

РЕГЛАМЕНТ ЗА ИЗПЪЛНЕНИЕ (ЕС) № 1249/2012 НА КОМИСИЯТА

от 19 декември 2012 година

за установяване на технически стандарти за изпълнение по отношение на формата на документацията с данни, която трябва да съхраняват централните контрагенти съгласно Регламент (ЕС) № 648/2012 на Европейския парламент и на Съвета относно извънборсовите деривати, централните контрагенти и регистрите на трансакции

(текст от значение за ЕИП)

ЕВРОПЕЙСКАТА КОМИСИЯ,

като взе предвид Договора за функционирането на Европейския съюз,

като взе предвид становището на Европейската централна банка ⁽¹⁾,като взе предвид Регламент (ЕС) № 648/2012 на Европейския парламент и на Съвета от 4 юли 2012 година относно извънборсовите деривати, централните контрагенти и регистрите на трансакции ⁽²⁾, и по-специално член 29, параграф 5 от него:

като има предвид, че:

- (1) Съгласно член 29, параграф 4 от Регламент (ЕС) № 648/2012 и членове 13, 14 и 15 от делегирания акт относно регулаторните технически стандарти за определяне на подробните изисквания за документацията с данни и информацията, които трябва да съхраняват централните контрагенти, приет съгласно член 29, параграф 4 от Регламент (ЕС) № 648/2012, следва да бъдат установени и разпоредби за определяне на формата на документацията с данни и на информацията, които се съхраняват в съответствие с посочените членове.
- (2) За да изпълняват задълженията си ефективно и съгласувано, съответните органи следва да получават от различните централни контрагенти (ЦК) данни, които са съпоставими. Използването на обща форма също улеснява сравняването на данни, получени от различни ЦК.
- (3) Всеки ЦК следва да бъде задължен да съхранява данни във форма, която е съвместима с формата на данните, съхранявани от регистрите на трансакции, като се има предвид, че при определени обстоятелства ЦК и регистрите на трансакции трябва да съхраняват или отчитат една и съща информация. Използването на обща форма за данните от цялата инфраструктура на финансовите пазари спомага за разширяването на употребата на тези форми от най-различни пазарни участници, което на свой ред насърчава стандартизацията.
- (4) За да бъде улеснена автоматичната обработка на данните и да бъде спомогнато за намаление на разходите за пазарните участници, е важно за всички ЦК да се използват стандартизирани процедури и форми за данните, доколкото е възможно.

- (5) Базовият актив следва да бъде идентифициран чрез единен идентификационен код, но понастоящем няма общоприета стандартизирана система от кодове за идентифициране на базовите активи в дадена кошница активи. Затова ЦК следва поне да посочват, че базовите активи са кошница от активи, и да използват международните идентификационни номера на ценни книжа (ISIN номера) за стандартизираните индекси, когато това е възможно.
- (6) Настоящият регламент е изготвен въз основа на проектите на технически стандарти за изпълнение, представени на Комисията от Европейския орган за ценни книжа и пазари (ЕОЦКП).
- (7) Съгласно член 15 от Регламент (ЕС) № 1095/2010 на Европейския парламент и на Съвета от 24 ноември 2010 година за създаване на Европейски надзорен орган (Европейски орган за ценни книжа и пазари) ⁽³⁾ ЕОЦКП проведе открити обществени консултации, преди да представи тези проекти на технически стандарти за изпълнение, въз основа на които е изготвен настоящият регламент, анализира потенциалните свързани с тях разходи и ползи и поиска становището на Групата на участниците от сектора на ценните книжа и пазарите, създадена в съответствие с член 37 от посочения регламент,

ПРИЕ НАСТОЯЩИЯ РЕГЛАМЕНТ:

Член 1

Форма на данните

1. Всеки централен контрагент (ЦК) съхранява документацията с данните по член 20 от делегирания акт относно регулаторните технически стандарти за определяне на подробните изисквания за документацията с данни и информацията, които трябва да съхраняват централните контрагенти, приет съгласно член 29, параграф 4 от Регламент (ЕС) № 648/2012, за всеки обработен договор във формата съгласно таблица 1 от приложението.
2. Всеки ЦК съхранява документацията с данните по член 21 от делегирания акт относно регулаторните технически стандарти за определяне на подробните изисквания за документацията с данни и информацията, които трябва да съхраняват централните контрагенти, приет съгласно член 29, параграф 4 от Регламент (ЕС) № 648/2012, за всяка позиция във формата съгласно таблица 2 от приложението.

⁽¹⁾ все още непубликувана в Официален вестник.

⁽²⁾ ОВ L 201, 27.7.2012 г., стр. 1.

⁽³⁾ ОВ L 331, 15.12.2010 г., стр. 84.

3. Всеки ЦК съхранява документацията с данните по член 22 от делегирания акт относно регулаторните технически стандарти за определяне на подробните изисквания за документацията с данни и информацията, които трябва да съхраняват централните контрагенти, приет съгласно член 29, параграф 4 от Регламент (ЕС) № 648/2012, за стопанската си дейност и вътрешната си организация и във формата съгласно таблица 3 от приложението.

4. Всеки ЦК представя на компетентния орган документацията с данни и информацията по параграфи 1, 2 и 3 във

форма, която дава възможност за пряко предаване на данни между ЦК и компетентния орган. Всеки ЦК установява такъв процес на пряко предаване на данни в срок от шест месеца от получаването на искане от компетентния орган.

Член 2

Влизане в сила

Настоящият регламент влиза в сила на двадесетия ден след публикуването му в *Официален вестник на Европейския съюз*.

Настоящият регламент е задължителен в своята цялост и се прилага пряко във всички държави членки.

Съставено в Брюксел на 19 декември 2012 година.

За Комисията
Председател
José Manuel BARROSO

ПРИЛОЖЕНИЕ

Таблицы с данни за съхранение по член 1

Таблица 1

Данни за обработените трансакции

	Поле	Форма	Описание
1	Дата и час на отчитането	Формат за представяне на дата по ISO 8601/ формат за представяне на час като координирано универсално време (UTC).	Дата и час на отчитането.
2	Цена/процент	До 20 цифрови знака във формат xxxх.ууууу.	Цената на една ценна книга или един договор за дериват без комисиона и (в съответните случаи) начислена лихва. При дългов инструмент цената може да бъде изразена или като парична сума, или като процент.
2a	Изражение на цената	Напр. код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака, процент.	Начинът, по който е изразена цената.
3	Условна валута	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака.	Валутата, в която е изразена цената. Ако в случай на облигация или на друга форма на секюритизиран дълг цената се изразява като процент, този процент се посочва.
3a	Валута на доставката	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака.	Валутата, която трябва да бъде доставена.
4	Количество	До 10 цифрови знака.	Броят единици на финансовите инструменти, номиналната стойност на облигациите или броят на договорите за деривати, включени в сделката.
5	Изражение на количеството	До 10 цифрови знака.	Указание дали количеството е изразено като брой единици финансови инструменти, като номинална стойност на облигации или като брой договори за деривати.
6	Страна, от която действа ЦК	V=купувач / S=продавач.	
7	Идентификационен код на продукта	Временна класификация съгласно информацията по член 4 от Регламент (ЕС) № хх/2012 г. [Проект на технически стандарт за изпълнение относно формата и периодичността на отчетите за трансакциите, предавани на регистрите на трансакции], международен идентификационен номер на ценни книжа (ISIN номер) или единен идентификационен код на продукта (EIKП).	Договорът се идентифицира чрез идентификационен код на продукта, ако има такъв.
8	Идентификационен код на клиринговия член	Идентификационен код на правния субект (ИКПС) (20 буквено-цифрови знака), временен идентификационен код на субекта (20 буквено-цифрови знака), бизнес идентификационен код (BIC) (11 буквено-цифрови знака) или клиентски код (50 буквено-цифрови знака).	Ако отчитащият се контрагент не е клирингов член, неговият клирингов член се идентифицира в това поле чрез единен код. При физическите лица се използва клиентски код, определен от ЦК.

	Поле	Форма	Описание
9	Идентификационен код на ползващото се лице	Идентификационен код на правния субект (ИКПС) (20 буквено-цифрови знака), временен идентификационен код на субекта (20 буквено-цифрови знака), бизнес идентификационен код (ВІС) (11 буквено-цифрови знака) или клиентски код (50 буквено-цифрови знака).	Ако ползващото се лице по договора не е контрагент по този договор, то трябва да бъде идентифицирано чрез единен код или — при физически лица — чрез клиентски код, определен от правния субект и използван от физическото лице.
10	Страна, която е прехвърлила договора (при предаване на сделката на ЦК)	Идентификационен код на правния субект (ИКПС) (20 буквено-цифрови знака), временен идентификационен код на субекта (20 буквено-цифрови знака), бизнес идентификационен код (ВІС) (11 буквено-цифрови знака) или клиентски код (50 буквено-цифрови знака).	
11	Място на изпълнение	Идентификационен код на пазара по ISO 10383 в съответните случаи, ХOFF — за допуснатите до търговия на регулиран пазар деривати, които се търгуват извънборсово, или ХХХХ — за извънборсовите деривати.	Идентифициране на мястото, където е била изпълнена трансакцията. При договорите, сключени извън борсата, трябва да се посочи дали съответният инструмент е допуснат до търговия, но е търгуван извънборсово, или не е допуснат до търговия и е търгуван извънборсово.
12	Дата на встъпване на ЦК в трансакцията	Формат за представяне на дата по ISO 8601.	Датата, на която ЦК е встъпил в трансакцията.
13	Час на включване на ЦК в трансакцията	Формат за представяне на час по координирано универсално време (UTC).	Часът, в който ЦК е встъпил в трансакцията, отчитан в местното време на компетентния орган, пред когото се отчита трансакцията, и часовият пояс, по който се отчита трансакцията, изразен като координирано универсално време (UTC) +/- часове.
14	Дата на приключване на договора	Формат за представяне на дата по ISO 8601.	Датата, на която е бил приключен договърът.
15	Час на приключване на договора	Формат за представяне на час по координирано универсално време (UTC).	Часът, в който е бил приключен договърът, отчитан в местното време на компетентния орган, пред когото се отчита трансакцията, и часовият пояс, по който се отчита трансакцията, изразен като координирано универсално време (UTC) +/- часове.
16	Вид на доставката	C=с парични средства, P=физическа доставка, O=по избор на контрагента.	Посочва се дали сетълментът на договора се извършва чрез физическа доставка или чрез плащане с парични средства.
17	Дата на сетълмент	Формат за представяне на дата по ISO 8601.	Датата, на която е бил извършен сетълмент или покупка на деривата от трето лице при неизпълнение от страна на контрагента (buy-in). Ако датите са няколко, може да бъдат добавени още полета.
18	Час на сетълмента или покупката на деривата от трето лице при неизпълнение от страна на контрагента (buy-in)	Формат за представяне на час по координирано универсално време (UTC).	Часът, в който е бил извършен сетълмент или покупка на деривата от трето лице при неизпълнение от страна на контрагента (buy-in), отчитан в местното време на компетентния орган, пред когото се отчита трансакцията, и часовият пояс, по който се отчита трансакцията, изразен като координирано универсално време (UTC) +/- часове.

	Поле	Форма	Описание
Подробни сведения за първоначалните условия по договорите, за които се извършва клиринг — посочват се в приложимите случаи			
19	Дата	Формат за представяне на дата по ISO 8601.	Датата, на която първоначално е бил сключен договорът.
20	Час	Формат за представяне на час по координирано универсално време (UTC).	Часът, в който е бил сключен първоначалният договор, отчитан в местното време на компетентния орган, пред когото се отчита трансакцията, и часовият пояс, по който се отчита трансакцията, изразен като координирано универсално време (UTC) +/- часове.
21	Идентификационен код на продукта	Временна класификация съгласно информацията по член 4 от Регламент (ЕС) № xx/2012 г. [Проект на технически стандарт за изпълнение относно формата и периодичността на отчетите за трансакциите, предавани на регистрите на трансакции], международен идентификационен номер на ценни книжа (ISIN номер) или единен идентификационен код на продукта (ЕИКП).	Договорът се идентифицира чрез единен идентификационен код на продукта, ако има такъв.
22	Базов актив	Единен идентификационен код на продукта, международен идентификационен номер на ценни книжа (ISIN номер) (12 буквено-цифрови знака) и код за класификация на финансови инструменти (CFI код) (6 буквено-цифрови знака). Идентификационен код на правния субект (ИКПС) (20 буквено-цифрови знака), временен идентификационен код на субекта (20 буквено-цифрови знака), V= кошница или I=индекс.	Идентифициране на инструмента — за ценна книга, която е базов актив по договор за дериват, както и прехвърлима ценна книга, попадаща в обхвата на член 4, параграф 1, точка 18, буква в) от Директива 2004/39/ЕО.
23	Вид на деривата (при договори за деривати)	Хармонизираното описание на вида на деривата следва да се извърши съгласно една от горните категории съгласно единен международно признат стандарт за класификация на финансови инструменти.	
24	Включване на инструмента в регистъра на ЕОЦКП на договорите, за които задължително се извършва клиринг (при договор за дериват)	Y=да / N=не.	
Друга информация, която се предоставя в приложимите случаи			
25	Идентификация на ЦК, с който има споразумение за оперативна съвместимост и който извършва клиринг на част от трансакцията	Идентификационен код на правния субект (ИКПС) (20 буквено-цифрови знака), временен идентификационен код на субекта (20 буквено-цифрови знака), бизнес идентификационен код (BIC) (11 буквено-цифрови знака) или клиентски код (50 буквено-цифрови знака).	

Таблица 2

Данни за позициите

	Поле	Форма
1	Идентификационен код на клиринговия член	Идентификационен код на правния субект (ИКПС), временен идентификационен код на субекта или бизнес идентификационен код (BIC).
2	Идентификационен код на ползващото се лице	Идентификационен код на правния субект (ИКПС), временен идентификационен код на субекта, бизнес идентификационен код (BIC) или клиентски код.
3	ЦК, с който има споразумение за оперативна съвместимост и който поддържа позицията	Идентификационен код на правния субект (ИКПС), временен идентификационен код на субекта, бизнес идентификационен код (BIC) или клиентски код.
4	Знак на позицията	B=купувач / S=продавач.
5	Стойност на позицията	До 10 цифрови знака (xxxx,yy).
6	Цена, на която са оценени договорите	До 10 цифрови знака (xxxx,yy).
7	Валута	Код на валутата по ISO
8	Друга значима информация	Свободен текст
9	Размер на обезпеченията, поискани от ЦК	До 10 цифрови знака (xxxx,yy).
10	Размер на вноските за гаранционния фонд, поискани от ЦК	До 10 цифрови знака (xxxx,yy).
11	Размер на другите финансови средства, поискани от ЦК	До 10 цифрови знака (xxxx,yy).
12A	Размер на обезпеченията, предоставени от клиринговия член във връзка с клиентска сметка А	До 10 цифрови знака (xxxx,yy).
13A	Размер на вноските за гаранционния фонд, предоставени от клиринговия член във връзка с клиентска сметка А	До 10 цифрови знака (xxxx,yy).
14A	Размер на другите финансови ресурси, предоставени от клиринговия член във връзка с клиентска сметка А	До 10 цифрови знака (xxxx,yy).
15B	Размер на обезпеченията, предоставени от клиринговия член във връзка с клиентска сметка Б	До 10 цифрови знака (xxxx,yy).
16B	Размер на вноските за гаранционния фонд, предоставени от клиринговия член във връзка с клиентска сметка Б	До 10 цифрови знака (xxxx,yy).
17B	Размер на другите финансови ресурси, предоставени от клиринговия член във връзка с клиентска сметка Б	До 10 цифрови знака (xxxx,yy).

Таблица 3

Данни за предприятието и дейността му

	Поле	Форма	Описание
1	Органиграми	Свободен текст	Ръководен съвет и съответни комитети, отдел по клиринга, отдел за управление на риска и всички други съответни отдели или звена.

Акционери или съдружници (членове), които имат квалифицирано дялово участие (да се добавят полета за всеки съответен акционер или съдружник).

2	Вид	S=акционер / M= съдружник.	
3	Вид на квалифицираното дялово участие	D=пряко / I=косвено.	
4	Вид на субекта	N=физическо лице / L= юридическо лице.	
5	Размер на дяловото участие	До 10 цифрови знака (xxxxxy).	

Други документи

6	Правила, процедури и процеси, необходими съгласно организационните изисквания	Документи	
7	Протоколи от заседания на ръководния съвет, на подкомитетите (ако има такива) и на висшите ръководни комитети (ако има такива)	Документи	
8	Протоколи от заседанията на комитета по риска	Документи	
9	Протоколи от събранията на консултативната група с клирингови членове и с клиенти (ако има такива).	Документи	
10	Доклади от извършени вътрешни и външни одити, доклади за управлението на риска, доклади за спазването на нормативните изисквания и доклади от консултанти.	Документи	
11	Правила за осигуряване на непрекъснатост на дейността и план за възстановяване при катастрофично събитие	Документи	
12	План за поддържане на ликвидността и ежедневни отчети за ликвидността	Документи	
13	Документи, отразяващи всички активи и пасиви и сметките на собствениците	Документи	

	Поле	Форма	Описание
14	Получени жалби	<i>Свободен текст</i>	За всяка жалба: сведения за името, адреса и номера на сметката на жалбоподателя; дата на получаване на жалбата; имената на всички лица, посочени в жалбата; описание на предмета на жалбата; действия в отговор на жалбата; дата, на която е взето решение по жалбата.
15	Сведения за прекъсване на предоставяните услуги или за нарушения в процеса на предоставянето им	<i>Свободен текст</i>	Сведения за всяко прекъсване на предоставяните услуги или за нарушения в процеса на предоставянето им, в т.ч. подробен доклад за времето на възникване и ефекта на прекъсването/нарушението и действията за преодоляването му.
16	Резултати от извършени последващи тестове и тестове за устойчивост (бек-тестове и стрестестове)	<i>Свободен текст</i>	
17	Кореспонденция с компетентните органи, ЕОЦКП и съответните членове на Европейската система на централните банки (ЕСЦБ)	<i>Документи</i>	
18	Правни становища, получени съгласно организационните изисквания	<i>Документи</i>	
19	Споразумения за оперативна съвместимост с други ЦК (ако има такива)	<i>Документи</i>	
20	Списък на всички клирингови членове (член 17 от Регламент (ЕС) № XXX/2012)	<i>Свободен текст / документ.</i>	Списък по член 17 от Регламент (ЕС) № XXX/2012.
21	Сведения, изисквани по член 17 от Регламент (ЕС) № XXX/2012.	<i>Свободен текст / документи.</i>	Законодателство и правила, с които се уреждат: i) достъпът до ЦК, ii) договорите, сключвани между ЦК и клиринговите ѝ членове и — в съответните случаи — клиентите ѝ, iii) договорите, които ЦК приема за клиринг, iv) споразуменията за оперативна съвместимост, v) използването на обезпечения и вноски за гаранционния фонд, в т.ч. ликвидирването на позиции и обезпечения и степента, в която обезпечението е защитено от искове от трети лица (ниво на разделение).
22	Разработване на нови проекти	<i>Свободен текст</i>	При предоставяне на нови услуги.