e. UPI).</i>	Samningurinn skal auðkenndur með því að nota einkvæmt afurðaaudkenni, ef við á.
22	Undirliggjandi eign	<i>Einkvæmt afurðaaudkenni, ISIN-númer (12 alstafir) og flokkun fjármálagerninga (6 alstafir). Audkenni lögaðila (20 talna alstafir), bráðabirgðaaudkenni aðila (20 alstafir), B = karfa, eða I = vísitala.</i>	Auðkenning gerningsins sem gildir um verðbréfið sem er undirliggjandi eign afleiðusamnings og framseljanlegt verðbréf sem fellur undir c-lið 18. liðar 1. mgr. 4. gr. tilskipunar 2004/39/EB.
23	Tegund afleiðu (ef um afleiðusamning er að ræða)	Samræmd lýsing á tegund afleiðu skal gerð í samræmi við einn af efstu flokkunum samkvæmt alþjóðlega viðurkenndum staðli fyrir flokkun fjármálagerninga.	
24	Færsla gernings á skrá Evrópsku verðbréfa-markaðseftirlitsstofnunarinnar yfir samninga sem falla undir stöðustofnunar skylduna (ef um er að ræða afleiðusamning)	<i>Y=já/N=nei.</i>	
Aðrar upplýsingar sem veita á að því marki sem þær eiga við			
25	Auðkenning rekstrarsamhæfs miðlægs mótaðila sem stöðustofnar einn legg viðskiptanna	<i>Audkenni lögaðila (20 alstafir), bráðabirgðaaudkenni aðila (20 alstafir), auðkenniskóði banka (11 alstafir) eða kóði viðskiptavinar (50 alstafir).</i>	

Tafla 2

Skrár um stöður

	Reitur	Snið
1	Auðkenni stöðustofnunaðila	<i>Auðkenni lögaðila, bráðabirgðaaauðkenni aðila eða auðkenniskóði banka</i>
2	Auðkenni rétthafa	<i>Auðkenni lögaðila, bráðabirgðaaauðkenni aðila eða auðkenniskóði banka</i>
3	Rekstrarsamhæfður miðlægur mótaðili sem viðheldur stöðunni	<i>Auðkenni lögaðila, bráðabirgðaaauðkenni aðila eða auðkenniskóði banka</i>
4	Merki stöðunnar	<i>B=kaupandi/S=seljandi</i>
5	Verðmæti stöðunnar	<i>Allt að 10 tölustafir (xxxx,yy).</i>
6	Verðið sem samningarnir eru metnir á	<i>Allt að 10 tölustafir (xxxx,yy).</i>
7	Gjaldmiðill	<i>ISO gjaldmiðilskóði.</i>
8	Aðrar upplýsingar sem skipta máli	<i>Frjáls texti</i>
9	Fjárhæð trygginga sem miðlægur mótaðili krefst	<i>Allt að 10 tölustafir (xxxx,yy).</i>
10	Fjárhæð framlaga í vanskilasjóð sem miðlægur mótaðili krefst	<i>Allt að 10 tölustafir (xxxx,yy).</i>
11	Fjárhæð annars fjármagns sem miðlægur mótaðili krefst	<i>Allt að 10 tölustafir (xxxx,yy).</i>
12A	Fjárhæð trygginga sem stöðustofnunaðili leggur fram vegna viðskiptavinareiknings A	<i>Allt að 10 tölustafir (xxxx,yy).</i>
13A	Fjárhæð framlaga í vanskilasjóð sem stöðustofnunaðili leggur fram vegna viðskiptavinareiknings A	<i>Allt að 10 tölustafir (xxxx,yy).</i>
14A	Fjárhæð annars fjármagns sem stöðustofnunaðili leggur fram vegna viðskiptavinareiknings A	<i>Allt að 10 tölustafir (xxxx,yy).</i>
15B	Fjárhæð trygginga sem stöðustofnunaðili leggur fram vegna viðskiptavinareiknings B	<i>Allt að 10 tölustafir (xxxx,yy).</i>
16B	Fjárhæð framlaga í vanskilasjóð sem stöðustofnunaðili leggur fram vegna viðskiptavinareiknings B	<i>Allt að 10 tölustafir (xxxx,yy).</i>
17B	Fjárhæð annars fjármagns sem stöðustofnunaðili leggur fram vegna viðskiptavinareiknings B	<i>Allt að 10 tölustafir (xxxx,yy).</i>

Tafla 3

Gögn um rekstur

	Reitur	Snið	Lýsing
1	Skipurit	<i>Frjáls texti</i>	Stjórn og viðeigandi nefndir, stöðustofnunardeild, áhættustýringardeild og allar aðrar viðeigandi einingar eða deildir.

Hluthafar eða aðilar sem eiga virkan eignarhluta (bæta þarf við reitum fyrir hvern viðkomandi hluthafa eða aðila)

2	Tegund	<i>S=hluthafi/M=aðili.</i>	
3	Tegund virks eignarhlutar	<i>D=beinn / I=óbeinn.</i>	
4	Tegund aðila	<i>N=einstaklingur/L=lögaðili.</i>	
5	Fjárhæð eignarhlutar	<i>Allt að 10 tölustafir (xxxx,yyyy).</i>	

Önnur skjöl

6	Stefnur, verkferlar og ferli sem gerð er skipulagskrafa um	<i>Skjöl</i>	
7	Fundargerðir stjórnar, undirnefnda (ef við á) og nefnda yfirstjórnar (ef við á)	<i>Skjöl</i>	
8	Fundargerðir áhættunefndar	<i>Skjöl</i>	
9	Fundargerðir samráðshóps með stöðustofnunaradilum og viðskiptavinum (sé um slíkan hóp að ræða)	<i>Skjöl</i>	
10	Skýrslur innri og ytri endurskoðunar, áhættustýringar, regluvörslu og ráðgjafa	<i>Skjöl</i>	
11	Stefna um rekstrarsamfellu og áætlun um endurreisn eftir stóráfall.	<i>Skjöl</i>	
12	Lausafjáraætlun og daglegar skýrslur um lausafjárstöðu	<i>Skjöl</i>	
13	Skjöl sem sýna allar eignir, skuldir og eiginfjárstöðu	<i>Skjöl</i>	

	Reitur	Snið	Lýsing
14	Móttæknar kvartanir	<i>Frjáls texti</i>	Fyrir hverja kvörtun: upplýsingar um nafn, heimilisfang og reikningsnúmer kvartanda; dagsetning móttöku kvörtunarinnar; nöfn allra einstaklinga sem eru nafngreindir í kvörtuninni; lýsing á eðli kvörtunarinnar; lúkning kvörtunarinnar; dagsetning úrlausnar kvörtunarinnar.
15	Upplýsingar um röskun á þjónustu eða starfstruflun	<i>Frjáls texti</i>	Upplýsingar um allar raskanir á þjónustu eða starfstruflanir, þ.m.t. ítarleg skýrsla um tímasetningu, áhrif og aðgerðir til úrbóta.
16	Niðurstöður afturvirkra prófa og álagsprófa sem framkvæmd hafa verið	<i>Frjáls texti</i>	
17	Skrifleg samskipti við lögbær yfirvöld, Evrópsku verðbréfamarkaðseftirlitsstofnunina og viðeigandi aðila seðlabankakerfis Evrópu	<i>Skjöl</i>	
18	Lögfræðiálit sem eru móttækin í samræmi við skipulagskröfur	<i>Skjöl</i>	
19	Fyrirkomulag rekstrarsamhæfis við aðra miðlæga mótaðila (eftir atvikum)	<i>Skjöl</i>	
20	Listi yfir alla stöðustofnunaraðila (17. gr. reglugerðar (ESB) nr. XXX/2012)	<i>Frjáls texti / Skjal</i>	Listi í samræmi við 17. gr. reglugerðar (ESB) nr. XXX/2012.
21	Upplýsingar sem krafist er skv. 17. gr. reglugerðar (ESB) nr. XXX/2012	<i>Frjáls texti / Skjöl</i>	Lög og reglur sem gilda um i) aðgengi að miðlæga mótaðilanum, ii) samninga sem gerðir eru af miðlæga mótaðilanum við stöðustofnunar aðila og, ef því verður komið við, viðskiptavini, iii) samninga sem miðlægi mótaðilinn samþykkir til stöðustofnunar, iv) fyrirkomulag rekstrarsamhæfis, v) notkun á tryggingum og framlögum í vanskilasjóð, þ.m.t. innlausn á stöðum og tryggingum og að hvaða marki trygging er vernduð gegn kröfum þriðja aðila (stíg aðgreiningar).
22	Þróun á ferlum fyrir ný verkefni	<i>Frjáls texti</i>	Ef ný þjónusta er veitt.