KOMISJONI DELEGEERITUD MÄÄRUS (EL) 2019/358,

13. detsember 2018,

millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) 2015/2365 seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, mis käsitlevad väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute puhul kauplemisteabehoidlate poolt andmete kogumist, kontrollimist, summeerimist, võrdlemist ja avaldamist

(EMPs kohaldatav tekst)

EUROOPA KOMISJON,

võttes arvesse Euroopa Liidu toimimise lepingut,

võttes arvesse Euroopa Parlamendi ja nõukogu 25. novembri 2015. aasta määrust (EL) 2015/2365, mis käsitleb väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute ja uuesti kasutamise läbipaistvust ning millega muudetakse määrust (EL) nr 648/2012, ([1]) eriti selle artikli 5 lõike 7 punkti a ning artikli 12 lõike 3 punkte a ja b,

ning arvestades järgmist:

(1) Selleks et tagada väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute kohta kauplemisteabehoidlale teatatud üksikasjade kvaliteet, peaksid kauplemisteabehoidlad kontrollima aruannet esitavate üksuste isikusamasust, väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute üksikasjade järjestuse loogilist terviklikkust ning väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute kohta esitatavate kõnealuste üksikasjade täielikkust ja õigsust.

(2) Samal põhjusel peaksid kauplemisteabehoidlad kooskõlastavalt võrdlema iga laekunud väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu aruande üksikasju. Tuleks kindlaks määrata standardmenetlus, et kauplemisteabehoidlad saaksid kooskõlastaval võrdlemisel tegutseda järjepidevalt ja vähendada riski, et väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute üksikasjad ei läbi kooskõlastavat võrdlemist. Kuna aruannet esitavate üksuste tehnilistel süsteemidel on oma eripärad, ei pruugi väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute teatavad üksikasjad siiski olla identsed. Seetõttu tuleb kohaldada teatavaid lubatud hälbeid, nii et väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute kohta teatatud üksikasjade väheolulised erinevused ei takistaks ametiasutustel analüüsida andmeid piisava usaldusväärsusega.

(3) Võib eeldada, et aja jooksul paraneb aruannet esitavate üksuste teatamisvilumus, mis väljendub nii tagasilükatud aruannete arvu vähenemises kui ka kooskõlastava võrdlemise läbinud aruannete arvus. Neile tuleks siiski anda piisavalt aega teatamisnõuetega kohanemiseks, eelkõige selleks, et ennetada kohe pärast teatamiskohustuse jõustumist kooskõlastava võrdlemise ootel tehingute kuhjumist. Seepärast on asjakohane, et esimeses etapis kehtiks kooskõlastava võrdlemise nõue ainult piiratud arvu väljade suhtes.

(4) Aruandeid esitavad üksustel ja vajaduse korral teavitamise eest vastutavatel üksustel peaks olema võimalik jälgida, kas nad täidavad määruse (EL) 2015/2365 kohaseid teatamiskohustusi. Seepärast peaks neil olema võimalik iga päev tutvuda teatava kõnealuseid aruandeid käsitleva teabega, sh nende aruannete kontrollimise tulemustega, samuti esitatud andmete kooskõlastava võrdlemise edenemisega. Seega on vaja täpsustada teave, mida kauplemisteabehoidla peaks kõnealustele üksustele iga tööpäeva lõpus kättesaadavaks tegema.

(5) Väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute üksikasjade terviklikkuse huvides tuleks määruse (EL) 2015/2365 artikli 12 lõikes 2 osutatud vahetu ja viivitamatu juurdepääs tagada ühtlustatud ja järjepideval viisil. Selleks et normeerida teatamist, minimeerida tööstusharu kulusid ning tagada kauplemisteabehoidlate vahel andmete võrreldavus ja järjepidev summeerimine, on asjakohane esitada kõik aruanded ja vahetada andmeid XML-vormingus ning järgida finantssektoris laialdaselt kasutatavat metoodikat.

(6) Kahe vastaspoole vahelisi riskipositsioone käsitlevatele positsiooni tasandi andmetele juurdepääs on oluline, et määruse (EL) 2015/2365 artikli 12 lõikes 2 osutatud üksustel oleks võimalik määrata kindlaks finantsstabiilsuse süsteemsete või mittesüsteemsete riskide võimalikud allikad.

(7) Selleks et tagada üldsusele väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute piisav läbipaistvus, peaksid positsioonide summeerimise kriteeriumid võimaldama üldsusel mõista väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu turgude

([1]) ELT L 337, 23.12.2015, lk 1.

toimimist, kahjustamata seejuures kauplemisteabehoidlatele esitatud andmete konfidentsiaalsust. Määruse (EL) 2015/2365 artikli 12 lõike 1 kohase koondpositsioonide avaldamise sagedus ja üksikasjad tuleks täpsustada viisil, mis põhineb Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrusega (EL) nr 648/2012 ([2]) tuletislepingute jaoks sätestatud seonduval raamistikul.

(8) Käesolev määrus põhineb regulatiivsete tehniliste standardite eelnõul, mille Euroopa Väärtpaberiturujärelevalve (ESMA) esitas komisjonile Euroopa Parlamendi ja nõukogu määruse (EL) nr 1095/2010 ([3]) artiklis 10 sätestatud korras.

(9) Käesoleva määruse sätetes käsitletakse andmete kogumisel, summeerimisel ja võrdlemisel kauplemisteabehoidlate järgitavaid tegevusstandardeid ning korda, mida kauplemisteabehoidlatel tuleb kohaldada, et kontrollida neile väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute kohta teatatud üksikasjade täielikkust ja õigsust. Selleks et tagada nimetatud sätete kooskõla ja võimaldada kauplemisteabehoidlatele paremat ülevaadet, on soovitatav koondada kõik regulatiivsed tehnilised standardid ühte määrusesse.

(10) ESMA on korraldanud kõnealuste regulatiivsete tehniliste standardite eelnõu kohta avaliku konsultatsiooni, analüüsinud võimalikku seonduvat kulu ja kasu ning küsinud määruse (EL) nr 1095/2010 artikli 37 kohaselt moodustatud väärtpaberituru sidusrühmade kogu arvamust,

ON VASTU VÕTNUD KÄESOLEVA MÄÄRUSE:

Artikkel 1

Väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute aruannete kontrollimine kauplemisteabehoidlate poolt

1. Kauplemisteabehoidla kontrollib väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute kohta saadud aruandes kõiki järgmisi andmeid:

a) aruande esitanud üksuse isikusamasus, nagu on osutatud komisjoni rakendusmääruse (EL) 2019/363 ([4]) I lisa tabeli 1 andmeväljal 2;

b) väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingust teatamiseks kasutatava XML-vormi vastavus ISO 20022 meetodile kooskõlas rakendusmäärusega (EL) 2019/363;

c) aruannet esitav üksus, kui see erineb rakendusmääruse (EL) 2019/363 I lisa tabeli 1 andmeväljal 3 nimetatud teavitavast vastaspoolest, on teavitava vastaspoole nimel teatamiseks nõuetekohaselt volitatud, välja arvatud määruse (EL) 2015/2365 artikli 4 lõikes 3 sätestatud juhul;

d) väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu kohta ei ole sama aruannet varem esitatud;

e) väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu aruanne, milles on toimingu liigiks märgitud „muutmine“, käsitleb väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu kohta varem esitatud aruannet;

f) väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu aruanne, milles on toimingu liigiks märgitud „muutmine“, ei käsitle väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingut, mille kohta on varem saabunud tühistamise teade;

g) väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu aruanne ei sisalda toimingu liiki „uus“, kui sellest väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingust on juba varem teatatud;

h) väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu aruanne ei sisalda toimingu liiki „positsioonikomponent“, kui sellest väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingust on juba varem teatatud;

([2]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 4. juuli 2012. aasta määrus (EL) nr 648/2012 börsiväliste tuletisinstrumentide, kesksete vastaspoolte ja kauplemisteabehoidlate kohta (ELT L 201, 27.7.2012, lk 1).

([3]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 24. novembri 2010. aasta määrus (EL) nr 1095/2010, millega asutatakse Euroopa Järelevalveasutus (Euroopa Väärtpaberiturujärelevalve), muudetakse otsust nr 716/2009/EÜ ning tunnistatakse kehtetuks komisjoni otsus 2009/77/EÜ (ELT L 331, 15.12.2010, lk 84).

([4]) Komisjoni 13. detsembri 2018. aasta rakendusmäärus (EL) 2019/363, milles sätestatakse rakenduslikud tehnilised standardid seoses Euroopa Parlamendi ja nõukogu määruse (EL) 2015/2365 kohaselt kauplemisteabehoidlatele väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute üksikasjade kohta esitatavate teadete vormingu ja selliste teadete esitamise sagedusega ning muudetakse rakendusmäärust (EL) nr 1247/2012 seoses teavitamiskoodide kasutamisega tuletuslepingutest teavitamisel (vt käesoelva *Euroopa Liidu Teataja* lk 85).

i) väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu aruandega ei soovita muuta aruannet esitava üksuse, teavitava vastaspoole või varem teatatud väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu vastaspoole üksikasju;

j) väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu aruandega ei soovita varasemat väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu aruannet muuta seeläbi, et täpsustatakse väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu teatatud tähtpäevast hilisem väärtuspäev;

k) väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu aruande õigsus ja täielikkus.

2. Kauplemisteabehoidla kontrollib, kas väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute puhul on rakendusmääruse (EL) 2019/363 I lisa tabeli 2 andmeväljadel 73–96 sisestatud teave tagatiste kohta, kui sama tabeli andmevälja 72 „Väärtpaberite laenuks andmisel tagatise puudumise märge“ all on kirje „väär“. Kooskõlas käesoleva määruse artikliga 3 teatab kauplemisteabehoidla kontrollimise tulemuse aruande esitanud üksusele ja teavitavale vastaspoolele ning vajaduse korral ka teavitamise eest vastutavale üksusele.

3. Kui see ei vasta mõnele lõikes 1 sätestatud nõudele, lükkab kauplemisteabehoidla väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu aruande tagasi ja määrab selle ühte käesoleva määruse I lisa tabelis 2 sätestatud tagasilükkamise kategooriasse.

4. Kauplemisteabehoidla esitab aruande esitanud üksusele ja teavitavale vastaspoolele, vajaduse korral ka teavitamise eest vastutavale üksusele, 60 minuti jooksul pärast väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu aruande saamist lõikes 1 osutatud andmete kontrollimise tulemuste kohta üksikasjaliku teabe. Kauplemisteabehoidla kasutab nende tulemuste esitamiseks ISO 20022 meetodi kohaselt välja töötatud XML-vormingut ja vormi. Vajaduse korral sisaldavad tulemused väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu aruande tagasilükkamise konkreetseid põhjuseid kooskõlas lõikega 3.

Artikkel 2

Andmete kooskõlastav võrdlemine kauplemisteabehoidlate poolt

1. Kauplemisteabehoidla püüab teatatud väärtpaberite kaudu finantseerimise tehinguid lõikes 2 sätestatud tegevussamme astudes kooskõlastavalt võrrelda, eeldusel et täidetud on kõik järgmised tingimused:

a) kauplemisteabehoidla on viinud lõpule artikli 1 lõigetes 1 ja 2 sätestatud kontrollimised;

b) teatatud väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu mõlemal vastaspoolel on teatamiskohustus;

c) kauplemisteabehoidla ei ole saanud teatatud väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu kohta edasist aruannet, milles on toimingu liigiks märgitud „viga“.

2. Kui kõik lõikes 1 nimetatud tingimused on täidetud, astub kauplemisteabehoidla järgmised tegevussammud, kasutades seejuures iga käesoleva määruse I lisa tabelis 1 esitatud andmevälja uusimat väärtust:

a) pärast väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu aruande saamist kontrollib kauplemisteabehoidla, kas ta on saanud vastava väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu aruande ka teiselt vastaspoolelt või teise vastaspoole nimel;

b) kauplemisteabehoidla, kes ei ole saanud punktis a osutatud vastavat väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu aruannet, püüab kindlaks teha, milline kauplemisteabehoidla vastava väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu aruande sai ja edastab selleks teatatud väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute kohta kõikidele registreeritud kauplemisteabehoidlatele järgmiste andmeväljade väärtused: „tehingu kordumatu tunnuskood“, „teavitav vastaspool“, „teine vastaspool“ ja „raamlepingu liik“;

c) kauplemisteabehoidla, kes on tuvastanud, et punktis a osutatud vastava väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu aruande on saanud muu kauplemisteabehoidla, vahetab selle kauplemisteabehoidlaga väärtpaberite kaudu finantseerimise tehinguid käsitlevaid üksikasju, kasutades selleks ISO 20022 meetodi kohaselt välja töötatud XML-vormingut ja vormi;

d) kui punktist e ei tulene teisiti, loeb kauplemisteabehoidla teatatud väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu kooskõlastavalt võrrelduks, kui kõnealuse väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu andmed langevad kokku käesoleva lõike punktis a osutatud vastava väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu aruande üksikasjadega;

e) kauplemisteabehoidla püüab eraldi kokku viia laenuandmeid käsitlevaid andmevälju ja teatatud väärtpaberite kaudu finantseerimise tehinguga seotud tagatise andmevälju kooskõlas käesoleva määruse I lisa tabelis 1 sätestatud lubatud hälvete ja asjakohaste kohaldamiskuupäevadega;

f) seejärel määrab kauplemisteabehoidla igale teatatud väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingule kooskõlastava võrdlemise kategooriate väärtused, nagu on sätestatud käesoleva määruse I lisa tabelis 3;

g) kauplemisteabehoidla viib käesoleva lõike punktides a–f nimetatud tegevussammud lõpule esimesel võimalusel, kuid ei astu selliseid tegevussamme samal tööpäeval pärast 18:00 koordineeritud maailmaaja (UTC) järgi;

h) kauplemisteabehoidla, kes ei suuda teatatud väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu võrdlemisel kooskõlastuseni jõuda, püüab sellise teatatud väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu üksikasjad kokku viia järgmisel tööpäeval. Kauplemisteabehoidla ei püüa esitatud väärtpaberite kaudu finantseerimise tehinguid enam kooskõlastavalt võrrelda, kui väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu teatatud tähtpäevast on möödunud 30 kalendripäeva või kui kauplemisteabehoidla on saanud selle kohta „lõpetamise“ või „positsioonikomponendi“ liiki toimingu aruande.

3. Kauplemisteabehoidla küsib iga tööpäeva lõpus kinnitust kooskõlastava võrdlemise läbinud teatatud väärtpaberite finantseerimise tehingute koguarvu kohta igalt kauplemisteabehoidlalt, kellega ta on teatatud väärtpaberite kaudu finantseerimise tehinguid kooskõlastavalt võrrelnud.

4. Hiljemalt 60 minutit pärast lõike 2 punkti g kohase kooskõlastava võrdlemise lõppu esitab kauplemisteabehoidla aruande esitanud üksusele ja teavitavale vastaspoolele ning vajaduse korral ka teavitamise eest vastutavale üksusele kõnealuste teatatud väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute kooskõlastava võrdlemise tulemused. Kauplemisteabehoidla kasutab nende tulemuste esitamiseks ISO 20022 meetodi kohaselt välja töötatud XML-vormingut ja vormi, esitades sh teabe nende andmeväljade kohta, mis kooskõlastavat võrdlemist ei läbinud.

Artikkel 3

Päevalõpu reageerimismehhanismid

Iga tööpäeva lõpuks teeb kauplemisteabehoidla aruande esitanud üksusele ja teavitavale vastaspoolele ning vajaduse korral ka teavitamise eest vastutavale üksusele asjaomaste väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute kohta ISO 20022 meetodi kohaselt välja töötatud XML-vormingut ja vormi kasutades kättesaadavaks järgmise teabe:

a) kõnealusel päeval teatatud väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingud;

b) selliste väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute kauplemise hetkeseis, mille tähtpäev ei ole veel käes või mille kohta ei ole esitatud „vea“, „lõpetamise“ või „positsioonikomponendi“ liiki toimingu aruannet;

c) selliste väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute kordumatud tunnuskoodid, mille puhul rakendusmääruse (EL) 2019/363 I lisa tabeli 2 andmevälja 72 all on kirje „väär“ ning sama tabeli andmeväljadel 73–96 esitatava tagatise kohta ei ole teavet veel esitatud;

d) väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingud, mis on kõnealusel päeval tagasi lükatud;

e) kõigi teatatud väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute kooskõlastava võrdlemise staatus, välja arvatud selliste väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute puhul, mis on aegunud või mille kohta on saadud rohkem kui üks kuu enne nimetatud tööpäeva „lõpetamise“ või „positsioonikomponendi“ liiki toimingu aruanne.

Artikkel 4

Juurdepääs väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute üksikasjadele

Kauplemisteabehoidla tagab määruse (EL) 2015/2365 artikli 12 lõikes 2 loetletud üksustele vahetu ja viivitamatu juurdepääsu, sealhulgas määruse (EL) nr 1095/2010 artikli 28 kohase delegeerimise olemasolu korral, väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute üksikasjadele elektroonilisel ja masinloetaval kujul kooskõlas komisjoni delegeeritud määrusega (EL) 2019/357 ([5]).

Esimese lõigu kohaldamisel kasutab kauplemisteabehoidla ISO 20022 meetodi kohaselt välja töötatud XML-vormingut ja vormi.

([5]) Komisjoni 13. detsembri 2018. aasta delegeeritud määrus (EL) 2019/357, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) 2015/2365 seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, milles käsitletakse juurdepääsu väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute kohta kauplemisteabehoidlates hoitavatele andmetele (vt käesoleva *Euroopa Liidu Teataja* lk 22).

Artikkel 5

Positsiooni tasandi andmete arvutamine ja neile juurdepääs

1. Kauplemisteabehoidla arvutab vastaspooltevaheliste riskipositsioonide kohta positsiooni tasandi andmed laenu ja tagatise puhul. Positsiooni tasandi andmete arvutamine põhineb järgmistel kriteeriumidel:

a) kooskõlastava võrdlemise kategooriate väärtused käesoleva määruse I lisa tabeli 3 kohaselt;

b) väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu liik;

c) vastaspoolte sektor;

d) kliiringu staatus;

e) teostatud kauplemiskohas või väljaspool seda;

f) tagatise liik;

g) väärtpaberitehingute raha poole valuuta;

h) tähtpäevaklass;

i) väärtuskärbete klass;

j) kauplemisteabehoidlad, kellele teine vastaspool teatas väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu üksikasjad.

2. Kauplemisteabehoidla tagab, et määruse (EL) 2015/2365 artikli 12 lõikes 2 loetletud üksustel on juurdepääs positsiooni tasandi andmetele kooskõlas delegeeritud määruse (EL) 2019/357 kohase andmetele juurdepääsuga.

3. Lõikes 1 osutatud positsiooni tasandi andmed esitatakse elektroonilisel ja masinloetaval kujul ning kasutades ISO 20022 meetodi kohaselt välja töötatud XML-vormingut ja vormi.

4. Lõikes 2 osutatud juurdepääs antakse esimesel võimalusel ja hiljemalt määruse (EL) 2015/2365 artikli 4 lõike 1 kohase väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu aruande kättesaamisele järgneval tööpäeval.

5. Kauplemisteabehoidla tagab määruse (EL) 2015/2365 artikli 12 lõikes 2 osutatud üksustele koondtasandi andmetele juurepääsu, nagu on ette nähtud delegeeritud määruse (EL) 2019/357 kohaste juurdepääsutasanditega ja arvutatuna väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu andmete üldise kogumise ja summeerimise ühiselt kokku lepitud standardite ja menetluste kohaselt.

Artikkel 6

Avaldatavate koondpositsiooni andmete arvutamine

1. Kauplemisteabehoidla kasutab positsiooniandmete summeerimisel lõigetes 2 ja 3 järgmiste väärtuste kohta esitatud kriteeriume:

a) repolepingute põhisumma, ostu- ja tagasimüügi või müügi- ja tagasiostu tehingud, laenuks antud või võetud väärtpaberid või kaubad kokku ja võimenduslaenude summa;

b) asjaomaste väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute jaoks asjakohaste tehingute kordumatute tunnuskoodide arv;

c) tagatise turuväärtus.

2. Kauplemisteabehoidla summeerib vahemikus laupäev 00:00:00 (UTC) kuni reede 23:59:59 (UTC) teatatud selliste väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute positsiooniandmed, mille puhul toimingu liik oli „uus“, järgmiste kriteeriumide ja käesoleva määruse II lisa tabelis 1 sätestatud seonduvate väärtuste alusel:

a) teavitava vastaspoole või vajaduse korral asjaomase filiaali asukoht;

b) teise vastaspoole või vajaduse korral asjaomase filiaali asukoht;

c) väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu liik;

d) väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu kooskõlastava võrdlemise staatus käesoleva määruse I lisa tabeli 3 kohaselt;

e) väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu sõlmimise koha liik;

f) kas väärtpaberite kaudu finantseerimise tehing on kliiritud või mitte;

g) tagatise ülekandmise meetod;

h) kõik indeksid, mida kasutati alusena väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingus, millega kaubeldakse täitmiskohas, mis ei ole „XXXX“, kui kauplemisteabehoidlale indeksiga seoses teatatud koondnimiväärtus on üle 5 miljardi euro ja kui asjaomastest väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingutest on kauplemisteabehoidlale teatanud vähemalt kuus eri vastaspoolt.

3. Kauplemisteabehoidla summeerib iga reede kella 23:59:59 (UTC) seisuga positsiooniandmed väärtpaberite kaudu finantseerimise kõikide selliste tehingute kohta, mille tähtpäev ei ole veel käes või mille kohta ei ole laekunud „vea“, „lõpetamise“ või „positsioonikomponendi“ liiki toimingu aruannet, järgmiste kriteeriumide ja käesoleva määruse II lisa tabelis 1 sätestatud seonduvate väärtuste alusel:

a) teavitava vastaspoole või vajaduse korral asjaomase filiaali asukoht;

b) teise vastaspoole või vajaduse korral asjaomase filiaali asukoht;

c) väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu liik;

d) väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu kooskõlastava võrdlemise staatus käesoleva määruse I lisa tabeli 3 kohaselt;

e) väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu sõlmimise koha liik;

f) kas väärtpaberite kaudu finantseerimise tehing on kliiritud või mitte;

g) tagatise ülekandmise meetod;

h) kõik indeksid, mida kasutati alusena väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingus, millega kaubeldakse täitmiskohas, mis ei ole „XXXX“, kui kauplemisteabehoidlale indeksiga seoses teatatud koondnimiväärtus on üle 5 miljardi euro ja asjaomastest väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingutest on kauplemisteabehoidlale teatanud vähemalt kuus eri vastaspoolt.

4. Kauplemisteabehoidla kehtestab koondpositsiooni andmetega seotud erakorraliste väärtuste tuvastamise menetluse.

5. Kauplemisteabehoidla kehtestab menetluse koondpositsiooni andmete korrigeerimiseks ja sellistest korrektiividest teatamiseks, sealhulgas juhul, kui korrigeerimise tingisid „vea“ liiki toimingu aruanded, ning algsete ja parandatud koondandmete avaldamiseks.

Artikkel 7

Koondpositsiooni andmete avaldamine

1. Kauplemisteabehoidla avaldab eelmisel reedel kella 23:59:59-ks (UTC) teatatud väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute kohta oma veebisaidil artikli 6 kohaselt arvutatud koondpositsiooni andmed iga nädal hiljemalt teisipäeval kell 12:00 päeval.

2. Kauplemisteabehoidla avaldab kõik koondpositsiooni andmed eurodes ja kasutab nende andmete avaldamisele eelnenud reede seisuga EKP veebisaidil avaldatud vahetuskursse.

3. Kauplemisteabehoidla tagab, et koondpositsiooni andmed avaldatakse tabelina, nagu on sätestatud käesoleva määruse II lisas, ning andmete allalaadimise võimalusega.

4. Kauplemisteabehoidla hoiab avaldatud koondpositsiooni andmeid oma veebisaidil üleval vähemalt 104 nädalat.

Artikkel 8

Jõustumine

Käesolev määrus jõustub kahekümnendal päeval pärast selle avaldamist *Euroopa Liidu Teatajas*.

Käesolev määrus on tervikuna siduv ja vahetult kohaldatav kõikides liikmesriikides.

Brüssel, 13. detsember 2018

Komisjoni nimel
president
Jean-Claude JUNCKER

I LISA

Tabel 1

Kooskõlastava võrdlemise andmeväljad, lubatud hälbed ja kooskõlastava võrdlemise etapi algus

Tabel	Punkt	Andmeväli	Lubatud hälve	Alguskuupäeva koht
Vastaspoole andmed	—	Teavitav vastaspool	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Vastaspoole andmed	—	Vastaspoole roll	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Vastaspoole andmed	—	Teine vastaspool	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Tehingu kordumatu tunnuskood	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu liik	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Kliiritud	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Kliiringu ajatempel	Üks tund	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Laen	Keskne vastaspool	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Kauplemiskoht	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Raamlepingu liik	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Täitmise ajatempel	Üks tund	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Väärtuspäev (alguskuupäev)	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Tähtpäev (lõppkuupäev)	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Lõpetamise kuupäev	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Minimaalne etteteatamistähtaeg	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Laen	Varaseim tagasiostu kuupäev	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Laen	Üldtagatise märge	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud

Tabel	Punkt	Andmeväli	Lubatud hälve	Alguskuupäeva koht
Tehinguandmed	Laen	DBV („Delivery By Value“) märge	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Laen	Tagatise andmise meetod	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Tähtajatu	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Lõpetamise võimalus	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Laen	Fikseeritud intressimäär	Kuni kolm kümnendkohta	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Intressiarvestusmeetod	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Ujuv intress	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Ujuva intressi baasperiood – ajaperiood	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Ujuva intressi baasperiood – kordaja	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Laen	Ujuva intressi makse sagedus – ajaperiood	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Laen	Ujuva intressi maksesagedus – kordaja	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Laen	Ujuva intressimäära muutmise sagedus – ajaperiood	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Ujuva intressimäära muutmise sagedus – kordaja	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Intressivahe	Kuni kolm kümnendkohta	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Võimenduslaenu valuuta summa	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Võimenduslaenu valuuta	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i

Tabel	Punkt	Andmeväli	Lubatud hälve	Alguskuupäeva koht
Tehinguandmed	Laen	Kohandatud intressimäär	Kuni kolm kümnendkohta	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Laen	Intressimäära kuupäev	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Laen	Põhisumma väärtuspäeval	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Põhisumma tähtpäeval	0,0005 %	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Põhisumma valuuta	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Vara liik	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Väärtpaberi tunnuskood	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Väärtpaberi liigitus	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Põhitoode	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Laen	Alamtoode	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Laen	Muu alamtoode	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Laen	Kogus või nimiväärtus	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Mõõtühik	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Laen	Nimiväärtuse valuuta	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Väärtpaberi või kauba hind	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Laen	Hinna valuuta	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Laen	Väärtpaberi kvaliteet	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv
Tehinguandmed	Laen	Väärtpaberi tähtpäev	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv

Tabel	Punkt	Andmeväli	Lubatud hälve	Alguskuupäeva koht
Tehinguandmed	Laen	Emitendi kohtualluvus	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv
Tehinguandmed	Laen	Emitendi LEI	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv
Tehinguandmed	Laen	Väärtpaberi liik	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv
Tehinguandmed	Laen	Laenuväärtus	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Laen	Turuväärtus	0,0005 %	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Laen	Fikseeritud mahahindlusmäär	Kuni kolm kümnendkohta	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Ujuv mahahindlusmäär	Kuni kolm kümnendkohta	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Ujuva mahahindlusmäära baasperiood – ajaperiood	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Laen	Ujuva mahahindlusmäära baasperiood – kordaja	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Laen	Ujuva mahahindlusmäära makse sagedus – ajaperiood	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Laen	Ujuva mahahindlusmäära makse sagedus – kordaja	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Laen	Ujuva mahahindlusmäära muutmise sagedus – ajaperiood	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Laen	Ujuva mahahindlusmäära muutmise sagedus – kordaja	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Laen	Mahahindlusmäära vahe	Kuni kolm kümnendkohta	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Laen	Laenuks andmise teenustasu	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i

Tabel	Punkt	Andmeväli	Lubatud hälve	Alguskuupäeva koht
Tehinguandmed	Laen	Erikokkulepped	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Laen	Tagasimaksmata võimenduslaen	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Tagasimaksmata võimenduslaenu alusvääring	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Lühikese positsiooni turuväärtus	0,0005 %	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Tagatis	Väärtpaberite laenuks andmisel tagatise puudumise märge	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Tagatis	Neto riskipositsiooni tagatus	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Tagatis	Tagatise väärtuspäev	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Tagatis	Tagatiskomponendi liik	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Tagatis	Rahalise tagatise summa	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Tagatis	Rahalise tagatise valuuta	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Tagatis	Tagatisena kasutatud väärtpaberi tunnus	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Tagatis	Tagatisena kasutatud väärtpaberi liigitus	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Tagatis	Põhitoode	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Tagatis	Alamtoode	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Tagatis	Muu alamtoode	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt iv + 24 kuud
Tehinguandmed	Tagatis	Tagatise kogus või nimiväärtus	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Tagatis	Tagatise mõõtühik	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i + 24 kuud

Tabel	Punkt	Andmeväli	Lubatud hälve	Alguskuupäeva koht
Tehinguandmed	Tagatis	Tagatise nimiväärtuse valuuta	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Tagatis	Hinna valuuta	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i + 24 kuud
Tehinguandmed	Tagatis	Ühikuhind	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i + 24 kuud
Tehinguandmed	Tagatis	Tagatise turuväärtus	0,0005 %	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i + 24 kuud
Tehinguandmed	Tagatis	Väärtuskärbe või võimendus	Kuni kolm kümnendkohta	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Tagatis	Tagatise kvaliteet	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Tagatis	Väärtpaberi tähtpäev	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Tagatis	Emitendi kohtualluvus	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Tagatis	Emitendi LEI	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Tagatis	Tagatise liik	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Tagatis	Tagatise uuesti kasutamise võimalus	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Tagatis	Tagatise korvi tunnus	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i
Tehinguandmed	Laen	Tasand	Puudub	Määruse (EL) 2015/2365 artikli 33 lõike 2 punkti a alapunkt i

Tabel 2

Väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu aruande tagasilükkamise põhjused

Tagasilükkamise kategooriad	Põhjus
Skeem	— väärtpaberite kaudu finantseerimise tehing lükati tagasi skeemi mittevastavuse pärast
Luba	— väärtpaberite kaudu finantseerimise tehing lükati tagasi, kuna aruannet esitaval üksusel ei ole lubatud teavitava vastaspoole nimel aruannet esitada
Loogilisus	— väärtpaberite kaudu finantseerimise tehing lükati tagasi, kuna väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu puhul valitud toimingu liik ei ole loogiliselt võttes õige
Tegevus	— väärtpaberite kaudu finantseerimise tehing lükati tagasi, kuna väärtpaberite kaudu finantseerimise tehing ei vasta sisult ühele või mitmele tingimusele.

Tabel 3

Kooskõlastava võrdlemise tulemused

Kooskõlastava võrdlemise kategooriad	Kooskõlastava võrdlemise väärtused
Aruandluse liik	Ühepoolne/kahepoolne
Mõlema vastaspoole teatamisnõue	Jah/ei
Sobitamine	Sobitatud/sobitamata
Laenu kooskõlastav võrdlemine	Kooskõlastatavalt võrreldud/võrdlemata
Tagatise kooskõlastav võrdlemine	Kooskõlastatavalt võrreldud/võrdlemata
Täiendavad muudatused	Jah/ei

II LISA

Tabel 1

Avalikud andmed

Tabel A. Summeerimine

Kuupäev	Kauplemisteabehoidla	Summeerimise liik	Koha liik	Teavitava vastaspoole asukoht	Teise vastaspoole asukoht	Kooskõlastav võrdlemine	Väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu liik	Kliiritud	Tagatise ülekandmise meetod	Kasutatud indeks [1]	Kogu laenuks antud summa	Tehingute koguarv	Tagatise koondväärtus
20161007	ELi kauplemisteabehoidla	Esitatud	XXXX	EMP	EMP	Kahepoolne, laen kooskõlastatavalt võrreldud, tagatis kooskõlastatavalt võrdlemata	Repoleping	Jah	Omandiõiguse ülemineku põhinev finantstagatiskokkulepe		…		…
…	…	Jääk	XOFF	EMP-väline	EMP-väline	Kahepoolne, laen kooskõlastatavalt võrreldud, tagatis kooskõlastatavalt võrreldud	BSB/SBB	Puudub	SICA		…		…
…	…	…	EMP turu tunnuskood	…	…	Ühepoolne EMP, laen kooskõlastatavalt võrreldud, tagatis kooskõlastatavalt võrreldud	Väärtpaberite või kauba laenuks andmine ja võtmine	…	SIUR		…		…
…	…	…	EMP-välise turu tunnuskood	…	…	…	Võimenduslaen	…			…		…
…	…	…	…	…	…	…	…	…	…	…	…	…	…

[1] Sisestada asjaomased rakendusmääruse (EL) 2019/363 I lisa tabeli 2 „Laenu- ja tagatise andmed“ andmeväljal 25 esitatud indeksid.