KOMISIJOS DELEGUOTASIS REGLAMENTAS (ES) 2019/358

2018 m. gruodžio 13 d.

kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) 2015/2365 papildomas sandorių duomenų saugyklų atliekamo vertybinių popierių įsigijimo finansavimo sandorių (VPĮFS) duomenų rinkimo, tikrinimo, bendrinimo, lyginimo ir skelbimo techniniais reguliavimo standartais

(Tekstas svarbus EEE)

EUROPOS KOMISIJA,

atsižvelgdama į Sutartį dėl Europos Sąjungos veikimo,

atsižvelgdama į 2015 m. lapkričio 25 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (ES) 2015/2365 dėl vertybinių popierių įsigijimo finansavimo sandorių ir pakartotinio naudojimo skaidrumo ir kuriuo iš dalies keičiamas Reglamentas (ES) Nr. 648/2012 ([1]), ypač į jo 5 straipsnio 7 dalies a punktą ir 12 straipsnio 3 dalies a ir b punktus,

kadangi:

(1) siekiant užtikrinti aukštą VPĮFS duomenų, teikiamų sandorių duomenų saugykloms, kokybę, sandorių duomenų saugyklos turėtų tikrinti pranešimą teikiančių subjektų tapatybę, loginę VPĮFS duomenų teikimo seką ir tų VPĮFS duomenų išsamumą ir teisingumą;

(2) dėl tos pačios priežasties sandorių duomenų saugyklos turėtų suderinti kiekvieno gauto VPĮFS pranešimo duomenis. Reikėtų išsamiai nustatyti standartizuotą procesą, kad sandorių duomenų saugyklos galėtų nuosekliai derinti duomenis ir mažinti nesuderintų VPĮFS duomenų riziką. Tačiau kai kurie VPĮFS duomenys gali būti neidentiški dėl pranešimą teikiančių subjektų technologijų sistemų specifikos. Todėl reikia taikyti tam tikrą leistiną nuokrypį, kad nedideli teikiamų VPĮFS duomenų skirtumai nebūtų kliūtis institucijoms analizuoti duomenis su deramu pasitikėjimu;

(3) reikėtų tikėtis, kad pranešimus teikiantys subjektai ilgainiui patobulins savo teikiamus pranešimus, todėl mažės atmetamų pranešimų skaičius ir teikiami duomenys bus labiau suderinti. Tačiau jiems reikėtų skirti pakankamai laiko, kad prisitaikytų prie duomenų teikimo reikalavimų, visų pirma siekiant išvengti nesuderintų sandorių kaupimosi iš karto pradėjus taikyti pareigą teikti duomenis. Todėl tikslinga pirmuoju etapu suderinti mažesnį skaičių laukelių;

(4) pranešimus teikiantys subjektai ir už duomenų teikimą atsakingi subjektai, jeigu yra, turėtų galėti stebėti, ar laikosi savo pareigos teikti duomenis pagal Reglamentą (ES) 2015/2365. Todėl jie turėtų kasdien turėti prieigą prie tam tikros informacijos, susijusios su tais pranešimais, įskaitant tų pranešimų patikrinimo rezultatus ir teikiamų duomenų suderinimo eigą. Todėl būtina išsamiai nustatyti informaciją, kurią sandorių duomenų saugyklos turėtų pateikti tiems subjektams kiekvienos darbo dienos pabaigoje;

(5) kad VPĮFS duomenys būtų vientisi, prie jų turėtų būti suderintai ir nuosekliai teikiama tiesioginė ir neatidėliotina prieiga, nurodyta Reglamento (ES) 2015/2365 12 straipsnio 2 dalyje. Siekiant standartizuoti duomenų teikimą, kuo labiau sumažinti išlaidas teikėjams ir užtikrinti duomenų palyginamumą ir nuoseklų bendrinimą visose sandorių duomenų saugyklose, teikti visus pranešimus apie rezultatus ir keistis informacija tikslinga naudojant XML formato šablonus laikantis plačiai finansų sektoriuje naudojamos metodikos;

(6) prieiga prie dviejų konkrečių sandorio šalių pozicijų lygmens duomenų yra labai svarbi, kad Reglamento (ES) 2015/2365 12 straipsnio 2 dalyje nurodyti subjektai galėtų nustatyti, iš kur kyla galima sisteminė arba nesisteminė rizika finansiniam stabilumui;

(7) siekiant užtikrinti deramą VPĮFS skaidrumą visuomenei, pozicijų bendrinimui naudojami kriterijai turėtų suteikti galimybę visuomenei suprasti VPĮFS rinkų veikimą nepažeidžiant sandorių duomenų saugykloms teikiamų

([1]) OL L 337, 2015 12 23, p. 1.

duomenų konfidencialumo. Sandorių duomenų saugyklos pagal Reglamento (ES) 2015/2365 12 straipsnio 1 dalį vykdomo bendrų pozicijų skelbimo dažnumas ir jų duomenys turėtų būti išsamiai nustatyti remiantis susijusia išvestinių finansinių priemonių sutartims taikoma sistema, numatyta Europos Parlamento ir Tarybos reglamentu (ES) Nr. 648/2012 ([2]);

(8) šis reglamentas pagrįstas techninių reguliavimo standartų projektais, kuriuos Europos vertybinių popierių ir rinkų institucija (ESMA) pateikė Komisijai pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 1095/2010 ([3]) 10 straipsnyje nustatytą tvarką;

(9) šio reglamento nuostatos susijusios su sandorių duomenų saugyklų atliekamo duomenų rinkimo, bendrinimo ir lyginimo veiklos standartais ir sandorių duomenų saugyklų taikytinomis procedūromis siekiant patikrinti, ar joms pateikti VPĮFS duomenys yra išsamūs ir teisingi. Siekiant užtikrinti tų nuostatų tarpusavio derėjimą ir palengvinti sąlygas sandorių duomenų saugykloms visapusiškai jas apžvelgti, pageidautina susijusius techninius reguliavimo standartus pateikti viename reglamente;

(10) be to, ESMA surengė atviras viešas konsultacijas dėl šių techninių reguliavimo standartų projektų, išanalizavo galimas su jais susijusias sąnaudas ir naudą ir paprašė, kad pagal Reglamento (ES) Nr. 1095/2010 37 straipsnį įsteigta ESMA Vertybinių popierių ir rinkų suinteresuotųjų subjektų grupė pateiktų savo nuomonę,

PRIĖMĖ ŠĮ REGLAMENTĄ:

1 straipsnis

Sandorių duomenų saugyklų vykdomas VPĮFS pranešimų tikrinimas

1. Sandorių duomenų saugykla tikrina visus šiuos gauto VPĮFS pranešimo aspektus:

a) pranešimą teikiančio subjekto tapatybę, kaip nurodyta Komisijos įgyvendinimo reglamento (ES) 2019/363 ([4]) I priedo 1 lentelės 2 laukelyje;

b) ar XML šablonas, naudotas pranešti apie VPĮFS, atitinka ISO 20022 metodiką pagal Įgyvendinimo reglamentą (ES) 2019/363;

c) ar pranešimą teikiantis subjektas, jeigu skiriasi nuo duomenis teikiančios sandorio šalies, kaip nurodyta Įgyvendinimo reglamento (ES) 2019/363 I priedo 1 lentelės 3 laukelyje, yra tinkamai įgaliotas teikti pranešimą duomenis teikiančios sandorio šalies vardu, išskyrus Reglamento (ES) 2015/2365 4 straipsnio 3 dalyje numatytą atvejį;

d) ar tas pats VPĮFS pranešimas nebuvo pateiktas anksčiau;

e) ar VPĮFS pranešimas su nurodyta veiksmo rūšimi „pakeitimas“ yra susijęs su anksčiau pateiktu VPĮFS pranešimu;

f) ar VPĮFS pranešimas su nurodyta veiksmo rūšimi „pakeitimas“ nėra susijęs su VPĮFS, apie kurį pranešta kaip anuliuotą;

g) ar VPĮFS pranešime nenurodyta veiksmo rūšis „naujas“, kai apie tą VPĮFS jau pranešta;

h) ar VPĮFS pranešime nenurodyta veiksmo rūšis „pozicijos komponentas“, kai apie tą VPĮFS jau pranešta;

([2]) 2012 m. liepos 4 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 648/2012 dėl ne biržos išvestinių finansinių priemonių, pagrindinių sandorio šalių ir sandorių duomenų saugyklų (OL L 201, 2012 7 27, p. 1).

([3]) 2010 m. lapkričio 24 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 1095/2010, kuriuo įsteigiama Europos priežiūros institucija (Europos vertybinių popierių ir rinkų institucija) ir iš dalies keičiamas Sprendimas Nr. 716/2009/EB bei panaikinamas Komisijos sprendimas 2009/77/EB (OL L 331, 2010 12 15, p. 84).

([4]) 2018 m. gruodžio 13 d. Komisijos įgyvendinimo reglamentas (ES) 2019/363, kuriuo nustatomi pranešimų apie vertybinių popierių įsigijimo finansavimo sandorių duomenis, teikiamų sandorių duomenų saugykloms pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (ES) 2015/2365, formato ir dažnumo techniniai įgyvendinimo standartai ir iš dalies keičiamos Įgyvendinimo reglamento (ES) Nr. 1247/2012 nuostatos, susijusios su pranešimų kodų naudojimu teikiant pranešimus apie išvestinių finansinių priemonių sutartis (žr. šio Oficialiojo leidinio p. 85).

i) ar VPĮFS pranešimu nesiekiama pakeisti VPĮFS, apie kurį anksčiau pranešta, pranešimą teikiančio subjekto, duomenis teikiančios sandorio šalies ar kitos sandorio šalies duomenų;

j) ar VPĮFS pranešimu nesiekiama pakeisti esamo VPĮFS pranešimo nurodant vėlesnę įskaitymo datą nei pranešta VPĮFS termino diena;

k) VPĮFS pranešimo išsamumą ir teisingumą.

2. Sandorių duomenų saugykla patikrina, ar informacija apie užtikrinimo priemonę, gautą pagal VPĮFS, pateikta Įgyvendinimo reglamento (ES) 2019/363 I priedo 2 lentelės 73–96 laukeliuose, kai tos pačios lentelės 72 laukelis „užtikrinimo priemone neužtikrintų vertybinių popierių skolinimo žyma“ nurodomas kaip „klaidingas“. Pagal šio reglamento 3 straipsnį sandorių duomenų saugykla praneša patikrinimo rezultatus pranešimą teikiančiam subjektui ir duomenis teikiančiai sandorio šaliai, taip pat subjektui, atsakingam už duomenų teikimą, jeigu yra.

3. Sandorių duomenų saugykla atmeta VPĮFS pranešimą, kuris neatitinka vieno iš reikalavimų, nurodytų 1 dalyje, ir priskiria jį prie vienos iš atmetimo kategorijų, nurodytų šio reglamento I priedo 2 lentelėje.

4. Sandorių duomenų saugykla pateikia pranešimą teikiančiam subjektui ir duomenis teikiančiai sandorio šaliai, taip pat subjektui, atsakingam už duomenų teikimą, jeigu yra, išsamią informaciją apie 1 dalyje nurodyto duomenų patikrinimo rezultatus per šešiasdešimt minučių po VPĮFS pranešimo gavimo. Sandorių duomenų saugykla pateikia tuos rezultatus XML formatu naudodama šabloną, parengtą pagal ISO 20022 metodiką. Pateikiant rezultatus pagal 3 dalį nurodomos konkrečios VPĮFS pranešimo atmetimo priežastys, jeigu yra.

2 straipsnis

Sandorių duomenų saugyklų vykdomas duomenų derinimas

1. Sandorių duomenų saugykla siekia suderinti VPĮFS, apie kuriuos pranešta, vykdydama 2 dalyje nurodytus veiksmus, jeigu laikomasi visų toliau nurodomų sąlygų:

a) sandorių duomenų saugykla baigė patikrinimus, nurodytus 1 straipsnio 1 ir 2 dalyse;

b) abi VPĮFS, apie kurį pranešta, šalys turi pareigą teikti duomenis;

c) sandorių duomenų saugykla nėra dėl VPĮFS, apie kurį pranešta, gavusi paskesnio pranešimo su nurodyta veiksmo rūšimi „klaida“.

2. Jeigu laikomasi visų 1 dalyje nurodytų sąlygų, sandorių duomenų saugykla, naudodama paskutines praneštas kiekvieno šio reglamento I priedo 1 lentelės laukelio vertes, vykdo šiuos veiksmus:

a) gavusi VPĮFS pranešimą, sandorių duomenų saugykla patikrina, ar yra gavusi atitinkamą VPĮFS pranešimą iš kitos sandorio šalies arba jos vardu;

b) sandorių duomenų saugykla, negavusi atitinkamo VPĮFS pranešimo, kaip nurodyta a punkte, bando nustatyti sandorių duomenų saugyklą, kuri gavo atitinkamą VPĮFS pranešimą, visoms registruotoms sandorių duomenų saugykloms perduodama VPĮFS, apie kurį pranešta, vertes iš šių laukelių: „unikalus sandorio identifikatorius“, „duomenis teikianti sandorio šalis“, „kita sandorio šalis“ ir „pagrindinio susitarimo rūšis“;

c) sandorių duomenų saugykla, nustačiusi, kad kita sandorių duomenų saugykla yra gavusi atitinkamą VPĮFS pranešimą, kaip nurodyta a punkte, apsikeičia su ta sandorių duomenų saugykla VPĮFS pranešimo duomenimis XML formatu naudodama šabloną, parengtą pagal ISO 20022 metodiką;

d) laikydamasi e punkto, sandorių duomenų saugykla VPĮFS, apie kurį pranešta, laiko suderintu, jeigu to VPĮFS duomenys atitinka atitinkamo VPĮFS pranešimo duomenis, kaip nurodyta šios dalies a punkte;

e) sandorių duomenų saugykla siekia atskirai suderinti VPĮFS, apie kurį pranešta, laukelius, susijusius su paskolos duomenimis, ir laukelius, susijusius su užtikrinimo priemonės duomenimis, laikydamasi leistino nuokrypio ribų ir atitinkamų taikymo datų, nustatytų šio reglamento I priedo 1 lentelėje;

f) paskui sandorių duomenų saugykla kiekvienam VPĮFS, apie kurį pranešta, priskiria suderinimo kategorijų vertes, kaip nurodyta šio reglamento I priedo 3 lentelėje;

g) sandorių duomenų saugykla kuo greičiau užbaigia šios dalies a–f punktuose nurodytus veiksmus ir nesiima jokių tokių veiksmų po tos darbo dienos 18:00 suderintuoju pasauliniu laiku (UCT);

h) sandorių duomenų saugykla, negalėdama suderinti VPĮFS, apie kurį pranešta, siekia to VPĮFS, apie kurį pranešta, duomenis suderinti kitą darbo dieną. Sandorių duomenų saugykla toliau nebesiekia suderinti VPĮFS, apie kurį pranešta, praėjus trisdešimt kalendorinių dienų po VPĮFS, apie kurį pranešta, termino dienos arba po to, kai gauna su juo susijusį pranešimą su nurodytomis veiksmo rūšimis „nutraukimas“ arba „pozicijos komponentas“.

3. Sandorių duomenų saugykla kiekvienos darbo dienos pabaigoje kiekvienai sandorių duomenų saugyklai, su kuria suderino VPĮFS, apie kuriuos pranešta, patvirtina bendrą suderintų VPĮFS, apie kuriuos pranešta, skaičių.

4. Ne vėliau kaip per šešiasdešimt minučių po suderinimo proceso pabaigos, kaip nurodyta 2 dalies g punkte, sandorių duomenų saugykla pateikia pranešimą teikiančiam subjektui ir duomenis teikiančiai sandorio šaliai, taip pat subjektui, atsakingam už duomenų teikimą, jeigu yra, savo atlikto suderinimo proceso, susijusio su VPĮFS, apie kurį pranešta, rezultatus. Sandorių duomenų saugykla tuos rezultatus pateikia XML formatu naudodama šabloną, parengtą pagal ISO 20022 metodiką, įskaitant informaciją apie nesuderintus laukelius.

3 straipsnis

Atsakymo pateikimo dienos pabaigoje mechanizmai

Iki kiekvienos darbo dienos pabaigos sandorių duomenų saugykla XML formatu naudodama šabloną, parengtą pagal ISO 20022 metodiką, pateikia pranešimą teikiančiam subjektui ir duomenis teikiančiai sandorio šaliai, taip pat subjektui, atsakingam už duomenų teikimą, jeigu yra, tokią informaciją apie atitinkamus VPĮFS:

a) VPĮFS, apie kuriuos pranešta tą dieną;

b) VPĮFS, kurių terminas nesuėjęs arba apie kuriuos nepranešta nurodant veiksmo rūšis „klaida“, „nutraukimas“ arba „pozicijos komponentas“, naujausią sandorių padėtį;

c) unikalius sandorio identifikatorius, žyminčius VPĮFS, kurių atžvilgiu Įgyvendinimo reglamento (ES) 2019/363 I priedo 2 lentelės 72 laukelyje įrašyta „klaidingas“, o informacija apie užtikrinimo priemonę tos pačios lentelės 73–96 laukeliuose dar nebuvo pranešta;

d) VPĮFS pranešimus, kurie tą dieną buvo atmesti;

e) visų VPĮFS, apie kuriuos pranešta, išskyrus tuos VPĮFS, kurių galiojimas baigėsi arba dėl kurių daugiau nei prieš mėnesį iki tos darbo dienos gauti VPĮFS pranešimai su nurodytomis veiksmo rūšimis „nutraukimas“ arba „pozicijos komponentas“, suderinimo statusą.

4 straipsnis

Prieiga prie VPĮFS duomenų

Sandorių duomenų saugykla subjektams, nurodytiems Reglamento (ES) 2015/2365 12 straipsnio 2 dalyje, įskaitant užduočių ir pareigų perdavimo pagal Reglamento (ES) Nr. 1095/2010 28 straipsnį atvejus, suteikia tiesioginę ir neatidėliotiną prieigą prie VPĮFS duomenų elektronine, kompiuteriu skaitoma forma pagal Komisijos deleguotąjį reglamentą (ES) 2019/357 ([5]).

Taikydama pirmą pastraipą sandorių duomenų saugykla naudoja XML formatą ir šabloną, parengtą pagal ISO 20022 metodiką.

([5]) 2018 m. gruodžio 13 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2019/357, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) 2015/2365 papildomas techniniais reguliavimo standartais, susijusiais su prieiga prie sandorių duomenų saugyklose laikomų vertybinių popierių įsigijimo finansavimo sandorių (VPĮFS) duomenų (žr. šio Oficialiojo leidinio p. 22).

5 straipsnis

Pozicijų lygmens duomenų apskaičiavimas ir prieiga prie jų

1. Sandorių duomenų saugykla apskaičiuoja sandorio šalių pozicijų lygmens duomenis pagal paskolą ir užtikrinimo priemonę. Pozicijų lygmens duomenys apskaičiuojami atsižvelgiant į šiuos kriterijus:

a) suderinimo kategorijų vertes, nurodytas šio reglamento I priedo 3 lentelėje;

b) VPĮFS rūšį,

c) sandorio šalių sektorių;

d) tarpuskaitos statusą;

e) ar prekyba vyko prekybos vietoje ar už jos ribų;

f) užtikrinimo priemonės rūšį;

g) atsiskaitymo piniginėmis lėšomis valiutą;

h) termino intervalą;

i) vertės sumažinimo intervalą;

j) sandorių duomenų saugyklas, kurioms kita sandorio šalis pateikė VPĮFS duomenis.

2. Sandorių duomenų saugykla subjektams, nurodytiems Reglamento (ES) 2015/2365 12 straipsnio 2 dalyje, užtikrina prieigą prie pozicijų lygmens duomenų pagal Deleguotąjį reglamentą (ES) 2019/357.

3. 1 dalyje nurodyti pozicijų lygmens duomenys teikiami elektronine, kompiuteriu skaitoma forma XML formatu naudojant šabloną, parengtą pagal ISO 20022 metodiką.

4. 2 dalyje nurodyta prieiga suteikiama kuo greičiau, bet ne vėliau kaip kitą darbo dieną po to, kai gaunamas VPĮFS pranešimas pagal Reglamento (ES) 2015/2365 4 straipsnio 1 dalį.

5. Sandorių duomenų saugykla subjektams, nurodytiems Reglamento (ES) 2015/2365 12 straipsnio 2 dalyje, suteikia prieigą prie apibendrintų duomenų, atitinkančių prieigos prie duomenų nuostatas, nurodytas Deleguotajame reglamente (ES) 2019/357, ir apskaičiuotų pagal bendrai sutartus VPĮFS duomenų rinkimo ir bendrinimo pasauliniu mastu standartus ir procedūras.

6 straipsnis

Skelbti skirtų bendrų pozicijų duomenų apskaičiavimas

1. Sandorių duomenų saugykla pagal 2 ir 3 dalyse pateiktus kriterijus bendrina pozicijų duomenis toliau nurodytų verčių atžvilgiu:

a) atpirkimo sandorių, pirkimo siekiant parduoti atgal sandorių arba pardavimo siekiant atpirkti sandorių pagrindinė suma, bendras paskolintų arba pasiskolintų vertybinių popierių arba biržos prekių kiekis ir garantinės įmokos paskolų suma;

b) atitinkamų VPĮFS unikalių sandorio identifikatorių skaičius;

c) užtikrinimo priemonės rinkos vertė.

2. Sandorių duomenų saugykla bendrina visų VPĮFS, apie kuriuos pranešta nurodant veiksmo rūšį „naujas“ nuo šeštadienio 00:00:00 UTC iki penktadienio 23:59:59 UTC, pozicijų duomenis pagal toliau nurodytus kriterijus ir susijusias vertes, pateiktas šio reglamento II priedo 1 lentelėje:

a) duomenis teikiančios sandorio šalies arba, jei yra, atitinkamo filialo vietą;

b) kitos sandorio šalies arba, jei yra, atitinkamo filialo vietą;

c) VPĮFS rūšį;

d) VPĮFS suderinimo statusą, kaip nurodyta šio reglamento I priedo 3 lentelėje;

e) VPĮFS sudarymo vietos rūšį;

f) tai, ar VPĮFS tarpuskaita vykdyta, ar ne;

g) užtikrinimo priemonės perdavimo metodą;

h) kiekvieną indeksą, susietą su VPĮFS, kuriuo prekiaujama vykdymo vietoje, kuri skiriasi nuo „XXXX“, kai bendra nominali indekso suma, apie kurią pranešta sandorių duomenų saugyklai, yra didesnė nei 5 mlrd. EUR ir kai yra ne mažiau kaip šešios skirtingos sandorio šalys, apie atitinkamus VPĮFS pranešusios sandorių duomenų saugyklai.

3. Sandorių duomenų saugykla bendrina pozicijų duomenis, susijusius su visais VPĮFS, kurių terminas dar nesuėjo arba kurių atžvilgiu iki penktadienio 23:59:59 UTC negauta pranešimų su nurodytomis veiksmo rūšimis „klaida“, „nutraukimas“ ar „pozicijos komponentas“, pagal toliau nurodytus kriterijus ir susijusias vertes, pateiktas šio reglamento II priedo 1 lentelėje:

a) duomenis teikiančios sandorio šalies arba, jei yra, atitinkamo filialo vietą;

b) kitos sandorio šalies arba, jei yra, atitinkamo filialo vietą;

c) VPĮFS rūšį;

d) VPĮFS suderinimo statusą, kaip nurodyta šio reglamento I priedo 3 lentelėje;

e) VPĮFS sudarymo vietos rūšį;

f) tai, ar VPĮFS tarpuskaita vykdyta, ar ne;

g) užtikrinimo priemonės perdavimo metodą;

h) kiekvieną indeksą, susietą su VPĮFS, kuriuo prekiaujama vykdymo vietoje, kuri skiriasi nuo „XXXX“, kai bendra nominali indekso suma, apie kurią pranešta sandorių duomenų saugyklai, yra didesnė nei 5 mlrd. EUR ir yra ne mažiau kaip šešios skirtingos sandorio šalys, apie atitinkamus VPĮFS pranešusios sandorių duomenų saugyklai.

4. Sandorių duomenų saugykla nustato tvarką, pagal kurią nustatomos netipinės vertės, susijusios su bendrų pozicijų duomenimis.

5. Sandorių duomenų saugykla nustato tvarką, pagal kurią atlieka bendrų pozicijų duomenų, įskaitant iš pranešimų su nurodyta veiksmo rūšimi „klaida“, pataisymus ir apie juos praneša ir pagal kurią paskelbia originalius ir pataisytus apibendrintus duomenis.

7 straipsnis

Bendrų pozicijų duomenų paskelbimas

1. Sandorių duomenų saugykla savo interneto svetainėje kas savaitę ne vėliau kaip iki antradienio vidurdienio skelbia VPĮFS, apie kuriuos pranešta iki praėjusio penktadienio 23:59:59 UTC, bendrų pozicijų duomenis, apskaičiuotus pagal 6 straipsnį.

2. Sandorių duomenų saugykla skelbia visus bendrų pozicijų duomenis eurais ir naudoja ECB interneto svetainėje penktadienį prieš paskelbimą pateiktą valiutos kursą.

3. Sandorių duomenų saugykla užtikrina, kad bendrų pozicijų duomenys būtų paskelbti lentelės forma, kaip nustatyta šio reglamento II priede, atsisiunčiamu formatu.

4. Bendrų pozicijų duomenys, kuriuos sandorių duomenų saugykla paskelbė savo interneto svetainėje, toliau skelbiami toje interneto svetainėje ne trumpiau kaip 104 savaites.

8 straipsnis

Įsigaliojimas

Šis reglamentas įsigalioja dvidešimtą dieną po jo paskelbimo *Europos Sąjungos oficialiajame leidinyje*.

Šis reglamentas privalomas visas ir tiesiogiai taikomas visose valstybėse narėse.

Priimta Briuselyje 2018 m. gruodžio 13 d.

Komisijos vardu

Pirmininkas

Jean-Claude JUNCKER

I PRIEDAS

1 lentelė

Suderinimo laukeliai, leistino nuokrypio ribos ir suderinimo etapo pradžios data

Lentelė	Skiltis	Laukelis	Leistinas nuokrypis	Pradžios data, nurodyta:
Sandorio šalies duomenys	Nėra duomenų	Duomenis teikianti sandorio šalis	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio šalies duomenys	Nėra duomenų	Sandorio šalies pobūdis	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio šalies duomenys	Nėra duomenų	Kita sandorio šalis	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Unikalus sandorio identifikatorius (UTI)	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	VPĮFS rūšis	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Tarpuskaita atlikta	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Tarpuskaitos laiko žyma	Viena valanda	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Paskola	Pagrindinė sandorio šalis	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Prekybos vieta	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Pagrindinio susitarimo rūšis	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Įvykdymo laiko žyma	Viena valanda	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Įskaitymo data (pradžios data)	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Termino diena (pabaigos diena)	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Nutraukimo data	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Minimalus pranešimo laikotarpis	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Paskola	Anksčiausia pareikalavimo data	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Paskola	Bendrojo užstato rodiklis	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai

Lentelė	Skiltis	Laukelis	Leistinas nuokrypis	Pradžios data, nurodyta:
Sandorio duomenys	Paskola	Pateikimo pagal vertę rodiklis	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Paskola	Užtikrinimo priemonės pateikimo būdas	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Neterminuotas	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Nutraukimo pasirinkimo galimybė	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Paskola	Fiksuotoji norma	Iki trečio skaitmens po kablelio	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Dienų skaičiavimo susitarimas	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Kintamoji norma	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Kintamosios normos bazinis laikotarpis – laikotarpis	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Kintamosios normos bazinis laikotarpis – daugiklis	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Paskola	Kintamosios normos mokėjimo dažnumas – laikotarpis	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Paskola	Kintamosios normos mokėjimo dažnumas – daugiklis	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Paskola	Kintamosios normos perskaičiavimo dažnumas – laikotarpis	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Kintamosios normos perskaičiavimo dažnumas – daugiklis	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Skirtumas	Iki trečio skaitmens po kablelio	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Garantinės įmokos skolinimo valiutos suma	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Garantinės įmokos skolinimo valiuta	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis

Lentelė	Skiltis	Laukelis	Leistinas nuokrypis	Pradžios data, nurodyta:
Sandorio duomenys	Paskola	Pakoreguota norma	Iki trečio skaitmens po kablelio	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Paskola	Normos data	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Paskola	Pagrindinė suma įskaitymo datą	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Pagrindinė suma termino dieną	0,0005 %	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Pagrindinės sumos valiuta	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Turto rūšis	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Vertybinio popieriaus identifikatorius	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Vertybinio popieriaus klasifikavimas	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Bazinė prekė	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Paskola	Prekės pakategorė	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Paskola	Papildoma prekės pakategorė	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Paskola	Kiekis arba nominali suma	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Matavimo vienetas	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Paskola	Nominalios sumos valiuta	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Vertybinių popierių arba biržos prekių kaina	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Paskola	Kainos valiuta	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Paskola	Vertybinio popieriaus kokybė	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Vertybinio popieriaus terminas	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis

Lentelė	Skiltis	Laukelis	Leistinas nuokrypis	Pradžios data, nurodyta:
Sandorio duomenys	Paskola	Emitento jurisdikcija	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Emitento LEI	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Vertybinio popieriaus rūšis	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Paskolos vertė	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Paskola	Rinkos vertė	0,0005 %	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Paskola	Fiksuotoji grąžinama palūkanų norma	Iki trečio skaitmens po kablelio	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Kintamoji grąžinama palūkanų norma	Iki trečio skaitmens po kablelio	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Kintamosios grąžinamos palūkanų normos bazinis laikotarpis – laikotarpis	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Paskola	Kintamosios grąžinamos palūkanų normos bazinis laikotarpis – daugiklis	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Paskola	Kintamosios grąžinamos palūkanų normos mokėjimo dažnumas – laikotarpis	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Paskola	Kintamosios grąžinamos palūkanų normos mokėjimo dažnumas – daugiklis	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Paskola	Kintamosios grąžinamos palūkanų normos perskaičiavimo dažnumas – laikotarpis	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Paskola	Kintamosios grąžinamos palūkanų normos perskaičiavimo dažnumas – daugiklis	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Paskola	Grąžinamos palūkanų normos skirtumas	Iki trečio skaitmens po kablelio	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Paskola	Skolinimo mokestis	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis

Lentelė	Skiltis	Laukelis	Leistinas nuokrypis	Pradžios data, nurodyta:
Sandorio duomenys	Paskola	Išskirtiniai susitarimai	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Paskola	Negrąžinta garantinės įmokos paskola	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Negrąžintos garantinės įmokos paskolos bazinė valiuta	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Trumposios pozicijos rinkos vertė	0,0005 %	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Užtikrinimo priemonė	Neužtikrinto vertybinių popierių skolinimo žymė	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Užtikrinimo priemonė	Grynosios pozicijos užtikrinimas	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Užtikrinimo priemonė	Užtikrinimo priemonės įskaitymo data	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Užtikrinimo priemonė	Užtikrinimo priemonės komponento rūšis	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Užtikrinimo priemonė	Piniginės užtikrinimo priemonės suma	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Užtikrinimo priemonė	Piniginės užtikrinimo priemonės valiuta	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Užtikrinimo priemonė	Vertybinio popieriaus, naudojamo kaip užtikrinimo priemonė, identifikavimas	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Užtikrinimo priemonė	Vertybinio popieriaus, naudojamo kaip užtikrinimo priemonė, klasifikavimas	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Užtikrinimo priemonė	Bazinė prekė	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Užtikrinimo priemonė	Prekės pakategorė	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Užtikrinimo priemonė	Papildoma prekės pakategorė	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto iv papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Užtikrinimo priemonė	Užtikrinimo priemonės kiekis arba nominali suma	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Užtikrinimo priemonė	Užtikrinimo priemonės matavimo vienetas	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis + 24 mėnesiai

Lentelė	Skiltis	Laukelis	Leistinas nuokrypis	Pradžios data, nurodyta:
Sandorio duomenys	Užtikrinimo priemonė	Užtikrinimo priemonės nominalios sumos valiuta	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Užtikrinimo priemonė	Kainos valiuta	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Užtikrinimo priemonė	Vieneto kaina	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Užtikrinimo priemonė	Užtikrinimo priemonės rinkos vertė	0,0005 %	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis + 24 mėnesiai
Sandorio duomenys	Užtikrinimo priemonė	Vertės sumažinimas arba garantinė įmoka	Iki trečio skaitmens po kablelio	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Užtikrinimo priemonė	Užtikrinimo priemonės kokybė	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Užtikrinimo priemonė	Vertybinio popieriaus termino diena	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Užtikrinimo priemonė	Emitento jurisdikcija	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Užtikrinimo priemonė	Emitento LEI	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Užtikrinimo priemonė	Užtikrinimo priemonės rūšis	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Užtikrinimo priemonė	Užtikrinimo priemonės pakartotinio naudojimo galimybė	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Užtikrinimo priemonė	Užtikrinimo priemonės krepšelio identifikatorius	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis
Sandorio duomenys	Paskola	Lygis	Ne	Reglamento (ES) 2015/2365 33 straipsnio 2 dalies a punkto i papunktis

2 lentelė

VPĮFS pranešimo atmetimo priežastys

Atmetimo kategorijos	Priežastis
Schema	— VPĮFS atmestas, nes neatitinka schemos reikalavimų
Leidimas	— VPĮFS atmestas, nes pranešimą teikiantis subjektas neturi leidimo jį teikti duomenis teikiančios sandorio šalies vardu
Loginė priežastis	— VPĮFS atmestas, nes VPĮFS veiksmo rūšis nėra logiška
Veikla	— VPĮFS atmestas, nes jo turinys neatitinka vieno ar daugiau turinio patikrinimų

3 lentelė

Suderinimo proceso rezultatai

Suderinimo kategorijos	Suderinimo vertės
Pranešimo rūšis	Vienašalis / Dvišalis
Duomenų teikimo reikalavimai abiem sandorio šalims	Taip / Ne
Poravimo statusas	Porinis / Neporinis
Paskolos suderinimo statusas	Suderinta / Nesuderinta
Užtikrinimo priemonės suderinimo statusas	Suderinta / Nesuderinta
Tolesni pakeitimai	Taip / Ne

II PRIEDAS

1 lentelė

Vieši duomenys

A lentelė. Bendrinimas

Data	Sandorių duomenų saugykla	Bendrinimo rūšis	Vietos rūšis	Duomenis teikiančios sandorio šalies vieta	Kitos sandorio šalies vieta	Suderinimas	VPĮFS rūšis	Tarpuskaita atlikta	Užtikrinimo priemonės perleidimo metodas	Susietas indeksas [1]	Bendra paskolinta suma	Bendras sandorių skaičius	Bendra užtikrinimo priemonių vertė
20161007	ES sandorių duomenų saugykla	Pranešta	XXXX	EEE	EEE	Dvišalis, paskola suderinta, užtikrinimo priemonė nesuderinta	Atpirkimo sandoris	Taip	TTCA		…		…
…	…	Negrąžinta	XOFF	Ne EEE	Ne EEE	Dvišalis, paskola suderinta, užtikrinimo priemonė suderinta	BSB/SBB	Ne	SICA		…		…
…	…	…	EEE rinkos identifikavimo kodas (MIC)	…	…	Vienašalis EEE, paskola suderinta, užtikrinimo priemonė suderinta	Vertybinių popierių arba biržos prekių skolinimas ir skolinimasis	…	SIUR		…		…
…	…	…	Ne EEE MIC	…	…	…	Garantinės įmokos skolinimas	…			…		…
…	…	…	…	…	…	…	…	…	…	…	…	…	…

[1] Įrašomi atitinkami indeksai, įtraukti į Įgyvendinimo reglamento (ES) 2019/363 I priedo 2 lentelės „Paskolų ir užtikrinimo priemonių duomenys“ 25 laukelį