



Rada
Unii Europejskiej

Bruksela, 17 czerwca 2022 r.
(OR. en)

10384/22

EF 178
ECOFIN 637
DELECT 97

PISMO PRZEWODNIE

Od: Sekretarz generalna Komisji Europejskiej (podpisała dyrektor Martine DEPREZ)

Do: Sekretariat Generalny Rady

Nr dok. Kom.: C(2022) 3581 final

Dotyczy: ROZPORZĄDZENIE DELEGOWANE KOMISJI (UE) .../... z dnia 10.6.2022 r. uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych określających procedury uzgadniania danych między repozytoriami transakcji i procedury, które repozytorium transakcji ma stosować w celu weryfikacji spełnienia przez kontrahenta dokonującego zgłoszenia lub podmiot przekazujący zgłoszenie wymogów dotyczących zgłaszania oraz w celu weryfikacji kompletności i poprawności zgłaszanych danych

Delegacje otrzymują w załączeniu dokument C(2022) 3581 final.

Zał.: C(2022) 3581 final

Bruksela, dnia 10.6.2022 r.
C(2022) 3581 final

ROZPORZĄDZENIE DELEGOWANE KOMISJI (UE) .../...

z dnia 10.6.2022 r.

uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych określających procedury uzgadniania danych między repozytoriami transakcji i procedury, które repozytorium transakcji ma stosować w celu weryfikacji spełnienia przez kontrahenta dokonującego zgłoszenia lub podmiot przekazujący zgłoszenie wymogów dotyczących zgłaszania oraz w celu weryfikacji kompletności i poprawności zgłaszanych danych

(Tekst mający znaczenie dla EOG)

UZASADNIENIE

1. KONTEKST AKTU DELEGOWANEGO

Rozporządzeniem Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2019/834 z dnia 20 maja 2019 r. (EMIR REFIT) zmieniającym rozporządzenie (UE) nr 648/2012 (EMIR) wprowadzono szereg uprawnień dla ESMA w zakresie opracowywania wykonawczych i regulacyjnych standardów technicznych dotyczących ram sprawozdawczości na podstawie EMIR.

W szczególności w art. 78 ust. 10 tego rozporządzenia zobowiązano ESMA do opracowania regulacyjnych standardów technicznych określających procedury uzgadniania danych między repozytoriami transakcji oraz procedury sprawdzania przez repozytoria transakcji kompletności i prawidłowości danych zgłaszanych zgodnie z art. 9.

2. KONSULTACJE PRZEPROWADZONE PRZED PRZYJĘCIEM AKTU

Aspekty proceduralne

W dniach 26 marca 2020 r. – 3 lipca 2020 r. ESMA przeprowadził konsultacje publiczne w sprawie projektu regulacyjnych i wykonawczych standardów technicznych. Urząd otrzymał łącznie 41 odpowiedzi jawnych i 10 odpowiedzi poufnych.

Opinie zainteresowanych stron

Weryfikacja instrumentów pochodnych przez repozytorium transakcji

Zasadniczym elementem prawidłowego funkcjonowania systemu zgłaszania na podstawie EMIR oraz zapewnienia odpowiedniej jakości zgłoszeń dotyczących instrumentów pochodnych jest walidacja przez repozytoria transakcji danych przekazywanych przez kontrahentów podlegających obowiązkowi zgłaszania. Chociaż w art. 9 ust. 1e EMIR zmienionego przez EMIR REFIT przewidziano, że „kontrahenci i CCP zobowiązani do zgłaszania szczegółowych informacji na temat kontraktów pochodnych zapewniają, by takie informacje szczegółowe były zgłaszane prawidłowo i bez powielania”, w art. 78 ust. 9 i art. 78 ust. 10 EMIR zmienionego przez EMIR REFIT również na repozytoria transakcji nałożono obowiązek w zakresie procedur weryfikacji danych.

W dokumencie konsultacyjnym ESMA zaproponował ramy regulujące gromadzenie i walidację danych przez repozytoria transakcji.

Aby zapewnić pewność prawa w odniesieniu do przestrzegania obowiązku zgłaszania przy wprowadzaniu przez repozytoria transakcji procedur weryfikacji, ESMA zaproponował, aby odrzucać dane, które nie zostały zgłoszone zgodnie z wymogami określonymi w art. 9 EMIR, a nie tylko kierować do danego podmiotu zastrzeżenie.

Większość respondentów poparła wnioszek ESMA dotyczący ram i uznała, że przyczynią się one do ogólnej jakości danych.

Procedura aktualizacji identyfikatora podmiotu prawnego (LEI)

W dokumencie konsultacyjnym ESMA podkreślił znaczenie procesu, który ma być stosowany przez repozytoria transakcji i kontrahentów w przypadku zmian w LEI wynikających z połączenia, przejęcia lub innych zdarzeń korporacyjnych związanych z restrukturyzacją. Większość respondentów zgodziła się z propozycją ESMA zakładającą doprecyzowanie tych aspektów i włączenie do regulacyjnych standardów technicznych zasadniczych elementów odnośnego procesu, zwłaszcza w odniesieniu do elementów związanych z ramami czasowymi aktualizacji LEI, ponieważ mają one zasadnicze znaczenie dla zapewnienia jakości danych.

Uzgadnianie danych przez repozytoria transakcji

Brak wstępnej specyfikacji przez ESMA procesu uzgadniania ze względu na brak upoważnienia prawnego doprowadził do tego, że (i) procedury uzgadniania były niespójne, (ii) terminy uzgodnienia były niejednorodne, (iii) o granicach tolerancji i kategoryzacji pól decydowały repozytoria transakcji, (iv) terminy realizacja wniosków o zmianę były odległe. Aby rozwiązać te problemy, ESMA zaproponował, aby po walidacji danych przez repozytoria transakcji uzgadniały one szczegółowe informacje dotyczące obu stron zgłaszanego instrumentu pochodnego. Wynika to z podstawy prawnej określonej w art. 78 ust. 9 lit. a) rozporządzenia EMIR, zmienionego przez EMIR REFIT, który stanowi, że repozytoria transakcji ustanawiają „procedury uzgadniania danych między repozytoriami transakcji”. W dokumencie konsultacyjnym ESMA zaproponował kilka ogólnych zasad przeprowadzania uzgodnień. Respondenci biorący udział w konsultacjach publicznych poparli harmonizację procesu uzgadniania i przedstawili szereg uwag, które ESMA uwzględnił w zasadach ustanowionych w niniejszym projekcie rozporządzenia delegowanego.

Mechanizm reagowania na koniec dnia

Repozytoria transakcji powinny przekazywać, stosownie do przypadku, kontrahentom dokonującym zgłoszeń, podmiotom przekazującym zgłoszenia, podmiotom odpowiedzialnym za zgłaszanie oraz osobom trzecim, którym przyznano dostęp do informacji na podstawie art. 78 ust. 7 EMIR, określone informacje według stanu na koniec dnia, które powinny umożliwić im poprawę jakości danych zgłaszanych zgodnie z EMIR.

ESMA uważa, że informacje na temat odrzuconych transakcji według stanu na koniec dnia stanowią dla podmiotów praktyczne wskazówki umożliwiające (i) potwierdzenie prawidłowości ich zgłoszeń, (ii) podjęcie działań w odniesieniu do wszelkich potencjalnych instrumentów pochodnych, których jeszcze nie skorygowano, oraz (iii) bezpośrednie przetwarzanie i automatyzację przepływu pracy.

ESMA otrzymał znaczną liczbę bardzo szczegółowych uwag dotyczących zaproponowanych rozwiązań. Po rozpatrzeniu tych informacji zwrotnych ESMA zaproponował minimalny zestaw zgłaszanych danych według stanu na koniec dnia, które mają być udostępniane przez repozytoria transakcji.

3. OCENA SKUTKÓW

Komisja nie przeprowadziła szczegółowej oceny skutków proponowanych regulacyjnych standardów technicznych, ale oparła swoją ocenę na przeprowadzonej przez ESMA analizie kosztów i korzyści zawartej w sprawozdaniu końcowym Urzędu.

Główne decyzje polityczne zostały już przeanalizowane i opublikowane przez Komisję we wniosku ustawodawczym, który doprowadził do przyjęcia rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2019/834 z dnia 20 maja 2019 r. zmieniającego rozporządzenie (UE) nr 648/2012.

ESMA przyjmuje, że proponowane standardy techniczne poprawią jakość danych zgłaszanych zgodnie z EMIR, a tym samym przyniosą wyraźne korzyści organom uprawnionym do dostępu do tych danych, a także podmiotom dokonującym zgłoszeń i repozytoriom transakcji. Na przykład proponowane zmiany dostosowujące wymogi w UE do globalnych wytycznych dotyczących zgłaszania instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym powinny przynieść znaczne zmniejszenie kosztów dla podmiotów dokonujących zgłoszeń w kilku jurysdykcjach. Podobnie, oprócz standaryzacji formatów i stosowania normy ISO 20022 w odniesieniu do zgłoszeń dokonywanych przez kontrahentów do repozytoriów transakcji, pełniejsze informacje zwrotne

na temat odrzuconych wniosków i zastrzeżeń ułatwią korygowanie danych przez podmioty dokonujące zgłoszeń oraz przyczynią się do zmniejszenia problemów związanych z jakością danych, a tym samym do dalszego zwiększenia automatyzacji zgłaszania i ograniczenia problemów związanych z jakością danych. W przypadku uzgadniania oczekuje się, że proponowane zmiany harmonizujące wymogi dotyczące uzgadniania między repozytoriami transakcji doprowadzą do poprawy spójności informacji zwrotnych dotyczących uzgadniania przekazywanych podmiotom dokonującym zgłoszeń i przyczynią się do łatwiejszego uzgadniania zgłoszeń, zmniejszając tym samym potrzebę uciążliwych procesów następczych związanych z przerwami w uzgadnianiu, co z kolei przełoży się na niższe koszty przestrzegania przepisów i poprawę jakości danych.

Chociaż korzyści te przewyższają koszty, jest nieuniknione, że w perspektywie krótkoterminowej zmiany w systemach zgłaszania wynikające z proponowanych regulacyjnych i wykonawczych standardów technicznych pociągną za sobą koszty dla organów, kontrahentów i repozytoriów transakcji. ESMA proponuje harmonogram wdrażania, który powinien pomóc w złagodzeniu wpływu kosztów.

4. ASPEKTY PRAWNE AKTU DELEGOWANEGO

W art. 1 określono proces weryfikacji przez repozytoria transakcji zgłoszeń instrumentów pochodnych.

W art. 2 określono procedurę aktualizacji LEI.

W art. 3 ustanowiono procedurę uzgadniania danych przez repozytoria transakcji.

W art. 4 określono informacje dotyczące zgłoszonych instrumentów pochodnych według stanu na koniec dnia, które to informacje repozytoria transakcji mają obowiązek udostępniać określonym podmiotom.

W art. 5 określono datę wejścia w życie rozporządzenia delegowanego.

ROZPORZĄDZENIE DELEGOWANE KOMISJI (UE) .../...

z dnia 10.6.2022 r.

uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych określających procedury uzgadniania danych między repozytoriami transakcji i procedury, które repozytorium transakcji ma stosować w celu weryfikacji spełnienia przez kontrahenta dokonującego zgłoszenia lub podmiot przekazujący zgłoszenie wymogów dotyczących zgłaszania oraz w celu weryfikacji kompletności i poprawności zgłaszanych danych

(Tekst mający znaczenie dla EOG)

KOMISJA EUROPEJSKA,

uwzględniając Traktat o funkcjonowaniu Unii Europejskiej,

uwzględniając rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 z dnia 4 lipca 2012 r. w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i repozytoriów transakcji¹, w szczególności jego art. 78 ust. 10,

a także mając na uwadze, co następuje:

- (1) Aby zapewnić wysoką jakość szczegółowych informacji dotyczących instrumentów pochodnych zgłaszanych do repozytoriów transakcji, repozytoria transakcji powinny weryfikować tożsamość podmiotów przekazujących zgłoszenia, logiczną integralność kolejności, w jakiej zgłaszane są szczegółowe informacje dotyczące instrumentu pochodnego, oraz kompletność i prawidłowość tych szczegółowych informacji.
- (2) Z tego samego powodu repozytoria transakcji powinny uzgadniać szczegółowe informacje zawarte w każdym otrzymanym zgłoszeniu instrumentu pochodnego, w przypadku gdy obaj kontrahenci podlegają obowiązkowi zgłaszania. Należy określić standardowy proces umożliwiający repozytoriom transakcji prowadzenie uzgodnień w spójny sposób i ograniczenie ryzyka braku uzgodnienia szczegółowych informacji dotyczących instrumentów pochodnych. Niektóre szczegółowe informacje dotyczące instrumentów pochodnych mogą się jednak różnić ze względu na specyfikę systemów technicznych wykorzystywanych przez podmioty przekazujące zgłoszenia. Należy zatem przyjąć pewną tolerancję, aby niewielkie różnice w zgłoszonych szczegółowych informacjach dotyczących instrumentów pochodnych nie uniemożliwiały organom analizowania danych przy zachowaniu odpowiedniego poziomu zaufania.
- (3) Ponadto, niezależnie od innych obowiązków względem szczegółowych informacji na temat instrumentów pochodnych gromadzonych i rejestrowanych podczas procesu uzgadniania, repozytoria transakcji powinny zapewnić poufność danych wymienianych między sobą i udostępnianych kontrahentom dokonującym zgłoszeń, podmiotom odpowiedzialnym za zgłaszanie oraz podmiotom przekazującym zgłoszenia.

¹ Dz.U. L 201 z 27.7.2012, s. 1.

- (4) W przypadku zaistnienia zdarzenia korporacyjnego związanego z restrukturyzacją skutkującą zmianą identyfikatora podmiotu prawnego („LEI”) kontrahenta szczegółowe informacje dotyczące podmiotów wskazanych w zgłoszeniu instrumentu pochodnego powinny podlegać aktualizacji. Aby zapewnić integralność tych informacji, co ma zasadnicze znaczenie z punktu widzenia monitorowania ryzyka systemowego dla stabilności finansowej, aktualizację tę powinny przeprowadzać centralnie repozytoria transakcji. Z tego względu należy ustanowić procedurę w celu zapewnienia, aby repozytoria transakcji mogły aktualizować identyfikator podmiotu w sposób scentralizowany, zapewniając tym samym efektywny, solidny i terminowy proces.
- (5) Podmiotom przekazującym zgłoszenia należy zapewnić wystarczającą ilość czasu na dostosowanie się do wymogów dotyczących zgłaszania, w szczególności aby zapobiec nagromadzeniu niezgodnionych transakcji bezpośrednio po wejściu w życie obowiązku zgłaszania. W związku z tym właściwe jest, aby na pierwszym etapie uzgadnianie dotyczyło tylko ograniczonego zbioru pól.
- (6) Podmioty przekazujące zgłoszenia i podmioty odpowiedzialne za zgłaszanie, stosownie do przypadku, powinny mieć możliwość monitorowania przestrzegania przez nie obowiązku zgłaszania, któremu podlegają, a który wynika z rozporządzenia (UE) 648/2012. Powinny zatem mieć codzienny dostęp do niektórych informacji dotyczących tych zgłoszeń, w tym do wyników ich weryfikacji, również w przypadku wygenerowania zastrzeżenia, a także do informacji o postępie procesu uzgadniania zgłoszonych danych. W związku z tym konieczne jest określenie informacji, które repozytorium transakcji powinno udostępniać tym podmiotom na koniec każdego dnia roboczego.
- (7) Podstawę niniejszego rozporządzenia stanowi projekt regulacyjnych standardów technicznych przedłożony Komisji przez Europejski Urząd Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych.
- (8) Europejski Urząd Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych skonsultował się z członkami Europejskiego Systemu Banków Centralnych i przeprowadził otwarte konsultacje publiczne w zakresie projektu regulacyjnych standardów technicznych, który stanowi podstawę niniejszego rozporządzenia, dokonał analizy potencjalnych powiązanych kosztów i korzyści oraz zwrócił się o poradę do Grupy Interesariuszy z Sektora Giełd i Papierów Wartościowych powołanej na podstawie art. 37 rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 1095/2010².
- (9) Aby umożliwić kontrahentom i repozytoriom transakcji podjęcie wszelkich niezbędnych działań w celu dostosowania się do nowych wymogów, datę rozpoczęcia stosowania niniejszego rozporządzenia należy odroczyć o osiemnaście miesięcy,

² Rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 1095/2010 z dnia 24 listopada 2010 r. w sprawie ustanowienia Europejskiego Urzędu Nadzoru (Europejskiego Urzędu Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych), zmiany decyzji nr 716/2009/WE i uchylecia decyzji Komisji 2009/77/WE (Dz.U. L 331 z 15.12.2010, s. 84).

PRZYJMUJE NINIEJSZE ROZPORZĄDZENIE:

Artykuł 1

Weryfikacja instrumentów pochodnych przez repozytoria transakcji

1. W otrzymanym zgłoszeniu instrumentu pochodnego repozytorium transakcji weryfikuje wszystkie następujące elementy:
 - a) tożsamość podmiotu przekazującego zgłoszenie, o którym mowa w polu 2 tabeli 1 i w polu 2 tabeli 3 w załączniku do [*Urząd Publikacji: proszę wstawić odniesienie do C(2022) 3588*];
 - b) czy formularz w formacie XML użyty do zgłoszenia instrumentu pochodnego jest zgodny z metodyką określoną w normie ISO 20022, zgodnie z art. 1 [*Urząd Publikacji: proszę wstawić odniesienie do C(2022) 3588*];
 - c) czy podmiot przekazujący zgłoszenie, jeżeli jest to inny podmiot niż podmiot odpowiedzialny za zgłaszanie, o którym mowa w polu 3 tabeli 1 oraz w polu 3 tabeli 3 załącznika do [*Urząd Publikacji: proszę wstawić odniesienie do C(2022) 3588*], jest należycie upoważniony do dokonywania zgłoszeń w imieniu kontrahenta 1 lub podmiotu odpowiedzialnego za zgłaszanie, jeżeli jest to inny podmiot niż kontrahent 1, o którym mowa w polu 4 tabeli 1 oraz w polu 4 tabeli 3 załącznika do [*Urząd Publikacji: proszę wstawić odniesienie do C(2022) 3588*];
 - d) czy tego samego instrumentu pochodnego nie zgłoszono już wcześniej;
 - e) czy zgłoszenie instrumentu pochodnego z oznaczeniem rodzaju operacji „zmiana”, „aktualizacja depozytu zabezpieczającego”, „wycena”, „korekta”, „błąd” lub „rozwiązanie” odnosi się do instrumentu pochodnego, który uprzednio zgłoszono;
 - f) czy zgłoszenie instrumentu pochodnego z oznaczeniem rodzaju operacji „zmiana” nie odnosi się do instrumentu pochodnego zgłoszonego jako anulowany z oznaczeniem rodzaju operacji „błąd”, który nie został następnie zgłoszony z oznaczeniem rodzaju operacji „wznowienie”;
 - g) czy zgłoszenia instrumentu pochodnego nie opatrzone rodzajem operacji „nowy” w odniesieniu do instrumentu pochodnego, który uprzednio zgłoszono;
 - h) czy zgłoszenia instrumentu pochodnego nie opatrzone rodzajem operacji „składnik pozycji” w odniesieniu do instrumentu pochodnego, który uprzednio zgłoszono;
 - i) czy zgłoszenie instrumentu pochodnego nie ma na celu zmiany szczegółowych informacji w polach „kontrahent 1” lub „kontrahent 2” w odniesieniu do uprzednio zgłoszonego instrumentu pochodnego;
 - j) czy zgłoszenie instrumentu pochodnego nie ma na celu zmiany istniejącego zgłoszenia instrumentu pochodnego poprzez określenie daty rozpoczęcia obowiązywania, która przypada później niż zgłoszony termin zapadalności instrumentu pochodnego;
 - k) czy zgłoszenie instrumentu pochodnego z oznaczeniem rodzaju operacji „wznowienie” odnosi się do uprzednio przekazanego zgłoszenia instrumentu pochodnego opatrzonego rodzajem operacji „błąd” lub „rozwiązanie”, lub do instrumentu pochodnego, którego termin zapadalności upłynął;

- 1) prawidłowość i kompletność zgłoszenia instrumentu pochodnego.
2. Repozytorium transakcji odrzuca zgłoszenie instrumentu pochodnego, które nie spełnia jednego z wymogów określonych w ust. 1, i przypisuje mu jedną z kategorii odrzucenia zgłoszenia określonych w tabeli 1 w załączniku.
3. Repozytorium transakcji dostarcza podmiotom przekazującym zgłoszenia szczegółowe informacje na temat wyników weryfikacji danych, o której mowa w ust. 1, w ciągu sześćdziesięciu minut od otrzymania zgłoszenia instrumentu pochodnego. Repozytorium transakcji przekazuje wspomniane informacje na temat wyników weryfikacji w formacie XML na formularzu opracowanym zgodnie z metodyką określoną w normie ISO 20022. W informacjach tych wskazuje się powody odrzucenia zgłoszenia instrumentu pochodnego zgodnie z tabelą 1 w załączniku.

Artykuł 2

Procedura aktualizacji identyfikatorów podmiotów prawnych

1. Repozytorium transakcji, do którego skierowano wniosek na podstawie art. 8 [*Urząd Publikacji: proszę wstawić odniesienie do C(2022) 3588*], identyfikuje instrumenty pochodne, o których mowa w art. 2 ust. 2 [*Urząd Publikacji: proszę wstawić odniesienie do C(2022) 3588*], nierozliczone w chwili zajścia zdarzenia korporacyjnego związanego z restrukturyzacją, jeżeli podmiot zgłoszono w polu „kontrahent 1” lub „kontrahent 2” przy użyciu identyfikatora używanego przed wystąpieniem zdarzenia korporacyjnego związanego z restrukturyzacją, zgodnie z informacją zawartą w odpowiednim wniosku. Zastępuje ono stary identyfikator nowym identyfikatorem podmiotu prawnego („LEI”) w zgłoszeniach odnoszących się do wszystkich odnośnych instrumentów pochodnych w chwili zajścia zdarzenia, o którym mowa w art. 8 [*Urząd Publikacji: proszę wstawić odniesienie do C(2022) 3588*], dotyczącego tego kontrahenta. Repozytorium transakcji przeprowadza procedurę aktualizacji identyfikatora najpóźniej w dniu restrukturyzacji albo w terminie 30 dni kalendarzowych od otrzymania wniosku o aktualizację, w przypadku gdy wniosek złożono mniej niż 30 dni kalendarzowych przed datą zdarzenia korporacyjnego związanego z restrukturyzacją.
2. Repozytorium transakcji identyfikuje odpowiednie instrumenty pochodne, o których mowa w art. 2 ust. 2 [*Urząd Publikacji: proszę wstawić odniesienie do C(2022) 3588*], w chwili zajścia zdarzenia korporacyjnego związanego z restrukturyzacją, gdy podmiot jest identyfikowany za pomocą starego identyfikatora w którymkolwiek z pól, i zastępuje ten identyfikator nowym LEI. W przypadku gdy zdarzenie korporacyjne związane z restrukturyzacją wiąże się z aktualizacją LEI w polach innych niż „kontrahent 1” lub „kontrahent 2”, repozytorium transakcji dokonuje takiej aktualizacji odpowiednich instrumentów pochodnych wyłącznie po terminowym potwierdzeniu dokonanym przez kontrahenta 1 lub podmiot odpowiedzialny za zgłaszanie.
3. Repozytorium transakcji wykonuje następujące czynności:
 - a) po otrzymaniu odpowiedniego potwierdzenia zgodnie z ust. 2 wprowadza aktualizację LEI od daty, o której mowa w ust. 1;
 - b) jak najszybciej i nie później niż 5 dni roboczych po otrzymaniu kompletnego powiadomienia przesyła następujące informacje wszystkim pozostałym repozytoriom transakcji i, stosownie do przypadku, kontrahentom

dokonującym zgłoszenia, podmiotom przekazującym zgłoszenia, podmiotom odpowiedzialnym za zgłaszanie zaangażowanym w kontrakty pochodne, których dotyczy aktualizacja LEI, oraz osobom trzecim, którym przyznano dostęp do informacji na podstawie art. 78 ust. 7 rozporządzenia (UE) nr 648/2012:

- (i) stary identyfikator lub stare identyfikatory;
 - (ii) nowy identyfikator;
 - (iii) datę, od której dokonana zostanie aktualizacja;
 - (iv) w przypadku zdarzeń korporacyjnych mających wpływ na podzbiór instrumentów pochodnych nierozliczonych na dzień zdarzenia – wykaz unikatowych identyfikatorów transakcji (UTI) dla instrumentów pochodnych, których dotyczy aktualizacja LEI;
- c) najpóźniej na dzień roboczy przed datą zastosowania aktualizacji przekazuje podmiotom wymienionym w art. 81 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012, które mają dostęp do danych dotyczących instrumentów pochodnych poddanych aktualizacji, za pomocą specjalnego pliku w formacie nadającym się do odczytu maszynowego:
- (i) stary identyfikator lub stare identyfikatory;
 - (ii) nowy identyfikator;
 - (iii) datę, od której dokonana zostanie aktualizacja;
 - (iv) w przypadku zdarzeń korporacyjnych mających wpływ na podzbiór instrumentów pochodnych nierozliczonych na dzień zdarzenia – wykaz UTI dla instrumentów pochodnych, których dotyczy aktualizacja LEI;
- d) rejestruje aktualizację LEI w rejestrze zgłoszeń.
4. Repozytorium transakcji nie przeprowadza aktualizacji LEI zgłoszonych w odniesieniu do instrumentów pochodnych innych niż te, o których mowa w art. 2 ust. 2 [*Urząd Publikacji: proszę wstawić odniesienie do C(2022) 3588*], w chwili zajścia zdarzenia korporacyjnego.

Artykuł 3

Uzgadnianie danych przez repozytoria transakcji

1. Repozytorium transakcji dąży do uzgodnienia zgłoszonego instrumentu pochodnego, podejmując działania określone w ust. 3, jeżeli spełnione są wszystkie następujące warunki:
- a) repozytorium transakcji zakończyło czynności weryfikacyjne określone w art. 1 ust. 1 i 2;
 - b) obydwaj kontrahenci zgłoszonego instrumentu pochodnego podlegają obowiązkowi zgłaszania na podstawie art. 9 rozporządzenia (UE) nr 648/2012;
 - c) repozytorium transakcji nie otrzymało zgłoszenia z oznaczeniem rodzaju operacji „błąd” odnoszącego się do zgłoszonego instrumentu pochodnego, chyba że po takim zgłoszeniu otrzymało zgłoszenie z oznaczeniem rodzaju operacji „wznowienie”.

2. Repozytorium transakcji posiada rozwiązania zapewniające poufność danych podczas wymiany informacji z innymi repozytoriami transakcji oraz przy przekazywaniu kontrahentom dokonującym zgłoszeń, podmiotom przekazującym zgłoszenia, podmiotom odpowiedzialnym za zgłaszanie oraz osobom trzecim, którym przyznano dostęp do informacji na podstawie art. 78 ust. 7 rozporządzenia (UE) nr 648/2012, informacji na temat wartości we wszystkich polach podlegających uzgodnieniu.
3. Jeżeli spełnione są wszystkie warunki określone w ust. 1, repozytorium transakcji podejmuje następujące działania, korzystając z ostatniej zgłoszonej na poprzedni dzień roboczy wartości dla każdego z pól w tabeli 2 w załączniku:
 - a) po otrzymaniu zgłoszenia instrumentu pochodnego repozytorium transakcji weryfikuje, czy otrzymało analogiczne zgłoszenie od drugiego kontrahenta lub w jego imieniu;
 - b) repozytorium transakcji, które nie otrzymało analogicznego zgłoszenia instrumentu pochodnego, o którym to zgłoszeniu mowa w lit. a), podejmuje próbę zidentyfikowania repozytorium transakcji, które otrzymało analogiczne zgłoszenie instrumentu pochodnego, przekazując wszystkim zarejestrowanym repozytoriom transakcji wartości następujących pól zgłoszenia instrumentu pochodnego: „unikatowy identyfikator transakcji”, „kontrahent 1” i „kontrahent 2”;
 - c) repozytorium transakcji, które ustali, że inne repozytorium transakcji otrzymało analogiczne zgłoszenie instrumentu pochodnego, o którym to zgłoszeniu mowa w lit. a), wymienia z tym repozytorium transakcji szczegółowe informacje dotyczące zgłoszonego instrumentu pochodnego w formacie XML na formularzu opracowanym zgodnie z metodyką określoną w normie ISO 20022;
 - d) repozytorium transakcji uznaje zgłoszony instrument pochodny za uzgodniony, jeżeli szczegółowe informacje dotyczące tego instrumentu pochodnego będącego przedmiotem uzgodnienia pokrywają się ze szczegółowymi informacjami zawartymi w analogicznym zgłoszeniu instrumentu pochodnego, o którym to zgłoszeniu mowa w lit. a), oraz zgodnie z mającymi zastosowanie granicami tolerancji i odpowiednimi datami rozpoczęcia uzgadniania określonymi w tabeli 2 w załączniku;
 - e) repozytorium transakcji przypisuje następnie wartości kategoriom uzgodnienia w odniesieniu do każdego zgłoszonego instrumentu pochodnego, jak określono w tabeli 3 w załączniku;
 - f) repozytorium transakcji kończy działania określone w lit. a)–e) w najwcześniejszym możliwym terminie i nie podejmuje żadnych takich działań po północy uniwersalnego czasu koordynowanego w danym dniu roboczym;
 - g) repozytorium transakcji, które nie może dokonać uzgodnienia zgłoszonego instrumentu pochodnego, podejmuje starania, aby dopasować szczegółowe informacje dotyczące przedmiotowego zgłoszonego instrumentu pochodnego następnego dnia roboczego. Repozytorium transakcji nie musi już podejmować starań w celu uzgodnienia zgłoszonego instrumentu pochodnego po upływie trzydziestu dni kalendarzowych od momentu, gdy instrument pochodny nie ma już statusu instrumentu nierozliczonego.

4. Na koniec każdego dnia roboczego repozytorium transakcji potwierdza z każdym repozytorium transakcji, z którym uzgadniało zgłoszone instrumenty pochodne, łączną liczbę dopasowanych instrumentów pochodnych oraz liczbę uzgodnionych instrumentów pochodnych. Repozytorium transakcji dysponuje pisemnymi procedurami zapewniającymi usunięcie wszelkich rozbieżności stwierdzonych w tym procesie.
5. Najpóźniej sześćdziesiąt minut po zakończeniu procesu uzgadniania określonego w ust. 3 lit. f) repozytorium transakcji dostarcza podmiotom przekazującym zgłoszenia wyniki przeprowadzonego przez repozytorium transakcji procesu uzgadniania zgłoszonych instrumentów pochodnych. Repozytorium transakcji przekazuje te wyniki w formacie XML na formularzu opracowanym zgodnie z metodyką określoną w normie ISO 20022, w tym informacje dotyczące pól, które nie zostały uzgodnione.

Artykuł 4

Mechanizmy reagowania na koniec dnia

1. W odniesieniu do każdego dnia roboczego repozytorium transakcji udostępnia, stosownie do przypadku, kontrahentom dokonującym zgłoszeń, podmiotom przekazującym zgłoszenia, podmiotom odpowiedzialnym za zgłaszanie oraz osobom trzecim, którym przyznano dostęp do informacji na podstawie art. 78 ust. 7 rozporządzenia (UE) nr 648/2012, następujące informacje dotyczące odpowiednich instrumentów pochodnych w formacie XML na formularzu opracowanym zgodnie z metodyką określoną w normie ISO 20022:
 - a) instrumenty pochodne zgłoszone w danym dniu;
 - b) najnowsze stany transakcji dla nierozliczonych instrumentów pochodnych;
 - c) zgłoszenia instrumentów pochodnych, które danego dnia odrzucono;
 - d) status uzgodnienia dla wszystkich zgłoszonych instrumentów pochodnych podlegających uzgodnieniu zgodnie z art. 3 ust. 1;
 - e) nierozliczone instrumenty pochodne, w odniesieniu do których nie zgłoszono wyceny lub w odniesieniu do których zgłoszonej wyceny dokonano wcześniej niż czternaście dni kalendarzowych przed dniem, w odniesieniu do którego wygenerowano zgłoszenie;
 - f) nierozliczone instrumenty pochodne, w odniesieniu do których nie zgłoszono informacji o depozycie zabezpieczającym lub w odniesieniu do których zgłoszone informacje o depozycie zabezpieczającym pochodzą z dnia wcześniejszego niż czternaście dni kalendarzowych przed dniem, w odniesieniu do którego wygenerowano zgłoszenie;
 - g) instrumenty pochodne otrzymane tego dnia z oznaczeniem rodzaju operacji „nowy”, „składnik pozycji”, „zmiana” lub „korekta”, których kwota nominalna jest nietypowa dla tej klasy instrumentów pochodnych.
2. Repozytorium transakcji przekazuje takie informacje nie później niż o godz. 06.00 uniwersalnego czasu koordynowanego w dniu roboczym następującym po dniu, do którego odnoszą się informacje przewidziane w ust. 1.

Artykuł 5

Wejście w życie i rozpoczęcie stosowania

Niniejsze rozporządzenie wchodzi w życie dwudziestego dnia po jego opublikowaniu w *Dzienniku Urzędowym Unii Europejskiej*.

Niniejsze rozporządzenie stosuje się od dnia [*Urząd Publikacji: proszę wstawić datę – pierwszy poniedziałek po dniu przypadającym 18 miesięcy po dacie wejścia w życie*] r.

Niniejsze rozporządzenie wiąże w całości i jest bezpośrednio stosowane we wszystkich państwach członkowskich.

Sporządzono w Brukseli dnia 10.6.2022 r.

*W imieniu Komisji
Przewodnicząca
Ursula VON DER LEYEN*