

EES-STOFNANIR

SAMEIGINLEGA EES-NEFNDIN

FRAMSELD REGLUGERÐ FRAMKVÆMDASTJÓRNARINNAR
(ESB) 2017/1800

2019/EES/37/01

frá 29. júní 2017

um breytingu á framseldri reglugerð (ESB) nr. 151/2013 um viðbætur við reglugerð Evrópuþingsins og ráðsins (ESB) nr. 648/2012 (*)

FRAMKVÆMDASTJÓRN EVRÓPUSAMBANDSINS HEFUR,

með hliðsjón af sáttmálanum um starfshætti Evrópusambandsins,

með hliðsjón af reglugerð Evrópuþingsins og ráðsins (ESB) nr. 648/2012 frá 4. júlí 2012 um OTC-afleiður, miðlæga mótaðila og afleiðuviðskiptaskrár (1), einkum 5. mgr. 81. gr.,

og að teknu tilliti til eftirfarandi:

- 1) Beiting framseldrar reglugerðar framkvæmdastjórnarinnar (ESB) nr. 151/2013 (2) hefur leitt í ljós að skortur á sérstökum stöðlum fyrir gagnaadgang og -söfnun og samanburði leiðir til skipulagsgalla. Skortur á stöðluðum gögnum, samræmdri virkni og stöðluðu skilaboðasniði hefur hindrað beinan og tafarlausan aðgang að gögnum og hefur því komið í veg fyrir að aðilarnir sem taldir eru upp í 3. mgr. 81. gr. reglugerðar (ESB) nr. 648/2012 geti metið kerfisáhættu á skilvirkan hátt og þar með skyldur sínar og umboð.
- 2) Til að ryðja þessum hindrunum úr vegi er nauðsynlegt að breyta framseldri reglugerð (ESB) nr. 151/2013 með því að tilgreina nánar rekstrarstaðlana sem krafist er til að safna og bera saman gögn milli afleiðuviðskiptaskráa svo tryggt sé að aðilarnir sem um getur í 3. mgr. 81. gr. reglugerðar (ESB) nr. 648/2012 hafi aðgang að upplýsingunum sem nauðsynlegar eru til að þeir geti staðið við skyldur sínar og umboð.
- 3) Til að samanburður og söfnun gagna milli afleiðuviðskiptaskráa séu árangursrík og skilvirk ætti að nota XML-sniðmát og XML-skilaboð, sem þróuð eru í samræmi við aðferðafræði ISO 20022, fyrir aðgang að gögnum og boðskipti milli aðilanna sem um getur í 3. mgr. 81. gr. reglugerðar (ESB) nr. 648/2012 og afleiðuviðskiptaskrána. Þetta ætti ekki að koma í veg fyrir að afleiðuviðskiptaskrár og viðkomandi aðilar geti komist að samkomulagi um að veita aðgang eða eiga samskipti með því að nota annað snið auk XML-sniðs.
- 4) Nota ætti XML-sniðið til að veita viðkomandi aðilum gögn á þann hátt að það auðveldi söfnun þeirra og nota ætti XML-skilaboð til að einfalda gagnaskiptin milli afleiðuviðskiptaskrána og viðkomandi aðila. Framseld reglugerð (ESB) nr. 151/2013 útilokar ekki að önnur sniðmát en XML-snið séu einnig notuð, s.s. „gildi aðskilin með kommu“ (csv-snið) eða textaskrár (txt-snið), að því marki að þau geri viðkomandi aðilum kleift að uppfylla skyldur sínar og umboð. Afleiðuviðskiptaskrár ætti þess vegna að vera heimilt að halda áfram að nota þessi snið í viðbót við, en þó aldrei í staðinn fyrir, XML-sniðin. Til að tryggja samanburðarhæfi og samsöfnun gagna milli afleiðuviðskiptaskráa ætti a.m.k. að nota XML-snið og XML-skilaboð, sem byggjast á aðferðafræði ISO 20022, fyrir allar frágagsskýrslur og -skipti.
- 5) Aðilarnir sem skráðir eru í 3. mgr. 81. gr. reglugerðar (ESB) nr. 648/2012 geta framselt verkefni og skyldustörf til Evrópsku verðbréfamarkaðseftirlitsstofnunarinnar skv. 28. gr. reglugerðar (ESB) nr. 1095/2010 (3), þ.m.t. varðandi aðgang að gögnum sem tilkynnt eru til afleiðuviðskiptaskráa. Slík verkaskipan ætti ekki á nokkurn hátt að hafa áhrif á skuldbindingar afleiðuviðskiptaskráa um að veita aðilum sem tilgreindir eru í 3. mgr. 81. gr. reglugerðar (ESB) nr. 648/2012, beinan og tafarlausan aðgang að þeim gögnum.
- 6) Til að tryggja trúnað ættu öll gagnaskipti milli afleiðuviðskiptaskráa og viðkomandi aðila að fara fram með öruggri tengingu milli véla og með því að nota dulkóðaðar gagnaskiptareglur. Til að tryggja sameiginlega lágmarksstaðla ætti að

(*) Þessi ESB-gerð birtist í Stjútíð. ESB L 259, 7.10.2017, bls. 14. Hennar var getið í ákvörðun sameiginlegru EES-nefndarinnar nr. 256/2018 frá 5. desember 2018 um breytingu á IX. viðauka (Fjármálaþjónusta) við EES-samninginn (bíður birtingar).

(1) Stjútíð. ESB L 201, 27.7.2012, bls. 1.

(2) Framseld reglugerð framkvæmdastjórnarinnar (ESB) nr. 151/2013 frá 19. desember 2012 um viðbætur við reglugerð Evrópuþingsins og ráðsins (ESB) nr. 648/2012 um OTC-afleiður, miðlæga mótaðila og afleiðuviðskiptaskrár að því er varðar tæknilega eftirlitsstaðla þar sem tilgreind eru gögn sem afleiðuviðskiptaskrár eiga að birta og gera aðgengileg og rekstrarstaðlar til að safna, bera saman og hafa aðgang að gögnum (Stjútíð. ESB L 52, 23.2.2013, bls. 33).

(3) Reglugerð Evrópuþingsins og ráðsins (ESB) nr. 1095/2010 frá 24. nóvember 2010 um að koma á fót evrópskri eftirlitsstofnun (Evrópska verðbréfamarkaðseftirlitsstofnunin), um breytingu á ákvörðun nr. 716/2009/EB og um niðurfellingu á ákvörðun framkvæmdastjórnarinnar 2009/77/EB (Stjútíð. ESB L 331, 15.12.2010, bls. 84).

nota SSH-skráaflutningsreglur (SFTP) milli afleiðuviðskiptaskrána og aðilanna sem skráðir eru í 3. mgr. 81. gr. reglugerðar (ESB) nr. 648/2012. Þetta ætti ekki að koma í veg fyrir að afleiðuviðskiptaskrár og viðkomandi aðilar geti komist að samkomulagi um að koma á öruggri tengingu milli véla með því að nota aðra aðskilda rás í stað SSH-skráaflutningsreglnanna. Afleiðuviðskiptaskrár ætti þess vegna að vera heimilt að halda áfram að nota aðrar öruggar tengingar milli véla í viðbót við, en þó aldrei í staðinn fyrir, SSH-skráaflutningsreglurnar.

- 7) Gögn sem varða síðustu viðskiptastöðu afleiðusamninga með opnar stöður eru nauðsynleg til að vakta fjármála-stöðugleika og kerfisáhættu. Viðkomandi aðilar ættu þess vegna að hafa aðgang að þeim gögnum.
- 8) Nauðsynlegt er að auðvelda beinan og tafarlausan aðgang að sérstökum gagnasöfnum með því að koma á samstæðu samtengjanlegra sérstakra beiðna sem varða aðilana að viðskiptunum, efnahagsleg skilyrði, flokkun og auðkenni afleiðusamningsins, fullnustutímabilið, skýrslugjöf og gjalddaga, sem og viðskipta- og lífsferilsviðburði.
- 9) Samræma ætti frestina sem afleiðuviðskiptaskrár hafa til að láta viðkomandi aðilum í té gögn til að bæta beint og tafarlaust aðgengi að gögnum afleiðuviðskiptaskrárinnar og gera viðkomandi aðilum og afleiðuviðskiptaskrár kleift að lagfæra áætlunargerð innri gagnavinnsluferla sinna.
- 10) Því ætti að breyta framseldri reglugerð (ESB) nr. 151/2013 til að tilgreina nánar og bæta rekstrarrámmann fyrir að fá aðgang, söfnunina og samanburð gagna milli afleiðuviðskiptaskráa.
- 11) Fresta ætti beitingu ákvæðanna sem mælt er fyrir um í þessari framseldu reglugerð til að auðvelda afleiðuviðskiptaskránum aðlögun kerfanna að skilgreiningunum sem mælt er fyrir um í þessari framseldu reglugerð.
- 12) Reglugerð þessi byggist á drögum að tæknilegum eftirlitsstöðlum sem Evrópska verðbréfamarkaðseftirlitsstofnunin hefur lagt fyrir framkvæmdastjórnina.
- 13) Í samræmi við 10. gr. reglugerðar (ESB) nr. 1095/2010 hefur Evrópska verðbréfamarkaðseftirlitsstofnunin haft opið samráð við almenning um drögin að tæknilegum eftirlitsstöðlum sem þessi reglugerð byggist á og greint mögulegan tengdan kostnað og ávinning. Þetta opna samráð gerði Evrópsku verðbréfamarkaðseftirlitsstofnuninni kleift að fá álit viðkomandi yfirvalda og aðila að seðlabankakerfi Evrópu (ESCB) sem kynnt var af Seðlabanka Evrópu. Þar að auki leitaði Evrópska verðbréfamarkaðseftirlitsstofnunin eftir álit hagsmunahóps á verðbréfamarkaði, sem komið var á fót í samræmi við 37. gr. reglugerðar (ESB) nr. 1095/2010.

SAMÞYKKT REGLUGERÐ ÞESSA:

1. gr.

Breytingar á framseldri reglugerð (ESB) nr. 151/2013

1. Ákvæðum 4. gr. er breytt sem hér segir:

a) Í stað 1. mgr. komi eftirfarandi:

„1. Afleiðuviðskiptaskrá skal veita aðilunum, sem taldir eru upp í 3. mgr. 81. gr. reglugerðar (ESB) nr. 648/2012, beinan og tafarlausan aðgang, þ.m.t. þegar verkefni hafa verið framseld skv. 28. gr. reglugerðar (ESB) nr. 1095/2010, að upplýsingum um afleiðusamninga í samræmi við 2. og 3. gr. þessarar reglugerðar.

Að því er varðar fyrstu undirgrein skal afleiðuviðskiptaskrá nota XML-snið og sniðmát sem er þróað í samræmi við aðferðafræði ISO 20022. Afleiðuviðskiptaskrá getur auk þess, eftir samkomulag við hlutaðeigandi aðila, veitt aðgang að upplýsingum um afleiðusamninga á öðru sniði sem gagnkvæmt samkomulag er um.“

b) Ákvæði 2. liðar falli brott.

2. Eftirfarandi 3. til 9. mgr bætist við 5. gr.:

„3. Afleiðuviðskiptaskrá skal koma á og viðhalda nauðsynlegu tæknilegu fyrirkomulagi til gera aðilunum, sem taldir eru upp í 3. mgr. 81. gr. reglugerðar (ESB) nr. 648/2012, kleift að tengjast með því að nota örugga tengingu milli véla til þess að leggja fram beiðnir um gögn og til að taka við gögnum.

Að því er varðar fyrstu undirgrein skal afleiðuviðskiptaskrá nota SSH-skráaflutningsreglur. Afleiðuviðskiptaskráin skal nota stöðluð XML-skilaboð, sem þróuð hafa verið í samræmi við aðferðafræði ISO 20022, til að eiga samskipti í gegnum þá tengingu. Afleiðuviðskiptaskrá getur auk þess, eftir samkomulag við hlutaðeigandi aðila, komið á tengingu með því að nota aðra samskiptareglu, sem gagnkvæmt samkomulag er um.

4. Í samræmi við 2. og 3. gr. þessarar reglugerðar skal afleiðuviðskiptaskrá veita aðilunum, sem taldir eru upp í 3. mgr. 81. gr. reglugerðar (ESB) nr. 648/2012, aðgang að eftirfarandi upplýsingum:

- a) öllum skýrslum um afleiðusamninga,
- b) síðustu viðskiptastöðu afleiðusamninga sem ekki hafa gjaldfallið eða verið viðfangsefni skýrslu með aðgerðategund „E“, „C“, „P“ eða „Z“ eins og um getur í reit 93 í töflu 2 í viðaukanum við framkvæmdarreglugerð framkvæmdastjórnarinnar (ESB) nr. 1247/2012 (*).

5. Afleiðuviðskiptaskrá skal koma á og viðhalda nauðsynlegu tæknilegu fyrirkomulagi til gera aðilunum, sem taldir eru upp í 3. mgr. 81. gr. reglugerðar (ESB) nr. 648/2012, kleift að koma á fyrirframskilgreindum reglubundnum beiðnum um aðgang að upplýsingum um afleiðusamninga, eins og ákvarðað er í 4. mgr., sem nauðsynlegar eru fyrir þessa aðila til að uppfylla skyldur sínar og umboð.

6. Afleiðuviðskiptaskrá skal að beiðni aðilanna sem skráðir eru í 3. mgr. 81. gr. reglugerðar (ESB) nr. 648/2012 veita aðgang að upplýsingum um afleiðusamninga samkvæmt sérhverri samsetningu af eftirfarandi reitum, eins og um getur í viðaukanum við framkvæmdarreglugerð (ESB) nr. 1247/2012, sem eru:

- a) tímastimpill tilkynningar,
- b) auðkenni skýrslugjafarmótaðila,
- c) auðkenni hins mótaðilans,
- d) atvinnugrein skýrslugjafarmótaðilans,
- e) gerð skýrslugjafarmótaðilans,
- f) auðkenni miðlara,
- g) auðkenni skýrslugjafaraðilans,
- h) auðkenni rétthafa,
- i) eignaflokkur,
- j) flokkun afurðar,
- k) auðkenni afurðar,
- l) undirliggjandi auðkenni,
- m) viðskiptastaður,
- n) tímastimpill framkvæmdar,
- o) gjalddagi,
- p) uppsagnardagur,
- q) miðlægur mótaðili (CCP) og
- r) tegund aðgerðar.

7. Afleiðuviðskiptaskrá skal koma á og viðhalda tæknilegri getu til að veita beinan og tafarlausan aðgang að upplýsingum um afleiðusamninga sem nauðsynlegar eru fyrir aðilana sem taldir eru upp í 3. mgr. 81. gr. reglugerðar (ESB) nr. 648/2012, til að uppfylla umboð sín og skyldur. Sá aðgangur skal veittur sem hér segir:

- a) ef aðili sem tilgreindur er í 3. mgr. 81. gr. reglugerðar (ESB) nr. 648/2012, biður um aðgang að upplýsingum um útistandandi afleiðusamninga eða afleiðusamninga sem annaðhvort hafa gjaldfallið eða skýrslur verið gerðar um með aðgerðategund „E“, „C“, „Z“ eða „P“, eins og um getur í reit 93 í töflu 2 í viðaukanum við framkvæmdarreglugerð (ESB) nr. 1247/2012, fyrir ekki meira en einu ári fyrir daginn sem beiðnin var lögð fram, skal afleiðuviðskiptaskrá uppfylla þá beiðni eigi síðar en klukkan 12:00 að samræmdum heimstíma á fyrsta almanaksdegi eftir daginn sem beiðnin um aðgang er lögð fram.

- b) ef aðili sem tilgreindur er í 3. mgr. 81. gr. reglugerðar (ESB) nr. 648/2012, biður um aðgang að upplýsingum um afleiðusamninga sem annaðhvort hafa gjaldfallið eða skýrslur verið gerðar um með aðgerðategund „E“, „C“, „Z“ eða „P“, eins og um getur í reit 93 í töflu 2 í viðaukanum við framkvæmdarreglugerð (ESB) nr. 1247/2012, fyrir meira en einu ári fyrir daginn sem beiðnin var lögð fram, skal afleiðuviðskiptaskrá uppfylla þá beiðni eigi síðar en þremur virkum dögum eftir daginn sem beiðnin um aðgang er lögð fram.
- c) ef beiðni aðila sem tilgreindur er í 3. mgr. 81. gr. reglugerðar (ESB) nr. 648/2012, um aðgang að gögnum tengist afleiðusamningum sem falla undir bæði a- og b-lið, skal afleiðuviðskiptaskráin veita upplýsingar um þessa afleiðusamninga eigi síðar en þremur virkum dögum eftir daginn sem beiðnin um aðgang er lögð fram.
8. Afleiðuviðskiptaskrá skal staðfesta móttöku og sannprófa réttleika og heildstæðni sérhverrar beiðni um aðgang að gögnum sem aðilarnir sem taldir eru upp í 3. mgr. 81. gr. reglugerðar (ESB) nr. 648/2012, leggja fram. Hún skal tilkynna þessum aðilum um niðurstöðuna úr þeirri sannprófun eigi síðar en sextíu mínútum eftir að beiðnin er lögð fram.
9. Afleiðuviðskiptaskrá skal nota rafræna undirskrift og dulkóðaðar gagnaskiptareglur til að tryggja trúnað, heildstæðni og vernd gagnanna sem gerð eru aðgengileg aðilunum sem taldir eru upp í 3. mgr. 81. gr. reglugerðar (ESB) nr. 648/2012.

(*) Framkvæmdarreglugerð framkvæmdastjórnarinnar (ESB) nr. 1247/2012 frá 19. desember 2012 um tæknilega framkvæmdarstaðla að því er varðar framsetningu og tíðni skýrslna um viðskipti til afleiðuviðskiptaskráa samkvæmt reglugerð þingsins og ráðsins (ESB) nr. 648/2012 um OTC-afleiður, miðlæga mótaðila og afleiðuviðskiptaskrár (Stjttíð. ESB. L 352, 21.12.2012, bls. 20) með áorðnum breytingum samkvæmt framkvæmdarreglugerð (ESB) 2017/105 (Stjttíð. ESB. L 17, 21.1.2017, bls. 17).“

2. gr.

Gildistaka og beiting

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

Hún gildir frá og með 1. nóvember 2017.

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

Gjört í Brussel 29. júní 2017.

Fyrir hönd framkvæmdastjórnarinnar,

Jean-Claude JUNCKER

forseti.