

ΚΑΤ' ΕΞΟΥΣΙΟΔΟΤΗΣΗ ΚΑΝΟΝΙΣΜΟΣ (ΕΕ) αριθ. 151/2013 ΤΗΣ ΕΠΙΤΡΟΠΗΣ

της 19ης Δεκεμβρίου 2012

για την εφαρμογή του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου για τα εξωχρηματιστηριακά παράγωγα, τους κεντρικούς αντισυμβαλλομένους και τα αρχεία καταγραφής συναλλαγών όσον αφορά τα κανονιστικά τεχνικά πρότυπα που θα προσδιορίζουν τα δεδομένα που θα πρέπει να δημοσιεύονται και να διατίθενται από αρχεία καταγραφής συναλλαγών και τα λειτουργικά πρότυπα για τη συγκέντρωση, σύγκριση και αξιολόγηση των δεδομένων

(Κείμενο που παρουσιάζει ενδιαφέρον για τον ΕΟΧ)

Η ΕΥΡΩΠΑΪΚΗ ΕΠΙΤΡΟΠΗ,

Έχοντας υπόψη τη Συνθήκη για τη λειτουργία της Ευρωπαϊκής Ένωσης,

Έχοντας υπόψη τη γνώμη της Ευρωπαϊκής Κεντρικής Τράπεζας ⁽¹⁾,Έχοντας υπόψη τον κανονισμό (ΕΕ) αριθ. 648/2012 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 4ης Ιουλίου 2012, για τα εξωχρηματιστηριακά παράγωγα, τους κεντρικούς αντισυμβαλλομένους και τα αρχεία καταγραφής συναλλαγών ⁽²⁾, και ιδίως το άρθρο 81 παράγραφος 5,

Εκτιμώντας τα ακόλουθα:

- (1) Είναι βασικό να προσδιορίζονται σαφώς οι σχετικές συμβάσεις και οι αντίστοιχοι αντισυμβαλλόμενοι τους. Κατόπιν λειτουργικής προσέγγισης, οι οντότητες που έχουν πρόσβαση σε δεδομένα που τηρούνται από αρχεία καταγραφής συναλλαγών θα πρέπει να θεωρούνται ανάλογα με τις αρμοδιότητες που διαθέτουν και τα καθήκοντα που ασκούν.
- (2) Η Ευρωπαϊκή Αρχή Κινητών Αξιών και Αγορών (ΕΑΚΑΑ) θα πρέπει να έχει πρόσβαση σε όλα τα δεδομένα σε επίπεδο συναλλαγών που τηρούνται από αρχεία καταγραφής συναλλαγών, προς το σκοπό της εποπτείας του αρχείου καταγραφής συναλλαγών, ώστε να είναι σε θέση να ζητεί πληροφορίες, να λαμβάνει τα ενδεδειγμένα εποπτικά μέτρα και να παρακολουθεί επίσης εάν η εγγραφή ως αρχείο καταγραφής συναλλαγών θα πρέπει να διατηρηθεί ή να ανακληθεί.
- (3) Δεδομένων των αρμοδιοτήτων της δυνάμει του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 1095/2010 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 24ης Νοεμβρίου 2010, σχετικά με τη σύσταση Ευρωπαϊκής Εποπτικής Αρχής (Ευρωπαϊκή Αρχή Κινητών Αξιών και Αγορών) ⁽³⁾ και του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012, θα πρέπει να παρέχεται πρόσβαση στη ΕΑΚΑΑ στο πλαίσιο διαφόρων εντολών. Η πρόσβαση σε δεδομένα από μεμονωμένα μέλη του προσωπικού της ΕΑΚΑΑ θα πρέπει να είναι σύμφωνη με εκάστη αυτών των ειδικών εντολών.
- (4) Το Ευρωπαϊκό Συμβούλιο Συστημικού Κινδύνου (ΕΣΣΚ), η ΕΑΚΑΑ και τα σχετικά μέλη του ευρωπαϊκού συστήματος κεντρικών τραπεζών (ΕΣΚΤ), συμπεριλαμβανομένων ορισμένων εθνικών κεντρικών τραπεζών και σχετικών αρχών κινητών αξιών και αγορών της Ένωσης, έχουν εντολή να παρακολουθούν και να διατηρούν τη χρηματοπιστωτική σταθερότητα

στην Ένωση, και θα πρέπει συνεπώς να έχουν πρόσβαση σε δεδομένα συναλλαγών για όλους τους αντισυμβαλλομένους προς το σκοπό των αντίστοιχων καθηκόντων τους εν προκειμένω.

- (5) Επότες και επιβλέποντες των κεντρικών αντισυμβαλλομένων χρειάζονται πρόσβαση ώστε να καθίσταται δυνατή η αποτελεσματική άσκηση των καθηκόντων τους όσον αφορά τις εν λόγω οντότητες και θα πρέπει συνεπώς να έχουν πρόσβαση σε όλες τις πληροφορίες που είναι αναγκαίες για την εν λόγω εντολή.
- (6) Η πρόσβαση από τα σχετικά μέλη του ΕΣΚΤ εξυπηρετεί την εκπλήρωση των βασικών καθηκόντων τους, ιδίως τις λειτουργίες μιας κεντρικής τράπεζας έκδοσης, την εντολή τους για χρηματοπιστωτική σταθερότητα, και σε ορισμένες περιπτώσεις προληπτική εποπτεία επί ορισμένων αντισυμβαλλομένων. Εφόσον ορισμένα μέλη του ΕΣΚΤ έχουν διαφορετικές εντολές δυνάμει της εθνικής νομοθεσίας, θα πρέπει να αποκτήσουν πρόσβαση σε δεδομένα σύμφωνα με τις διάφορες εντολές που απαριθμούνται στο άρθρο 81 παράγραφος 3 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012.
- (7) Οι σχετικές αρχές κινητών αξιών και αγοράς της Ένωσης έχουν ως κύριο καθήκον την προστασία των επενδυτών στις αντίστοιχες δικαιοδοσίες τους και θα πρέπει να αποκτήσουν πρόσβαση σε δεδομένα συναλλαγών για αγορές, συμμετέχοντες, προϊόντα και υποκείμενα που καλύπτονται δυνάμει των εντολών τους για εποπτεία και επιβολή.
- (8) Οι αρχές που ορίζει το άρθρο 4 της οδηγίας 2004/25/ΕΚ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 21ης Απριλίου 2004, σχετικά με τις δημόσιες προσφορές εξαγοράς ⁽⁴⁾ θα πρέπει να αποκτήσουν πρόσβαση στις συναλλαγές μετοχικών παραγώγων όπου το υποκείμενο είτε έχει εισαχθεί προς διαπραγμάτευση σε ρυθμιζόμενη αγορά της δικαιοδοσίας τους, έχει επίσημη διεύθυνση εντός της δικαιοδοσίας τους είτε είναι προσφέρων για εταιρεία όσον αφορά την εν λόγω επιχείρηση και το αντάλλαγμα που προτείνει περιλαμβάνει μετοχές.
- (9) Ο Οργανισμός Συνεργασίας των Ρυθμιστικών Αρχών Ενέργειας (ACER) θα πρέπει να αποκτήσει πρόσβαση προς το σκοπό της παρακολούθησης των χονδρικών αγορών ενέργειας προκειμένου να εντοπίζει και να αποτρέπει καταχρηστικές πρακτικές στις αγορές δυνάμει του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 1227/2011 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 25ης Οκτωβρίου 2011, για την ακεραιότητα και τη διαφάνεια στη χονδρική αγορά ενέργειας (REMIT) ⁽⁵⁾. Ο ACER θα πρέπει συνεπώς να αποκτήσει πρόσβαση σε όλα τα δεδομένα που τηρεί το αρχείο καταγραφής συναλλαγών όσον αφορά τα παράγωγα ενέργειας.

⁽¹⁾ Δεν έχει ακόμα δημοσιευθεί στην Επίσημη Εφημερίδα.⁽²⁾ ΕΕ L 201 της 27.7.2012, σ. 1.⁽³⁾ ΕΕ L 331 της 15.12.2010, σ. 84.⁽⁴⁾ ΕΕ L 142 της 30.4.2004, σ. 12.⁽⁵⁾ ΕΕ L 326 της 8.12.2011, σ. 1.

- (10) Ο κανονισμός (ΕΕ) αριθ. 648/2012 καλύπτει μόνο συναλλακτικά δεδομένα και όχι προσυναλλακτικά δεδομένα όπως εντολές πραγματοποίησης διαπραγματεύσεων σύμφωνα με τον κανονισμό (ΕΕ) αριθ. 1227/2011. Συνεπώς, τα αρχεία καταγραφής συναλλαγών δεν θα πρέπει να θεωρούνται η ενδεδειγμένη πηγή ενημέρωσης του ACER εν προκειμένω.
- (11) Στο πλαίσιο μιας λειτουργικής προσέγγισης για την αξιολόγηση δεδομένων που τηρούν τα αρχεία καταγραφής συναλλαγών, η προληπτική εποπτεία αποτελεί βασική συνιστώσα. Ομοίως, διάφορες αρχές δύναται να έχουν εντολή άσκησης προληπτικής εποπτείας. Συνεπώς, η πρόσβαση στα δεδομένα συναλλαγών για τις σχετικές οντότητες θα πρέπει να εξασφαλίζεται σε όλες τις αρχές που απαριθμούνται στο άρθρο 81 παράγραφος 3 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012.
- (12) Οι οντότητες που αξιολογούν δεδομένα αρχείων καταγραφής συναλλαγών βάσει του άρθρου 81 παράγραφος 3 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012 θα πρέπει να διασφαλίζουν ότι τηρούν και εφαρμόζουν πολιτικές προκειμένου να διασφαλίζεται ότι μόνον οι αρμόδιοι έχουν πρόσβαση στις πληροφορίες για ευκρινή και νομικά βάσιμο σκοπό, ενώ καθίσταται επίσης σαφές και για τα πιθανά άλλα άτομα που έχουν λάβει άδεια πρόσβασης στα εν λόγω δεδομένα.
- (13) Η πρόσβαση στα δεδομένα θα πρέπει να θεωρείται στο πλαίσιο τριών επιπέδων συγκέντρωσης. Τα δεδομένα για τις συναλλαγές θα πρέπει να περιλαμβάνουν λεπτομέρειες μεμονωμένων συναλλαγών· τα δεδομένα θέσεων θα πρέπει να αφορούν δεδομένα για συνολικές θέσεις ανά υποκείμενο/προϊόν για μεμονωμένους αντισυμβαλλομένους· και τα συγκεντρωτικά θεωρητικά δεδομένα θα πρέπει να αντιστοιχούν σε συνολικές θέσεις ανά υποκείμενο/προϊόν, χωρίς λεπτομέρειες για τον αντισυμβαλλόμενο. Η πρόσβαση σε δεδομένα θέσης παρέχει επίσης πρόσβαση σε δεδομένα επιπέδου θέσης και συγκεντρωτικά δεδομένα. Η πρόσβαση σε δεδομένα θέσης παρέχει επίσης πρόσβαση σε συγκεντρωτικά δεδομένα, αλλά όχι σε δεδομένα σε επίπεδο συναλλαγών. Αντιστρόφως, η πρόσβαση σε συγκεντρωτικά θεωρητικά δεδομένα θα πρέπει να είναι η πιο ομαλή κατηγορία και δεν θα πρέπει να επιτρέπει την πρόσβαση σε δεδομένα σε επίπεδο θέσεων ή συναλλαγής.
- (14) Ο παρών κανονισμός βασίζεται στα σχέδια ρυθμιστικών τεχνικών προτύπων που υπέβαλε η Ευρωπαϊκή Αρχή Κινητών Αξιών και Αγορών στην Ευρωπαϊκή Επιτροπή.
- (15) Σύμφωνα με το άρθρο 10 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 1095/2010, η ΕΑΚΑΑ προέβη σε διαβουλεύσεις με τις αρμόδιες αρχές και τα μέλη του ευρωπαϊκού συστήματος κεντρικών τραπεζών (ΕΣΚΤ) πριν από την υποβολή των σχεδίων κανονιστικών τεχνικών προτύπων στις οποίες βασίζεται ο παρών κανονισμός. Η ΕΑΚΑΑ πραγματοποίησε επίσης ανοιχτές δημόσιες διαβουλεύσεις για τα εν λόγω σχέδια ρυθμιστικών τεχνικών προτύπων, ανέλυσε τα δυνητικά συναφή κόστη και οφέλη και ζήτησε τη γνώμη της Ομάδας Συμφεροντούχων Κινητών Αξιών και Αγορών της ΕΑΚΑΑ που συστάθηκε σύμφωνα με το άρθρο 37 του συγκεκριμένου κανονισμού,
- α) ανάλυση των συνολικών ανοιχτών θέσεων ανά κατηγορία παραγωγών ως εξής:
- i) βασικά εμπορεύματα·
 - ii) πιστώσεις·
 - iii) συνάλλαγμα·
 - iv) μετοχές·
 - v) επιτόκια·
 - vi) άλλες κατηγορίες·
- β) ανάλυση των συνολικών όγκων συναλλαγών ανά κατηγορία παραγωγών ως εξής:
- i) βασικά εμπορεύματα·
 - ii) πιστώσεις·
 - iii) συνάλλαγμα·
 - iv) μετοχές·
 - v) επιτόκια·
 - vi) άλλες κατηγορίες·
- γ) ανάλυση συγκεντρωτικών αξιών ανά κατηγορία παραγωγών, ως εξής:
- i) βασικά εμπορεύματα·
 - ii) πιστώσεις·
 - iii) συνάλλαγμα·
 - iv) μετοχές·
 - v) επιτόκια·
 - vi) άλλες κατηγορίες·
2. Τα δεδομένα δημοσιεύονται σε ιστότοπο ή σε δικτυακή πύλη που είναι άμεσα προσβάσιμα από το κοινό και ενημερώνονται τουλάχιστον σε εβδομαδιαία βάση.

ΕΞΕΔΩΣΕ ΤΟΝ ΠΑΡΟΝΤΑ ΚΑΝΟΝΙΣΜΟ:

Άρθρο 1

Δημοσίευση συγκεντρωτικών δεδομένων

1. Τα αρχεία καταγραφής συναλλαγών δημοσιεύουν δεδομένα που προβλέπονται στο άρθρο 81 παράγραφος 1 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012, τα οποία περιλαμβάνουν τουλάχιστον:

Άρθρο 2

Πρόσβαση των αρμοδίων αρχών σε δεδομένα

1. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών παρέχει πρόσβαση σε όλα τα δεδομένα συναλλαγών στην Ευρωπαϊκή Αρχή Κινητών Αξιών και Αγορών (ΕΑΚΑΑ) για τον σκοπό της άσκησης των εποπτικών της αρμοδιοτήτων.

2. Η ΕΑΚΑΑ καθιερώνει εσωτερικές διαδικασίες, προκειμένου να διασφαλίζει την ενδεδειγμένη πρόσβαση του προσωπικού, και τυχόν σχετικούς περιορισμούς πρόσβασης ως προς μη εποπτικές δραστηριότητες στο πλαίσιο της εντολής της ΕΑΚΑΑ.

3. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών παρέχει στον Οργανισμό Συνεργασίας των Ρυθμιστικών Αρχών Ενέργειας (ACER) πρόσβαση σε όλα τα δεδομένα συναλλαγών που αφορούν παράγωγα, εφόσον το υποκείμενο είναι η ενέργεια ή άδειες εκπομπής ρύπων.

4. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών παρέχει σε αρμόδια αρχή που εποπτεύει κεντρικό αντισυμβαλλόμενο και στο σχετικό μέλος του ευρωπαϊκού συστήματος κεντρικών τραπεζών (ΕΣΚΤ) που εποπτεύει τον κεντρικό αντισυμβαλλόμενο, ανάλογα με την περίπτωση, πρόσβαση σε όλα τα δεδομένα των συναλλαγών που εκκαθαρίζονται ή αναφέρονται από τον κεντρικό αντισυμβαλλόμενο.

5. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών παρέχει στην αρμόδια αρχή που εποπτεύει τους τόπους εκτέλεσης των αναφερόμενων συμβάσεων πρόσβαση σε όλα τα δεδομένα συναλλαγών για συμβάσεις εκτελεσθείσες στους συγκεκριμένους τόπους.

6. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών παρέχει στην εποπτική αρχή που ορίζεται βάσει του άρθρου 4 της οδηγίας 2004/25/ΕΚ πρόσβαση σε όλα τα δεδομένα συναλλαγών επί παραγώγων, εφόσον το υποκείμενο είναι κινητή αξία που έχει εκδοθεί από εταιρεία η οποία πληροί έναν από τους ακόλουθους όρους:

- α) έχει εισαχθεί προς διαπραγμάτευση σε ρυθμιζόμενη αγορά εντός της δικαιοδοσίας τους·
- β) έχει την εταιρική έδρα της ή, σε περίπτωση που δεν έχει εταιρική έδρα, τα κεντρικά γραφεία της, εντός της δικαιοδοσίας τους·
- γ) είναι προσφέρων για τις οντότητες που προβλέπονται στο στοιχείο α) ή β) και το αντάλλαγμα που προτείνει περιλαμβάνει κινητές αξίες.

7. Τα δεδομένα που παρέχονται σύμφωνα με την παράγραφο 6 περιλαμβάνουν πληροφορίες για:

- α) τις υποκείμενες κινητές αξίες·
- β) την κατηγορία παραγώγων·
- γ) την ένδειξη της θέσης·
- δ) τον αριθμό των κινητών αξιών αναφοράς·
- ε) τους αντισυμβαλλομένους των παραγώγων.

8. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών παρέχει στις αρμόδιες αρχές κινητών αξιών και αγορών της Ένωσης, που αναφέρονται στο άρθρο 81 παράγραφος 3 στοιχείο η) του κανονισμού (ΕΕ)

αριθ. 648/2012, πρόσβαση σε όλα τα δεδομένα συναλλαγών σχετικά με αγορές, συμμετέχοντες, συμβάσεις και υποκείμενα, που εμπίπτουν στο πεδίο της συγκεκριμένης αρχής σύμφωνα με τις αντίστοιχες εποπτικές αρμοδιότητες και εντολές της.

9. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών παρέχει στο Ευρωπαϊκό Συμβούλιο Συστημικού Κινδύνου, στην ΕΑΚΑΑ και στα σχετικά μέλη του ΕΣΚΤ δεδομένα σε επίπεδο συναλλαγών:

- α) για όλους τους αντισυμβαλλομένους εντός των αντίστοιχων περιοχών δικαιοδοσίας τους·
- β) για συμβάσεις παραγώγων, εφόσον η οντότητα αναφοράς της σύμβασης παραγώγων βρίσκεται εντός της αντίστοιχης περιοχής δικαιοδοσίας τους ή εφόσον η υποχρέωση αναφοράς είναι κρατικός χρεωστικός τίτλος της αντίστοιχης περιοχής δικαιοδοσίας.

10. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών παρέχει σε σχετικό μέλος του ΕΣΚΤ πρόσβαση σε δεδομένα θέσεων για συμβάσεις παραγώγων στο νόμισμα που εκδίδει το εν λόγω μέλος.

11. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών, για σκοπούς προληπτικής εποπτείας των αντισυμβαλλομένων που υπόκεινται στην υποχρέωση αναφοράς, παρέχει στις σχετικές οντότητες που απαριθμούνται στο άρθρο 81 παράγραφος 3 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012 πρόσβαση σε όλα τα δεδομένα συναλλαγών των εν λόγω αντισυμβαλλομένων.

Άρθρο 3

Αρχή τρίτης χώρας

1. Όσον αφορά αρμόδια αρχή τρίτης χώρας η οποία έχει συνάψει διεθνή συμφωνία με την Ένωση, όπως αναφέρεται στο άρθρο 75 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012, το αρχείο καταγραφής συναλλαγών παρέχει πρόσβαση στα δεδομένα, λαμβάνοντας υπόψη την εντολή και τις αρμοδιότητες της αρχής της τρίτης χώρας και σύμφωνα με τις διατάξεις της σχετικής διεθνούς συμφωνίας.

2. Όσον αφορά αρμόδια αρχή τρίτης χώρας η οποία έχει συνάψει συμφωνία συνεργασίας με την ΕΑΚΑΑ, όπως αναφέρεται στο άρθρο 76 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012, το αρχείο καταγραφής συναλλαγών παρέχει πρόσβαση στα δεδομένα, λαμβάνοντας υπόψη την εντολή και τις αρμοδιότητες της αρχής της τρίτης χώρας και σύμφωνα με τις διατάξεις της σχετικής συμφωνίας συνεργασίας.

Άρθρο 4

Λειτουργικά πρότυπα για συγκέντρωση και σύγκριση δεδομένων

1. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών παρέχει πρόσβαση στις οντότητες που απαριθμούνται στο άρθρο 81 παράγραφος 3 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012 σύμφωνα με τις διαδικασίες επικοινωνίας, τα πρότυπα για αποστολή μηνυμάτων και τα δεδομένα αναφοράς που χρησιμοποιούνται συνήθως σε διεθνές επίπεδο.

2. Οι αντισυμβαλλόμενοι συναλλαγής δημιουργούν έναν μοναδικό αναγνωριστικό κωδικό συναλλαγής για κάθε σύμβαση παραγώγων, ώστε τα αρχεία καταγραφής συναλλαγών να μπορούν να συγκεντρώνουν και να συγκρίνουν δεδομένα μεταξύ διαφόρων αρχείων καταγραφής συναλλαγών.

Άρθρο 5

Λειτουργικά πρότυπα πρόσβασης σε δεδομένα

1. Το αρχείο καταγραφής συναλλαγών καταγράφει πληροφορίες όσον αφορά την πρόσβαση σε δεδομένα η οποία παρέχεται στις οντότητες που απαριθμούνται στο άρθρο 81 παράγραφος 3 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012.

2. Οι πληροφορίες της παραγράφου 1 περιλαμβάνουν:

α) την έκταση των προσβάσιμων δεδομένων·

β) παραπομπή στις νομικές διατάξεις που επιτρέπουν την πρόσβαση στα εν λόγω δεδομένα δυνάμει του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012 και του παρόντος κανονισμού.

Άρθρο 6

Έναρξη ισχύος

Ο παρών κανονισμός αρχίζει να ισχύει την εικοστή ημέρα από τη δημοσίευσή του στην *Επίσημη Εφημερίδα της Ευρωπαϊκής Ένωσης*.

Ο παρών κανονισμός είναι δεσμευτικός ως προς όλα τα μέρη του και ισχύει άμεσα σε κάθε κράτος μέλος.

Βρυξέλλες, 19 Δεκεμβρίου 2012.

Για την Επιτροπή
Ο Πρόεδρος
José Manuel BARROSO