DELEGIRANA UREDBA KOMISIJE (EU) 2019/358

z dne 13. decembra 2018

o dopolnitvi Uredbe (EU) 2015/2365 Evropskega parlamenta in Sveta v zvezi z regulativnimi tehničnimi standardi o zbiranju, preverjanju, združevanju, primerjanju in objavljanju podatkov o poslih financiranja z vrednostnimi papirji s strani repozitorijev sklenjenih poslov

(Besedilo velja za EGP)

EVROPSKA KOMISIJA JE –

ob upoštevanju Pogodbe o delovanju Evropske unije,

ob upoštevanju Uredbe (EU) 2015/2365 Evropskega parlamenta in Sveta z dne 25. novembra 2015 o preglednosti poslov financiranja z vrednostnimi papirji in ponovne uporabe ter spremembi Uredbe (EU) št. 648/2012 ([1]) ter zlasti člena 5(7)(a) in točk (a) in (b) člena 12(3) Uredbe,

ob upoštevanju naslednjega:

(1) Da bi se zagotovila visoka kakovost podrobnosti o poslih financiranja z vrednostnimi papirji, ki se sporočajo repozitorijem sklenjenih poslov, bi morali repozitoriji sklenjenih poslov preverjati identiteto subjektov, ki predložijo poročilo, logično celovitost zaporedja, v katerem se sporočajo podrobnosti o poslih financiranja z vrednostnimi papirji, ter celovitost in pravilnost teh podrobnosti.

(2) Iz istega razloga bi morali repozitoriji sklenjenih poslov uskladiti podrobnosti vsakega poročila o poslih financiranja z vrednostnimi papirji, ki so ga prejeli. Da bi lahko repozitoriji sklenjenih poslov dosledno izvedli uskladitev in bi se zmanjšala tveganja, da podrobnosti o poslih financiranja z vrednostnimi papirji ostanejo neusklajena, bi bilo treba določiti standardiziran postopek. Nekatere podrobnosti o poslih financiranja z vrednostnimi papirji pa morda ne bodo enake zaradi posebnosti tehnoloških sistemov, ki jih uporabljajo subjekti, ki predložijo poročilo. Zato je treba uporabiti določena dovoljena odstopanja, tako da manjše razlike v sporočenih podrobnostih o poslih financiranja z vrednostnimi papirji ne preprečujejo organom, da bi analizirali podatke z ustrezno stopnjo zaupanja.

(3) Pričakuje se, da bodo subjekti, ki predložijo poročilo, sčasoma izboljšali svoje poročanje v smislu zmanjšanja števila zavrnjenih poročil in v smislu usklajenih poročil. Treba pa bi jim bilo dati dovolj časa za prilagoditev na zahteve poročanja, da se še zlasti prepreči kopičenje neusklajenih poslov takoj po tem, ko se začne uporabljati obveznost poročanja. Zato bi bilo primerno, da bi se v prvi fazi uskladil le manjši sklop podatkovnih polj.

(4) Subjekti, ki predložijo poročilo, in subjekti, odgovorni za poročanje, če je ustrezno, bi morali imeti možnost spremljati svoje spoštovanje obveznosti poročanja v skladu z Uredbo (EU) 2015/2365. Zato bi morali imeti vsak dan možnost dostopa do nekaterih informacij v zvezi z navedenimi poročili, vključno z rezultatom preverjanj teh poročil in napredkom pri usklajevanju sporočenih podatkov. Posledično je treba določiti, katere informacije bi moral repozitorij sklenjenih poslov dati na voljo tem subjektom ob koncu vsakega delovnega dne.

(5) Zaradi integritete podrobnosti o poslih financiranja z vrednostnimi papirji bi bilo treba enotno in dosledno zagotoviti neposreden in takojšen dostop iz člena 12(2) Uredbe (EU) 2015/2365. Da bi se poročanje standardiziralo, stroški za sektor čim bolj zmanjšali ter da bi se zagotovila primerljivost in usklajeno združevanje podatkov po repozitorijih sklenjenih poslov, je primerno, da se vsa poročila o rezultatih in izmenjave predložijo v obliki predloge XML in upoštevajo metodologijo, ki se na široko uporablja v finančnem sektorju.

(6) Dostop do podatkov na ravni pozicij o izpostavljenostih med danima nasprotnima strankama je bistven, da lahko subjekti iz člena 12(2) Uredbe (EU) 2015/2365 določijo morebitne vire sistemskih ali nesistemskih tveganj za finančno stabilnost.

(7) Da se javnosti zagotovi ustrezna raven preglednosti v zvezi s posli financiranja z vrednostnimi papirji, bi morala merila, ki se uporabljajo za združevanje pozicij, širši javnosti omogočiti razumevanje delovanja trgov poslov

([1]) UL L 337, 23.12.2015, str. 1.

financiranja z vrednostnimi papirji, brez poseganja v zaupnost podatkov, sporočenih repozitorijem sklenjenih poslov. Pogostost in podrobnosti objavljanja skupnih pozicij s strani repozitorija sklenjenih poslov v skladu s členom 12(1) Uredbe (EU) 2015/2365 bi morale biti določene na način, ki temelji na zadevnem okviru iz Uredbe (EU) št. 648/2012 Evropskega parlamenta in Sveta ([2]) za pogodbe o izvedenih finančnih instrumentih.

(8) Ta uredba temelji na osnutkih regulativnih tehničnih standardov, ki jih je Evropski organ za vrednostne papirje in trge (ESMA) predložil Komisiji v skladu s postopkom iz člena 10 Uredbe (EU) št. 1095/2010 Evropskega parlamenta in Sveta ([3]).

(9) Določbe v tej uredbi obravnavajo operativne standarde za zbiranje, združevanje in primerjanje podatkov s strani repozitorijev sklenjenih poslov ter postopke, ki jih morajo uporabljati repozitoriji sklenjenih poslov, da preverijo celovitost in pravilnost sporočenih podrobnosti o poslih financiranja z vrednostnimi papirji. Da se zagotovi skladnost med navedenimi določbami in se repozitorijem sklenjenih poslov omogoči celovit pregled, je zaželeno, da se povezani regulativni tehnični standardi vključijo v eno uredbo.

(10) ESMA je o teh osnutkih regulativnih tehničnih standardov opravil javna posvetovanja, analiziral morebitne s tem povezane stroške in koristi ter zahteval mnenje svoje interesne skupine za vrednostne papirje in trge, ustanovljene v skladu s členom 37 Uredbe (EU) št. 1095/2010 –

SPREJELA NASLEDNJO UREDBO:

Člen 1

Preverjanje poročil o poslih financiranja z vrednostnimi papirji, ki ga izvajajo repozitoriji sklenjenih poslov

1. Repozitorij sklenjenih poslov v prejetem poročilu o poslih financiranja z vrednostnimi papirji preveri vse od naslednjega:

(a) identiteto subjekta, ki predloži poročilo, iz polja 2 tabele 1 Priloge I k Izvedbeni uredbi Komisije (EU) 2019/363 ([4]);

(b) da je predloga XML, ki se uporablja za sporočanje posla financiranja z vrednostnimi papirji, v skladu z metodologijo ISO 20022 na podlagi Izvedbene uredbe (EU) 2019/363;

(c) da ima subjekt, ki predloži poročilo, če se razlikuje od nasprotne stranke poročevalke iz polja 3 tabele 1 Priloge I k Izvedbeni uredbi (EU) 2019/363, ustrezno pooblastilo, da poroča v imenu nasprotne stranke poročevalke, razen v primeru iz člena 4(3) Uredbe (EU) 2015/2365;

(d) da isto poročilo o poslih financiranja z vrednostnimi papirji ni bilo že predloženo;

(e) da se poročilo o poslih financiranja z vrednostnimi papirji z vrsto ukrepa „spreminjanje“ nanaša na predhodno predloženo poročilo o poslih financiranja z vrednostnimi papirji;

(f) da se poročilo o poslih financiranja z vrednostnimi papirji z vrsto ukrepa „spreminjanje“ ne nanaša na posel financiranja z vrednostnimi papirji, o katerem je bilo sporočeno, da je bil preklican;

(g) da poročilo o poslih financiranja z vrednostnimi papirji ne vključuje vrste ukrepa „nov“ v zvezi s poslom financiranja z vrednostnimi papirji, ki je že bil sporočen;

(h) da poročilo o poslih financiranja z vrednostnimi papirji ne vključuje vrste ukrepa „komponenta pozicije“ v zvezi s poslom financiranja z vrednostnimi papirji, ki je že bil sporočen;

([2]) Uredba (EU) št. 648/2012 Evropskega parlamenta in Sveta z dne 4. julija 2012 o izvedenih finančnih instrumentih OTC, centralnih nasprotnih strankah in repozitorijih sklenjenih poslov (UL L 201, 27.7.2012, str. 1).

([3]) Uredba (EU) št. 1095/2010 Evropskega parlamenta in Sveta z dne 24. novembra 2010 o ustanovitvi Evropskega nadzornega organa (Evropski organ za vrednostne papirje in trge) in o spremembi Sklepa št. 716/2009/ES ter razveljavitvi Sklepa Komisije 2009/77/ES (UL L 331, 15.12.2010, str. 84).

([4]) Izvedbena uredba Komisije (EU) 2019/363 z dne 13. decembra 2018 o določitvi izvedbenih tehničnih standardov glede oblike in pogostosti poročanja o podrobnostih poslov financiranja z vrednostnimi papirji v repozitorije sklenjenih poslov v skladu z Uredbo (EU) 2015/2365 Evropskega parlamenta in Sveta ter o spremembi Izvedbene uredbe Komisije (EU) št. 1247/2012 glede uporabe kod poročanja pri poročanju o pogodbah o izvedenih finančnih instrumentih (glej stran 85 tega Uradnega lista).

(i) da se s poročilom o poslih financiranja z vrednostnimi papirji ne nameravajo spremeniti podrobnosti glede subjekta, ki predloži poročilo, nasprotne stranke poročevalke ali druge nasprotne stranke v predhodno sporočenem poslu financiranja z vrednostnimi papirji;

(j) da se s poročilom o poslih financiranja z vrednostnimi papirji ne namerava spremeniti obstoječega poročila o poslih financiranja z vrednostnimi papirji, tako da bi se datum valute posla določil pozneje kot sporočen datum zapadlosti posla financiranja z vrednostnimi papirji;

(k) pravilnost in celovitost poročila o poslih financiranja z vrednostnimi papirji.

2. Repozitorij sklenjenih poslov preveri, ali so bile informacije o zavarovanju s premoženjem sporočene v poljih od 73 do 96 tabele 2 Priloge I k Izvedbeni uredbi (EU) 2019/363 za posle financiranja z vrednostnimi papirji, pri katerih je polje 72 „kazalnik nezavarovanega posojanja vrednostnih papirjev“ iste tabele sporočeno kot „napačno“. Repozitorij sklenjenih poslov v skladu s členom 3 te uredbe o rezultatu preverjanja obvesti subjekt, ki predloži poročilo, nasprotno stranko poročevalko in subjekt, ki je odgovoren za poročanje, če je to primerno.

3. Repozitorij sklenjenih poslov zavrne poročilo o poslih financiranja z vrednostnimi papirji, ki ne izpolnjuje ene od zahtev iz odstavka 1, in ga razvrsti v eno od kategorij za zavrnitev iz tabele 2 Priloge I k tej uredbi.

4. Repozitorij sklenjenih poslov subjektu, ki predloži poročilo, nasprotni stranki poročevalki in subjektu, ki je odgovoren za poročanje, če je to primerno, predloži podrobne informacije o rezultatih preverjanja podatkov iz odstavka 1 najpozneje šestdeset minut po prejemu poročila o poslih financiranja z vrednostnimi papirji. Repozitorij sklenjenih poslov predloži navedene rezultate v obliki XML in predlogi, ki je bila pripravljena v skladu z metodologijo ISO 20022. Rezultati, kadar je ustrezno, vključujejo posebne razloge za zavrnitev poročila o poslih financiranja z vrednostnimi papirji v skladu z odstavkom 3.

Člen 2

Usklajevanje podatkov, ki ga izvajajo repozitoriji sklenjenih poslov

1. Repozitorij sklenjenih poslov si bo prizadeval za uskladitev sporočenih poslov financiranja z vrednostnimi papirji z izvedbo ukrepov iz odstavka 2, če so izpolnjeni vsi naslednji pogoji:

(a) repozitorij sklenjenih poslov je opravil preverjanja iz odstavkov 1 in 2 člena 1;

(b) za obe nasprotni stranki v sporočenem poslu financiranja z vrednostnimi papirji velja obveznost poročanja;

(c) repozitorij sklenjenih poslov ni prejel naknadnega poročila z vrsto ukrepa „napaka“ v zvezi s sporočenim poslom financiranja z vrednostnimi papirji.

2. Če so izpolnjeni vsi pogoji iz odstavka 1, repozitorij sklenjenih poslov izvede naslednje ukrepe, pri tem pa uporabi zadnje sporočene vrednosti za vsako od polj v tabeli 1 iz Priloge I k tej uredbi:

(a) repozitorij sklenjenih poslov, ki je prejel poročilo o poslih financiranja z vrednostnimi papirji, preveri, ali je prejel ustrezno poročilo o poslih financiranja z vrednostnimi papirji od druge nasprotne stranke ali v njenem imenu;

(b) repozitorij sklenjenih poslov, ki ni prejel ustreznega poročila o poslih financiranja z vrednostnimi papirji iz točke (a), poskuša odkriti repozitorij sklenjenih poslov, ki je prejel to poročilo, tako da sporoči vsem registriranim repozitorijem sklenjenih poslov vrednosti naslednjih polj sporočenih poslov financiranja z vrednostnimi papirji: „edinstveni identifikator posla“, „nasprotna stranka poročevalka“, „druga nasprotna stranka“ in „vrsta krovnega dogovora“;

(c) repozitorij sklenjenih poslov, ki ugotovi, da je drug repozitorij sklenjenih poslov prejel ustrezno poročilo o poslih financiranja z vrednostnimi papirji iz točke (a), z navedenim repozitorijem sklenjenih poslov izmenja podrobnosti sporočenega posla financiranja z vrednostnimi papirji v obliki XML in predlogi, pripravljeni v skladu z metodologijo ISO 20022;

(d) ob upoštevanju točke (e) repozitorij sklenjenih poslov obravnava sporočeni posel financiranja z vrednostnimi papirji kot usklajen, kadar se podrobnosti navedenega posla financiranja z vrednostnimi papirji ujemajo s podrobnostmi ustreznega poročila o poslih financiranja z vrednostnimi papirji iz točke (a) tega odstavka;

(e) repozitorij sklenjenih poslov si prizadeva, da bi ločeno uskladil polja, ki se nanašajo na podatke o posojilih, in polja, ki se nanašajo na podatke o zavarovanju s premoženjem, sporočenega posla financiranja z vrednostnimi papirji v skladu z mejami dovoljenega odstopanja in zadevnimi datumi za začetek uporabe, določenimi v tabeli 1 Priloge I k tej uredbi;

(f) repozitorij sklenjenih poslov nato dodeli vrednosti kategorijam usklajevanja za vsak sporočeni posel financiranja z vrednostnimi papirji, kot so določene v tabeli 3 Priloge I k tej uredbi;

(g) repozitorij sklenjenih poslov zaključi ukrepe iz točk (a) do (f) tega odstavka takoj, ko je mogoče, in takih ukrepov ne sprejema po 18:00 po univerzalnem koordiniranem času (UCT) na določen delovni dan;

(h) repozitorij sklenjenih poslov, ki ne more uskladiti sporočenega posla financiranja z vrednostnimi papirji, poskuša uskladiti podrobnosti navedenega sporočenega posla financiranja z vrednostnimi papirji naslednji delovni dan. Repozitorij sklenjenih poslov ne poskuša več uskladiti sporočenih poslov financiranja z vrednostnimi papirji trideset koledarskih dni po sporočeni zapadlosti posla financiranja z vrednostnimi papirji ali po tem, ko je repozitorij sklenjenih poslov prejel poročilo, ki se nanj nanaša, z vrsto ukrepa „prekinitev“ ali „komponenta pozicije“.

3. Repozitorij sklenjenih poslov ob koncu vsakega delovnega dne z vsakim repozitorijem sklenjenih poslov, s katerim je uskladil sporočene posle financiranja z vrednostnimi papirji, potrdi skupno število teh poslov.

4. Najpozneje šestdeset minut po zaključku postopka usklajevanja iz točke (g) odstavka 2 repozitorij sklenjenih poslov subjektu, ki predloži poročilo, nasprotni stranki poročevalki in subjektu, ki je odgovoren za poročanje, če je to primerno, predloži rezultate postopka usklajevanja, ki ga je izvedel v zvezi s sporočenimi posli financiranja z vrednostnimi papirji. Repozitorij sklenjenih poslov predloži navedene rezultate v obliki XML in predlogi, ki je bila pripravljena v skladu z metodologijo ISO 20022, vključno z informacijami o poljih, ki niso bila usklajena.

Člen 3

Mehanizmi odzivanja ob koncu dneva

Ob koncu vsakega delovnega dne repozitorij sklenjenih poslov subjektu, ki predloži poročilo, nasprotni stranki poročevalki in subjektu, ki je odgovoren za poročanje, če je to primerno, zagotovi naslednje informacije o relevantnih poslih financiranja z vrednostnimi papirji v obliki XML in predlogi, ki je bila pripravljena v skladu z metodologijo ISO 20022:

(a) posle financiranja z vrednostnimi papirji, sporočene tisti dan;

(b) zadnje trgovalne statuse poslov financiranja z vrednostnimi papirji, ki še niso zapadli oziroma za katere še niso bila pripravljena poročila z vrstami ukrepa „napaka“, „prekinitev“ ali „komponenta pozicije“;

(c) edinstvene identifikatorje poslov financiranja z vrednostnimi papirji, za katere je polje 72 tabele 2 Priloge I k Izvedbeni uredbi (EU) 2019/363 sporočeno kot „napačno“ in informacije o zavarovanju s premoženjem v poljih od 73 do 96 iste tabele še niso bile sporočene;

(d) poročila o poslih financiranja z vrednostnimi papirji, ki so bila tisti dan zavrnjena;

(e) stopnjo usklajenosti vseh sporočenih poslov financiranja z vrednostnimi papirji, razen tistih poslov financiranja z vrednostnimi papirji, ki so potekli ali za katere so bila prejeta poročila o poslih financiranja z vrednostnimi papirji z vrsto ukrepa „prekinitev“ ali „komponenta pozicije“ več kot mesec dni pred tem delovnim dnem.

Člen 4

Dostop do podrobnosti o poslih financiranja z vrednostnimi papirji

Repozitorij sklenjenih poslov zagotovi subjektom iz člena 12(2) Uredbe (EU) 2015/2365 neposreden in takojšen dostop do podrobnosti o poslih financiranja z vrednostnimi papirji v elektronski in strojno berljivi obliki v skladu z Delegirano uredbo Komisije (EU) 2019/357 ([5]), tudi če obstaja prenos nalog in odgovornosti v skladu s členom 28 Uredbe (EU) št. 1095/2010.

Za namene prvega pododstavka repozitorij sklenjenih poslov uporablja obliko XML in predlogo, pripravljeno v skladu z metodologijo ISO 20022.

([5]) Delegirana uredba Komisije (EU) 2019/357 z dne 13. decembra 2018 o dopolnitvi Uredbe (EU) 2015/2365 Evropskega parlamenta in Sveta v zvezi z regulativnimi tehničnimi standardi o dostopu do podrobnosti o poslih financiranja z vrednostnimi papirji, shranjenih v repozitorijih sklenjenih poslov (glej stran 22 tega Uradnega lista).

Člen 5

Izračun podatkov na ravni pozicij in dostop do teh podatkov

1. Repozitorij sklenjenih poslov izračuna podatke na ravni pozicij o izpostavljenostih med nasprotnimi strankami v smislu posojila in zavarovanja s premoženjem. Izračun podatkov na ravni pozicij temelji na naslednjih merilih:

(a) vrednostih za kategorije usklajevanja, kot je določeno v tabeli 3 Priloge I k tej uredbi;

(b) vrsti poslov financiranja z vrednostnimi papirji;

(c) sektorju nasprotnih strank;

(d) statusu glede kliringa;

(e) ali je posel potekal na mestu trgovanja ali zunaj njega;

(f) vrsti zavarovanja s premoženjem;

(g) valuti denarnega dela poslov;

(h) žepku zapadlosti;

(i) žepku odbitka;

(j) repozitorijih sklenjenih poslov, ki jim je druga nasprotna stranka sporočila podrobnosti o poslih financiranja z vrednostnimi papirji.

2. Repozitorij sklenjenih poslov zagotovi, da imajo subjekti iz člena 12(2) Uredbe (EU) 2015/2365 dostop do podatkov na ravni pozicij v skladu z dostopom do podatkov iz Delegirane uredbe (EU) 2019/357.

3. Podatki na ravni pozicij iz odstavka 1 se predložijo v elektronski in strojno berljivi obliki, obliki XML in predlogi, ki je bila pripravljena v skladu z metodologijo ISO 20022.

4. Dostop iz odstavka 2 se zagotovi čim prej in najpozneje na delovni dan po prejemu poročila o poslih financiranja z vrednostnimi papirji v skladu s členom 4(1) Uredbe (EU) 2015/2365.

5. Repozitorij sklenjenih poslov zagotovi subjektom iz člena 12(2) Uredbe (EU) 2015/2365 v skladu z dostopom do podatkov, ki je določen v Delegirani uredbi (EU) 2019/357, dostop do podatkov na združeni ravni, ki se izračunajo v skladu s skupno dogovorjenimi standardi in postopki za zbiranje in združevanje podatkov o poslih financiranja z vrednostnimi papirji na svetovni ravni.

Člen 6

Izračun podatkov o skupnih pozicijah za objavo

1. Repozitorij sklenjenih poslov združi podatke o pozicijah v skladu z merili iz odstavkov 2 in 3, kar zadeva naslednje vrednosti:

(a) znesek glavnice pogodb o začasni prodaji, posle nakupa in ponovne prodaje ali posle prodaje in ponovnega nakupa, skupno količino vrednostnih papirjev ali blaga, ki se posojajo ali izposojajo, in znesek kreditiranja z vzvodom;

(b) število edinstvenih identifikatorjev posla, ki se nanašajo na zadevne posle financiranja z vrednostnimi papirji;

(c) tržno vrednost zavarovanja s premoženjem.

2. Repozitorij sklenjenih poslov združi podatke o pozicijah za vse posle financiranja z vrednostnimi papirji, sporočene z vrsto ukrepa „nov“ med soboto 00:00:00 UTC in petkom 23:59:59 UTC, na podlagi naslednjih meril in z njimi povezanih vrednosti, določenih v tabeli 1 iz Priloge II k tej uredbi:

(a) lokacije nasprotne stranke poročevalke ali, kadar je to primerno, zadevne podružnice;

(b) lokacije druge nasprotne stranke ali, kadar je to primerno, zadevne podružnice;

(c) vrste poslov financiranja z vrednostnimi papirji;

(d) stopnje usklajenosti posla financiranja z vrednostnimi papirji, kot je določena v tabeli 3 Priloge I k tej uredbi;

(e) vrste mesta, kjer se je sklenil posel financiranja z vrednostnimi papirji;

(f) ali je bil za posel financiranja z vrednostnimi papirji izveden kliring ali ne;

(g) metode, po kateri je bilo preneseno zavarovanje s premoženjem;

(h) vsakega indeksa, ki se uporablja kot referenca v poslu financiranja z vrednostnimi papirji, s katerim se trguje na izvedbenem mestu, ki se razlikuje od „XXXX“, če je skupni nominalni znesek, sporočen repozitoriju sklenjenih poslov v indeksu, večji od 5 milijard EUR in če obstaja vsaj šest različnih nasprotnih strank, ki so sporočile zadevne posle financiranja z vrednostnimi papirji repozitoriju sklenjenih poslov.

3. Repozitorij sklenjenih poslov združi podatke o pozicijah za vse posle financiranja z vrednostnimi papirji, ki še niso zapadli oziroma za katere še niso bila prejeta poročila z vrstami ukrepa „napaka“, „prekinitev“ ali „komponenta pozicije“ do petka 23:59:59 UTC, na podlagi naslednjih meril in z njimi povezanih vrednosti, določenih v tabeli 1 iz Priloge II k tej uredbi:

(a) lokacije nasprotne stranke poročevalke ali, kadar je to primerno, zadevne podružnice;

(b) lokacije druge nasprotne stranke ali, kadar je to primerno, zadevne podružnice;

(c) vrste poslov financiranja z vrednostnimi papirji;

(d) stopnje usklajenosti posla financiranja z vrednostnimi papirji, kot je določena v tabeli 3 Priloge I k tej uredbi;

(e) vrste mesta, kjer se je sklenil posel financiranja z vrednostnimi papirji;

(f) ali je bil za posel financiranja z vrednostnimi papirji izveden kliring ali ne;

(g) metode, po kateri je bilo preneseno zavarovanje s premoženjem;

(h) vsakega indeksa, ki se uporablja kot referenca v poslu financiranja z vrednostnimi papirji, s katerim se trguje na izvedbenem mestu, ki se razlikuje od „XXXX“, če je skupni nominalni znesek, sporočen repozitoriju sklenjenih poslov v indeksu, večji od 5 milijard EUR in če obstaja vsaj šest različnih nasprotnih strank, ki so sporočile zadevne posle financiranja z vrednostnimi papirji repozitoriju sklenjenih poslov.

4. Repozitorij sklenjenih poslov vzpostavi postopek za odkrivanje izrednih vrednosti, ki se nanašajo na podatke o skupnih pozicijah.

5. Repozitorij sklenjenih poslov ima vzpostavljen postopek za izvedbo popravkov podatkov o skupnih pozicijah, vključno s tistimi, ki izhajajo iz poročil z vrsto ukrepa „napaka“, za obveščanje o teh popravkih ter za objavo prvotnih in popravljenih združenih podatkov.

Člen 7

Objavljanje podatkov o skupnih pozicijah

1. Repozitorij sklenjenih poslov na svoji spletni strani objavi podatke o skupnih pozicijah, izračunane v skladu s členom 6, vsak teden najpozneje do torka opoldan za posle financiranja z vrednostnimi papirji, ki so bili sporočeni do 23:59:59 UTC na predhodni petek.

2. Repozitorij sklenjenih poslov objavi vse podatke o skupnih pozicijah v eurih in uporabi menjalne tečaje, ki so bili objavljeni na spletni strani ECB v petek pred objavo teh podatkov.

3. Repozitorij sklenjenih poslov zagotovi, da se podatki o skupnih pozicijah objavijo v obliki tabele, kakor je določena v Prilogi II k tej uredbi in ki omogoča prenos podatkov.

4. Podatki o skupnih pozicijah, ki jih je repozitorij sklenjenih poslov objavil na svoji spletni strani, ostanejo na navedeni spletni strani najmanj 104 tedne.

Člen 8

Začetek veljavnosti

Ta uredba začne veljati dvajseti dan po objavi v *Uradnem listu Evropske unije*.

Zavezujoča je v celoti in se neposredno uporablja v vseh državah članicah.

V Bruslju, 13. decembra 2018

Za Komisijo
Predsednik
Jean-Claude JUNCKER

PRILOGA I

Tabela 1

Polja za usklajevanje, dovoljena odstopanja in datum začetka faze usklajevanja

Tabela	Oddelek	Polje	Dovoljeno odstopanje	Datum začetka, naveden v:
podatki o nasprotni stranki	n.r.	nasprotna stranka poročevalka	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o nasprotni stranki	n.r.	stran nasprotne stranke	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o nasprotni stranki	n.r.	druga nasprotna stranka	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	edinstveni identifikator posla	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	vrsta posla financiranja z vrednostnimi papirji	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	opravljen kliring	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	časovni žig kliringa	ena ura	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	posojilo	CNS	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	mesto trgovanja	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	vrsta krovnega dogovora	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	časovni žig izvršitve	ena ura	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	datum valute posla (začetni datum)	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	datum zapadlosti (končni datum)	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	datum prekinitve	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	minimalni odpovedni rok	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	posojilo	najzgodnejši datum vračila na zahtevo	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	posojilo	splošni kazalnik zavarovanja s premoženjem	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev

Tabela	Oddelek	Polje	Dovoljeno odstopanje	Datum začetka, naveden v:
podatki o poslih	posojilo	kazalnik dobave po vrednosti (*Delivery By Value* – DBV)	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	posojilo	način zagotavljanja zavarovanja s premoženjem	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	nedoločen čas	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	možnost prekinitve	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	posojilo	fiksna obrestna mera	največ tri decimalna mesta	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	dogovor o štetju dni	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	variabilna obrestna mera	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	referenčno obdobje za variabilno obrestno mero – obdobje	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	referenčno obdobje za variabilno obrestno mero – multiplikator	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	posojilo	pogostost plačil pri variabilni obrestni meri – obdobje	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	posojilo	pogostost plačil pri variabilni obrestni meri – multiplikator	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	posojilo	pogostost ponastavitve variabilne obrestne mere – obdobje	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	pogostost ponastavitve variabilne obrestne mere – multiplikator	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	razpon	največ tri decimalna mesta	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	znesek v valuti kreditiranja z vzvodom	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	valuta kreditiranja z vzvodom	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365

Tabela	Oddelek	Polje	Dovoljeno odstopanje	Datum začetka, naveden v:
podatki o poslih	posojilo	prilagojena obrestna mera	največ tri decimalna mesta	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	posojilo	datum obrestne mere	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	posojilo	znesek glavnice na datum valute	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	znesek glavnice na datum zapadlosti	0,0005 %	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	valuta zneska glavnice	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	vrsta sredstva	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	identifikator vrednostnega papirja	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	razvrstitev vrednostnega papirja	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	osnovni produkt	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	posojilo	podvrsta produkta	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	posojilo	nadaljnja podvrsta produkta	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	posojilo	količina ali nominalni znesek	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	merska enota	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	posojilo	valuta nominalnega zneska	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	cena vrednostnega papirja ali blaga	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	posojilo	valuta cene	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	posojilo	kakovost vrednostnega papirja	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	zapadlost vrednostnega papirja	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365

Tabela	Oddelek	Polje	Dovoljeno odstopanje	Datum začetka, naveden v:
podatki o poslih	posojilo	jurisdikcija izdajatelja	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	identifikator pravnih subjektov izdajatelja	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	vrsta vrednostnega papirja	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	vrednost posojila	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	posojilo	tržna vrednost	0,0005 %	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	posojilo	fiksna stopnja popusta	največ tri decimalna mesta	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	variabilna stopnja popusta	največ tri decimalna mesta	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	referenčno obdobje za variabilno stopnja popusta – obdobje	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	posojilo	referenčno obdobje za variabilno stopnja popusta – multiplikator	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	posojilo	pogostost plačil pri variabilni stopnji popusta – obdobje	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	posojilo	pogostost plačil pri variabilni stopnji popusta – multiplikator	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	posojilo	pogostost ponastavitve variabilne stopnje popusta – obdobje	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	posojilo	pogostost ponastavitve variabilne stopnje popusta – multiplikator	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	posojilo	razpon stopnje popusta	največ tri decimalna mesta	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	posojilo	pristojbina za posojanje	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365

Tabela	Oddelek	Polje	Dovoljeno odstopanje	Datum začetka, naveden v:
podatki o poslih	posojilo	dogovori o izključni pravici	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	posojilo	neporavnani znesek posojila z vzvodom	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	osnovna valuta neporavnanega zneska posojila z vzvodom	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	tržna vrednost kratkih pozicij	0,0005 %	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	zavarovanje s premoženjem	kazalnik nezavarovanega posojanja vrednostnih papirjev	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	zavarovanje s premoženjem	zavarovanje neto izpostavljenosti s premoženjem	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	zavarovanje s premoženjem	datum valute zavarovanja s premoženjem	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	zavarovanje s premoženjem	vrsta komponente zavarovanja s premoženjem	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	zavarovanje s premoženjem	znesek zavarovanja z denarnimi sredstvi	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	zavarovanje s premoženjem	valuta zavarovanja z denarnimi sredstvi	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	zavarovanje s premoženjem	identifikacija vrednostnega papirja, ki se uporablja kot zavarovanje s premoženjem	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	zavarovanje s premoženjem	razvrstitev vrednostnega papirja, ki se uporablja kot zavarovanje s premoženjem	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	zavarovanje s premoženjem	osnovni produkt	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	zavarovanje s premoženjem	podvrsta produkta	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	zavarovanje s premoženjem	nadaljnja podvrsta produkta	ne	členu 33(2)(a)(iv) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	zavarovanje s premoženjem	količina ali nominalni znesek zavarovanja s premoženjem	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	zavarovanje s premoženjem	merska enota zavarovanja s premoženjem	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev

Tabela	Oddelek	Polje	Dovoljeno odstopanje	Datum začetka, naveden v:
podatki o poslih	zavarovanje s premoženjem	valuta nominalnega zneska zavarovanja s premoženjem	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	zavarovanje s premoženjem	valuta cene	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	zavarovanje s premoženjem	cena na enoto	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	zavarovanje s premoženjem	tržna vrednost zavarovanja s premoženjem	0,0005 %	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365 + 24 mesecev
podatki o poslih	zavarovanje s premoženjem	odbitek ali vzvod	največ tri decimalna mesta	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	zavarovanje s premoženjem	kakovost zavarovanja s premoženjem	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	zavarovanje s premoženjem	datum zapadlosti vrednostnega papirja	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	zavarovanje s premoženjem	jurisdikcija izdajatelja	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	zavarovanje s premoženjem	identifikator pravnih subjektov izdajatelja	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	zavarovanje s premoženjem	vrsta zavarovanja s premoženjem	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	zavarovanje s premoženjem	razpoložljivost za ponovno uporabo zavarovanja s premoženjem	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	zavarovanje s premoženjem	identifikator košarice zavarovanja s premoženjem	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365
podatki o poslih	posojilo	raven	ne	členu 33(2)(a)(i) Uredbe (EU) 2015/2365

Tabela 2

Razlogi za zavrnitev poročila o poslih financiranja z vrednostnimi papirji

Kategorije za zavrnitev	Razlog
Shema	— posel financiranja z vrednostnimi papirji je bil zavrnjen, ker shema ne izpolnjuje zahtev
Dovoljenje	— posel financiranja z vrednostnimi papirji je bil zavrnjen, ker subjekt, ki je predložil poročilo, nima dovoljenja za poročanje v imenu nasprotne stranke poročevalke
Logika	— posel financiranja z vrednostnimi papirji je bil zavrnjen, ker vrsta ukrepa za ta posel ni logično pravilna
Posel	— posel financiranja z vrednostnimi papirji je bil zavrnjen, ker ne izpolnjuje ene ali več potrditev vsebine

Tabela 3

Rezultati postopka usklajevanja

Kategorije usklajevanja	Vrednosti usklajevanja
Vrsta poročanja	enostransko/dvostransko
Zahteve glede poročanja za obe nasprotni stranki	da/ne
Status glede uparjevanja	uparjeno/neuparjeno
Status glede usklajenosti posojila	usklajeno/neusklajeno
Status glede usklajenosti zavarovanja s premoženjem	usklajeno/neusklajeno
Dodatne spremembe	da/ne

PRILOGA II

Tabela 1

Javni podatki

Tabela A. Združevanje

Datum	TR	Vrsta združevanja	Vrsta mesta	Lokacija nasprotne stranke poročevalke	Lokacija druge nasprotne stranke	Usklajevanje	Vrsta posla financiranja z vrednostnimi papirji	Opravljen kliring	Metode prenosa zavarovanja s premoženjem	Indeks, ki se uporablja kot referenca [1]	Skupni posojeni znesek	Skupno število poslov	Skupna vrednost zavarovanja s premoženjem
20161007	EU TR	sporočeno	XXXX	EGP	EGP	dvostransko, usklajeno posojilo, neusklajeno zavarovanje s premoženjem	repo posli	da	TTCA		…		…
…	…	neporavnano	XOFF	zunaj EGP	zunaj EGP	dvostransko, usklajeno posojilo, usklajeno zavarovanje s premoženjem	BSB/SBB	ne	SICA		…		…
…	…	…	EGP MIC	…	…	enostransko EGP, usklajeno posojilo, usklajeno zavarovanje s premoženjem	posoja in izposoja vrednostnih papirjev ali blaga	…	SIUR		…		…
…	…	…	zunaj EGP MIC	…	…	…	kreditiranje z vzvodom	…			…		…
…	…	…	…	…	…	…	…	…	…	…	…	…	…

[1] Vnesite zadevne indekse, vključene v polje 25 tabele 2 „Podatki o posojilu in zavarovanju s premoženjem“ Priloge I k Izvedbeni uredbi (EU) 2019/363.