



Raad van de
Europese Unie

Brussel, 17 juni 2022
(OR. nl)

10384/22

EF 178
ECOFIN 637
DELECT 97

BEGELEIDENDE NOTA

van:	de secretaris-generaal van de Europese Commissie, ondertekend door mevrouw Martine DEPREZ, directeur
aan:	het secretariaat-generaal van de Raad
nr. Comdoc.:	C(2022) 3581 final
Betreft:	GEDELEGEERDE VERORDENING (EU) .../... VAN DE COMMISSIE van 10.6.2022 tot aanvulling van Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad betreffende technische reguleringsnormen tot nadere bepaling van de procedures voor de afstemming van gegevens tussen transactieregisters en de procedures die het transactieregister moet toepassen om te verifiëren of de rapporterende tegenpartij of de indienende entiteit de rapportagevereisten naleeft, en om de volledigheid en juistheid van de gerapporteerde gegevens te verifiëren

Hierbij gaat voor de delegaties document C(2022) 3581 final.

Bijlage: C(2022) 3581 final



Brussel, 10.6.2022
C(2022) 3581 final

GEDELEGEERDE VERORDENING (EU) .../... VAN DE COMMISSIE

van 10.6.2022

tot aanvulling van Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad betreffende technische reguleringsnormen tot nadere bepaling van de procedures voor de afstemming van gegevens tussen transactieregisters en de procedures die het transactieregister moet toepassen om te verifiëren of de rapporterende tegenpartij of de indienende entiteit de rapportagevereisten naleeft, en om de volledigheid en juistheid van de gerapporteerde gegevens te verifiëren

(Voor de EER relevante tekst)

TOELICHTING

1. ACHTERGROND VAN DE GEDELEGEERDE HANDELING

Bij Verordening (EU) 2019/834 van het Europees Parlement en de Raad van 20 mei 2019 tot wijziging van Verordening (EU) nr. 648/2012 (EMIR Refit) worden aan de ESMA bevoegdheden verleend om technische uitvoerings- en reguleringsnormen te ontwikkelen met betrekking tot het rapportagekader voor de EMIR.

Zo is in artikel 78, lid 10, van die verordening bepaald dat de ESMA technische reguleringsnormen opstelt voor de procedures voor de afstemming van gegevens tussen transactieregisters en voor de procedures die het transactieregister moet toepassen om de volledigheid en juistheid van de overeenkomstig artikel 9 gerapporteerde gegevens te verifiëren.

2. RAADPLEGING VOORAFGAAND AAN DE AANNEMING VAN DE HANDELING

Procedurele aspecten

De ESMA heeft tussen 26 maart 2020 en 3 juli 2020 een openbare raadpleging gehouden over haar ontwerpen van technische regulerings- en uitvoeringsnormen. De ESMA heeft in het totaal 41 publieke en 10 vertrouwelijke reacties ontvangen.

Standpunten van belanghebbenden

Verificatie van derivaten door transactieregisters

Een essentieel element voor de correcte werking van de rapportageregeling uit hoofde van de EMIR en voor het verzekeren van de kwaliteit van de derivatenrapportage is de validering door transactieregisters van de gegevensindiening door de aan de rapportageverplichting onderworpen tegenpartijen. Hoewel in artikel 9, lid 1 sexies, EMIR, zoals gewijzigd bij de EMIR Refit, is bepaald dat “[t]egenpartijen en CTP’s die verplicht zijn de gegevens betreffende derivatencontracten te rapporteren, [...] ervoor [zorgen] dat dergelijke gegevens juist en niet dubbel worden gerapporteerd”, wordt bij artikel 78, leden 9 en 10, EMIR, zoals gewijzigd bij de EMIR Refit, ook een verantwoordelijkheid bij de transactieregisters gelegd ten aanzien van de procedures voor de verificatie van de gegevens.

De ESMA heeft in het raadplegingsdocument een kader voorgesteld voor de verzameling van gegevens en de validering van gegevens door transactieregisters.

Om de rechtszekerheid ten aanzien van de naleving van de rapportageverplichting bij het opzetten van de procedures voor de verificatie door transactieregisters te waarborgen, had de ESMA voorgesteld om gegevens die niet overeenkomstig de vereisten van artikel 9 EMIR werden ingediend, te verwerpen, in plaats van alleen een waarschuwing te geven aan de betrokken entiteit.

De meeste respondenten steunde het voorstel van de ESMA voor het kader en waren het ermee eens dat het zou bijdragen tot de algehele gegevenskwaliteit.

Procedure voor het bijwerken van identificatiecodes voor juridische entiteiten (LEI’s)

In het raadplegingsdocument benadrukte de ESMA het belang van het proces dat door transactieregisters en tegenpartijen moet worden gevolgd bij wijzigingen in de LEI’s als gevolg van fusies, overnames of andere bedrijfsherstructureringen. De meeste respondenten waren het eens met het voorstel van de ESMA om deze aspecten te verduidelijken en in de technische reguleringsnormen de belangrijkste elementen van het proces op te nemen, in het

bijzonder met betrekking tot het tijdsplan voor het bijwerken van de LEI's, aangezien die elementen van fundamenteel belang zijn om de gegevenskwaliteit te verzekeren.

Afstemming van gegevens door transactieregisters

Het gebrek aan een eerste specificatie van het afstemmingsproces door de ESMA, wegens het ontbreken van een wettelijk mandaat, leidde tot i) inconsistente afstemmingsprocedures, ii) inconsistente afstemmingstermijnen, iii) toleranties en een categorisering van velden die door transactieregisters werden bepaald, en iv) lange uitvoeringstermijnen voor wijzigingsverzoeken. Om die problemen aan te pakken, stelde de ESMA voor dat de transactieregisters, zodra de gegevens door hen zijn gevalideerd, de gerapporteerde gegevens van beide zijden van het derivaat op elkaar afstemmen. Dit vloeit voort uit de rechtsgrondslag in artikel 78, lid 9, punt a), EMIR, zoals gewijzigd bij de EMIR Refit, waarin is bepaald dat de transactieregisters "procedures voor de effectieve afstemming van gegevens tussen transactieregisters" vaststellen. De ESMA stelde in het raadplegingsdocument een aantal algemene beginselen voor het uitvoeren van de afstemming voor. Respondenten op de openbare raadpleging steunden de harmonisatie van het afstemmingsproces en maakten een aantal opmerkingen waarmee de ESMA rekening heeft gehouden in de beginselen die in dit ontwerp van gedelegeerde verordening zijn vastgesteld.

Eindedagsresponsmechanisme

Transactieregisters moeten de rapporterende tegenpartijen, rapporterende entiteiten, voor de rapportage verantwoordelijke entiteiten en derde partijen waaraan op grond van artikel 78, lid 7, EMIR toegang is verleend tot informatie, naargelang het geval, bepaalde eindedagsinformatie verstrekken die hen in staat stelt om de kwaliteit van de in het kader van EMIR gerapporteerde gegevens te verbeteren.

De ESMA is van mening dat het voor de entiteiten nuttig kan zijn om over eindedagsinformatie te beschikken i) om hun indieningen te bevestigen, ii) om potentiële derivaten die nog niet zijn gecorrigeerd aan te pakken en iii) om automatische verwerking van begin tot eind en werkstroomautomatisering mogelijk te maken.

De ESMA heeft een groot aantal zeer gedetailleerde reacties op haar voorstellen ontvangen. Nadat zij die feedback in overweging had genomen, heeft de ESMA een minimumreeks eindedagsrapporten voorgesteld die door transactieregisters beschikbaar moeten worden gesteld.

3. EFFECTBEOORDELING

De Commissie heeft geen gedetailleerde effectbeoordeling van de voorgestelde technische reguleringsnormen verricht, maar heeft haar beoordeling gebaseerd op de kosten-batenanalyse in het eindverslag van de ESMA.

De Commissie heeft de belangrijkste beleidsbeslissingen reeds geanalyseerd en gepubliceerd in het kader van het wetgevingsvoorstel dat heeft geleid tot Verordening (EU) 2019/834 van het Europees Parlement en de Raad van 20 mei 2019 tot wijziging van Verordening (EU) nr. 648/2012.

De ESMA is van mening dat de voorgestelde technische normen de kwaliteit van de in het kader van de EMIR gerapporteerde gegevens zullen verbeteren en aldus een duidelijk voordeel zullen opleveren voor de autoriteiten die EMIR-gegevens mogen raadplegen, maar ook voor rapporterende entiteiten en transactieregisters. Zo zullen de voorgestelde wijzigingen om de vereisten in de EU in overeenstemming te brengen met de mondiale richtsnoeren inzake de rapportage van otc-derivaten, naar verwachting aanzienlijke

kostenbesparingen met zich brengen voor entiteiten die in verschillende rechtsgebieden rapporteren. Naast de standaardisering van formaten en het gebruik van ISO 20022 voor de rapportage door de tegenpartijen aan de transactieregisters, zal ook meer omvattende feedback over verwerpingen en waarschuwingen de correctie van de gegevens door de rapporterende entiteiten vergemakkelijken en de problemen met de gegevenskwaliteit beperken en zo de automatisering van de rapportage verder verbeteren en de problemen met de gegevenskwaliteit verder beperken. In het geval van afstemming zullen de voorgestelde wijzigingen die de vereisten met betrekking tot de afstemming tussen de transactieregisters op één lijn moeten brengen, naar verwachting leiden tot meer samenhangende feedback aan de rapporterende entiteiten en zullen zij bijdragen tot een gemakkelijkere afstemming van de rapporten en zo de noodzaak van de omslachtige follow-upprocessen bij inconsistenties in de rapporten verminderen, wat de nalevingskosten zal verlagen en de gegevenskwaliteit ten goede zal komen.

Hoewel deze voordelen opwegen tegen de kosten, zullen de uit de voorgestelde technische regulerings- en uitvoeringsnormen voortvloeiende wijzigingen van de rapportagesystemen op de korte termijn onvermijdelijk kosten met zich brengen voor de autoriteiten, de tegenpartijen en de transactieregisters. De ESMA stelt een tijdschema voor de uitvoering voor dat kostenimplicaties moet helpen verlichten.

4. JURIDISCHE ELEMENTEN VAN DE GEDELEGEERDE HANDELING

In artikel 1 is het proces voor de verificatie van rapporten inzake derivaten door transactieregisters beschreven.

In artikel 2 is de procedure voor het bijwerken van LEI's beschreven.

In artikel 3 is de procedure voor de afstemming van gegevens tussen transactieregisters vastgesteld.

In artikel 4 is de eindedagsinformatie met betrekking tot gerapporteerde derivaten vastgesteld die transactieregisters aan bepaalde entiteiten beschikbaar moeten stellen.

Artikel 5 bepaalt de datum van inwerkingtreding van de gedelegeerde verordening.

GEDELEGEERDE VERORDENING (EU) .../... VAN DE COMMISSIE

van 10.6.2022

tot aanvulling van Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad betreffende technische reguleringsnormen tot nadere bepaling van de procedures voor de afstemming van gegevens tussen transactieregisters en de procedures die het transactieregister moet toepassen om te verifiëren of de rapporterende tegenpartij of de indienende entiteit de rapportagevereisten naleeft, en om de volledigheid en juistheid van de gerapporteerde gegevens te verifiëren

(Voor de EER relevante tekst)

DE EUROPESE COMMISSIE,

Gezien het Verdrag betreffende de werking van de Europese Unie,

Gezien Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad van 4 juli 2012 betreffende otc-derivaten, centrale tegenpartijen en transactieregisters, en met name artikel 78, lid 10¹,

Overwegende hetgeen volgt:

- (1) Teneinde te garanderen dat gegevens van hoge kwaliteit over derivaten aan transactieregisters worden gerapporteerd, moeten deze registers de identiteit van de rapporterende entiteiten, de logische integriteit van de volgorde waarin de gegevens over derivaten worden gerapporteerd, en de volledigheid en juistheid van deze gegevens verifiëren.
- (2) Om dezelfde reden moeten transactieregisters de gegevens van elk ontvangen derivaatrapport op elkaar afstemmen wanneer beide tegenpartijen onderworpen zijn aan een rapportageverplichting. Er moet een standaardprocedure worden vastgesteld opdat transactieregisters de afstemming op consistente wijze kunnen uitvoeren, alsook om het risico te beperken dat gegevens over derivaten niet op elkaar worden afgestemd. Bepaalde gegevens over derivaten kunnen mogelijk echter niet identiek zijn als gevolg van de specifieke kenmerken van de informatietechnologiesystemen die door de rapporterende entiteiten worden gebruikt. Daarom moeten bepaalde toleranties worden toegepast, zodat minieme verschillen in de gerapporteerde gegevens over derivaten de autoriteiten niet beletten de gegevens met voldoende betrouwbaarheid te analyseren.
- (3) Voorts moeten de transactieregisters, onverminderd andere verplichtingen met betrekking tot de tijdens het afstemmingsproces verzamelde en geregistreerde gegevens over derivaten, de vertrouwelijkheid waarborgen van de tussen hen uitgewisselde en aan de rapporterende tegenpartijen, de voor de rapportage verantwoordelijke entiteiten en de rapporterende entiteiten beschikbaar gestelde gegevens.

¹ PB L 201 van 27.7.2012, blz. 1.

- (4) Wanneer zich een bedrijfsherstructurering voordoet die tot de wijziging van de identificatiecode voor juridische entiteiten (“LEI”) van een tegenpartij leidt, moeten de gegevens van de in een derivaatrapport geïdentificeerde entiteiten worden bijgewerkt. Om de integriteit van die informatie te verzekeren, die van essentieel belang is voor het toezicht op systeemrisico’s voor de financiële stabiliteit, moet de actualisering centraal door de transactieregisters worden uitgevoerd. Daarom moet een procedure worden vastgesteld om ervoor te zorgen dat transactieregisters de identificatiecode van de entiteit centraal kunnen bijwerken, om zo een efficiënt, robuust en tijdig proces te waarborgen.
- (5) Er moet de rapporterende entiteiten echter voldoende tijd worden gegund om zich aan de rapportagevereisten aan te passen, met name om te voorkomen dat er zich onmiddellijk na de inwerkingtreding van de rapportageverplichting een opeenstapeling van niet-afgestemde transacties voordoet. Het is daarom raadzaam dat in een eerste fase slechts een beperkt aantal velden op elkaar moet worden afgestemd.
- (6) Rapporterende entiteiten en, in voorkomend geval, voor de rapportage verantwoordelijke autoriteiten, moeten in staat zijn hun naleving van hun rapportageverplichtingen uit hoofde van Verordening (EU) 648/2012 te controleren. Zij moeten bijgevolg dagelijks toegang kunnen krijgen tot bepaalde informatie over deze rapporten, met inbegrip van zowel de uitkomst van de verificatie van deze rapporten, als wanneer een waarschuwing is afgegeven, en de vooruitgang die bij de afstemming van de gerapporteerde gegevens is geboekt. Daarom is het noodzakelijk te specificeren welke informatie een transactieregister aan het einde van elke werkdag ter beschikking van deze entiteiten moet stellen.
- (7) Deze verordening is gebaseerd op het ontwerp van technische reguleringsnormen die de Europese Autoriteit voor effecten en markten bij de Commissie heeft ingediend.
- (8) De Europese Autoriteit voor effecten en markten heeft de leden van het Europees Stelsel van centrale banken geraadpleegd en heeft open publieke raadplegingen gehouden over de ontwerpen van technische reguleringsnormen waarop deze verordening is gebaseerd, de potentiële hieraan gerelateerde kosten en baten geanalyseerd en het advies ingewonnen van de Stakeholdergroep effecten en markten, die overeenkomstig artikel 37 van Verordening (EU) nr. 1095/2010 van het Europees Parlement en de Raad² is opgericht.
- (9) Om tegenpartijen en transactieregisters in staat te stellen alle nodige maatregelen te nemen om zich aan de nieuwe vereisten aan te passen, moet de datum van toepassing van deze verordening met 18 maanden worden uitgesteld,

HEEFT DE VOLGENDE VERORDENING VASTGESTELD:

Artikel 1

Verificatie van derivaten door transactieregisters

1. Een transactieregister verifieert alle volgende elementen van een ontvangen derivaatrapport:

² Verordening (EU) nr. 1095/2010 van het Europees Parlement en de Raad van 24 november 2010 tot oprichting van een Europese toezichthoudende autoriteit (Europese Autoriteit voor effecten en markten), tot wijziging van Besluit nr. 716/2009/EG en tot intrekking van Besluit 2009/77/EG van de Commissie (PB L 331 van 15.12.2010, blz. 84).

- (a) de identiteit van de rapporterende entiteit zoals bedoeld in veld 2 van tabel 1 en veld 2 van tabel 3 van de bijlage bij [PB: *gelieve verwijzing in te voegen naar C(2022) 3588*];
 - (b) of de XML-template die voor de rapportage van een derivaat is gebruikt, strookt met de ISO 20022-methode overeenkomstig artikel 1 van [PB: *gelieve verwijzing in te voegen naar C(2022) 3588*];
 - (c) of de rapporterende entiteit, indien verschillend van de voor de rapportage verantwoordelijke entiteit zoals bedoeld in veld 3 van tabel 1 en veld 3 van tabel 3 van de bijlage I bij [PB: *gelieve verwijzing in te voegen naar C(2022) 3588*], naar behoren gemachtigd is om namens tegenpartij 1 of de voor de rapportage verantwoordelijk entiteit, indien verschillend van tegenpartij 1, zoals bedoeld in veld 4 van tabel 1 en veld 4 van tabel 3 van de bijlage I bij [PB: *gelieve verwijzing in te voegen naar C(2022) 3588*];
 - (d) of dezelfde derivaatrapportage niet al eerder is ingediend;
 - (e) of een derivaatrapport met soort actie “Wijziging”, “Actualisering van de margin”, “Waardering”, “Correctie”, “Fout” of “Beëindigen” verband houdt met een eerder ingediend derivaat;
 - (f) of een derivaatrapport met soort actie “Wijziging” geen verband houdt met een derivaat dat als geannuleerd is gerapporteerd met soort actie “Fout” en vervolgens niet is gerapporteerd met actietype “Heropenen”;
 - (g) of een derivaatrapport niet het soort actie “Nieuw” bevat en betrekking heeft op een derivaat dat al eerder is gerapporteerd;
 - (h) of een derivaatrapport niet het soort actie “Positiebestanddeel” bevat en betrekking heeft op een derivaat dat al eerder is gerapporteerd;
 - (i) of een derivaatrapport niet tot doel heeft de gegevens in de velden “Tegenpartij 1” of “Tegenpartij 2” van een eerder gerapporteerd derivaat te wijzigen;
 - (j) of een derivaatrapport niet beoogt een bestaand derivaat te wijzigen door een latere ingangsdatum te specificeren dan de gerapporteerde vervaldatum van het derivaat;
 - (k) of een derivaat dat werd gerapporteerd met het soort actie “Heropenen” betrekking heeft op een eerder ingediend derivaatrapport met actietype “Fout” of “Beëindigen” of op een derivaat dat is vervallen;
 - (l) de juistheid en volledigheid van het derivaatrapport.
2. Een transactieregister verwerpt een derivaatrapport dat niet aan één van de vereisten van lid 1 voldoet en brengt dat rapport onder in één van de verwerpingscategorieën die in tabel 1 van de bijlage zijn vermeld.
3. Uiterlijk zestig minuten na ontvangst van een derivaatrapport verstrekt een transactieregister de rapporterende entiteiten gedetailleerde informatie over de resultaten van de in lid 1 bedoelde gegevensverificatie. Een transactieregister verstrekt deze resultaten in een template in XML-formaat overeenkomstig de ISO 20022-methode. In de resultaten wordt vermeld waarom een derivaatrapport overeenkomstig tabel 1 van de bijlage is verworpen.

Artikel 2

Procedure voor het bijwerken van identificatiecode voor juridische entiteiten

1. Een transactieregister waaraan een verzoek op grond van artikel 8 van [PB: *gelieve verwijzing in te voegen naar C(2022) 3588*] wordt gericht, identificeert de uitstaande derivaten als bedoeld in artikel 2, lid 2, van [PB: *gelieve verwijzing in te voegen naar C(2022) 3588*] bij de bedrijfsherstructurering, wanneer de entiteit wordt gerapporteerd met de identificatiecode die vóór de bedrijfsherstructurering werd gebruikt in het veld “Tegenpartij 1” of “Tegenpartij 2”, zoals meegedeeld in het desbetreffende verzoek. Het vervangt de oude identificatiecode door de nieuwe identificatiecode voor juridische entiteiten (“LEI”) in de rapporten voor al die derivaten op het tijdstip van de in artikel 8 van [PB: *gelieve verwijzing in te voegen naar C(2022) 3588*] bedoelde gebeurtenis met betrekking tot die tegenpartij. Een transactieregister voert de procedure voor de actualisering van de identificatiecode uit uiterlijk op de dag van de herstructurering of binnen dertig kalenderdagen na ontvangst van het verzoek indien het rapport minder dan dertig kalenderdagen vóór de datum van de bedrijfsherstructurering is ingediend.
2. Een transactieregister identificeert de relevante derivaten als bedoeld in artikel 2, lid 2, van [PB: *gelieve verwijzing in te voegen naar C(2022) 3588*] bij de bedrijfsherstructurering wanneer de entiteit in een van de andere velden met de oude identificatiecode wordt geïdentificeerd en vervangt die identificatiecode door de nieuwe LEI. Wanneer een bedrijfsherstructurering verband houdt met een actualisering van de LEI voor andere velden dan “Tegenpartij 1” of “Tegenpartij 2”, voert het transactieregister die actualisering van de relevante derivaten alleen uit na een tijdige bevestiging door tegenpartij 1 of door de voor de rapportage verantwoordelijke entiteit.
3. Een transactieregister voert de volgende acties uit:
 - (a) na ontvangst van de in lid 2 bedoelde bevestiging, werkt het de LEI bij vanaf de in lid 1 bedoelde datum;
 - (b) het deelt alle andere transactieregisters en de rapporterende tegenpartijen, de rapporterende entiteiten, de voor de rapportage verantwoordelijke entiteiten die betrokken zijn bij de derivatencontracten waarop de actualisering van de LEI betrekking heeft en derden waaraan op grond van artikel 78, lid 7, van Verordening (EU) nr. 648/2012 toegang tot informatie is verleend, naargelang het geval, zo spoedig mogelijk, en uiterlijk vijf werkdagen na ontvangst van de volledige kennisgeving het volgende mee:
 - i) de oude identificatiecode(s);
 - ii) de nieuwe identificatiecode;
 - iii) de datum waarop de actualisering moet plaatsvinden;
 - iv) in het geval van corporate events die gevolgen hebben voor een subset van de op de datum van de gebeurtenis uitstaande derivaten, de lijst van de unieke transactiecodes (UTI's) van de derivaten waarop de actualisering van de LEI betrekking heeft;
 - (c) het stelt uiterlijk op de werkdag vóór de datum waarop de actualisering wordt toegepast de in artikel 81, lid 3, van Verordening (EU) nr. 648/2012 vermelde entiteiten die toegang hebben tot de gegevens met betrekking tot de

bijgewerkte derivaten, met behulp van een specifiek bestand in machineleesbaar formaat, in kennis van:

- i) de oude identificatiecode(s);
 - ii) de nieuwe identificatiecode;
 - iii) de datum waarop de actualisering moet plaatsvinden;
 - iv) in het geval van corporate events die gevolgen hebben voor een subset van de op de datum van de gebeurtenis uitstaande derivaten, de lijst van de UTI's van de derivaten waarop de actualisering van de LEI betrekking heeft;
- (d) het registreert de actualisering van de LEI in het rapportageboek.
4. Een transactieregister werkt de LEI's die zijn gerapporteerd voor andere dan de in artikel 2, lid 2, van [PB: *gelieve verwijzing in te voegen naar C(2022) 3588*] bedoelde derivaten niet bij op het tijdstip van het corporate event.

Artikel 3

Afstemming van gegevens door transactieregisters

1. Een transactieregister streeft de afstemming van een gerapporteerd derivaat na door de in lid 3 beschreven stappen te ondernemen, mits aan alle volgende voorwaarden is voldaan:
 - (a) het transactieregister heeft de in artikel 1, leden 1 en 2, beschreven verificaties voltooid;
 - (b) beide tegenpartijen bij het gerapporteerde derivaat hebben een rapportageverplichting op grond van artikel 9 van Verordening (EU) nr. 648/2012;
 - (c) het transactieregister heeft met betrekking tot het gerapporteerde derivaat geen rapport met het actiotype "Fout" ontvangen, tenzij dat rapport is gevolgd door een rapport met actiotype "Heropenen".
2. Een transactieregister treft de nodige regelingen om de vertrouwelijkheid van de gegevens te waarborgen bij de uitwisseling van informatie met andere transactieregisters en bij het verstrekken van informatie over de waarden voor alle velden waarvoor afstemming geldt aan de rapporterende tegenpartijen, de rapporterende entiteiten, de voor de rapportage verantwoordelijke entiteiten en derden waaraan op grond van artikel 78, lid 7, van Verordening (EU) nr. 648/2012 toegang is verleend tot informatie.
3. Wanneer aan alle voorwaarden van lid 1 is voldaan, onderneemt een transactieregister de volgende stappen, waarbij het gebruikmaakt van de laatst gerapporteerde waarde voor elk van de velden in tabel 2 van de bijlage op de voorgaande werkdag:
 - (a) een transactieregister dat een derivaatrapport heeft ontvangen, verifieert of het een overeenkomstig rapport van of namens de andere tegenpartij heeft ontvangen;
 - (b) een transactieregister dat geen overeenkomstig derivaatrapport als bedoeld in punt a) heeft ontvangen, tracht het transactieregister te identificeren dat het overeenkomstige derivaatrapport heeft ontvangen door aan alle geregistreerde transactieregisters de waarden van de volgende velden van het gerapporteerde

derivaat mee te delen: “Unieke transactie-identificatiecode”, “Tegenpartij 1” en “Tegenpartij 2”;

- (c) een transactieregister dat vaststelt dat een ander transactieregister een overeenkomstig derivaatrapport als bedoeld in punt a) heeft ontvangen, wisselt met dat transactieregister de gegevens van het gerapporteerde derivaat uit in een template in XML-formaat die overeenkomstig de ISO 20022-methode is ontwikkeld;
 - (d) een transactieregister behandelt een gerapporteerd derivaat als afgestemd wanneer de gegevens van dat aan afstemming onderworpen derivaat overeenstemmen met de gegevens van het overeenkomstige derivaat als bedoeld in punt a) en in overeenstemming met de toepasselijke tolerantiegrenzen en de relevante toepassingsdata als vastgesteld in tabel 2 van de bijlage;
 - (e) vervolgens kent een transactieregister aan elke gerapporteerde derivatentransactie waarden voor de afstemmingscategorieën toe, zoals deze zijn vermeld in tabel 3 van de bijlage;
 - (f) een transactieregister voltooit zo spoedig mogelijk de in de punten a) tot en met e) beschreven stappen en onderneemt op een gegeven werkdag geen van deze stappen na middernacht gecoördineerde universele tijd (Universal Coordinated Time, UTC);
 - (g) een transactieregister dat een gerapporteerd derivaat niet kan afstemmen, streeft op de volgende werkdag de afstemming na van de gegevens van het desbetreffende gerapporteerde derivaat. Dertig kalenderdagen nadat het derivaat niet langer uitstaat, streeft het transactieregister niet langer de afstemming van het gerapporteerde derivaat na.
4. Aan het einde van elke werkdag gaat een transactieregister met elk transactieregister waarmee het derivaten heeft afgestemd, het totale aantal gekoppelde derivaten en het aantal afgestemde derivaten na. Een transactieregister beschikt over schriftelijke procedures om alle bij dit proces vastgestelde discrepanties op te lossen.
5. Uiterlijk zestig minuten na de voltooiing van het afstemmingsproces overeenkomstig lid 3, punt g), verstrekt een transactieregister de rapporterende entiteiten de resultaten van het afstemmingsproces dat het met betrekking tot de gerapporteerde derivaten heeft uitgevoerd. Een transactieregister verstrekt deze resultaten in een template in XML-formaat die overeenkomstig de ISO 20022-methode is ontwikkeld, met vermelding van informatie over de velden die niet op elkaar zijn afgestemd.

Artikel 4

Eindedagsresponsmechanismen

1. Met betrekking tot elke werkdag verstrekt een transactieregister de rapporterende tegenpartijen, de rapporterende entiteiten, de voor de rapportage verantwoordelijke entiteiten en derden waaraan op grond van artikel 78, lid 7, van Verordening (EU) nr. 648/2012 toegang is verleend tot informatie, naargelang het geval, de volgende informatie over de betrokken derivaten, in een XML-indeling en een template die is ontwikkeld overeenkomstig de ISO 20022-methode:
- (a) in de loop van die dag gerapporteerde derivaten;
 - (b) de meest recente handelsstaten van uitstaande derivaten;

- (c) de derivatenrapporten die in de loop van die dag zijn verworpen;
 - (d) de afstemmingsstatus van alle gerapporteerde derivaten die overeenkomstig artikel 3, lid 1, onderworpen zijn aan afstemming;
 - (e) de uitstaande derivaten waarvoor geen waardering is gerapporteerd of waarvoor de gerapporteerde waardering dateert van meer dan 14 kalenderdagen vóór de dag waarop het rapport wordt gegenereerd;
 - (f) de uitstaande derivaten waarvoor geen margin-informatie is gerapporteerd of waarvoor de gerapporteerde margin-informatie dateert van meer dan 14 kalenderdagen vóór de dag waarop het rapport wordt gegenereerd;
 - (g) de derivaten die op die dag zijn ontvangen met soort actie “Nieuw”, “Positiebestanddeel”, “Wijziging” of “Correctie” en waarvan het nominale bedrag abnormaal is voor die klasse van derivaten.
2. Een transactieregister verstrekt die informatie uiterlijk om 06.00 uur gecoördineerde universele tijd op de werkdag volgend op de dag waarop de in lid 1 bedoelde informatie betrekking heeft.

Artikel 5

Inwerkingtreding en toepassing

Deze verordening treedt in werking op de twintigste dag na die van de bekendmaking ervan in het *Publicatieblad van de Europese Unie*.

Zij is van toepassing met ingang van [PB: gelieve de datum in te voegen van de eerste maandag volgend op de datum die overeenkomt met 18 maanden na de datum van inwerkingtreding].

Deze verordening is verbindend in al haar onderdelen en is rechtstreeks toepasselijk in elke lidstaat.

Gedaan te Brussel, 10.6.2022

Voor de Commissie
De voorzitter
Ursula VON DER LEYEN