



Rada
Európskej únie

V Bruseli 17. júna 2022
(OR. en)

10384/22

EF 178
ECOFIN 637
DELECT 97

SPRIEVODNÁ POZNÁMKA

Od:	Martine DEPREZOVÁ, riaditeľka, v zastúpení generálnej tajomníčky Európskej komisie
Komu:	Generálny sekretariát Rady
Č. dok. Kom.:	C(2022) 3581 final
Predmet:	DELEGOVANÉ NARIADENIE KOMISIE (EÚ) .../... z 10. 6. 2022 ktorým sa dopĺňa nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 648/2012, pokiaľ ide o regulačné technické normy, ktorými sa stanovujú postupy zosúladovania údajov medzi archívmi obchodných údajov a postupy, ktoré má uplatňovať archív obchodných údajov s cieľom overiť dodržiavanie požiadaviek na ohlasovanie zo strany ohlasujúcej protistrany alebo predkladajúceho subjektu a s cieľom overiť úplnosť a správnosť ohlasovaných údajov

Delegáciám v prílohe zasielame dokument C(2022) 3581 final.

Príloha: C(2022) 3581 final



V Bruseli 10. 6. 2022
C(2022) 3581 final

DELEGOVANÉ NARIADENIE KOMISIE (EÚ) .../...

z 10. 6. 2022

ktorým sa dopĺňa nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 648/2012, pokiaľ ide o regulačné technické normy, ktorými sa stanovujú postupy zosúlad'ovania údajov medzi archívmi obchodných údajov a postupy, ktoré má uplatňovať archív obchodných údajov s cieľom overiť dodržiavanie požiadaviek na ohlasovanie zo strany ohlasujúcej protistrany alebo predkladajúceho subjektu a s cieľom overiť úplnosť a správnosť ohlasovaných údajov

(Text s významom pre EHP)

DÔVODOVÁ SPRÁVA

1. KONTEXT DELEGOVANÉHO AKTU

V nariadení Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) 2019/834 z 20. mája 2019, ktorým sa mení nariadenie (EÚ) č. 648/2012 (nariadenie EMIR REFIT), sa zavádzajú viaceré právomoci orgánu ESMA na vypracovanie vykonávacích a regulačných technických noriem v súvislosti s rámcom pre ohlasovanie podľa nariadenia EMIR.

Konkrétne sa v článku 78 ods. 10 uvedeného nariadenia vyžaduje, aby orgán ESMA vypracoval regulačné technické normy, v ktorých sa stanovujú postupy zosúladzovania údajov medzi archívami obchodných údajov, ako aj postupy, ktoré majú uplatňovať archívy obchodných údajov s cieľom overiť úplnosť a správnosť údajov ohlasovaných podľa článku 9.

2. KONZULTÁCIE PRED PRIJATÍM AKTU

Procedurálne aspekty

Orgán ESMA uskutočnil od 26. marca 2020 do 3. júla 2020 verejné konzultácie o svojom návrhu regulačných a vykonávacích technických noriem. Orgánu ESMA bolo doručených celkovo 41 verejných odpovedí a 10 odpovedí dôverného charakteru.

Stanoviská zainteresovaných strán

Overovanie derivátov archívami obchodných údajov

Kľúčovým prvkom správneho fungovania režimu ohlasovania podľa nariadenia EMIR a zabezpečovania kvality ohlasovania derivátov je overovanie údajov predkladaných protistranami, na ktoré sa vzťahuje ohlasovacia povinnosť, vykonávané archívami obchodných údajov. Hoci sa v článku 9 ods. 1e nariadenia EMIR zmeneného nariadením EMIR REFIT stanovuje, že „[p]rotistrany a centrálné protistrany, od ktorých sa vyžaduje ohlasovanie údajov o zmluvách o derivátoch, zabezpečia, aby boli takéto údaje ohlasované správne a bez duplicity“, v článku 78 ods. 9 a 10 nariadenia EMIR zmeneného nariadením EMIR REFIT sa takisto ukladá archívom obchodných údajov zodpovednosť za postupy overovania údajov.

V konzultačnom dokumente navrhol orgán ESMA rámec pre zhromažďovanie údajov a overovanie údajov vykonávané archívami obchodných údajov.

S cieľom zaistiť pri stanovovaní postupov overovania zo strany archívov obchodných údajov právnu istotu, pokiaľ ide o dodržiavanie ohlasovacej povinnosti, orgán ESMA navrhol zamietnuť údaje, ktoré neboli ohlásené v súlade s požiadavkami stanovenými v článku 9 nariadenia EMIR, namiesto toho, aby sa pre príslušný subjekt len vydali upozornenia.

Väčšina respondentov podporila návrh rámca orgánu ESMA a súhlasila s tým, že sa ním prispeje k celkovej kvalite údajov.

Postup aktualizácie identifikátorov právnickej osoby

V konzultačnom dokumente orgán ESMA zdôraznil dôležitosť procesu, ktorý majú archívy obchodných údajov a protistrany uplatňovať v prípade zmien identifikátorov právnickej osoby v dôsledku fúzií, akvizícií alebo inej podnikovej reštrukturalizácie. Väčšina respondentov súhlasila s návrhom orgánu ESMA na objasnenie týchto aspektov a začlenenie kľúčových prvkov procesu do regulačných technických noriem, a to najmä prvkov, ktoré sa týkajú harmonogramu aktualizácie identifikátorov právnickej osoby, keďže tieto prvky majú z hľadiska zabezpečenia kvality údajov zásadný význam.

Zosúlad'ovanie údajov archívmi obchodných údajov

Nedostatočné počiatkové špecifikácie procesu zosúlad'ovania zo strany orgánu ESMA, ktoré vyplývali z neexistencie zákonného mandátu, viedli k i) nekonzistentným postupom zosúlad'ovania; ii) nekonzistentným harmonogramom zosúlad'ovania; iii) tomu, že o toleranciách a kategorizácii oblastí rozhodovali archívy obchodných údajov; iv) dlhým prieťahom pri vybavovaní žiadostí o zmenu. V záujme riešenia týchto problémov orgán ESMA navrhol, aby archívy obchodných údajov po tom, ako údaje overia, zosúladili údaje obidvoch strán derivátu, ktoré sa ohlasujú. Vyplýva to z právneho základu uvedeného v článku 78 ods. 9 písm. a) nariadenia EMIR zmeneného nariadením EMIR REFIT, v ktorom sa stanovuje, že archívy obchodných údajov stanovia „postupy účinného zosúlad'ovania údajov medzi archívmi obchodných údajov“. Orgán ESMA v konzultačnom dokumente navrhol viacero všeobecných zásad na vykonávanie zosúlad'ovania. Respondenti verejných konzultácií podporili harmonizáciu procesu zosúlad'ovania a poskytli niekoľko pripomienok, na ktoré orgán ESMA prihliada v súvislosti so zásadami stanovenými v tomto návrhu delegovaného nariadenia.

Mechanizmus reakcie na konci dňa

Archívy obchodných údajov by mali ohlasujúcim protistranám, subjektom predkladajúcim správy, subjektom zodpovedným za ohlasovanie a prípadne aj tretím stranám, ktorým bol udelený prístup k informáciám podľa článku 78 ods. 7 nariadenia EMIR, poskytovať určité informácie dostupné na konci dňa, ktoré by im mali umožniť zlepšiť kvalitu údajov ohlasovaných podľa nariadenia EMIR.

Orgán ESMA sa domnieva, že informácie dostupné na konci dňa o zamietnutých obchodoch môžu byť pre subjekty praktické i) ako dôkaz o predložení údajov; ii) na účely prijatia opatrení v súvislosti s akýmkoľvek potenciálnym derivátom, ktorý ešte nebol opravený, a iii) na umožnenie priameho spracúvania a automatizácie pracovného postupu.

Orgán ESMA prijal v súvislosti so svojimi návrhmi veľké množstvo veľmi podrobných reakcií. Po zohľadnení tejto spätnej väzby orgán ESMA navrhol minimálny súbor správ s informáciami dostupnými na konci dňa, ktoré majú sprístupňovať archívy obchodných údajov.

3. POSÚDENIE VPLYVU

Komisia nevykonala podrobné posúdenie vplyvu, pokiaľ ide o navrhované regulačné technické normy, ale vo svojom posúdení vychádza z analýzy nákladov a prínosov vypracovanej orgánom ESMA, ktorá je súčasťou jeho záverečnej správy.

Hlavné rozhodnutia týkajúce sa politik už Komisia zanalyzovala a uverejnila v rámci práce na legislatívnom návrhu, ktorý viedol k nariadeniu Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) 2019/834 z 20. mája 2019, ktorým sa mení nariadenie (EÚ) č. 648/2012.

Orgán ESMA chápe, že navrhované technické normy prispievajú k zlepšeniu kvality údajov ohlasovaných podľa nariadenia EMIR, čo bude jednoznačne prínosné pre orgány oprávnené na prístup k údajom podľa nariadenia EMIR, ale aj pre ohlasujúce subjekty a archívy obchodných údajov. Navrhované zmeny, ktorými sa požiadavky v EÚ zosúlad'ujú s globálnym usmernením o ohlasovaní mimoburzových derivátov, by mali napríklad priniesť významné zníženie nákladov pre subjekty s povinnosťou ohlasovania vo viacerých jurisdikciách. Okrem štandardizácie formátov a používania normy ISO 20022 pri ohlasovaní archívom obchodných údajov protistranami sa vďaka komplexnejšej spätnej väzbe k zamietnutiam a upozorneniam zároveň uľahčí oprava údajov ohlasujúcimi subjektmi a zmiernia sa problémy s kvalitou údajov, čo povedie k ďalšiemu posilneniu automatizácie

ohlasovania a zmierneniu problémov s kvalitou údajov. V prípade zosúlad'ovania by mali navrhované zmeny, ktorými sa harmonizujú požiadavky na zosúlad'ovanie vo všetkých archívoch obchodných údajov, vyústiť do poskytovania konzistentnejšej spätnej väzby k zosúlad'ovaniu ohlasujúcim subjektom a prispieť k jednoduchšiemu zosúlad'ovaniu správ, a tým aj k zníženiu potreby zaťažujúcich nadväzujúcich procesov týkajúcich sa prestávok v zosúlad'ovaní, čím sa znížia náklady na dodržiavanie predpisov a zvýši sa kvalita údajov.

Hoci uvedené prínosy prevažujú nad nákladmi, z krátkodobého hľadiska budú úpravy systémov ohlasovania vyplývajúce z navrhovaných regulačných a vykonávacích technických noriem nevyhnutne znamenať náklady pre orgány, protistrany a archívy obchodných údajov. Orgán ESMA navrhuje harmonogram vykonávania, ktorým by sa mali nákladové dôsledky zmierniť.

4. PRÁVNE PRVKY DELEGOVANÉHO AKTU

V článku 1 sa stanovuje proces overovania správ o derivátoch archívmi obchodných údajov.

V článku 2 sa stanovuje postup aktualizácie identifikátorov právnickej osoby.

V článku 3 sa stanovuje postup zosúlad'ovania údajov archívmi obchodných údajov.

V článku 4 sa stanovujú informácie dostupné na konci dňa o ohlasovaných derivátoch, ktoré musia archívy obchodných údajov sprístupňovať niektorým subjektom.

V článku 5 sa stanovuje dátum nadobudnutia účinnosti delegovaného nariadenia.

DELEGOVANÉ NARIADENIE KOMISIE (EÚ) .../...

z 10. 6. 2022

ktorým sa dopĺňa nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 648/2012, pokiaľ ide o regulačné technické normy, ktorými sa stanovujú postupy zosúlad'ovania údajov medzi archívmi obchodných údajov a postupy, ktoré má uplatňovať archív obchodných údajov s cieľom overiť dodržiavanie požiadaviek na ohlasovanie zo strany ohlasujúcej protistrany alebo predkladajúceho subjektu a s cieľom overiť úplnosť a správnosť ohlasovaných údajov

(Text s významom pre EHP)

EURÓPSKA KOMISIA,

so zreteľom na Zmluvu o fungovaní Európskej únie,

so zreteľom na nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 648/2012 zo 4. júla 2012 o mimoburzových derivátoch, centrálnych protistranách a archívoch obchodných údajov¹, a najmä na jeho článok 78 ods. 10,

keďže:

- (1) Archívy obchodných údajov by v záujme zabezpečenia vysokej kvality údajov, ktoré sú im ohlasované, mali overovať identitu subjektov predkladajúcich správy, logickú integritu poradia ohlasovaných údajov o derivátoch, ako aj úplnosť a správnosť týchto údajov.
- (2) Z rovnakého dôvodu by archívy obchodných údajov mali zosúladiť údaje o každej prijatej správe o deriváte v prípadoch, keď majú ohlasovaciu povinnosť obe protistrany. Mal by sa stanoviť štandardizovaný postup, ktorý by archívom obchodných údajov umožnil konzistentne zosúlad'ovať údaje a znížil by riziko, že údaje o derivátoch nebudú zosúladené. Určité údaje o derivátoch však nemusia byť rovnaké vzhľadom na špecifiká systémov informačných technológií používaných subjektmi predkladajúcimi správy. Preto sa musia uplatňovať určité tolerancie, aby malé rozdiely v ohlasovaných údajoch o derivátoch nebránili orgánom vykonať analýzu údajov s dostatočnou úrovňou spoľahlivosti.
- (3) Ďalej by mali archívy obchodných údajov bez ohľadu na iné povinnosti týkajúce sa údajov o derivátoch, ktoré zhromažďujú a zaznamenávajú pri vykonávaní procesu zosúlad'ovania, zabezpečovať dôvernosť údajov, ktoré si medzi sebou vymieňajú a ktoré sprístupňujú ohlasujúcim protistranám, subjektom zodpovedným za ohlasovanie a subjektom predkladajúcim správy.
- (4) Ak sa uskutoční reštrukturalizácia spoločnosti, ktorá vedie k zmene identifikátora právnickej osoby (LEI) protistrany, musia sa aktualizovať údaje o subjektoch uvedených v správe o deriváte. V záujme zabezpečenia integrity uvedených informácií, ktorá je nevyhnutným predpokladom monitorovania systémových rizík pre finančnú stabilitu, je potrebné, aby túto aktualizáciu vykonávali archívy obchodných

¹ Ú. v. EÚ L 201, 27.7.2012, s. 1.

údajov centrálne. Z uvedeného dôvodu by sa mal zaviesť postup, ktorým by sa zabezpečilo, aby mohli archívy obchodných údajov aktualizovať identifikátor subjektu centrálne, čím by sa zabezpečil efektívny, spoľahlivý a včasný proces.

- (5) Subjektom predkladajúcim správy by sa mal poskytnúť dostatok času, aby sa požiadavkám na ohlasovanie prispôbili, a to najmä s cieľom zabrániť hromadeniu nezosúladených obchodov hneď po tom, ako sa ohlasovacia povinnosť začne uplatňovať. Preto je vhodné zosúladiť v prvej fáze len obmedzený súbor oblastí.
- (6) Subjekty predkladajúce správy a subjekty zodpovedné za ohlasovanie by v prípade potreby mali mať možnosť monitorovať, či konajú v súlade s ohlasovacími povinnosťami podľa nariadenia (EÚ) č. 648/2012. Preto by mali mať v súvislosti s týmito správami možnosť každodenného prístupu k určitým informáciám vrátane výsledku overovania týchto správ, a to aj v prípadoch, keď bolo vydané upozornenie, a k informáciám o pokroku v oblasti zosúladovania ohlasovaných údajov. Preto je nevyhnutné bližšie určiť informácie, ktoré by mal archív obchodných údajov prístupňovať týmto subjektom na konci každého pracovného dňa.
- (7) Toto nariadenie vychádza z návrhu regulačných technických noriem, ktorý Komisii predložil Európsky orgán pre cenné papiere a trhy.
- (8) Európsky orgán pre cenné papiere a trhy uskutočnil konzultácie s členmi Európskeho systému centrálnych bánk a vykonal otvorené verejné konzultácie k návrhu regulačných technických noriem, z ktorého toto nariadenie vychádza, analyzoval možné súvisiace náklady a prínosy a požiadal o poradenstvo Skupinu zainteresovaných strán v oblasti cenných papierov a trhov vytvorenú v súlade s článkom 37 nariadenia Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 1095/2010².
- (9) S cieľom umožniť protistranám a archívom obchodných údajov prijať všetky potrebné opatrenia na prispôbenie sa novým požiadavkám by sa mal dátum začatia uplatňovania tohto nariadenia odložiť o osemnásť mesiacov,

PRIJALA TOTO NARIADENIE:

Článok 1

Overovanie derivátov archívmi obchodných údajov

1. Archív obchodných údajov overuje v prijatej správe o deriváte všetky tieto náležitosti:
 - a) identitu subjektu predkladajúceho správu, ako sa uvádza v poli 2 tabuľky 1 a v poli 2 tabuľky 3 prílohy k [Úrad pre publikácie, vložte odkaz na C(2022) 3588];
 - b) dodržanie súladu vzoru vo formáte XML použitého na ohlásenie derivátu s metodikou ISO 20022 v súlade s článkom 1 [Úrad pre publikácie, vložte odkaz na C(2022) 3588];
 - c) či je subjekt predkladajúci správu, ak sa líši od subjektu zodpovedného za ohlasovanie, ako sa uvádza v poli 3 tabuľky 1 a v poli 3 tabuľky 3 prílohy

² Nariadenie 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) a ktorým sa mení a dopĺňa rozhodnutie č. 716/2009/ES a zrušuje rozhodnutie Komisie 2009/77/ES (Ú. v. EÚ L 331, 15.12.2010, s. 84).

k [Úrad pre publikácie, vložte odkaz C(2022) 3588], riadne oprávnený ohlasovať v mene protistrany 1 alebo subjektu zodpovedného za ohlasovanie, ak sa líši od protistrany 1, ako sa uvádza v poli 4 tabuľky 1 a v poli 4 tabuľky 3 prílohy k [Úrad pre publikácie, vložte odkaz na C(2022) 3588];

- d) či už nebol ten istý derivát ohlásený;
 - e) či sa správa o deriváte s druhom opatrenia „Zmena“, „Aktualizácia marže“, „Ocenenie“, „Oprava“, „Chyba“ alebo „Ukončenie“ týka už predloženého derivátu;
 - f) či sa správa o deriváte s druhom opatrenia „Zmena“ netýka derivátu, ktorý už bol ohlásený ako zrušený s druhom opatrenia „Chyba“ a ktorý nebol následne ohlásený s druhom opatrenia „Obnovenie“;
 - g) či správa o deriváte neobsahuje druh opatrenia „Nové“ v súvislosti s už ohláseným derivátom;
 - h) či správa o deriváte neobsahuje druh opatrenia „Zložka pozície“ v súvislosti s už ohláseným derivátom;
 - i) či správa o deriváte nemá za cieľ zmeniť údaje v poliach „Protistrana 1“ alebo „Protistrana 2“ pri už ohlásenom deriváte;
 - j) či správa o deriváte nemá za cieľ zmeniť existujúci derivát tým, že sa v nej určí neskorší dátum začatia platnosti, než je ohlásený dátum splatnosti derivátu;
 - k) či sa správa o deriváte s druhom opatrenia „Obnovenie“ týka už predloženej správy o deriváte s druhom opatrenia „Chyba“ alebo „Ukončenie“, prípadne derivátu, ktorého splatnosť už uplynula;
 - l) správnosť a úplnosť správy o deriváte.
2. Archív obchodných údajov zamietne správu o deriváte, ktorá nespĺňa jednu z požiadaviek stanovených v odseku 1, a prideli jej jednu z kategórií zamietnutia stanovených v tabuľke 1 prílohy.
3. Archív obchodných údajov poskytne subjektom predkladajúcim správy podrobné informácie o výsledkoch overovania údajov uvedeného v odseku 1 do šesťdesiatich minút od doručenia správy o deriváte. Archív obchodných údajov poskytne tieto výsledky vo formáte XML a vzore vypracovanom v súlade s metodikou ISO 20022. Vo výsledkoch sa uvádzajú dôvody zamietnutia správy o deriváte v súlade s tabuľkou 1 prílohy.

Článok 2

Postup aktualizácie identifikátorov právnickej osoby

1. Archív obchodných údajov, ktorému je adresovaná žiadosť podľa článku 8 [Úrad pre publikácie, vložte odkaz na C(2022) 3588], určí nezúčtované deriváty uvedené v článku 2 ods. 2 [Úrad pre publikácie, vložte odkaz na C(2022) 3588] v čase reštrukturalizácie spoločnosti, pričom subjekt sa ohlasuje s identifikátorom používaným pred reštrukturalizáciou v poli „Protistrana 1“ alebo „Protistrana 2“, ako sa uvádza v príslušnej žiadosti. Starý identifikátor nahradí novým identifikátorom právnickej osoby v správach, ktoré sa týkajú všetkých derivátov uvedených v článku 8 [Úrad pre publikácie, vložte odkaz na C(2022) 3588] a vzťahujúcich sa v čase reštrukturalizácie na uvedenú protistranu. Archív obchodných údajov vykoná

postup aktualizácie identifikátora najneskôr v deň reštrukturalizácie alebo do 30 kalendárnych dní od prijatia žiadosti, ak sa ohlási menej ako 30 kalendárnych dní pred dátumom uskutočnenia reštrukturalizácie.

2. Archív obchodných údajov určí príslušné deriváty uvedené v článku 2 ods. 2 [*Úrad pre publikácie, vložte odkaz na C(2022) 3588*] v čase reštrukturalizácie spoločnosti, pričom subjekt sa v ktoromkoľvek poli identifikuje pomocou starého identifikátora, a nahradí uvedený identifikátor novým identifikátorom právnickej osoby. Ak reštrukturalizácia spoločnosti súvisí s aktualizáciou identifikátora právnickej osoby v poliach iných ako „Protistrana 1“ alebo „Protistrana 2“, archív obchodných údajov vykoná túto aktualizáciu príslušných derivátov až po včasnom potvrdení protistrany 1 alebo subjektu zodpovedného za ohlasovanie.
3. Archív obchodných údajov vykoná tieto kroky:
 - a) po prijatí príslušného potvrdenia podľa odseku 2 vykoná aktualizáciu identifikátora právnickej osoby k dátumu uvedenému v odseku 1;
 - b) čo najskôr, najneskôr však päť pracovných dní od prijatia úplného oznámenia, poskytne všetkým ostatným archívom obchodných údajov a ohlasujúcim protistranám, subjektom predkladajúcim správy, subjektom zodpovedným za ohlasovanie zapojeným do zmlúv o derivátoch, ktorých sa týka aktualizácia identifikátora právnickej osoby, ako aj tretím stranám, ktorým bol udelený prístup k informáciám podľa článku 78 ods. 7 nariadenia (EÚ) č. 648/2012, tieto informácie:
 - i) starý identifikátor (staré identifikátory);
 - ii) nový identifikátor;
 - iii) dátum, ku ktorému sa uskutočňuje aktualizácia;
 - iv) v prípade podnikových udalostí, ktoré majú vplyv na podsúbor derivátov, ktoré neboli ku dňu udalosti zúčtované, zoznam jedinečných identifikátorov obchodu pre deriváty, ktorých sa aktualizácia identifikátora právnickej osoby týka;
 - c) najneskôr jeden pracovný deň pred dátumom, ku ktorému sa uplatňuje aktualizácia, oznámi prostredníctvom osobitného súboru v strojovo čitateľnom formáte subjektom uvedeným v článku 81 ods. 3 nariadenia (EÚ) č. 648/2012, ktoré majú prístup k údajom o aktualizovaných derivátoch:
 - i) starý identifikátor (staré identifikátory);
 - ii) nový identifikátor;
 - iii) dátum, ku ktorému sa uskutočňuje aktualizácia;
 - iv) v prípade podnikových udalostí, ktoré majú vplyv na podsúbor derivátov, ktoré neboli ku dňu udalosti zúčtované, zoznam jedinečných identifikátorov obchodu pre deriváty, ktorých sa týka aktualizácia identifikátora právnickej osoby;
 - d) zaznamená aktualizáciu identifikátora právnickej osoby do denníka ohlasovania.
4. Archív obchodných údajov neaktualizuje ohlásené identifikátory právnických osôb v prípade derivátov, ktoré sa v čase podnikovej udalosti líšia od derivátov uvedených v článku 2 ods. 2 [*Úrad pre publikácie, vložte odkaz na C(2022) 3588*].

Článok 3

Zosúlad'ovanie údajov archívmi obchodných údajov

1. Archív obchodných údajov sa usiluje o zosúlad'ovanie ohláseného derivátu vykonaním krokov stanovených v odseku 3, a to za predpokladu, že sú splnené všetky tieto podmienky:
 - a) archív obchodných údajov ukončil overovania stanovené v článku 1 ods. 1 a 2;
 - b) obe protistrany ohláseného derivátu majú ohlasovaciu povinnosť podľa článku 9 nariadenia (EÚ) č. 648/2012;
 - c) archív obchodných údajov nedostal v súvislosti s ohláseným derivátom správu s druhom opatrenia „Chyba“, s výnimkou prípadov, keď na takúto správu nadväzovala správa s druhom opatrenia „Obnovenie“.
2. Archív obchodných údajov musí mať zavedené mechanizmy na zabezpečenie dôvernosti údajov pri výmene informácií s ostatnými archívmi obchodných údajov a pri poskytovaní informácií ohlasujúcim protistranám, subjektom predkladajúcim správu, subjektom zodpovedným za ohlasovanie, ako aj tretím stranám, ktorým bol udelený prístup k informáciám podľa článku 78 ods. 7 nariadenia (EÚ) č. 648/2012 o hodnotách všetkých polí, na ktoré sa vzťahuje zosúlad'ovanie.
3. Ak sú splnené všetky podmienky stanovené v odseku 1, archív obchodných údajov podnikne tieto kroky, pričom využíva najnovšiu ohlásenú hodnotu pre každé z polí v tabuľke 2 prílohy za predchádzajúci pracovný deň:
 - a) archív obchodných údajov po prijatí správy o deriváte overuje, či dostal príslušnú správu od inej protistrany alebo v jej mene;
 - b) archív obchodných údajov, ktorý nedostal príslušnú správu o deriváte, ako sa uvádza v písmene a), sa pokúša identifikovať archív obchodných údajov, ktorý dostal príslušnú správu o deriváte, informovaním všetkých registrovaných archívov obchodných údajov o hodnotách týchto polí ohláseného derivátu: „Jedinečný identifikátor transakcie“, „Protistrana 1“ a „Protistrana 2“;
 - c) archív obchodných údajov, ktorý zistí, že iný archív obchodných údajov dostal príslušnú správu o deriváte, ako sa uvádza v písmene a), si vymieňa s uvedeným archívom obchodných údajov údaje o ohlásenom deriváte vo formáte XML a vzore vypracovanom v súlade s metodikou ISO 20022;
 - d) archív obchodných údajov zaobchádza s ohláseným derivátom ako so zosúladeným derivátom, ak sa údaje o uvedenom deriváte, na ktorý sa vzťahuje zosúlad'ovanie, zhodujú s údajmi o zodpovedajúcom deriváte uvedenom v písmene a) a sú v súlade s uplatniteľnými limitmi tolerancie a príslušnými dátumami uplatňovania stanovenými v tabuľke 2 prílohy;
 - e) archív obchodných údajov následne priradí hodnoty v kategóriách zosúlad'ovania za každú ohlásenú derivátovú transakciu, ako sa uvádza v tabuľke 3 prílohy;
 - f) archív obchodných údajov ukončuje kroky uvedené v písmenách a) až e) čo najskôr, pričom nepodniká žiadne takéto kroky po polnoci koordinovaného svetového času v daný pracovný deň;
 - g) archív obchodných údajov, ktorý nemôže zosúladiť ohlásený derivát, sa usiluje zladiť údaje uvedeného ohláseného derivátu v nasledujúci pracovný deň.

Archív obchodných údajov sa prestane usilovať o zosúladenie ohláseného derivátu po uplynutí tridsiatich kalendárnych dní od zúčtovania derivátu.

4. Archív obchodných údajov potvrdzuje celkový počet spárovaných derivátov a počet zosúladených derivátov s každým archívom obchodných údajov, s ktorým zosúladil deriváty na konci každého pracovného dňa. Archív obchodných údajov musí mať zavedené písomné postupy na zabezpečenie riešenia všetkých nezrovnalostí zistených v tomto procese.
5. Najneskôr šesťdesiat minút po ukončení procesu zosúladovania, ako sa stanovuje v odseku 3 písm. f), poskytnie archív obchodných údajov subjektom predkladajúcim správy výsledky ním vykonaného procesu zosúladovania týkajúceho sa ohlasovaných derivátov. Archív obchodných údajov poskytne tieto výsledky vo formáte XML a vzore vypracovanom v súlade s metodikou ISO 20022 vrátane informácií o poliach, ktoré neboli zosúladené.

Článok 4

Mechanizmy reakcie na konci dňa

1. Za každý pracovný deň sprístupňuje archív obchodných údajov ohlasujúcim protistranám, subjektom predkladajúcim správy, subjektom zodpovedným za ohlasovanie, ako aj tretím stranám, ktorým bol udelený prístup k informáciám podľa článku 78 ods. 7 nariadenia (EÚ) č. 648/2012, tieto informácie o dotknutých derivátoch vo formáte XML a vzore vypracovanom v súlade s metodikou ISO 20022:
 - a) deriváty ohlásené počas uvedeného dňa;
 - b) najnovšie obchodné údaje nezúčtovaných derivátov;
 - c) správy o derivátoch, ktoré boli zamietnuté počas uvedeného dňa;
 - d) stav zosúladovania všetkých ohlásených derivátov podliehajúcich zosúladovaniu podľa článku 3 ods. 1;
 - e) nezúčtované deriváty, za ktoré nebolo ohlásené žiadne ocenenie alebo za ktoré bolo ohlásené ocenenie s dátumom starším ako štrnásť kalendárnych dní pred dátumom, ku ktorému je vytvorená samotná správa;
 - f) nezúčtované deriváty, za ktoré neboli ohlásené žiadne informácie o marži alebo za ktoré boli ohlásené informácie o marži s dátumom starším ako štrnásť kalendárnych dní pred dátumom, ku ktorému je vytvorená samotná správa;
 - g) deriváty prijaté v uvedený deň s druhom opatrenia „Nové“, „Zložka pozície“, „Zmena“ alebo „Oprava“ a ktorých pomyselná hodnota je pri danej triede derivátov nezvyčajná.
2. Archív obchodných údajov poskytne takéto informácie najneskôr o 6:00 koordinovaného svetového času v pracovný deň nasledujúci po dni, ktorého sa informácie uvedené v odseku 1 týkajú.

Článok 5

Nadobudnutie účinnosti a uplatňovanie

Toto nariadenie nadobúda účinnosť dvadsiatym dňom po jeho uverejnení v *Úradnom vestníku Európskej únie*.

Uplatňuje sa od [Úrad pre publikácie: vložte dátum prvého pondelku po dátume, ktorý zodpovedá 18 mesiacom odo dňa nadobudnutia účinnosti].

Toto nariadenie je záväzné v celom rozsahu a priamo uplatniteľné vo všetkých členských štátoch.

V Bruseli 10. 6. 2022

*Za Komisiu
predsedníčka
Ursula VON DER LEYEN*