

Wytyczne

dotyczące przenoszenia danych pomiędzy repozytoriami transakcji na podstawie rozporządzeń EMIR i SFTR

Spis treści

| | | |
|--|--|----|
| 1 | Zakres stosowania | 4 |
| 2 | Odniesienia do przepisów prawa, skróty i definicje..... | 5 |
| 2.1 | Odniesienia do przepisów prawa..... | 5 |
| 2.2 | Skróty..... | 7 |
| 2.3 | Glosariusz pojęć i terminów..... | 8 |
| 3 | Cel | 11 |
| 4 | Zgodność i obowiązki sprawozdawcze | 12 |
| 4.1 | Status wytycznych..... | 12 |
| 4.2 | Obowiązki sprawozdawcze | 13 |
| 5 | Zmiany wytycznych dotyczących przenoszenia danych pomiędzy repozytoriami transakcji na podstawie rozporządzenia EMIR | 13 |
| 5.1 | Załącznik I – Procedura przeniesienia danych na wniosek uczestnika RT zgodnie z rozporządzeniem EMIR | 16 |
| 5.2 | Załącznik II – Procedura migracji w przypadku cofnięcia rejestracji zgodnie z rozporządzeniem EMIR | 19 |
| Wytyczne dotyczące przenoszenia danych pomiędzy repozytoriami transakcji na podstawie rozporządzenia SFTR..... | | 21 |
| 1 | Zakres stosowania | 21 |
| 2 | Odniesienia do przepisów prawa, skróty i definicje..... | 22 |
| 2.1 | Odniesienia do przepisów prawa..... | 22 |
| 2.2 | Skróty..... | 24 |
| 2.3 | Glosariusz pojęć i terminów..... | 25 |
| 3 | Cel | 27 |
| 4 | Zgodność i obowiązki sprawozdawcze | 29 |
| 4.1 | Status wytycznych..... | 29 |
| 4.2 | Obowiązki sprawozdawcze | 29 |
| 5 | Wytyczne dotyczące przenoszenia danych pomiędzy repozytoriami transakcji na podstawie rozporządzenia SFTR..... | 30 |
| 5.1 | Załącznik I – Procedura przeniesienia danych na wniosek uczestnika RT zgodnie z rozporządzeniem SFTR | 37 |
| 5.2 | Załącznik II – Procedura migracji w przypadku cofnięcia rejestracji zgodnie z rozporządzeniem SFTR | 39 |

1 Zakres stosowania

Kto?

1. Niniejsze wytyczne mają zastosowanie do repozytoriów transakcji (RT) zarejestrowanych lub uznanych przez ESMA, właściwych organów krajowych (NCA) oraz kontrahentów dokonujących zgłoszeń lub podmiotów dokonujących zgłoszeń w ich imieniu.

Co?

2. Przyjęte wytyczne mają zastosowanie w odniesieniu do:
 - a. zgłaszania bez dublowania szczegółowych informacji o instrumentach pochodnych przez kontrahentów i instytucje typu CCP zgodnie z art. 9 ust. 1 rozporządzenia EMIR;
 - b. procedur dotyczących przenoszenia danych zgodnie z art. 78 ust. 9 rozporządzenia EMIR;
 - c. przenoszenia instrumentów pochodnych między RT na wniosek kontrahentów lub podmiotu dokonującego zgłoszenia w ich imieniu, lub w sytuacji, gdy rejestracja RT została cofnięta zgodnie z art. 79 ust. 3 rozporządzenia EMIR;
 - d. prowadzenia rejestru szczegółowych informacji o instrumentach pochodnych zgodnie z art. 80 ust. 3 rozporządzenia EMIR; oraz
 - e. art. 21 ust. 2 regulacyjnych standardów technicznych dotyczących rejestracji (EMIR).

Kiedy?

3. Obowiązujące wytyczne dotyczące przenoszenia danych na mocy rozporządzenia EMIR mają zastosowanie od dnia 16 października 2017 r. Zmiany w niniejszych wytycznych stosuje się od dnia 3 października 2022 r.

2 Odniesienia do przepisów prawa, skróty i definicje

2.1 Odniesienia do przepisów prawa

| | |
|---|---|
| <i>MiFIR</i> | rozporządzenie delegowane Komisji (UE) nr 600/2014 z dnia 15 maja 2014 r. Parlamentu Europejskiego i Rady w sprawie rynków instrumentów finansowych, zmieniające rozporządzenie (UE) nr 648/2012 ¹ |
| <i>projekt regulacyjnych standardów technicznych dotyczących sprawozdawczości</i> | rozporządzenie delegowane Komisji (UE) nr RRRR/XXX z dnia ... uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i repozytoriów transakcji w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych określających minimalny poziom szczegółowości informacji podlegających zgłoszeniu repozytoriom transakcji oraz uchylające rozporządzenie delegowane Komisji (UE) nr 148/2013 ² |
| <i>regulacyjny standard techniczny dotyczący dostępu do danych</i> | rozporządzenie delegowane Komisji (UE) nr 151/2013 z dnia 19 grudnia 2012 r. uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i repozytoriów transakcji w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych określających dane, które mają być publikowane i udostępniane przez repozytoria transakcji, a także standardy operacyjne dotyczące agregowania i porównywania danych oraz dostępu do tych danych, zmienione rozporządzeniem delegowanym Komisji (UE) 2017/1800 oraz rozporządzeniem delegowanym Komisji (UE) 2019/361 ³ |
| <i>regulacyjny standard techniczny dotyczący rejestracji</i> | rozporządzenie delegowane Komisji (UE) nr 150/2013 z dnia 19 grudnia 2012 r. uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i |

¹ Dz.U. L 173 z 12.6.2014, s. 84.

² Projekt regulacyjnych standardów technicznych w zakresie sprawozdawczości przyjęty przez ESMA 17.12.2020 (ESMA74-362-824) zostaje przedłożony Komisji Europejskiej do zatwierdzenia.

³ Dz.U. L 52 z 23.2.2013, s. 33–36.

repozytoriów transakcji w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych określających szczegóły dotyczące wniosku o rejestrację jako repozytorium transakcji, zmienione rozporządzeniem delegowanym Komisji (UE) 2019/362 z dnia 13 grudnia 2018 r.⁴

regulacyjny standard techniczny dotyczący sprawozdawczości

rozporządzenie delegowane Komisji (UE) nr 148/2013 z dnia 19 grudnia 2012 r. uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i repozytoriów transakcji w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych określających minimalny poziom szczegółowości informacji podlegających zgłoszeniu repozytoriom transakcji, zmienione rozporządzeniem delegowanym Komisji (UE) 2017/104⁵

rozporządzenie EMIR

rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 z dnia 4 lipca 2012 r. w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i repozytoriów transakcji⁶

rozporządzenie w sprawie ustanowienia ESMA

rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 1095/2010 z dnia 24 listopada 2010 r. w sprawie ustanowienia Europejskiego Urzędu Nadzoru (Europejskiego Urzędu Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych), zmiany decyzji nr 716/2009/WE i uchylecia decyzji Komisji 2009/77/WE⁷

wykonawczy standard techniczny dotyczący sprawozdawczości

rozporządzenie wykonawcze Komisji (UE) nr 1247/2012 z dnia 19 grudnia 2012 r. ustanawiające wykonawcze standardy techniczne w odniesieniu do formatu i częstotliwości dokonywania zgłoszeń dotyczących transakcji do repozytoriów transakcji zgodnie z rozporządzeniem Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i

⁴ Dz.U. L 52 z 23.2.2013, s. 25–32.

⁵ Dz.U. L 52 z 23.2.2013, s. 1–10.

⁶ Dz.U. L 201 z 27.7.2012, s. 1.

⁷ Dz.U. L 331 z 15.12.2010, s. 84–119.

repozytoriów transakcji, zmienione rozporządzeniem wykonawczym Komisji (UE) 2017/105⁸

wytyczne dotyczące pozycji wytyczne w sprawie obliczania pozycji przez repozytoria transakcji na podstawie rozporządzenia EMIR⁹

2.2 Skróty

| | |
|--------------|---|
| <i>CSV</i> | wartości oddzielone przecinkiem |
| <i>DK</i> | dokument konsultacyjny |
| <i>EBC</i> | Europejski Bank Centralny |
| <i>EOG</i> | Europejski Obszar Gospodarczy |
| <i>ERR</i> | podmiot odpowiedzialny za zgłoszenie |
| <i>ESMA</i> | Europejski Urząd Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych |
| <i>FSB</i> | Rada Stabilności Finansowej |
| <i>ISO</i> | Międzynarodowa Organizacja Normalizacyjna |
| <i>KBC</i> | krajowy bank centralny |
| <i>LEI</i> | identyfikator podmiotu prawnego |
| <i>NCA</i> | właściwy organ krajowy |
| <i>RSE</i> | podmiot dokonujący zgłoszenia |
| <i>RT</i> | repozytorium transakcji |
| <i>SLA</i> | umowa o gwarantowanym poziomie usług |
| <i>TRACE</i> | system dostępu do danych RT |
| <i>UE</i> | Unia Europejska |

⁸ Dz.U. L 352 z 21.12.2012, s. 20–29.

⁹ ESMA70-151-1350.

2.3 Glosariusz pojęć i terminów

Wszystkie definicje, pojęcia i terminy, które są stosowane w rozporządzeniu EMIR, w obowiązującym regulacyjnym standardzie technicznym dotyczącym sprawozdawczości i wykonawczym standardzie technicznym dotyczącym sprawozdawczości, jak również w obowiązującym regulacyjnym standardzie technicznym dotyczącym dostępu do danych oraz w pytaniach i odpowiedziach, a także w niniejszych wytycznych, mają takie samo znaczenie.

Do celów niniejszych wytycznych zdefiniowano/opisano następujące terminy:

- „active client” / „klient aktywny” oznacza uczestnika RT, który posiada w RT aktywne instrumenty pochodne.
- „compressed derivatives” / „skompresowane instrumenty pochodne” oznaczają instrumenty pochodne, które zostały zbyte/zamknięte z powodu kompresji, jak określono w art. 2 ust. 1 pkt 47 rozporządzenia MiFIR, oraz instrumenty pochodne ujęte w pozycji. W związku z tym skompresowane instrumenty pochodne odnoszą się do zestawu instrumentów pochodnych między parą kontrahentów, które zostały zbyte/zamknięte przed pierwotnie ustalonym terminem zapadalności przez tych dwóch kontrahentów i są identyfikowane za pomocą komunikatu (ang. *action type*) „Z” lub „P” w ramach obecnego regulacyjnego standardu technicznego dotyczącego sprawozdawczości. Ponadto zgodnie z projektem regulacyjnych standardów technicznych dotyczących sprawozdawczości taki zestaw instrumentów pochodnych jest identyfikowany poprzez połączenie komunikatu „TERM” i „COMP”, połączenia komunikatu „TERM” i „INCP” lub „POSC”.
- „errored derivative” / „błędny instrument pochodny” oznacza instrument pochodny zgłoszony do RT w wyniku błędu. W obecnym regulacyjnym standardzie technicznym dotyczącym sprawozdawczości jest on oznaczony za pomocą komunikatu „E”, a w projekcie regulacyjnego standardu technicznego dotyczącego sprawozdawczości – „EROR”.
- „life-cycle events” / „zdarzenia występujące w cyklu życia” obejmują wszystkie komunikaty odnoszące się do danego instrumentu pochodnego.
- „matured derivative” / „zapadły instrument pochodny” oznacza instrument pochodny, który jest zgłoszony do RT i w określonym czasie osiągnął uzgodniony umownie termin zapadalności.
- „nowe RT” oznacza RT, do którego uczestnik RT rozpoczął lub zamierza rozpocząć zgłaszanie instrumentów pochodnych zgodnie z art. 9 rozporządzenia EMIR, chociaż początkowo podmiot ten zgłaszał instrumenty pochodne poprzedniego RT, bezpośrednio lub za pośrednictwem RSE.

- „non-active client” / „klient nieaktywny” oznacza uczestnika RT, który nie posiada już aktywnych instrumentów pochodnych w RT.
- „poprzednie RT” oznacza RT, do którego uczestnik RT dokonywał zgłoszenia lub do którego instrumenty pochodne uczestnika RT zostały zgłoszone przez RSE zgodnie z art. 9 rozporządzenia EMIR, ale (i) uczestnik RT postanowił zaprzestać zgłaszania ustaleń umownych lub (ii) rejestracja RT została cofnięta.
- „outstanding derivative” / „aktywny instrument pochodny” oznacza taki instrument pochodny, w tym rozliczane przez kontrahenta centralnego instrumenty pochodne, który jest zgłoszony do repozytorium transakcji i nie osiągnął terminu zapadalności oraz nie był przedmiotem komunikatów typu „E”, „C”, „P” lub „Z” w ramach obecnych regulacyjnych standardów technicznych dotyczących sprawozdawczości. Ponadto zgodnie z projektem regulacyjnych standardów technicznych dotyczących sprawozdawczości „aktywne instrumenty pochodne” oznaczają instrumenty pochodne, których termin zapadalności nie upłynął lub które nie były przedmiotem komunikatów typu „TERM”, „EROR” lub „POSC”. Ponadto zgodnie z projektem regulacyjnych standardów technicznych dotyczących sprawozdawczości „aktywny instrument pochodny” oznacza instrument pochodny, który został objęty komunikatem typu „REVI”, bez wcześniejszego zastosowania komunikatu „TERM” lub „EROR”.
- „portability” / „możliwość przenoszenia” oznacza możliwość przeniesienia rekordów danych dotyczących instrumentów pochodnych zgłoszonych zgodnie z art. 9 rozporządzenia EMIR z poprzedniego RT do nowego RT, zgodnie z definicjami zawartymi w niniejszych wytycznych.
- „positions” / „pozycje” oznaczają odzwierciedlenie ekspozycji między parą kontrahentów, zgodnie z wytycznymi dotyczącymi pozycji.
- „reconciliation” / „rekoncyliacja” oznacza proces, za pomocą którego RT potwierdzają, że obie strony instrumentu pochodnego zostały zgłoszone z tymi samymi informacjami przez każdy ERR.
- „rejections” / „odrzucenia” oznaczają, że instrumenty pochodne zostały odrzucone przez RT z powodu błędów w informacjach zgłoszonych przez ERR lub RSE.
- „report submitting entity” / „podmiot dokonujący zgłoszenia” (zwany dalej RSE) oznacza jednego z kontrahentów (zgodnie ze standardami technicznymi dotyczącymi dokonywania zgłoszeń¹⁰; należy go rozumieć jako podmiot, który wszedł w stosunek umowny z zarejestrowanym lub uznawanym RT oraz:
 - zgłasza wyłącznie instrumenty pochodne, w przypadku gdy jest jednym z kontrahentów, w którym to przypadku jest tożsamy z kontrahentem zgłaszającym kontrakt lub innym kontrahentem, lub

¹⁰ <https://eur-lex.europa.eu/legal-content/EN/TXT/?uri=CELEX%3A32017R0104>

- zgłasza instrumenty pochodne, w przypadku których jest albo nie jest jednym z kontrahentów.
- „terminated derivatives” / „zamknięte instrumenty pochodne”, zgodnie z regulacyjnym standardem technicznym dotyczącym sprawozdawczości, oznaczają instrumenty pochodne, które zostały zamknięte przed umownym terminem zapadalności przez dwóch kontrahentów i są identyfikowane za pomocą komunikatu typu „C”. Ponadto zgodnie z projektem regulacyjnych standardów technicznych dotyczących sprawozdawczości taki zestaw instrumentów pochodnych jest identyfikowany za pomocą kombinacji komunikatu typu „TERM” lub „POSC”. Zgodnie z projektem regulacyjnych standardów technicznych dotyczących sprawozdawczości „zamknięte instrumenty pochodne” obejmują również wspomniane powyżej skompresowane instrumenty pochodne.
- „transfer” lub „transfer (of details) of derivatives” / „przeniesienie (danych)” lub „przeniesienie danych dotyczących instrumentów pochodnych” oznacza czynność lub proces przeniesienia rekordów danych dotyczących instrumentów pochodnych, odpowiednio, z poprzedniego RT do nowego RT.
- „uczestnik RT”¹¹ oznacza podmiot, który posiada stosunek umowny mający na celu zgłaszanie kontraktów pochodnych zgodnie z art. 9 rozporządzenia EMIR z przynajmniej jednym zarejestrowanym lub uznawanym RT. Uczestnikiem repozytorium transakcji może być RSE, ERR, kontrahent dokonujący zgłoszenia lub kontrahent centralny (tj. CCP).

¹¹ Niektóre RT mogą ponadto określać rodzaje uczestników RT, takie jak uczestnicy zgłaszający, ogólnie zgłaszający, czy niezgłaszający. Takie podkategorie są przejrzyste z perspektywy niniejszych wytycznych.

3 Cel

4. Celem niniejszych wytycznych jest ustanowienie spójnych, wydajnych i skutecznych praktyk nadzorczych w ramach ESNF oraz zapewnienie wspólnego, jednolitego i spójnego ich stosowania poprzez dostarczenie wyjaśnień RT, kontrahentom dokonującym zgłoszenia i podmiotowi odpowiedzialnemu za zgłoszenie w celu zapewnienia zgodności z następującymi przepisami rozporządzenia EMIR:
 - a. art. 9 ust. 1 lit. e) rozporządzenia EMIR, który stanowi, że „kontrahenci i CCP zobowiązani do zgłaszania informacji szczegółowych na temat kontraktów pochodnych zapewniają, by takie informacje szczegółowe były zgłaszane prawidłowo i bez powielania”;
 - b. art. 80 ust. 3 rozporządzenia EMIR, który stanowi, że „Repozytorium transakcji bezzwłocznie rejestruje dane otrzymane na mocy art. 9 i przechowuje je przez co najmniej dziesięć lat po rozwiązaniu danych kontraktów. Repozytorium transakcji stosuje szybkie i wydajne procedury rejestrowania w celu udokumentowania zmian zarejestrowanych informacji”;
 - c. art. 79 ust. 3 rozporządzenia EMIR, który stanowi, że „Repozytorium transakcji, któremu cofnięto zezwolenie, zapewnia należyte zastępstwo, w tym przeniesienie danych do innych repozytoriów transakcji oraz przekierowanie przepływów sprawozdawczych do innych repozytoriów transakcji”; oraz
 - d. procedury dotyczące przenoszenia zgodnie z art. 78 ust. 9 rozporządzenia EMIR.
5. Podstawę wytycznych stanowi art. 16 ust. 1 rozporządzenia w sprawie ustanowienia ESMA, który stanowi, że „w celu ustanowienia spójnych, wydajnych i skutecznych praktyk nadzorczych w ramach ESNF oraz zapewnienia wspólnego, jednolitego i spójnego stosowania prawa Unii Urząd wydaje wytyczne skierowane do wszystkich właściwych organów lub wszystkich uczestników rynku finansowego, a także wydaje zalecenia skierowane do jednego właściwego organu lub większej liczby właściwych organów bądź do jednej instytucji finansowej lub większej liczby uczestników rynku finansowego”.
6. Zmienione wytyczne dotyczące przenoszenia danych zgodnie z EMIR mają trzy cele:
 - a. usunięcie przeszkód związanych z przenoszeniem danych z konkurencyjnego środowiska RT oraz umożliwienie uczestnikom RT czerpania korzyści ze środowiska, w którym uczestniczy wiele RT;
 - b. zapewnienie organom nadzoru odpowiedniej jakości dostępnych danych, w tym agregacji dokonanych przez RT, nawet w przypadku gdy uczestnik RT zmienia RT, któremu dokonuje zgłoszeń, oraz bez względu na powód dokonania takiej zmiany;
 - c. zapewnienie zgodnego, ujednoliconego i zharmonizowanego sposobu przenoszenia rekordów z jednego RT do innego RT oraz wspieranie ciągłości

zgłoszeń i rekonyliacji we wszystkich sprawach, w tym w przypadkach cofnięcia rejestracji RT.

7. Potrzeba przeniesienia danych do innego RT może powstać z różnych przyczyn. W związku z tym wytyczne obejmują oddzielnie sytuacje, w przypadku których (i) przeniesienie jest spowodowane cofnięciem rejestracji RT, a oddzielnie sprawy, w przypadku których (ii) przeniesienie następuje dobrowolnie w zwykłych warunkach rynkowych. Wytyczne nr 1–15 oraz wytyczne nr 33 i 34 mają zastosowanie do obu sytuacji, wytyczne nr 16–22 mają zastosowanie jedynie do dobrowolnego przenoszenia, a wytyczne nr 23–32 mają zastosowanie jedynie do cofnięcia rejestracji repozytorium transakcji. Zachęty i motywacje dla zainteresowanych stron w każdym z tych dwóch przypadków mogą być różne, w związku z czym każda konkretna sytuacja wymaga szczególnego podejścia.
8. W wytycznych ustalono ogólne zasady, które powinny być przestrzegane przez uczestników RT, np. RSE, kontrahentów i CCP z jednej strony oraz RT z drugiej strony. Zasady te są uzupełniane szczegółowymi procedurami określonymi w celu zapewnienia terminowego i sprawnego przeniesienia szczegółowych danych dotyczących instrumentów pochodnych. Niniejsze wytyczne nie obejmują jednak sytuacji, które nie wymagają przeniesienia danych, takich jak zgłaszających kontrahentów, którzy zdecydowali się dokonać zgłoszenia dwóm lub większej liczbie RT w tym samym czasie.

4 Zgodność i obowiązki sprawozdawcze

4.1 Status wytycznych

9. Zgodnie z art. 16 ust. 3 rozporządzenia w sprawie ustanowienia ESMA właściwe organy krajowe, repozytoria transakcji, kontrahenci dokonujący zgłoszenia i podmioty odpowiedzialne za zgłoszenie muszą dołożyć wszelkich starań, aby zastosować się do niniejszych wytycznych.
10. Właściwe organy, do których odnoszą się niniejsze wytyczne, powinny zastosować się do nich poprzez odpowiednie włączenie ich do swoich krajowych ram prawnych lub nadzorczych, również w przypadku, gdy poszczególne wytyczne są skierowane głównie do uczestników rynku finansowego. W takim przypadku właściwe organy powinny w ramach sprawowanego nadzoru zadbać o to, aby uczestnicy rynku finansowego przestrzegali wytycznych.
11. ESMA dokona oceny stosowania niniejszych wytycznych przez RT w ramach prowadzonego przez siebie bieżącego nadzoru bezpośredniego.

4.2 Obowiązki sprawozdawcze

12. W ciągu dwóch miesięcy od daty publikacji niniejszych wytycznych na stronie internetowej ESMA we wszystkich językach urzędowych UE właściwe organy, do których odnoszą się niniejsze wytyczne, mają obowiązek powiadomić ESMA, że (i) stosują się, (ii) nie stosują się, ale zamierzają zastosować się, lub (iii) nie stosują się i nie zamierzają zastosować się do niniejszych wytycznych.
13. W przypadku niezastosowania się do wytycznych właściwe organy mają obowiązek powiadomić ESMA o powodach niestosowania się do nich w ciągu dwóch miesięcy od ich publikacji na stronie internetowej ESMA we wszystkich językach urzędowych UE.
14. Szablon zawiadomienia jest dostępny na stronie internetowej ESMA. Po wypełnieniu szablonu należy przekazać go do ESMA.
15. RT nie mają obowiązku powiadamiania, czy stosują się do niniejszych wytycznych.
16. Kontrahenci dokonujący zgłoszenia i podmioty dokonujące zgłoszenia w ich imieniu nie mają obowiązku zawiadamiania, czy stosują się do niniejszych wytycznych.

5 Zmiany wytycznych dotyczących przenoszenia danych pomiędzy repozytoriami transakcji na podstawie rozporządzenia EMIR

17. Wytyczne nr 11, 15, 18, 19, 23 i 26 stanowiące część wytycznych dotyczących przenoszenia danych pomiędzy repozytoriami transakcji na mocy rozporządzenia EMIR otrzymują brzmienie:

Wytyczna 11. Przed przeniesieniem danych w dniu niebędącym dniem roboczym repozytoria transakcji powinny zapewnić, by uczestnicy RT modyfikowali aktywne instrumenty pochodne, które podlegają przenoszeniu danych, w celu spełnienia aktualnego wymogu w zakresie zgłaszania najpóźniej do godziny 23:59:59 w piątek przed weekendem, w którym odbywa się przeniesienie, oraz

- (i) w przypadku pełnego przeniesienia, od początku przeniesienia danych, poprzednie RT nie powinno przyjmować zgłoszeń dotyczących zdarzeń występujących w cyklu życia ani danych dotyczących pozycji w odniesieniu do instrumentów pochodnych będących przedmiotem przeniesienia;
- (ii) a ponadto, w przypadku częściowego przeniesienia, uczestnik RT powinien zapewnić właściwe zgłoszenie do odpowiednich RT zdarzeń występujących w cyklu życia instrumentów pochodnych.

W przypadku przeniesień w dni robocze poprzednie RT i nowe RT mają uzgodnić termin, przed przeniesieniem danych, w którym uczestnik RT powinien dokonać modyfikacji aktywnych instrumentów pochodnych, które podlegają przeniesieniu danych. W przypadku przeniesień w dni robocze poprzednie RT oraz uczestnik RT powinni stosować się do pkt (i) i (ii).

Wytyczna 15. W przypadku gdy nie wszystkie dane objęte planem migracji mogą zostać przeniesione jednorazowo, RT powinny przenosić dane w następującej kolejności:

- (i) aktualny stan otrzymanych aktywnych instrumentów pochodnych, tj. „stan transakcji” (trade state);
- (ii) w przypadku cofnięcia rejestracji – zgłoszenia dotyczące zdarzeń występujących w cyklu życia mających zastosowanie do aktywnych instrumentów pochodnych;
- (iii) w przypadku cofnięcia rejestracji – wszystkie zamknięte, skompresowane i zapadłe instrumenty pochodne, które nadal podlegają wymogowi na mocy art. 80 ust. 3 rozporządzenia EMIR, wraz z odpowiednimi zdarzeniami występującymi w cyklu życia;
- (iv) w przypadku cofnięcia rejestracji – wszystkie błędne instrumenty pochodne, które nadal podlegają wymogowi na mocy art. 80 ust. 3 rozporządzenia EMIR, wraz z odpowiednimi zdarzeniami występującymi w cyklu życia;
- (v) w przypadku cofnięcia rejestracji – wszystkie odrzucone instrumenty pochodne zgłoszone przez uczestnika RT, które nie przeszły walidacji danych;
- (vi) w przypadku cofnięcia rejestracji – rejestr zgłoszeń poprzedniego RT w formacie nadającym się do odczytu maszynowego, w którym zapisuje się powód lub powody zmiany, datę, znacznik czasu i jasny opis zmian (w tym starą i nową treść odpowiednich danych) dotyczących przenoszonych instrumentów pochodnych; oraz
- (vii) w przypadku cofnięcia rejestracji – wszystkie dane dotyczące odrzuceń, tj. sprawozdania wychodzące dla organów nadzoru dotyczące odrzuceń w formacie XML, oraz wszystkie dane dotyczące rekonyliacji, tj. sprawozdania wychodzące dla organów nadzoru dotyczące statusu rekonyliacji w formacie XML.

Wytyczna 18. W przypadku przeniesienia danych na wniosek uczestnika RT oraz w przypadku gdy rejestracja poprzedniego RT nie została cofnięta ani nie jest w trakcie procesu wycofywania, należy przekazać jedynie aktualny stan aktywnych instrumentów pochodnych, tj. „stan transakcji”.

Wytyczna 19. W przypadku przeniesienia danych na wniosek uczestnika RT poprzednie i nowe RT powinny postępować zgodnie z procedurą opisaną w załączniku I dotyczącą przenoszenia danych na wniosek uczestnika RT zgodnie z rozporządzeniem EMIR. RT powinny uzgodnić plan migracji w zakresie przeniesienia danych danego uczestnika RT tak szybko, jak to możliwe, nie później niż w terminie dziesięciu dni roboczych od otrzymania wniosku.

Wytyczna 23. W przypadku cofnięcia rejestracji RT przeniesienie danych powinno obejmować wszystkie szczegółowe informacje dotyczące instrumentów pochodnych zgłoszonych do RT, w tym odrzuconych, wraz z odpowiednim rejestrem zgłoszeń i wszystkimi danymi dotyczącymi odrzuceń, czyli sprawozdaniami wychodzącymi dla organów nadzoru dotyczącymi odrzuceń w formacie XML, a także wszystkie dane dotyczące rekonyliacji, czyli sprawozdania wychodzące dla organów nadzoru dotyczące statusu uzgadniania w formacie XML. Należy przestrzegać kolejności przenoszenia danych przedstawionej w wytycznej 15.

Wytyczna 26. W przypadku cofnięcia rejestracji na wniosek RT powinno ono powiadomić ESMA z wyprzedzeniem o planowanej dacie zakończenia działalności, a następnie niezwłocznie powiadomić drogą elektroniczną uczestników RT, pozostałe RT oraz odpowiednie właściwe organy krajowe. W przypadku RT z ponad 500 uczestnikami RT powiadomienie powinno zostać wysłane z wyprzedzeniem co najmniej dziewięciu miesięcy, a w przypadku RT z 500 lub mniej niż 500 uczestnikami RT – co najmniej sześciu miesięcy.

18. Do istniejących wytycznych dotyczących przenoszenia danych między repozytoriami transakcji na podstawie EMIR dodaje się nowe wytyczne nr 30–34 w brzmieniu:

Wytyczna 30. W przypadku cofnięcia rejestracji nowe RT może pobierać opłaty od aktywnych uczestników RT za ich dane dotyczące nieaktywnych instrumentów pochodnych.

Wytyczna 31. W przypadku cofnięcia rejestracji nowe RT może przechowywać dane dotyczące nieaktywnych instrumentów pochodnych, o różnej jakości danych lub w różnych formatach w odrębnych bazach danych/tabelach. Nowe RT powinno odpowiadać na zapytania organów nadzoru na żądanie.

Wytyczna 32. W przypadku cofnięcia rejestracji RT, którego rejestracja zostanie cofnięta, powinno przekazać nowemu RT niezbędne informacje techniczne dotyczące danych, które mają zostać przeniesione, w celu ułatwienia przeniesienia danych do nowego repozytorium, a następnie ich przechowywania przez nowe repozytorium. Poprzednie RT powinno dostarczyć nowemu RT wspomniane wcześniej informacje w odpowiednim terminie, aby umożliwić nowemu RT przygotowanie w razie potrzeby. Dokumentacja techniczna powinna obejmować co najmniej następujące aspekty:

- (i) przyporządkowanie pól do pól dotyczących rozporządzenia EMIR; oraz
- (ii) wyjaśnienia techniczne dla każdego pola.

Wytyczna 33. Przed przeniesieniem danych uczestnika RT i po nim uczestnik RT powinien zweryfikować i potwierdzić z nowym i poprzednim RT poprawność następujących informacji zbiorczych dotyczących instrumentów pochodnych będących przedmiotem przeniesienia, zgodnie z harmonogramem wyszczególnionym w wytycznej 11:

- (i) całkowita liczba aktywnych instrumentów pochodnych, przy czym każdy instrument pochodny określa się za pomocą niepowtarzalnej kombinacji pól „Kontrahent dokonujący zgłoszenia”, „Inny kontrahent” i „Niepowtarzalny identyfikator transakcji”, wraz z odpowiednimi zgłoszeniami dotyczącymi depozytów zabezpieczających;
- (ii) całkowita liczba zgłoszeń dotyczących zdarzeń występujących w cyklu życia tych instrumentów pochodnych (w przypadku ich przeniesienia);
- (iii) całkowita liczba rekordów dotyczących zamkniętych, skompresowanych i zapadłych instrumentów pochodnych w ciągu ostatnich pięciu lat, w odniesieniu do których istnieje obowiązek prowadzenia dokumentacji zgodnie z art. 9 ust. 2 rozporządzenia EMIR (w przypadku gdy są one przenoszone);

(iv) całkowita liczba rekordów dotyczących błędnych instrumentów pochodnych w ciągu ostatnich pięciu lat, w odniesieniu do których istnieje obowiązek prowadzenia dokumentacji zgodnie z art. 9 ust. 2 rozporządzenia EMIR (w przypadku przeniesienia).

Wytyczna 34. W związku z wytyczną 58 Wytycznych dotyczących zgłaszania na podstawie art. 4 i 12 rozporządzenia SFTR, w przypadku gdy kontrahent finansowy (FC) i kontrahent niefinansowy minus (NFC-) zgłaszają do dwóch różnych repozytoriów transakcji aktywne instrumenty pochodne będące przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym podlegające przeniesieniu:

(i) jeżeli kontrahent niefinansowy minus (NFC-) zdecyduje się nie dokonywać zgłoszeń samodzielnie, to aktywne instrumenty pochodne kontrahenta niefinansowego minus (NFC-) powinny zostać przeniesione do RT kontrahenta finansowego (FC), chyba że kontrahent finansowy zdecyduje się zostać klientem RT kontrahenta niefinansowego minus (NFC-) i zgłaszać instrumenty pochodne zawarte z kontrahentem niefinansowym minus (NFC-) do RT kontrahenta NFC-.

(ii) za każdym razem, gdy kontrahent niefinansowy zmienia swój status z kontrahenta niefinansowego+ (NFC+) na kontrahenta niefinansowego minus (NFC-) i podejmuje decyzję o niezgłaszaniu przez siebie własnych instrumentów pochodnych, powinien zwrócić się o przeniesienie własnych aktywnych instrumentów pochodnych zawartych z kontrahentem finansowym (FC) do RT tego kontrahenta finansowego z dniem zmiany swojego statusu, chyba że kontrahent finansowy (FC) zdecyduje się zostać klientem RT kontrahenta niefinansowego minus (NFC-) i zgłaszać instrumenty pochodne zawarte z kontrahentem niefinansowym minus (NFC-) do RTNFC-. Podobnie za każdym razem, gdy kontrahent niefinansowy zmienia swój status z kontrahenta niefinansowego minus (NFC-) na kontrahenta niefinansowego+ (NFC+), to aktywne instrumenty pochodne zawarte z kontrahentem finansowym powinny zostać przeniesione z powrotem do RT kontrahenta niefinansowego, chyba że kontrahent niefinansowy zdecyduje się zostać klientem RT kontrahenta finansowego i zgłaszać instrumenty pochodne zawarte z kontrahentem finansowym do RT FC.

(iii) Na potrzeby przeniesienia danych nie oczekuje się, że kontrahent niefinansowy ani kontrahent finansowy (ani żaden podmiot dokonujący zgłoszenia w ich imieniu) przeniosą się do repozytoriów transakcji drugiego kontrahenta.

5.1 Załącznik I – Procedura przeniesienia danych na wniosek uczestnika RT zgodnie z rozporządzeniem EMIR

A. Planowanie i przygotowanie

Po podpisaniu odpowiedniego porozumienia umownego z uczestnikiem RT nowe RT kontaktuje się z poprzednim RT i uzgadnia plan migracji opracowany zgodnie z wytyczną 3.

Nowe RT powiadamia pocztą elektroniczną odpowiednie organy nadzoru o dokonaniu przeniesienia.

Poprzednie RT określa i uzgadnia z uczestnikiem RT następujące informacje zbiorcze dotyczące instrumentów pochodnych uczestnika RT podlegających przeniesieniu:

- o Aktualny stan otrzymanych aktywnych instrumentów pochodnych, tj. „stan transakcji”
- o Całkowita liczba aktywnych instrumentów pochodnych

Poprzednie RT powinno żądać od uczestnika RT potwierdzenia zgodności powyższych informacji z rekordami uczestnika RT¹² zgodnie z wytyczną 8. W przypadku rozbieżności poprzednie RT powinno uzgodnić z uczestnikiem RT odpowiednią liczbę rozbieżności i uzgodnić ostateczny wykaz zgłoszeń instrumentów pochodnych, które zostaną przeniesione. Poprzednie RT powinno usunąć wszystkie rozbieżności *w najwcześniejszym możliwym terminie, lecz nie później niż w ciągu pięciu dni roboczych.*

B. Realizacja przeniesienia

Po potwierdzeniu liczby instrumentów pochodnych i rekordów poprzednie RT powinno przystąpić do wygenerowania odpowiedniego pliku (odpowiednich plików) zgodnie z wytyczną 5 i stosownymi zasadami ogólnymi.

Poprzednie i nowe RT wykonują plan migracji. Poprzednie RT powinno przenieść wygenerowane pliki do nowego RT, które potwierdza przeniesienie plików.

W związku z tym aktywne instrumenty pochodne powinny być przenoszone w uprzednio ustalony weekend lub w uzgodniony dzień roboczy.

C. Weryfikacja przeniesienia danych

Nowe RT powinno określić następujące wartości i informacje dotyczące otrzymanych rekordów i zweryfikować kompletność przeniesienia:

- o Aktualny stan otrzymanych aktywnych instrumentów pochodnych, tj. „stan transakcji”
- o Całkowita liczba aktywnych instrumentów pochodnych

Nowe RT powinno zażądać od uczestnika RT potwierdzenia zgodności powyższych informacji z rekordami uczestnika RT¹³ zgodnie z wytyczną 33. W przypadku rozbieżności obydwie RT powinny starać się uzgodnić odpowiednie wartości z uczestnikiem RT aż do momentu osiągnięcia porozumienia.

¹² Zgodnie z art. 9 ust. 2 rozporządzenia EMIR „Kontrahenci prowadzą ewidencję wszystkich zawartych przez siebie kontraktów pochodnych oraz wszelkich zmian przez co najmniej pięć lat od daty rozwiązania kontraktu”. W przypadku zgłaszającego uczestnika RT, który dokonuje zgłoszenia w imieniu innych, powinien on korzystać również z własnych zapisów.

¹³ Zgodnie z art. 9 ust. 2 rozporządzenia EMIR „Kontrahenci prowadzą ewidencję wszystkich zawartych przez siebie kontraktów pochodnych oraz wszelkich zmian przez co najmniej pięć lat od daty rozwiązania kontraktu”. W przypadku zgłaszającego uczestnika RT, który dokonuje zgłoszenia w imieniu innych, powinien on korzystać również z własnych zapisów.

| |
|--|
| D. Ostateczne powiadomienia |
| Nowe RT powinno powiadomić wszystkie RT o tym, że uczestnik zgłaszający zmienił RT. Informacja taka powinna być użyta w celu umożliwienia rekoncyliacji odpowiednich instrumentów pochodnych, które zostały przeniesione do nowego RT. |
| Nowe RT powinno powiadomić odpowiednie NCA oraz ESMA o zakończeniu przenoszenia danych uczestnika RT oraz określić rodzaje przeniesionych instrumentów pochodnych. |
| E. Prowadzenie ewidencji i bezpieczne usuwanie danych |
| Poprzednie RT powinno usunąć przeniesione aktywne instrumenty pochodne ze wszystkich zagregowanych danych. |
| Poprzednie RT powinno zachować przeniesione dane tak długo, jak jest to zalecane zgodnie z ogólnymi zasadami oraz zgodnie z wymogami rozporządzenia EMIR obowiązującymi przed dokonaniem przeniesienia. |
| Poprzednie RT powinno zachować rejestr zgłoszeń przez co najmniej 10 lat od zakończenia obowiązywania odpowiednich kontraktów. |
| Poprzednie RT zniszczy/usunie przeniesione dane, kiedy będzie to dozwolone, zgodnie z odpowiednimi ogólnymi zasadami dotyczącymi bezpiecznego usuwania/niszczenia. |

5.2 Załącznik II – Procedura migracji w przypadku cofnięcia rejestracji zgodnie z rozporządzeniem EMIR

| |
|--|
| <p>A. Powiadomienia wstępne</p> <p>(Wycofanie dobrowolne) RT powiadamia ESMA, uczestników RT, inne zaangażowane RT i NCA o złożeniu wniosku o wycofanie swojej rejestracji co najmniej przed (zgodnie z wytyczną 26) planowaną datą zakończenia działalności (w przypadku, gdy o wycofanie wnioskuje RT).</p> <p>lub</p> <p>(Wycofanie niedobrowolne) ESMA powiadamia nowe RT i NCA o tym, że nowe RT powinno (powinny) otrzymać dane, które zostały pierwotnie zgłoszone do poprzedniego RT (w przypadku gdy o wycofanie nie wnioskuje RT).</p> |
| <p>B. Planowanie i przygotowanie</p> <p>Poprzednie RT informuje uczestników RT o zamiarze zakończenia działalności. RT przygotowuje(-ą) plan migracji określony w wytycznej 3 oraz składa(-ją) go do ESMA oraz do nowego (nowych) RT. ESMA oraz inne zaangażowane RT zgłaszają ewentualne zastrzeżenia lub uwagi, a po ich rozstrzygnięciu wszystkie strony uzgadniają szczegóły dotyczące planu migracji.</p> <p>Poprzednie RT określa instrumenty pochodne podlegające przeniesieniu oraz przekazuje ESMA i innym zaangażowanym RT (w ramach planu migracji lub oddzielnie) następujące informacje dotyczące instrumentów pochodnych podlegających przeniesieniu, z podziałem na RT:</p> <ul style="list-style-type: none"> o Aktualny stan otrzymanych aktywnych instrumentów pochodnych, tj. „stan transakcji” o Całkowita liczba aktywnych instrumentów pochodnych o Całkowita liczba rekordów dotyczących zdarzeń występujących w cyklu życia aktywnych instrumentów pochodnych o Całkowita liczba rekordów dotyczących zamkniętych, skompresowanych i zapadłych instrumentów pochodnych o Całkowita liczba rekordów dotyczących błędnych instrumentów pochodnych o Całkowita liczba rekordów dotyczących odrzuconych instrumentów pochodnych zgłoszonych przez uczestnika RT, które nie przeszły walidacji danych o Liczba wpisów w rejestrze zgłoszeń o Liczba raportów wychodzących do organów nadzoru dotyczących odrzuceń w formacie XML i liczba raportów wychodzących do organów nadzoru dotyczących statusu rekonyliacji w formacie XML |
| <p>C. Realizacja przeniesienia</p> |
| <p>Po potwierdzeniu liczby instrumentów pochodnych i rekordów poprzednie RT powinno przystąpić do wygenerowania odpowiedniego pliku (odpowiednich plików) zgodnie z wytyczną 5.</p> |

Poprzednie i nowe RT wykonują plan migracji. Wygenerowane pliki są przenoszone z poprzedniego RT do nowego (nowych) RT, które potwierdzają każde przeniesienie.

Należy przestrzegać kolejności przenoszenia instrumentów pochodnych i rekordów podanej w wytycznej 15.

W miarę możliwości aktywne instrumenty pochodne powinny być przenoszone w trakcie weekendu lub w ciągu uzgodnionego dnia roboczego, podczas gdy odpowiadające im zdarzenia występujące w cyklu życia oraz wyceny/zabezpieczenia powinny zostać przeniesione w najwcześniejszym możliwym terminie.

Jeżeli nie jest to możliwe, aktywne instrumenty pochodne należy podzielić według uczestnika RT na dwie partie lub więcej partii, które zostaną przeniesione w kolejne weekendy lub w uzgodnione dni robocze. Odpowiednie zdarzenia występujące w cyklu życia każdej partii powinny zostać przeniesione w najwcześniejszym możliwym terminie.

Pozostałe instrumenty pochodne należy przenieść jak najszybciej.

Wszelkie zidentyfikowane problemy i dokonane postępy są zgłaszane regularnie ESMA w sposób terminowy.

D. Weryfikacja przeniesienia danych

Nowe RT powinno (powinny) określić następujące wartości i informacje dotyczące otrzymanych rekordów i zweryfikować kompletność przeniesienia:

- Aktualny stan otrzymanych aktywnych instrumentów pochodnych, tj. „stan transakcji”
- Całkowita liczba aktywnych instrumentów pochodnych
- Całkowita liczba rekordów dotyczących zdarzeń występujących w cyklu życia aktywnych instrumentów pochodnych
- Całkowita liczba rekordów dotyczących zamkniętych, skompresowanych i zapadłych instrumentów pochodnych
- Całkowita liczba rekordów dotyczących błędnych instrumentów pochodnych
- Całkowita liczba rekordów dotyczących odrzuconych instrumentów pochodnych zgłoszonych przez uczestnika RT, które nie przeszły walidacji danych
- Liczba wpisów w rejestrze zgłoszeń
- Całkowita liczba raportów wychodzących do organów nadzoru dotyczących odrzuceń w formacie XML i liczba raportów wychodzących do organów nadzoru dotyczących statusu uzgodnienia w formacie XML

Nowe RT powinny powiadomić ESMA oraz poprzednie RT o wyniku weryfikacji. W przypadku niepowodzenia weryfikacji podstawowa przyczyna jest badana przez obydwie strony (poprzednie i nowe RT), a proces przeniesienia jest powtarzany do momentu pomyślnego przeniesienia danych.

E. Ostateczne powiadomienia

Nowe RT powinny powiadomić odpowiednich uczestników RT, wszystkie pozostałe RT oraz odpowiednie NCA (pocztą elektroniczną) o pomyślnym zakończeniu przeniesienia.

F. Prowadzenie ewidencji i bezpieczne usuwanie danych

Poprzednie RT powinny zachować przeniesione dane przez okres określony w wytycznej 28 oraz zgodnie z wymogami rozporządzenia EMIR obowiązującymi przed dokonaniem przeniesienia.

Poprzednie RT powinny zniszczyć/usunąć przeniesione dane, kiedy jest to dozwolone, zgodnie z odpowiednimi zasadami dotyczącymi bezpiecznego usuwania/niszczenia określonymi w wytycznej 28.

Wytyczne dotyczące przenoszenia danych pomiędzy repozytoriami transakcji na podstawie rozporządzenia SFTR

1 Zakres stosowania

Kto?

1. Niniejsze wytyczne mają zastosowanie do repozytoriów transakcji (RT) zarejestrowanych lub uznanych przez ESMA, właściwych organów krajowych (NCA) oraz kontrahentów dokonujących zgłoszeń lub podmiotów dokonujących zgłoszeń w ich imieniu.

Co?

2. Przyjęte wytyczne mają zastosowanie w odniesieniu do:
 - a. zgłaszania szczegółowych informacji dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przez kontrahentów lub podmioty dokonujące zgłoszenia w ich imieniu zgodnie z art. 4 ust. 1 SFTR;
 - b. procedur dotyczących przenoszenia danych zgodnie z art. 78 ust. 9 rozporządzenia EMIR, o których mowa w art. 5 ust. 2 rozporządzenia SFTR;
 - c. przenoszenia danych dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych między repozytoriami transakcji na wniosek kontrahentów lub podmiotu zgłaszającego w ich imieniu, lub w sytuacji, w której rejestracja RT została cofnięta, objęte art. 79 ust. 3 rozporządzenia EMIR, zgodnie z art. 5 ust. 2 rozporządzenia SFTR;
 - d. prowadzenia rejestru szczegółowych informacji dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych zgodnie z art. 80 ust. 3 rozporządzenia EMIR, zgodnie z art. 5 ust. 2 rozporządzenia SFTR; oraz
 - e. art. 21 ust. 2 regulacyjnych standardów technicznych dotyczących rejestracji na podstawie rozporządzenia SFTR.

Kiedy?

3. Niniejsze wytyczne mają zastosowanie od dnia 3 października 2022 r.

2 Odniesienia do przepisów prawa, skróty i definicje

2.1 Odniesienia do przepisów prawa

| | |
|--|--|
| <i>regulacyjny standard techniczny dotyczący agregacji danych</i> | rozporządzenie delegowane Komisji (UE) 2019/358 z dnia 13 grudnia 2018 r. uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych w zakresie gromadzenia, weryfikacji, agregacji, porównywania i publikacji danych dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przez repozytoria transakcji ¹⁴ |
| <i>regulacyjny standard techniczny dotyczący dostępu do danych</i> | rozporządzenie delegowane Komisji (UE) 2019/357 z dnia 13 grudnia 2018 r. uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych w sprawie dostępu do szczegółowych informacji dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywanych w repozytoriach transakcji ¹⁵ |
| <i>regulacyjny standard techniczny dotyczący rejestracji</i> | rozporządzenie delegowane Komisji (UE) 2019/359 z dnia 13 grudnia 2018 r. uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych określających szczegóły dotyczące wniosku o rejestrację i o rozszerzenie rejestracji jako repozytorium transakcji ¹⁶ |
| <i>regulacyjny standard techniczny dotyczący sprawozdawczości</i> | rozporządzenie delegowane Komisji (UE) 2019/356 z dnia 13 grudnia 2018 r. uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych określających szczegółowe informacje dotyczące transakcji finansowanych z |

¹⁴ Dz.U. L 81 z 22.3.2019, s. 30–44.

¹⁵ Dz.U. L 81 z 22.3.2019, s. 22–29.

¹⁶ Dz.U. L 81 z 22.3.2019, s. 45–57.

użyciem papierów wartościowych, które należy zgłaszać repozytoriom transakcji¹⁷

rozporządzenie EMIR rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 z dnia 4 lipca 2012 r. w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i repozytoriów transakcji¹⁸

rozporządzenie SFTR rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 z dnia 25 listopada 2015 r. w sprawie przejrzystości transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ponownego wykorzystania oraz zmiany rozporządzenia (UE) nr 648/2012¹⁹

rozporządzenie w sprawie ustanowienia ESMA rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 1095/2010 z dnia 24 listopada 2010 r. w sprawie ustanowienia Europejskiego Urzędu Nadzoru (Europejskiego Urzędu Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych), zmiany decyzji nr 716/2009/WE i uchylecia decyzji Komisji 2009/77/WE²⁰

wykonawczy standard techniczny dotyczący sprawozdawczości rozporządzenie wykonawcze Komisji (UE) 2019/363 z dnia 13 grudnia 2018 r. ustanawiające wykonawcze standardy techniczne w odniesieniu do formatu i częstotliwości dokonywania zgłoszeń szczegółowych informacji dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych do repozytoriów transakcji zgodnie z rozporządzeniem Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 oraz zmieniające rozporządzenie wykonawcze Komisji (UE) nr 1247/2012 w odniesieniu do stosowania kodów sprawozdawczych w zgłoszeniach dotyczących instrumentów pochodnych²¹

wytyczne dotyczące pozycji wytyczne dotyczące obliczania pozycji w transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych przez repozytoria transakcji na podstawie rozporządzenia SFTR²²

¹⁷ Dz.U. L 81 z 22.3.2019, s. 1–21.

¹⁸ Dz.U. L 201 z 27.7.2012, s. 1.

¹⁹ Dz.U. L 337 z 23.12.2015, s. 1.

²⁰ Dz.U. L 331 z 15.12.2010, s. 84–119.

²¹ Dz.U. L 81 z 22.3.2019, s. 85–124.

²² ESMA74-362-1986.

*wytyczne dotyczące
zgłaszania transakcji
finansowanych z
użyciem papierów
wartościowych*

wytyczne dotyczące zgłaszania na podstawie art. 4 i 12
rozporządzenia SFTR²³

2.2 Skróty

| | |
|--------------|---|
| <i>CSV</i> | wartości oddzielone przecinkiem |
| <i>DK</i> | dokument konsultacyjny |
| <i>EBC</i> | Europejski Bank Centralny |
| <i>EOG</i> | Europejski Obszar Gospodarczy |
| <i>ERR</i> | podmiot odpowiedzialny za zgłoszenie |
| <i>ESMA</i> | Europejski Urząd Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych |
| <i>FSB</i> | Rada Stabilności Finansowej |
| <i>ISO</i> | Międzynarodowa Organizacja Normalizacyjna |
| <i>KBC</i> | krajowy bank centralny |
| <i>LEI</i> | identyfikator podmiotu prawnego |
| <i>NCA</i> | właściwy organ krajowy |
| <i>RSE</i> | podmiot dokonujący zgłoszenia |
| <i>RT</i> | repozytorium transakcji |
| <i>SFTP</i> | protokół przesyłania plików SSH |
| <i>SLA</i> | umowa o gwarantowanym poziomie usług |
| <i>TRACE</i> | system dostępu do danych RT |
| <i>UE</i> | Unia Europejska |

²³ ESMA70-151-270.

2.3 Glosariusz pojęć i terminów

Wszystkie definicje, pojęcia i terminy, które są stosowane w SFTR, obowiązującym regulacyjnym standardzie technicznym dotyczącym sprawozdawczości (SFTR) i wykonawczym standardzie technicznym dotyczącym sprawozdawczości (SFTR), jak również w obowiązującym regulacyjnym standardzie technicznym dotyczącym dostępu do danych (SFTR) oraz w pytaniach i odpowiedziach, a także w niniejszych wytycznych, mają takie samo znaczenie.

Do celów niniejszych wytycznych zdefiniowano/opisano następujące terminy:

- „active client” / „klient aktywny” oznacza uczestnika RT, który posiada w RT aktywne transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych.
- „entity responsible for the report” / „podmiot odpowiedzialny za zgłoszenie” (zwany dalej „ERR”) oznacza jednego z kontrahentów (zgodnie z regulacyjnymi standardami technicznymi dotyczącymi sprawozdawczości (SFTR)); należy go rozumieć jako kontrahenta finansowego odpowiedzialnego za dokonanie zgłoszenia w imieniu drugiego kontrahenta.
- „errored SFT” / „błędna transakcja finansowana z użyciem papierów wartościowych” oznacza transakcję finansowaną z użyciem papierów wartościowych, która została zgłoszona do RT w wyniku błędu. Jest oznaczona za pomocą komunikatu „EROR”.
- „life-cycle events” / „zdarzenia występujące w cyklu życia” obejmują wszystkie komunikaty odnoszące się do danej transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych.
- „matured SFT” / „zapadła transakcja finansowana z użyciem papierów wartościowych” oznacza transakcję finansowaną z użyciem papierów wartościowych, która jest zgłaszana do repozytorium transakcji i w określonym czasie osiągnęła uzgodniony umownie termin zapadalności.
- „nowe RT” oznacza RT, do którego uczestnik RT rozpoczął lub zamierza rozpocząć zgłaszanie umów dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych zgodnie z art. 4 SFTR, chociaż początkowo podmiot ten zgłaszał je poprzedniemu RT, bezpośrednio lub za pośrednictwem RSE.
- „non-active client” / „klient nieaktywny” oznacza uczestnika RT, który nie posiada już w RT aktywnych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych.
- „poprzednie RT” oznacza RT, do którego uczestnik RT zgłaszał transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych lub do którego kontrahent RT zgłaszał umowy dotyczące uczestnika RT na podstawie art. 4 SFTR, ale (i)

uczestnik RT postanowił zaprzestać zgłaszania ustaleń umownych lub (ii) rejestracja RT została cofnięta.

- „outstanding SFT” / „aktywna transakcja finansowana z użyciem papierów wartościowych” oznacza transakcję finansowaną z użyciem papierów wartościowych, której termin wymagalności nie upłynął lub która nie była przedmiotem komunikatów typu „EROR”, „ETRM” lub „POSC”, o których mowa w polu 98 w tabeli 2 w załączniku I do wykonawczego standardu technicznego dotyczącego sprawozdawczości (SFTR).
- „portability” / „możliwość przenoszenia” oznacza możliwość przeniesienia rekordów danych dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych zgłoszonych na podstawie art. 4 SFTR z poprzedniego RT do nowego RT, zgodnie z definicją zawartą w niniejszych wytycznych.
- „positions” / „pozycje” oznaczają odzwierciedlenie ekspozycji między parą kontrahentów, zgodnie z wytycznymi dotyczącymi pozycji (SFTR).
- „reconciliation” / „rekoncyliacja” oznacza proces, za pomocą którego RT potwierdzają, że obie strony transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych zostały zgłoszone z tymi samymi informacjami przez każdy ERR.
- „rejections” / „odrzućenia” oznaczają, że transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych zostały odrzucone przez RT z powodu błędów w informacjach zgłoszonych przez ERR lub RSE.
- „report submitting entity” / „podmiot dokonujący zgłoszenia” (zwany dalej RSE) oznacza jednego z kontrahentów (zgodnie z standardami technicznymi dotyczącymi dokonywania zgłoszeń²⁴); należy go rozumieć jako podmiot, który wszedł w stosunek umowy z zarejestrowanym lub uznawanym RT oraz:
 - zgłasza wyłącznie transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych, w przypadku gdy jest jednym z kontrahentów, w którym to przypadku jest tożsamy z kontrahentem zgłaszającym kontrakt lub innym kontrahentem, oraz
 - zgłasza transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych, w przypadku których jest albo nie jest jednym z kontrahentów.
- „terminated SFT” / „zamknięta transakcja finansowana z użyciem papierów wartościowych” oznacza transakcję finansowaną z użyciem papierów wartościowych, która została zamknięta przed umownym terminem zapadalności przez dwóch kontrahentów i jest identyfikowana za pomocą komunikatu „ETRM”.
- „transfer” lub „transfer (of details) of SFT” / „przeniesienie” lub „przeniesienie danych dotyczących) transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych” oznacza czynność lub proces przeniesienia rekordów danych

²⁴ <https://eur-lex.europa.eu/legal-content/EN/TXT/?uri=CELEX%3A32017R0104>

dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, odpowiednio, z poprzedniego RT do nowego RT.

- „uczestnik RT”²⁵ oznacza podmiot, który posiada stosunek umowny mający na celu zgłaszanie umów dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych zgodnie z art. 4 SFTR z przynajmniej jednym zarejestrowanym lub uznanym RT. Uczestnikiem repozytorium transakcji może być RSE, ERR, kontrahent dokonujący zgłoszenia lub kontrahent centralny (tj. CCP).

3 Cel

4. Celem niniejszych wytycznych jest ustanowienie spójnych, wydajnych i skutecznych praktyk nadzorczych w ramach ESNF oraz zapewnienie wspólnego, jednolitego i spójnego ich stosowania poprzez dostarczanie wyjaśnień RT, kontrahentom dokonującym zgłoszenia i podmiotowi odpowiedzialnemu za zgłoszenie w celu zapewnienia zgodności z następującymi przepisami rozporządzenia SFTR:
 - a. art. 4 ust. 1 rozporządzenia SFTR, który stanowi: „Kontrahenci transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych zgłaszają szczegółowe informacje dotyczące wszelkich transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, które zawarli, jak również informacje o wszelkich zmianach w takich transakcjach lub o ich zakończeniu, do repozytorium transakcji zarejestrowanego zgodnie z art. 5 lub uznanego zgodnie z art. 19. Informacje te są zgłaszane nie później niż w dniu roboczym następującym po zawarciu, zmianie lub zakończeniu transakcji”.
 - b. art. 80 ust. 3 rozporządzenia EMIR, który stanowi, że „Repozytorium transakcji bezzwłocznie rejestruje dane otrzymane na mocy art. 9 i przechowuje je przez co najmniej dziesięć lat po rozwiązaniu danych kontraktów. Repozytorium transakcji stosuje szybkie i wydajne procedury rejestrowania w celu udokumentowania zmian zarejestrowanych informacji”, o którym mowa w art. 5 ust. 2 rozporządzenia SFTR;
 - c. art. 79 ust. 3 rozporządzenia EMIR, który stanowi, że „Repozytorium transakcji, któremu cofnięto zezwolenie, zapewnia należyte zastępstwo, w tym przeniesienie danych do innych repozytoriów transakcji oraz przekierowanie przepływów sprawozdawczych do innych repozytoriów transakcji”, jak określono w art. 5 ust. 2 rozporządzenia w sprawie transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych (SFTR), oraz
 - d. procedury dotyczące przenoszenia zgodnie z art. 78 ust. 9 rozporządzenia EMIR, o których mowa w art. 5 ust. 2 rozporządzenia SFTR.

²⁵ Niektóre RT mogą ponadto określać rodzaje uczestników RT, takie jak uczestnicy zgłaszający, ogólnie zgłaszający czy niezgłaszający. Takie podkategorie są przejrzyste z perspektywy niniejszych wytycznych.

5. Podstawę wytycznych stanowi art. 16 ust. 1 rozporządzenia w sprawie ustanowienia ESMA, który stanowi, że „w celu ustanowienia spójnych, wydajnych i skutecznych praktyk nadzorczych w ramach ESNF oraz zapewnienia wspólnego, jednolitego i spójnego stosowania prawa Unii Urząd wydaje wytyczne skierowane do wszystkich właściwych organów lub wszystkich uczestników rynku finansowego, a także wydaje zalecenia skierowane do jednego właściwego organu lub większej liczby właściwych organów bądź do jednej instytucji finansowej lub większej liczby uczestników rynku finansowego”.
6. Nowe wytyczne dotyczące przenoszenia danych zgodnie z SFTR mają trzy cele:
 - a. usunięcie przeszkód związanych z przenoszeniem danych z konkurencyjnego środowiska RT oraz umożliwienie uczestnikom RT czerpania korzyści ze środowiska, w którym uczestniczy wiele RT;
 - b. zapewnienie organom nadzoru odpowiedniej jakości dostępnych danych, w tym agregacji dokonanych przez RT, nawet w przypadku gdy uczestnik RT zmienia RT, któremu dokonuje zgłoszeń, oraz bez względu na powód dokonania takiej zmiany;
 - c. zapewnienie zgodnego, ujednoliconego i zharmonizowanego sposobu przenoszenia rekordów z jednego RT do innego RT oraz wspieranie ciągłości zgłoszeń i rekonyliacji we wszystkich sprawach, w tym w przypadkach cofnięcia rejestracji RT.
7. Potrzeba przeniesienia danych do innego RT może powstać z różnych przyczyn. W związku z tym wytyczne obejmują oddzielnie sytuacje, w przypadku których (i) przeniesienie jest spowodowane cofnięciem rejestracji RT, a oddzielnie sprawy, w przypadku których (ii) przeniesienie następuje dobrowolnie w zwykłych warunkach rynkowych. Wytyczne nr 1–15 oraz wytyczne nr 33 i 34 mają zastosowanie do obu sytuacji, wytyczne nr 16–22 mają zastosowanie jedynie do dobrowolnego przenoszenia, a wytyczne nr 23–32 mają zastosowanie jedynie do wycofania rejestracji repozytorium transakcji. Zachęty i motywacje dla zainteresowanych stron w każdym z tych dwóch przypadków mogą być różne, w związku z czym każda konkretna sytuacja wymaga szczególnego podejścia.
8. W wytycznych ustalono ogólne zasady, które powinny być przestrzegane przez uczestników RT, np. RSE, kontrahentów i CCP z jednej strony oraz RT z drugiej strony. Zasady te są uzupełniane szczegółowymi procedurami określonymi w celu zapewnienia terminowego i sprawnego przeniesienia szczegółowych informacji dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych. Niniejsze wytyczne nie obejmują jednak sytuacji, które nie wymagają przeniesienia danych, takich jak zgłaszających kontrahentów, którzy zdecydowali się dokonać zgłoszenia dwóm lub większej liczbie RT w tym samym czasie.

4 Zgodność i obowiązki sprawozdawcze

4.1 Status wytycznych

9. Zgodnie z art. 16 ust. 3 rozporządzenia w sprawie ustanowienia ESMA właściwe organy krajowe, repozytoria transakcji, kontrahenci dokonujący zgłoszenia i podmioty odpowiedzialne za zgłoszenie muszą dołożyć wszelkich starań, aby zastosować się do niniejszych wytycznych.
10. Właściwe organy, do których odnoszą się niniejsze wytyczne, powinny zastosować się do nich poprzez odpowiednie włączenie ich do swoich krajowych ram prawnych lub nadzorczych, również w przypadku, gdy poszczególne wytyczne są skierowane głównie do uczestników rynku finansowego. W takim przypadku właściwe organy powinny w ramach sprawowanego nadzoru zadbać o to, aby uczestnicy rynku finansowego przestrzegali wytycznych.
11. ESMA dokona oceny stosowania niniejszych wytycznych przez RT w ramach prowadzonego przez siebie bieżącego nadzoru bezpośredniego.

4.2 Obowiązki sprawozdawcze

12. W ciągu dwóch miesięcy od daty publikacji niniejszych wytycznych na stronie internetowej ESMA we wszystkich językach urzędowych UE właściwe organy, do których odnoszą się niniejsze wytyczne, mają obowiązek powiadomić ESMA, że (i) stosują się, (ii) nie stosują się, ale zamierzają zastosować się, lub (iii) nie stosują się i nie zamierzają zastosować się do niniejszych wytycznych.
13. W przypadku niezastosowania się do wytycznych właściwe organy mają obowiązek powiadomić ESMA o powodach niestosowania się do nich w ciągu dwóch miesięcy od ich publikacji na stronie internetowej ESMA we wszystkich językach urzędowych UE.
14. Szablon zawiadomienia jest dostępny na stronie internetowej ESMA. Po wypełnieniu szablonu należy przekazać go do ESMA.
15. RT nie mają obowiązku powiadamiania, czy stosują się do niniejszych wytycznych.
16. Kontrahenci dokonujący zgłoszeń i podmioty dokonujące zgłoszenia w ich imieniu nie mają obowiązku zawiadamiania, czy stosują się do niniejszych wytycznych.

5 Wytyczne dotyczące przenoszenia danych pomiędzy repozytoriami transakcji na podstawie rozporządzenia SFTR

Wytyczna 1. Przeniesienie danych o transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych powinno zostać dokonane wyłącznie przez poprzednie RT i nowe RT. Nowe RT nie powinno przyjmować zgłoszeń dublujących się od uczestników RT dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych podlegających przeniesieniu. Poprzednie RT nie powinno przyjmować zgłoszeń z komunikatami „ETRM” i „EROR” dokonywanych przez uczestników RT w odniesieniu do transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych podlegających przeniesieniu.

Wytyczna 2. Przeniesienie danych powinno być dokonane przez RT zgodnie ze wspólnie uzgodnionym planem migracji. Plan migracji powinien zawierać szczegółowe rozplanowanie (terminy) oraz opis wymaganych mechanizmów kontrolnych, aby zapewnić terminowe, kompletne i dokładne przeniesienie danych.

Wytyczna 3. Wszystkie RT powinny korzystać ze standardowego szablonu planu migracji uzgodnionego wzajemnie przez wszystkie RT, zgodnego z treścią określoną w wytycznej 4.

Wytyczna 4. Plan migracji powinien zawierać następujące informacje:

- (i) zakres przeniesienia danych (np. uczestnik/uczestnicy RT, objęte transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych itp.);
- (ii) szczegółowy opis ról i obowiązków zaangażowanych podmiotów;
- (iii) harmonogram i główne etapy dokonania przeniesienia;
- (iv) mechanizmy kontrolne wymagane w celu zapewnienia poufności przenoszonych danych (np. rodzaj stosowanego szyfrowania);
- (v) mechanizmy kontrolne wymagane w celu zapewnienia integralności i dokładności przenoszonych danych (np. kryptograficzne sumy kontrolne i algorytmy skrótu);
- (vi) mechanizmy kontrolne wymagane w celu zapewnienia ciągłości operacji i zachowania statusu zgodności pomiędzy RT w odniesieniu do przenoszonych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych;
- (vii) nieprzekraczalny termin i dostępność danych; oraz
- (viii) wszelkie inne informacje ułatwiające i zapewniające sprawne przeniesienie danych.

Wytyczna 5. Repozytoria transakcji powinny przekazywać sobie nawzajem dane przy użyciu formatu XML i szablonu określonego zgodnie z art. 4 regulacyjnych standardów technicznych dotyczących dostępu do danych. Niezależnie od tego w przypadku (i) transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, które są nieaktywne w momencie przeniesienia, lub (iii) odrzuconych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych repozytoria transakcji mogą stosować pliki z wartościami oddzielnymi przecinkiem (csv). W plikach, które zostaną przeniesione, poprzednie RT powinno zamieścić

wszystkie odpowiednie szczegółowe informacje o transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych podlegających przeniesieniu.

Wytyczna 6. RT powinny korzystać z bezpiecznych protokołów machine-to-machine, w tym protokołu przesyłania plików SSH, w celu przenoszenia danych pomiędzy sobą.

Wytyczna 7. RT powinny korzystać z zaawansowanych protokołów szyfrowania oraz powinny wymieniać się odpowiednimi publicznymi kluczami kryptograficznymi ze swoimi partnerami. Aby zapewnić sprawne szyfrowanie danych, RT powinny z wyprzedzeniem sprawdzić, czy są w stanie zaszyfrować i odszyfrować pliki z danymi pochodzące od drugiej strony.

Wytyczna 8. Poprzednie RT powinno obliczyć liczbę transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz liczbę powiązanych zdarzeń występujących w cyklu życia, które zostaną przeniesione do nowego RT. Poprzednie RT powinno zażądać potwierdzenia przez uczestnika RT liczb dotyczących aktywnych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz powinno usunąć wszelkie rozbieżności w najwcześniejszym możliwym terminie, ale nie później niż w ciągu pięciu dni roboczych.

Wytyczna 9. Dla każdego wygenerowanego i przeniesionego pliku poprzednie RT powinno wygenerować kryptograficzną sumę kontrolną i uwzględnić ją podczas przenoszenia danych zgodnie ze wspólnie ustalonym algorytmem skrótu.

Wytyczna 10. Przeniesienie danych na wniosek uczestnika RT powinno zostać zrealizowane zasadniczo w dniu niebędącym dniem roboczym. Poprzednie i nowe RT mogą jednak zgodzić się na jego realizację w dniu roboczym w zależności od oczekiwanej wielkości przeniesienia.

Wytyczna 11. Przed przeniesieniem danych w dniu niebędącym dniem roboczym repozytoria transakcji powinny zapewnić, aby uczestnicy RT zmodyfikowali aktywne transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych, które podlegają przenoszeniu danych, w celu spełnienia najbardziej aktualnego wymogu w zakresie zgłaszania najpóźniej do godziny 23:59:59 w piątek przed weekendem, w którym odbywa się przeniesienie, oraz

- (i) w przypadku pełnego przeniesienia, od początku przeniesienia danych, poprzednie RT nie powinno przyjmować zgłoszeń dotyczących zdarzeń występujących w cyklu życia i danych dotyczących pozycji w odniesieniu do transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych będących przedmiotem przeniesienia;
- (ii) a ponadto, w przypadku częściowego przeniesienia, uczestnik RT powinien zapewnić dokładne zgłoszenie do odpowiednich RT zdarzeń występujących w cyklu życia transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych.

W przypadku przeniesień w dni robocze poprzednie RT i nowe RT mają uzgodnić termin, przed przeniesieniem danych, w którym uczestnik RT powinien dokonać modyfikacji aktywnych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, które podlegają przeniesieniu danych. W przypadku przeniesień w dni robocze poprzednie RT oraz uczestnik RT powinni stosować się do pkt (i) i (ii).

Wytyczna 12. Do momentu zakończenia przeniesienia wszystkich określonych plików podlegających przeniesieniu nowe RT nie powinno przyjmować zdarzeń występujących w cyklu życia ani danych o pozycjach dotyczących transakcji finansowych z użyciem papierów wartościowych podlegających przeniesieniu. Informacje o aktywnych transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych powinny być udostępnione przez poprzednie RT odpowiednim organom nadzoru.

Wytyczna 13. W momencie zakończenia przeniesienia danych nowe RT powinno:

- (i) udostępnić dane organom nadzoru;
- (ii) włączyć dane podlegające przeniesieniu do stosownych agregacji publicznych i przeznaczonych wyłącznie dla organów nadzoru;
- (iii) włączyć dane do procesu dokonywania uzgodnień pomiędzy RT, stosownie do przypadku.

Wytyczna 14. Po przeniesieniu zapisów uczestnika RT do innego RT poprzednie RT nie powinno pobierać żadnych określonych opłat za ewidencjonowanie nieaktywnych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych.

Wytyczna 15. W przypadku gdy nie wszystkie dane objęte planem migracji mogą zostać przeniesione jednorazowo, RT powinny przenosić dane w następującej kolejności:

- (i) aktualny stan otrzymanych aktywnych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, tj. „stan transakcji”;
- (ii) w przypadku cofnięcia rejestracji – zgłoszenia dotyczące zdarzeń występujących w cyklu życia mających zastosowanie do aktywnych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych;
- (iii) w przypadku cofnięcia rejestracji – wszystkie zamknięte i zapadłe transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych, które nadal podlegają wymogowi na mocy art. 80 ust. 3 rozporządzenia EMIR, zgodnie z art. 5 ust. 2 rozporządzenia SFTR, wraz z odpowiednimi zdarzeniami występującymi w cyklu życia;
- (iv) w przypadku cofnięcia rejestracji – wszystkie błędne transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych, które nadal podlegają wymogowi na mocy art. 80 ust. 3 rozporządzenia EMIR, zgodnie z art. 5 ust. 2 rozporządzenia SFTR, wraz z odpowiednimi zdarzeniami występującymi w cyklu życia;
- (v) w przypadku cofnięcia rejestracji – wszystkie odrzucone transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych zgłoszone przez uczestnika RT, które nie przeszły walidacji danych;
- (vi) w przypadku cofnięcia rejestracji – rejestr zgłoszeń poprzedniego RT w formacie nadającym się do odczytu maszynowego, w którym zapisuje się powód lub powody zmiany, datę, znacznik czasu i jasny opis zmian (w tym starą i nową treść odpowiednich danych) dotyczących przenoszonych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych; oraz

(vii) w przypadku cofnięcia rejestracji – wszystkie dane dotyczące odrzuceń, tj. sprawozdania wychodzące dla organów nadzoru dotyczące odrzuceń w formacie XML, oraz wszystkie dane dotyczące rekonyliacji, tj. sprawozdania wychodzące dla organów nadzoru dotyczące statusu rekonyliacji w formacie XML.

Wytyczna 16. W przypadku przeniesienia danych na wniosek uczestnika RT poprzednie RT powinno określić, czy wszystkie lub niektóre transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych dotyczące kontrahentów będących niezgłaszającymi uczestnikami RT, które zostały zgłoszone przez uczestnika RT, powinny zostać przeniesione do nowego RT.

Wytyczna 17. Jeśli w przypadku przenoszenia danych na wniosek uczestnika RT niezgłaszający uczestnik RT zdecyduje się pozostać w poprzednim RT, mimo że jego zgłaszający uczestnik RT zażądał przeniesienia do innego RT, poprzednie RT powinno oddzielić transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych złożone w imieniu niezgłaszającego uczestnika RT od przenoszonych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych.

Wytyczna 18. W przypadku przeniesienia danych na wniosek uczestnika RT oraz gdy rejestracja poprzedniego RT nie została cofnięta ani nie jest w trakcie procesu wycofywania, należy przekazać jedynie aktualny stan aktywnych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, tj. „stan transakcji”.

Wytyczna 19. W przypadku przeniesienia danych na wniosek uczestnika RT poprzednie RT i nowe RT powinny postępować zgodnie z procedurą opisaną w załączniku I dotyczącą przenoszenia danych na wniosek uczestnika RT zgodnie z rozporządzeniem SFTR. RT powinny uzgodnić plan migracji w zakresie przeniesienia danych danego uczestnika RT tak szybko, jak to możliwe, nie później niż w terminie dziesięciu dni roboczych od otrzymania wniosku.

Wytyczna 20. W przypadku przenoszenia danych na wniosek uczestnika RT, niezwłocznie po przeniesieniu aktywnych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych uczestnika RT do nowego RT, nowe RT powinno potwierdzić przeniesienie uczestnikowi RT, poprzedniemu RT, pozostałym RT oraz odpowiednim organom nadzoru mającym dostęp do transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych zgłaszanych przez uczestnika RT.

Wytyczna 21. W przypadku przenoszenia danych na wniosek uczestnika RT poprzednie RT powinno wyodrębnić i zabezpieczyć przenoszone informacje, stosując takie same zasady, procedury i zabezpieczenia do przenoszonych danych w zakresie ewidencjonowania jak w stosunku do pozostałych danych o transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych zgłaszanych temu RT przez co najmniej trzy miesiące oraz powinno zapewnić możliwość pobrania danych w terminie nie dłuższym niż siedem dni kalendarzowych.

Wytyczna 22. W przypadku dokonywania przeniesienia na wniosek uczestnika RT wszelkie opłaty naliczane przez poprzednie lub nowe RT powinny być uzasadnione kosztami, niedyskryminacyjne i ujęte w udostępnionej publicznie taryfie opłat określonego RT.

Wytyczna 23. W przypadku cofnięcia rejestracji RT przeniesienie danych powinno obejmować wszystkie szczegółowe informacje dotyczące transakcji finansowanych z użyciem papierów

wartościowych zgłoszonych do RT, w tym transakcji odrzuconych, wraz z odpowiednim rejestrem zgłoszeń i wszystkimi danymi dotyczącymi odrzuceń, czyli sprawozdaniami wychodzącymi do organów nadzoru dotyczącymi odrzuceń w formacie XML, a także wszystkie dane dotyczące rekonyliacji, czyli sprawozdania wychodzące do organów nadzoru dotyczące statusu rekonyliacji w formacie XML. Należy przestrzegać kolejności przenoszenia danych przedstawionej w wytycznej 15.

Wytyczna 24. W przypadku cofnięcia rejestracji RT plan(y) migracji dla przeniesienia danych powinny zostać włączone jako część planu likwidacji przedstawionego przez RT.

Wytyczna 25. Jeżeli przeniesienie danych wiąże się z cofnięciem rejestracji RT, poprzednie RT i nowe RT powinny stosować się do procedury migracji zawartej w załączniku II w przypadku cofnięcia rejestracji na mocy SFTR. Należy przestrzegać kolejności przenoszenia danych podanej w wytycznej 15. Poprzednie RT, tj. RT, którego rejestracja ma zostać cofnięta, powinno przekazać ESMA wystarczający dowód potwierdzający, że wszystkie przeniesienia zostały pomyślnie przeprowadzone.

Wytyczna 26. W przypadku cofnięcia rejestracji na wniosek RT powinno ono powiadomić ESMA z wyprzedzeniem o planowanej dacie zakończenia działalności, a następnie niezwłocznie powiadomić drogą elektroniczną uczestników RT, pozostałe RT oraz odpowiednie właściwe organy krajowe. W przypadku RT z ponad 500 uczestnikami RT powiadomienie powinno zostać wysłane z wyprzedzeniem co najmniej dziewięciu miesięcy, a w przypadku RT z 500 lub mniej niż 500 uczestnikami RT – co najmniej sześciu miesięcy.

Wytyczna 27. W przypadku cofnięcia rejestracji, po zakończeniu przeniesienia (przeniesień), nowe RT powinno potwierdzić takie zakończenie uczestnikom RT, wszystkim pozostałym RT oraz odpowiednim NCA.

Wytyczna 28. W przypadku cofnięcia rejestracji poprzednie RT powinno wyodrębnić i zabezpieczyć przenoszone informacje, stosując takie same zasady, procedury i zabezpieczenia w zakresie ewidencjonowania w stosunku do przenoszonych danych jak w stosunku do pozostałych danych do dnia faktycznego zakończenia działalności oraz powinno zapewnić możliwość terminowego pobrania danych w terminie nie dłuższym niż siedem dni kalendarzowych. W dniu faktycznego zakończenia działalności poprzednie RT powinno dokonać bezpiecznego zniszczenia/usunięcia danych zgodnie ze stosowanymi praktykami i dostępnymi najbardziej niezawodnymi technikami, uniemożliwiając przywrócenie czy odzyskanie danych po tym dniu.

Wytyczna 29. W przypadku cofnięcia rejestracji żadne z RT nie powinno pobierać opłat za przeniesienie danych.

Wytyczna 30. W przypadku cofnięcia rejestracji nowe RT może pobierać opłaty od aktywnych uczestników RT za ich dane dotyczące nieaktywnych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych.

Wytyczna 31. W przypadku cofnięcia rejestracji nowe RT może przechowywać dane dotyczące nieaktywnych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych o różnej jakości danych lub w różnych formatach w odrębnych bazach danych/tabelach. Nowe RT powinno odpowiadać na zapytania organów nadzoru na żądanie.

Wytyczna 32. W przypadku cofnięcia rejestracji RT, którego rejestracja zostanie cofnięta, powinno przekazać nowemu RT niezbędne informacje techniczne dotyczące danych, które mają zostać przeniesione, w celu ułatwienia przeniesienia danych do nowego repozytorium, a następnie ich przechowywania przez nowe repozytorium. Poprzednie RT powinno dostarczyć nowemu RT wspomniane wcześniej informacje w odpowiednim terminie, aby umożliwić nowemu RT przygotowanie w razie potrzeby. Dokumentacja techniczna powinna obejmować co najmniej następujące aspekty:

- (i) przyporządkowanie pól do pól dotyczących rozporządzenia SFTR; oraz
- (ii) wyjaśnienia techniczne dla każdego pola.

Wytyczna 33. Przed przeniesieniem danych uczestnika RT i po nim uczestnik RT powinien zweryfikować i potwierdzić z nowym i poprzednim RT poprawność następujących informacji zbiorczych dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych podlegających przeniesieniu zgodnie z harmonogramem szczegółowo opisanym w wytycznej 11:

- (i) całkowita liczba aktywnych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, w przypadku których każdą transakcję finansowaną z użyciem papierów wartościowych identyfikuje się poprzez niepowtarzalną kombinację pól „Kontrahent dokonujący zgłoszenia”, „Inny kontrahent” i „Niepowtarzalny identyfikator transakcji”, wraz z odpowiednim zabezpieczeniem na zasadzie netto, zgłoszeniami dotyczącymi depozytów zabezpieczających i zgłoszeniami dotyczącymi ponownego wykorzystania;
- (ii) całkowita liczba zgłoszeń dotyczących zdarzeń występujących w cyklu życia tych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych w odniesieniu do transakcji, depozytu zabezpieczającego i ponownego wykorzystania (w przypadku przeniesienia), gdzie
 - każde zgłoszenie dotyczące pożyczki i zabezpieczenia jest identyfikowane za pomocą niepowtarzalnej kombinacji pól SFTR „Kontrahent dokonujący zgłoszenia”, „Inny kontrahent” i „Niepowtarzalny identyfikator transakcji” lub „Rodzaj umowy ramowej”;
 - każde zgłoszenie dotyczące depozytu zabezpieczającego jest identyfikowane za pomocą niepowtarzalnej kombinacji pól SFTR „Kontrahent dokonujący zgłoszenia”, „Inny kontrahent” i „Kod portfela”;
 - każde zgłoszenie do ponownego wykorzystania jest oznaczone niepowtarzalną kombinacją pól SFTR „Kontrahent dokonujący zgłoszenia” i „Podmiot odpowiedzialny za zgłoszenie”;
- (iii) całkowita liczba rekordów dotyczących zamkniętych i zapadłych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych w odniesieniu do kredytów i zabezpieczenia, depozytu zabezpieczającego i ponownego wykorzystania w ciągu ostatnich pięciu lat, w odniesieniu do których istnieje obowiązek prowadzenia dokumentacji zgodnie z art. 4 ust. 4 rozporządzenia SFTR (w przypadku przeniesienia);
- (iv) całkowita liczba rekordów dotyczących błędnych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych w odniesieniu do kredytów i zabezpieczeń, depozytu zabezpieczającego i ponownego wykorzystania w ciągu ostatnich pięciu lat, w odniesieniu do

których istnieje obowiązek prowadzenia dokumentacji zgodnie z art. 4 ust. 4 rozporządzenia SFTR (w przypadku gdy są one przenoszone).

Wytyczna 34. W związku z wytyczną 58 Wytycznych dotyczących zgłaszania na podstawie art. 4 i 12 SFTR, w przypadku gdy kontrahent finansowy (FC) i kontrahent niefinansowy SME (SME NFC) zgłaszają do dwóch różnych repozytoriów transakcji aktywne transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych podlegające przeniesieniu:

(i) jeżeli kontrahent niefinansowy SME NFC zdecyduje się nie zgłaszać samodzielnie, aktywne transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych kontrahenta niefinansowego SME NFC powinny zostać przeniesione do RT kontrahenta finansowego (FC), chyba że kontrahent finansowy zdecyduje się zostać klientem kontrahenta niefinansowego SME NFC i zgłaszać transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych zawarte z kontrahentem niefinansowym SME NFC do RT kontrahenta SME NFC.

(ii) za każdym razem, gdy kontrahent niefinansowy zmienia swój status z kontrahenta niefinansowego non-SME NFC na kontrahenta niefinansowego SME NFC i decyduje się nie zgłaszać samodzielnie swoich transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, powinien przenieść swoje aktywne transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych zawarte z kontrahentem finansowym do RT tego kontrahenta finansowego z dniem zmiany swojego statusu, chyba że kontrahent finansowy (FC) zdecyduje się zostać klientem RT kontrahenta niefinansowego SME NFC i zgłaszać transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych zawarte z kontrahentem niefinansowym SME NFC do RT kontrahenta SME NFC. Podobnie za każdym razem, gdy kontrahent niefinansowy zmienia swój status z kontrahenta niefinansowego SME NFC na kontrahenta niefinansowego non-SME NFC, to aktywne transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych zawarte z kontrahentem finansowym powinny zostać przeniesione z powrotem do RT kontrahenta niefinansowego, chyba że kontrahent niefinansowy zdecyduje się zostać klientem RT kontrahenta finansowego i zgłaszać transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych zawarte z kontrahentem finansowym do RTFC.

(iii) Na potrzeby przeniesienia danych nie oczekuje się, że kontrahent niefinansowy ani kontrahent finansowy (ani żaden podmiot dokonujący zgłoszenia w ich imieniu) przeniosą się do repozytoriów transakcji drugiego kontrahenta.

5.1 Załącznik I – Procedura przeniesienia danych na wniosek uczestnika RT zgodnie z rozporządzeniem SFTR

| |
|--|
| <p>A. Planowanie i przygotowanie</p> |
| <p>Po podpisaniu odpowiedniego porozumienia umownego z uczestnikiem RT nowe RT kontaktuje się z poprzednim RT i uzgadnia plan migracji opracowany zgodnie z wytyczną 3.</p> <p>Nowe RT powiadamia pocztą elektroniczną odpowiednie organy nadzoru o dokonaniu przeniesienia.</p> |
| <p>Poprzednie RT określa i uzgadnia z uczestnikiem RT następujące informacje zbiorcze dotyczące transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych uczestnika RT podlegających przeniesieniu:</p> <ul style="list-style-type: none"> ○ Aktualny stan otrzymanych aktywnych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, tj. „stan transakcji”. ○ Całkowita liczba aktywnych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych |
| <p>Poprzednie RT powinno żądać od uczestnika RT potwierdzenia zgodności powyższych informacji z rekordami uczestnika RT²⁶ zgodnie z wytyczną 8. W przypadku rozbieżności poprzednie RT powinno uzgodnić z uczestnikiem RT odpowiednią liczbę rozbieżności i uzgodnić ostateczny wykaz zgłoszeń transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, które zostaną przeniesione. Poprzednie RT powinno usunąć wszystkie rozbieżności <i>w najwcześniejszym możliwym terminie, lecz nie później niż w ciągu pięciu dni roboczych.</i></p> |
| <p>B. Realizacja przeniesienia</p> |
| <p>Po potwierdzeniu liczby transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i rekordów poprzednie RT powinno przystąpić do wygenerowania odpowiedniego pliku (odpowiednich plików) zgodnie z wytyczną 5 i stosownymi zasadami ogólnymi.</p> <p>Poprzednie i nowe RT wykonują plan migracji. Poprzednie RT powinno przenieść wygenerowane pliki do nowego RT, które potwierdza przeniesienie plików.</p> <p>W związku z tym aktywne transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych powinny być przenoszone w uprzednio ustalony weekend lub w uzgodniony dzień roboczy.</p> |

²⁶ Zgodnie z art. 4 ust. 4 SFTR „Kontrahenci prowadzą ewidencję wszystkich zawartych, zmienionych lub zakończonych przez siebie transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przez co najmniej pięć lat od daty zakończenia transakcji”. W przypadku zgłaszającego uczestnika RT, który dokonuje zgłoszenia w imieniu innych, powinien on korzystać również z własnych zapisów.

| |
|---|
| <p>C. Weryfikacja przeniesienia danych</p> <p>Nowe RT powinno określić następujące wartości i informacje dotyczące otrzymanych rekordów i zweryfikować kompletność przeniesienia:</p> <ul style="list-style-type: none"> ○ Aktualny stan otrzymanych aktywnych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, tj. „stan transakcji” ○ Całkowita liczba aktywnych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych |
| <p>Nowe RT powinno zażądać od uczestnika RT potwierdzenia zgodności powyższych informacji z rekordami uczestnika RT²⁷ zgodnie z wytyczną 33. W przypadku rozbieżności obydwu RT powinny starać się uzgodnić odpowiednie wartości z uczestnikiem RT do momentu osiągnięcia porozumienia.</p> |
| <p>D. Ostateczne powiadomienia</p> <p>Nowe RT powinno powiadomić wszystkie RT o tym, że uczestnik zgłaszający zmienił RT. Informacja taka powinna być użyta w celu umożliwienia rekoncylacji odpowiednich transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, które zostały przeniesione do nowego RT.</p> |
| <p>Nowe RT powinno powiadomić odpowiednie NCA oraz ESMA o zakończeniu przenoszenia danych uczestnika RT oraz określić rodzaje przeniesionych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych.</p> |
| <p>E. Prowadzenie ewidencji i bezpieczne usuwanie danych</p> |
| <p>Poprzednie RT powinno usunąć przeniesione aktywne transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych ze wszystkich zagregowanych danych.</p> |
| <p>Poprzednie RT powinno zachować przeniesione dane tak długo, jak jest to zalecane zgodnie z ogólnymi zasadami oraz zgodnie z wymogami rozporządzenia SFTR obowiązującymi przed dokonaniem przeniesienia.</p> |
| <p>Poprzednie RT powinno zachować rejestr zgłoszeń przez co najmniej 10 lat od zakończenia obowiązywania odpowiednich kontraktów.</p> |
| <p>Poprzednie RT zniszczy/usunie przeniesione dane, kiedy będzie to dozwolone, zgodnie z odpowiednimi ogólnymi zasadami dotyczącymi bezpiecznego usuwania/niszczenia.</p> |

²⁷ Zgodnie z art. 4 ust. 4 SFTR „Kontrahenci prowadzą ewidencję wszystkich zawartych, zmienionych lub zakończonych przez siebie transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przez co najmniej pięć lat od daty zakończenia transakcji”. W przypadku zgłaszającego uczestnika RT, który dokonuje zgłoszenia w imieniu innych, powinien on korzystać również z własnych zapisów.

5.2 Załącznik II – Procedura migracji w przypadku cofnięcia rejestracji zgodnie z rozporządzeniem SFTR

| |
|--|
| <p>A. Powiadomienia wstępne</p> <p>(Wycofanie dobrowolne) RT powiadamia ESMA, uczestników RT, inne zaangażowane RT i NCA o złożeniu wniosku o wycofanie swojej rejestracji co najmniej przed (zgodnie z wytyczną 26) planowaną datą zakończenia działalności (w przypadku, gdy o wycofanie wnioskuje RT).</p> <p>lub</p> <p>(Wycofanie niedobrowolne) ESMA powiadamia nowe RT i NCA o tym, że nowe RT powinno (powinny) otrzymać dane, które zostały pierwotnie zgłoszone do poprzedniego RT (w przypadku gdy o wycofanie nie wnioskuje RT).</p> |
| <p>B. Planowanie i przygotowanie</p> <p>Poprzednie RT informuje uczestników RT o zamiarze zakończenia działalności. RT przygotowuje(-ą) plan migracji określony w wytycznej 3 oraz składa(-ją) go do ESMA oraz do nowego (nowych) RT. ESMA oraz inne zaangażowane RT zgłaszają ewentualne zastrzeżenia lub uwagi, a po ich rozstrzygnięciu wszystkie strony uzgadniają szczegóły dotyczące planu migracji.</p> <p>Poprzednie RT określa transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych podlegających przeniesieniu oraz przekazuje ESMA i innym zaangażowanym RT (w ramach planu migracji lub oddzielnie) następujące informacje dotyczące transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych podlegających przeniesieniu, z podziałem na RT:</p> <ul style="list-style-type: none"> ○ Ostatni stan otrzymanych aktywnych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, tj. „stan transakcji” ○ Całkowita liczba aktywnych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych ○ Całkowita liczba rekordów dotyczących zdarzeń występujących w cyklu życia transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych w odniesieniu do transakcji, depozytów zabezpieczających i zgłoszeń ponownego wykorzystania ○ Całkowita liczba rekordów dotyczących zamkniętych i zapadłych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych ○ Całkowita liczba rekordów dotyczących błędnych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych ○ Całkowita liczba rekordów dotyczących odrzuconych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych zgłoszonych przez uczestnika RT, które nie przeszły walidacji danych ○ Liczba wpisów w rejestrze zgłoszeń ○ Całkowita liczba raportów wychodzących do organów nadzoru dotyczących odrzuceń w formacie XML i liczba raportów wychodzących do organów nadzoru dotyczących statusu rekoncyliacji w formacie XML |

C. Realizacja przeniesienia

Po potwierdzeniu liczby transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i rekordów poprzednie RT powinno przystąpić do wygenerowania odpowiedniego pliku (odpowiednich plików) zgodnie z wytyczną 5.

Poprzednie i nowe RT wykonują plan migracji. Wygenerowane pliki są przenoszone ze poprzedniego RT do nowego (nowych) RT, które potwierdzają każde przeniesienie.

Należy przestrzegać kolejności przenoszenia transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i rekordów podanej w wytycznej 15.

W miarę możliwości aktywne transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych należy przenieść w ciągu weekendu lub uzgodnionego dnia roboczego, a powiązane zdarzenia występujące w cyklu życia powinny być jak najwcześniej przypisane do tych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych w odniesieniu do transakcji, depozytu zabezpieczającego i ponownego wykorzystania.

Jeżeli nie jest to możliwe, aktywne transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych należy podzielić według uczestnika RT na dwie partie lub więcej partii, które zostaną przeniesione w kolejne weekendy lub w uzgodnionych dniach roboczych. Odpowiednie zdarzenia występujące w cyklu życia każdej partii powinny zostać przeniesione w najwcześniejszym możliwym terminie.

Pozostałe transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych należy przenieść tak szybko, jak to możliwe.

Wszelkie zidentyfikowane problemy i dokonane postępy są zgłaszane regularnie ESMA w sposób terminowy.

D. Weryfikacja przeniesienia danych

Nowe RT powinno (powinny) określić następujące wartości i informacje dotyczące otrzymanych rekordów i zweryfikować kompletność przeniesienia:

- Ostatni stan otrzymanych aktywnych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, tj. „stan transakcji”.
- Całkowita liczba aktywnych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych
- Całkowita liczba rekordów dotyczących zdarzeń występujących w cyklu życia w odniesieniu do tych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych dla transakcji, depozytu zabezpieczającego i zgłoszeń ponownego wykorzystania
- Całkowita liczba rekordów dotyczących zamkniętych i zapadłych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych
- Całkowita liczba rekordów dotyczących błędnych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych
- Całkowita liczba rekordów dotyczących odrzuconych transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych zgłoszonych przez uczestnika RT, które nie przeszły walidacji danych
- Liczba wpisów w rejestrze zgłoszeń

- o Całkowita liczba raportów wychodzących do organów nadzoru dotyczących odrzuceń w formacie XML i liczba raportów wychodzących do organów nadzoru dotyczących statusu uzgodnienia w formacie XML

Nowe RT powinny powiadomić ESMA oraz poprzednie RT o wyniku weryfikacji. W przypadku niepowodzenia weryfikacji podstawowa przyczyna jest badana przez obydwie strony (poprzednie i nowe RT), a proces przeniesienia jest powtarzany do momentu pomyślnego przeprowadzenia przeniesienia danych.

E. Ostateczne powiadomienia

Nowe RT powinny powiadomić odpowiednich uczestników RT, wszystkie pozostałe RT oraz odpowiednie NCA (pocztą elektroniczną) o pomyślnym zakończeniu przeniesienia.

F. Prowadzenie ewidencji i bezpieczne usuwanie danych

Poprzednie RT powinno zachować przeniesione dane przez okres określony w wytycznej 28 oraz zgodnie z wymogami rozporządzenia SFTR obowiązującymi przed dokonaniem przeniesienia.

Poprzednie RT powinno zniszczyć/usunąć przeniesione dane, kiedy jest to dozwolone, zgodnie z odpowiednimi zasadami dotyczącymi bezpiecznego usuwania/niszczenia określonymi w wytycznej 28.