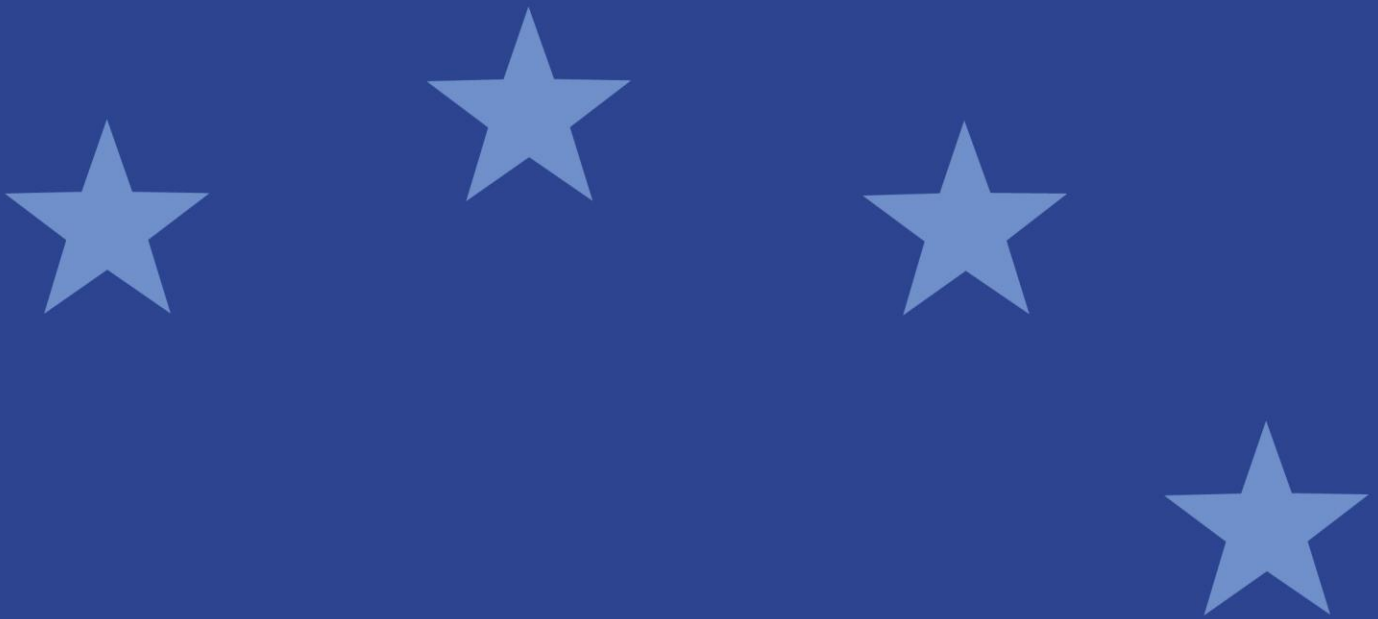




European Securities and
Markets Authority

Richtsnoeren

voor de overdracht van gegevens tussen transactieregisters



Inhoud

1	Toepassingsgebied	3
2	Lijst van begrippen en termen	4
3	Gebruikte afkortingen	5
4	Doel.....	6
5	Naleving	7
6	Richtsnoeren	7
7	Bijlage I – Procedure voor overdracht van gegevens op verzoek van een TR-deelnemer	12
8	Bijlage II – Procedure voor migratie in geval van intrekking van registratie.....	14

1 Toepassingsgebied

Wie?

1. Deze richtsnoeren gelden voor transactieregisters (TR's) die overeenkomstig de verordening Europese marktinfrastructuur (EMIR) zijn geregistreerd of erkend.

Wat?

2. Deze richtsnoeren gelden voor:
 - a. de rapportage zonder overlapping van gegevens van derivaten door tegenpartijen en CTP's overeenkomstig artikel 9, lid 1, van EMIR;
 - b. de overdracht van gegevens van derivaten tussen transactieregisters op verzoek van de tegenpartijen bij een derivaat, of van de entiteit die namens hen rapporteert, of in de situatie als bedoeld in artikel 79, lid 3, van EMIR; en
 - c. het bijhouden van gegevens van derivaten overeenkomstig artikel 80, lid 3, van EMIR.

Wanneer?

3. Deze richtsnoeren gelden met ingang van 16 oktober 2017.

2 Lijst van begrippen en termen

4. Alle definities, begrippen en termen die in EMIR, in de huidige technische reguleringsnormen en technische uitvoeringsnormen inzake rapportage¹, in de gewijzigde technische reguleringsnormen en technische uitvoeringsnormen inzake rapportage², in de Vragen & Antwoorden en in deze richtsnoeren worden gebruikt, worden in dezelfde betekenis gebruikt.
5. Voor het doel van deze richtsnoeren definieert ESMA bovendien de volgende begrippen, die zullen worden gebruikt om de verschillende situaties die zich kunnen voordoen, helderder te beschrijven.
6. “Entiteit die het rapport indient” (*report submitting entity*, hierna ‘RSE’ genoemd), dat een van de velden met betrekking tot tegenpartijen in de gewijzigde technische normen inzake rapportage³ is, dient te worden verstaan als de entiteit die een contractuele relatie met een geregistreerd of erkend transactieregister (TR) is aangegaan en:
 - a. uitsluitend haar eigen kant van een derivatencontract rapporteert, in welk geval zij samenvalt met de rapporterende tegenpartij bij het contract;
 - b. uitsluitend derivaten rapporteert waarbij zij een van de tegenpartijen is, in welk geval zij samenvalt met de rapporterende tegenpartij bij het contract of de andere tegenpartij; en
 - c. derivaten rapporteert waarbij zij al dan niet een van de tegenpartijen is.
7. “TR-deelnemer”⁴ is een entiteit die met ten minste één geregistreerd of erkend transactieregister een contractuele regeling heeft voor de rapportage van derivatencontracten overeenkomstig artikel 9 van EMIR. De TR-deelnemer kan een RSE

¹ GEDELEGEERDE VERORDENING (EU) nr. 148/2013 VAN DE COMMISSIE van 19 december 2012 tot aanvulling van Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad betreffende otc-derivaten, centrale tegenpartijen en transactieregisters met technische reguleringsnormen inzake de minimale mate van gedetailleerdheid van de aan transactieregisters te rapporteren gegevens, PB L52. van 23.2.2013, blz. 1

UITVOERINGSVERORDENING (EU) nr. 1247/2012 VAN DE COMMISSIE van 19 december 2012 tot vaststelling van technische uitvoeringsnormen met betrekking tot de formattering en de frequentie van de transactierapportage aan transactieregisters overeenkomstig Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad betreffende otc-derivaten, centrale tegenpartijen en transactieregisters, PB L352 van 21.12.2012, blz. 20.

² GEDELEGEERDE VERORDENING (EU) 2017/104 VAN DE COMMISSIE van 19 oktober 2016 tot wijziging van Gedelegeerde Verordening (EU) nr. 148/2013 tot aanvulling van Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad betreffende otc-derivaten, centrale tegenpartijen en transactieregisters met technische reguleringsnormen inzake de minimale mate van gedetailleerdheid van de aan transactieregisters te rapporteren gegevens, PB L17 van 21.1.2017, blz. 1.

UITVOERINGSVERORDENING (EU) 2017/105 VAN DE COMMISSIE van 19 oktober 2016 tot wijziging van Uitvoeringsverordening (EU) nr. 1247/2012 tot vaststelling van technische uitvoeringsnormen met betrekking tot de formattering en de frequentie van de transactierapportage aan transactieregisters overeenkomstig Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad betreffende otc-derivaten, centrale tegenpartijen en transactieregisters, PB L17 van 21.1.2017, blz. 17.

³ [https://www.esma.europa.eu/system/files/force/library/2015/11/2015-esma-1645 - final report emir article 9 rts_its.pdf](https://www.esma.europa.eu/system/files/force/library/2015/11/2015-esma-1645_-_final_report_emir_article_9_rts_its.pdf).

⁴ Sommige transactieregisters specificeren de typen TR-deelnemers nader, zoals rapporterende deelnemers, algemeen rapporterende deelnemers, niet-rapporterende deelnemers, enz. Vanuit het perspectief van deze richtsnoeren zijn deze subcategorieën transparant.

of een rapporterende tegenpartij of een CTP zijn die 'view-only'-toegang tot het transactieregister heeft.

3 Gebruikte afkortingen

CTP	Centrale tegenpartij
EMIR	Verordening Europese marktinfrastructuur – Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad van 4 juli 2012 betreffende otc-derivaten, centrale tegenpartijen en transactieregisters – ook 'de verordening' genoemd
ESMA	Europese Autoriteit voor effecten en markten
EU	Europese Unie
ISO	Internationale Organisatie voor normalisatie
ITS	Technische uitvoeringsnormen
LEI	Identificatiecode voor juridische entiteiten
MAR	Verordening (EU) nr. 596/2014 van het Europees Parlement en de Raad van 16 april 2014 betreffende marktmisbruik (Verordening marktmisbruik)
MiFIR	Verordening (EU) nr. 600/2014 van het Europees Parlement en de Raad van 15 mei 2014 betreffende markten in financiële instrumenten en tot wijziging van Verordening (EU) nr. 648/2012
MMSR	Verordening (EU) nr. 1333/2014 van de Europese Centrale Bank van 26 november 2014 houdende geldmarktstatistieken
NBA	Nationale bevoegde autoriteit
PB	Publicatieblad van de Europese Unie
OTC	Over-the-counter
V&A	Vragen & Antwoorden
RTS	Technische reguleringsnormen
SFTR	Verordening (EU) nr. 2015/2365 van het Europees Parlement en de Raad van 25 november 2015 betreffende de transparantie

van effectenfinancieringstransacties en van hergebruik en tot wijziging van Verordening (EU) nr. 648/2012

TR	Transactieregister
UTI	Unieke transactie-identificatie
XML	Extensible Markup Language
XSD	XML-schemadefinitie

4 Doel

8. Het doel van deze richtsnoeren is daarom drievoudig:
 - a. wegnemen van belemmeringen voor overdraagbaarheid in de concurrerende TR-omgeving die ten grondslag ligt aan EMIR, en ervoor zorgen dat TR-deelnemers kunnen profiteren van een omgeving met meerdere TR's;
 - b. waarborgen van de kwaliteit van de gegevens die beschikbaar zijn voor de autoriteiten, met inbegrip van de door TR's uitgevoerde aggregaties, ook wanneer de TR-deelnemer de TR waaraan hij rapporteert, wijzigt en ongeacht de reden voor een dergelijke wijziging;
 - c. waarborgen dat er een consistente en geharmoniseerde manier is om gegevens van een TR naar een andere TR over te dragen, en in alle gevallen de continuïteit van de rapportage en reconciliatie ondersteunen, ook in geval van de intrekking van de registratie van een TR.
9. Het kan om verschillende redenen nodig zijn om gegevens over te dragen aan een andere TR. De situaties waarin (i) de overdracht plaatsvindt wegens de intrekking van de registratie van de TR, en (ii) de overdracht plaatsvindt op vrijwillige basis en onder normale marktomstandigheden, worden in de richtsnoeren daarom apart behandeld. De stimulansen en beweegredenen van de betrokken partijen zullen in beide gevallen verschillen, en beide situaties vragen daarom om een eigen aanpak.
10. De richtsnoeren stellen algemene beginselen vast die door de TR-deelnemers in acht dienen te worden genomen, bijvoorbeeld door RSE's, tegenpartijen en CTP's enerzijds en de TR's anderzijds. Deze beginselen worden aangevuld met specifieke procedures om de tijdige en robuuste overdracht van gegevens van derivaten te waarborgen, die in de punten 10 en 11 van het definitieve rapport zijn uiteengezet.
11. Deze richtsnoeren hebben echter geen betrekking op situaties waarin geen gegevensoverdracht vereist is, zoals rapporterende tegenpartijen die hebben besloten om aan twee of meer transactieregisters tegelijk te rapporteren.

5 Naleving

12. Dit document bevat richtsnoeren overeenkomstig artikel 16 van de ESMA-verordening. Overeenkomstig artikel 16, lid 3, van de ESMA-verordening moeten bevoegde autoriteiten en financiële marktdeelnemers zich tot het uiterste inspannen om de richtsnoeren en aanbevelingen na te leven.

6 Richtsnoeren

1. Uitsluitend de oude TR en de nieuwe TR voeren de overdracht van gegevens betreffende derivaten uit. De nieuwe TR accepteert van TR-deelnemers geen overlappende rapporten met betrekking tot derivaten die voorwerp van overdracht zijn. De oude TR accepteert geen door TR-deelnemers opgestelde rapporten met betrekking tot derivaten die voorwerp van overdracht zijn en als soort actie 'Annulering' of 'Fout' vermelden.
2. De overdracht van gegevens wordt door de TR's uitgevoerd overeenkomstig een onderling overeengekomen migratieplan. Het migratieplan bevat de gedetailleerde planning (tijdpad) en een beschrijving van de aanwezige vereiste controles om de tijdige, volledige en nauwkeurige overdracht van gegevens te waarborgen.
3. Alle TR's gebruiken een door alle TR's onderling overeengekomen template voor een gestandaardiseerd migratieplan waarvan de inhoud in overeenstemming is met richtsnoer 4.
4. Het migratieplan bevat de volgende informatie:
 - i. de reikwijdte van de gegevensoverdracht (bijv. de TR-deelnemer(s), de betrokken derivaten, enz.);
 - ii. gedetailleerde gegevens over de rollen en verantwoordelijkheden van de betrokken entiteiten;
 - iii. het tijdpad en de relevante mijlpalen van de overdracht;
 - iv. de vereiste controles om de vertrouwelijkheid van de overgedragen gegevens te waarborgen (bijv. het gebruikte type encryptie);
 - v. de vereiste controles om de integriteit en juistheid van de overgedragen gegevens te waarborgen (bijv. cryptografische controletotalen en hash-algoritmen);
 - vi. de vereiste controles om de continuïteit van de activiteiten en de inter-TR-reconciliatiestatus van de over te dragen derivaten te waarborgen;
 - vii. het uiterste tijdstip en de beschikbaarheid van gegevens;

- viii. alle overige informatie die de soepele overdracht van de gegevens zal vergemakkelijken en garanderen.
5. TR's dragen gegevens aan elkaar over door gebruik te maken van het XML-formaat en de overeenkomstig artikel 4 van de gewijzigde technische reguleringsnormen RTS 151/2013 vastgestelde template. De TR's mogen echter kommagescheiden bestanden (csv-bestanden) gebruiken in geval van (i) derivaten die op het tijdstip van overdracht niet uitstaan, (ii) uitstaande derivaten die niet zijn gewijzigd na de datum van toepassing van de gewijzigde Gedelegeerde Verordening nr. 148/2013 van de Commissie, of (iii) afgewezen derivaten. In de bestanden die worden overgedragen, neemt de oude TR alle relevante gegevens op van de derivaten die voorwerp van de overdracht zijn.
 6. De TR's maken gebruik van veilige machine-to-machine-protocollen, waaronder het SSH File Transfer Protocol, om gegevens onderling over te dragen.
 7. De TR's maken gebruik van geavanceerde encryptieprotocollen en wisselen de relevante openbare encryptiesleutels met elkaar uit. Om te waarborgen dat de gegevensencryptie naadloos functioneert, testen de TR's vooraf of ze elkaars gegevensbestanden kunnen versleutelen en ontsleutelen.
 8. De oude TR berekent het aantal derivaten en het aantal bijbehorende levenscyclusgebeurtenissen dat aan de nieuwe TR zal worden overgedragen. De oude TR verzoekt de TR-deelnemer om de aantallen die betrekking hebben op uitstaande derivaten af te tekenen en lost alle discrepanties zo snel mogelijk, maar in ieder geval binnen vijf werkdagen op.
 9. De oude TR berekent voor elk gegenereerd en overgedragen bestand een cryptografisch controletootaal overeenkomstig een onderling overeengekomen hash-algoritme en neemt dit totaal in de gegevensoverdracht op.
 10. De overdracht van gegevens op verzoek van een TR-deelnemer wordt in principe niet op een werkdag uitgevoerd. De oude TR en de nieuwe TR kunnen echter afspreken om de overdracht op een werkdag uit te voeren, afhankelijk van het verwachte volume van de overdracht.
 11. Zodra de nieuwe TR de overdracht van de uitstaande derivaten heeft bevestigd, accepteert de oude TR geen rapporten meer over levenscyclusgebeurtenissen en positiegegevens betreffende de derivaten die voorwerp van de overdracht aan de nieuwe TR zijn.
 12. Totdat de overdracht van alle relevante bestanden die voorwerp van de overdracht zijn, is voltooid, accepteert de nieuwe TR geen levenscyclusgebeurtenissen of positiegegevens betreffende de derivaten die voorwerp van de overdracht zijn. De gegevens over uitstaande derivaten worden door de oude TR ter beschikking van de relevante autoriteiten gesteld.
 13. Zodra de gegevensoverdracht is voltooid, dient de nieuwe TR:

- i. de gegevens ter beschikking te stellen van de autoriteiten;
 - ii. de gegevens die voorwerp van de overdracht zijn, op te nemen in de relevante openbare aggregaties en in de aggregaties die uitsluitend voor de autoriteiten bestemd zijn;
 - iii. de gegevens op te nemen in het reconciliatieproces tussen de TR's, voor zover van toepassing.
14. Na de overdracht van gegevens van een TR-deelnemer aan een andere TR, mag de oude TR geen specifieke vergoedingen voor het bijhouden van gegevens van niet-uitstaande derivaten in rekening brengen.
15. Indien het niet mogelijk is om alle gegevens binnen het migratieplan in één keer over te dragen, dragen de TR's de gegevens in de volgende volgorde over:
 - i. de laatste stand van de ontvangen uitstaande derivaten, dat wil zeggen, de 'stand van de handel';
 - ii. de rapporten betreffende levenscyclusgebeurtenissen die van toepassing zijn op de uitstaande derivaten;
 - iii. alle beëindigde, gecomprimeerde en vervallen derivaten waarvoor de in artikel 80, lid 3, van EMIR gestelde eis nog geldt, tezamen met de relevante levenscyclusgebeurtenissen;
 - iv. alle foute derivaten waarvoor de in artikel 80, lid 3, van EMIR gestelde eis nog geldt, tezamen met de relevante levenscyclusgebeurtenissen;
 - v. alle afgewezen derivaten die door de TR-deelnemer zijn gerapporteerd en die de gegevensvalidaties niet hebben doorstaan (alleen in geval van intrekking van de registratie); en
 - vi. het rapportagelogboek waarin de reden(en) voor een wijziging, de datum, het tijdstempel en een duidelijke beschrijving van de wijzigingen (met inbegrip van de oude en nieuwe inhoud van de relevante gegevens) die betrekking hebben op de derivaten die worden overgedragen, worden vastgelegd.
16. In geval van gegevensoverdracht op verzoek van een TR-deelnemer bepaalt de oude TR of alle of enkele van de derivaten die verband houden met tegenpartijen die niet-rapporterende TR-deelnemers zijn en die door de TR-deelnemer werden gerapporteerd, aan de nieuwe TR dienen te worden overgedragen.
17. Indien, in geval van gegevensoverdracht op verzoek van een TR-deelnemer, een niet-rapporterende TR-deelnemer besluit om bij de oude TR te blijven, ook al heeft zijn rapporterende TR-deelnemer om overdracht aan een andere TR verzocht, verwijderd de

oude TR de namens de niet-rapporterende TR-deelnemer ingediende derivaten uit de derivaten die worden overgedragen.

18. In geval van gegevensoverdracht op verzoek van een TR-deelnemer en wanneer de registratie van de oude TR niet is ingetrokken en er evenmin een procedure loopt om deze in te trekken, omvatten de gegevens ten minste:
- i. alle uitstaande derivaten van de TR-deelnemer of, wanneer de TR-deelnemer een RSE is, de derivaten van de cliënten van de TR-deelnemer die aan de TR-deelnemer hebben bevestigd in te stemmen met de overdracht van derivaten aan een andere TR;
 - ii. alle levenscyclusgebeurtenissen, zoals wijzigingen, waarderingen, enz., die betrekking hebben op de uitstaande derivaten; en
 - iii. het rapportagelogboek dat betrekking heeft op de derivaten die worden overgedragen.

De in de punten i) en ii) genoemde gegevens worden naar beste vermogen in één keer overgedragen.

19. In geval van gegevensoverdracht op verzoek van een TR-deelnemer volgen de oude TR en de nieuwe TR de procedure die is beschreven in bijlage I, 'Procedure voor overdracht op verzoek van een TR-deelnemer'. De TR's komen zo snel mogelijk, maar in ieder geval binnen vijf werkdagen na de ontvangst van het verzoek het migratieplan voor de gegevensoverdracht van een gegeven TR-deelnemer overeen.

20. In geval van gegevensoverdracht op verzoek van een TR-deelnemer zendt de nieuwe TR zodra de uitstaande derivaten van een TR-deelnemer zijn overgedragen aan de nieuwe TR, een bevestiging van deze overdracht aan de TR-deelnemer, de oude TR, de overige TR's en de relevante autoriteiten die toegang hebben tot de door de TR-deelnemer gerapporteerde derivaten.

21. In geval van gegevensoverdracht op verzoek van een TR-deelnemer isoleert de oude TR de overgedragen gegevens en bewaart hij deze veilig door ten minste gedurende drie maanden op de overgedragen gegevens hetzelfde beleid en dezelfde procedures en waarborgen voor het bijhouden van gegevens toe te passen als op de overige gegevens van derivaten die aan deze TR worden gerapporteerd, en garandeert de oude TR dat gegevens binnen zeven kalenderdagen kunnen worden teruggehaald.

22. In geval van gegevensoverdracht op verzoek van een TR-deelnemer staan eventuele vergoedingen die door de oude TR of de nieuwe TR in rekening worden gebracht, in verhouding tot de kosten, zijn ze niet-discriminatoir en zijn ze opgenomen in het vergoedingsschema van de relevante TR's, dat openbaar wordt gemaakt.

23. In geval van intrekking van de registratie van een TR omvat de gegevensoverdracht alle gegevens van de aan de TR gerapporteerde derivaten, met inbegrip van de gegevens van

afgewezen derivaten, evenals het relevante rapportagelogboek. De in richtsnoer 15 uiteengezette volgorde van gegevensoverdracht dient te worden aangehouden.

24. In geval van intrekking van de registratie van een TR wordt het migratieplan, of worden de migratieplannen, voor gegevensoverdracht opgenomen in het door de TR gepresenteerde liquidatieplan.
25. Wanneer de gegevensoverdracht verband houdt met de intrekking van de registratie van een TR, volgen de oude TR en de nieuwe TR de procedure die is beschreven in bijlage II, 'Procedure voor migratie in geval van intrekking van registratie'. De in richtsnoer 15 uiteengezette volgorde van gegevensoverdracht dient te worden aangehouden. De oude TR, dat wil zeggen, de TR waarvan de registratie wordt ingetrokken, verstrekt ESMA voldoende bewijzen dat alle overdrachten succesvol zijn verlopen.
26. In geval van intrekking van de registratie op verzoek van een TR stelt de TR ESMA vooraf in kennis van de beoogde datum van beëindiging van de activiteiten en stelt de TR onmiddellijk daarna de TR-deelnemers en de relevante NBA's in kennis. Voor TR's met meer dan 500 TR-deelnemers vindt deze kennisgeving ten minste negen maanden van tevoren plaats, voor TR's met minder dan 500 deelnemers ten minste zes maanden van tevoren.
27. In geval van intrekking van de registratie zendt de nieuwe TR, zodra de overdracht(en) is (zijn) voltooid, hiervan een bevestiging aan de TR-deelnemers, alle overige TR's en de respectieve NBA's.
28. In geval van intrekking van de registratie isoleert de oude TR de overgedragen gegevens en bewaart hij deze veilig door tot de datum van de werkelijke beëindiging van de activiteiten op de overgedragen gegevens hetzelfde beleid en dezelfde procedures en waarborgen voor het bijhouden van gegevens toe te passen als op de overige gegevens, en garandeert de oude TR dat gegevens tijdig en binnen zeven kalenderdagen kunnen worden teruggehaald. Op de datum van werkelijke beëindiging van de activiteiten vernietigt/verwijdert de oude TR de gegevens op veilige wijze, conform de heersende praktijken en de meest betrouwbare technieken die beschikbaar zijn, om te waarborgen dat de gegevens na die datum niet meer kunnen worden hersteld of teruggehaald.
29. In geval van intrekking van een registratie mag geen van de TR's vergoedingen voor de gegevensoverdracht aanrekenen.

7 Bijlage I – Procedure voor overdracht van gegevens op verzoek van een TR-deelnemer

<p>A. Planning en voorbereiding</p> <p>Na ondertekening van de toepasselijke contractuele overeenkomst met de TR-deelnemer legt de nieuwe TR een overeenkomstig richtsnoer 3 opgesteld migratieplan voor aan de oude TR en bereikt hij overeenstemming met de oude TR over dit plan.</p> <p>De nieuwe TR stelt de relevante autoriteiten per e-mail op de hoogte van de overdracht.</p> <p>De oude TR bepaalt de volgende geaggregeerde informatie betreffende de derivaten van de TR-deelnemer die voorwerp zijn van overdracht, en bereikt hierover overeenstemming met de TR-deelnemer:</p> <ul style="list-style-type: none"> ○ het totale aantal uitstaande derivaten; ○ het totale aantal rapporten betreffende levenscyclusgebeurtenissen van deze derivaten; ○ het totale aantal vastleggingen betreffende beëindigde, gecomprimeerde en vervallen derivaten (indien deze worden overgedragen); ○ het totale aantal vastleggingen betreffende foute derivaten (indien deze worden overgedragen). <p>De oude TR vraagt de TR-deelnemer de hierboven genoemde informatie te vergelijken met de eigen vastleggingen van de TR-deelnemer en de juistheid ervan te bevestigen⁵. In geval van een discrepantie stemt de oude TR de relevante cijfers af met de TR-deelnemer en bereikt hij overeenstemming over de definitieve lijst van derivatenrapporten die zal worden gemigreerd. De oude TR lost alle discrepanties zo snel mogelijk, maar in ieder geval binnen vijf werkdagen op.</p>
<p>B. Uitvoering van de overdracht</p> <p>Zodra het aantal derivaten en vastleggingen is bevestigd, genereert de oude TR het relevante bestand, of de relevante bestanden, overeenkomstig richtsnoer 5 en de toepasselijke algemene beginselen.</p> <p>De oude TR en de nieuwe TR voeren het migratieplan uit. De oude TR draagt de gegenereerde bestanden over aan de nieuwe TR, die de bestandsoverdracht bevestigt.</p> <p>Indien het volume aan bestanden handelbaar is, draagt de oude TR het bestand, of de bestanden, betreffende uitstaande derivaten en de bijbehorende bestanden betreffende levenscyclusgebeurtenissen gelijktijdig over.</p>

⁵ Artikel 9, lid 2, van EMIR luidt: "Tegenpartijen houden ten minste gedurende vijf jaar na de beëindiging van een contract een register bij van alle derivatencontracten die zij hebben gesloten en van alle daarin aangebrachte wijzigingen." In geval van een rapporterende TR-deelnemer die rapporteert namens anderen, dient hij ook hun gegevens te gebruiken.

Indien het volume aan bestanden gelijktijdige overdracht niet toelaat, wordt de in richtsnoer 15 uiteengezette volgorde aangehouden.

In dit geval worden de uitstaande derivaten in een vooraf vastgesteld weekend overgedragen, terwijl de levenscyclusgebeurtenissen zo snel mogelijk in de daaropvolgende kalenderweek worden overgedragen.

C. Verificatie van de overgedragen gegevens

De nieuwe TR bepaalt de volgende cijfers en informatie voor de ontvangen gegevens en controleert de volledigheid van de overdracht:

- de laatste stand van de ontvangen uitstaande derivaten, dat wil zeggen, de ‘stand van de handel’;
- het totale aantal uitstaande derivaten;
- het totale aantal vastleggingen betreffende levenscyclusgebeurtenissen behorende bij de uitstaande derivaten;
- het totale aantal vastleggingen betreffende beëindigde, gecomprimeerde en vervallen derivaten (indien deze worden overgedragen);
- het totale aantal vastleggingen betreffende foute derivaten (indien deze worden overgedragen).

De nieuwe TR vraagt de TR-deelnemer de hierboven genoemde informatie te vergelijken met de eigen vastleggingen van de TR-deelnemer en de juistheid ervan te bevestigen⁶. In geval van een verschil proberen de twee TR’s de relevante cijfers met de TR-deelnemer af te stemmen totdat overeenstemming is bereikt.

D. Definitieve kennisgevingen

De nieuwe TR informeert alle TR’s dat de rapporterende deelnemer naar hem is overgestapt. Deze informatie wordt gebruikt om het reconciliatieproces voor de relevante derivaten die naar de nieuwe TR zijn gemigreerd, te vergemakkelijken.

De nieuwe TR informeert de relevante NBA’s en ESMA over de voltooiing van de overdracht van gegevens van de TR-deelnemer en stelt de soorten betrokken derivaten vast.

E. Bijhouden van gegevens en veilige verwijdering van gegevens

De oude TR verwijdert de gemigreerde uitstaande derivaten uit alle gegevensaggregaties.

De oude TR houdt de overgedragen gegevens bij zoals vóór de overdracht zolang als voorgeschreven door de algemene beginselen en overeenkomstig de vereisten in EMIR.

De oude TR bewaart het rapportagelogboek ten minste gedurende tien jaar na de beëindiging van de relevante contracten.

De oude TR vernietigt/verwijdert de overgedragen gegevens wanneer dit is toegestaan, en volgt daarbij de toepasselijke algemene beginselen voor veilige vernietiging/verwijdering.

⁶ Artikel 9, lid 2, van EMIR luidt: “Tegenpartijen houden ten minste gedurende vijf jaar na de beëindiging van een contract een register bij van alle derivatencontracten die zij hebben gesloten en van alle daarin aangebrachte wijzigingen.” In geval van een rapporterende TR-deelnemer die rapporteert namens anderen, dient hij ook hun gegevens te gebruiken.

8 Bijlage II – Procedure voor migratie in geval van intrekking van registratie

A. Eerste kennisgevingen

(Vrijwillige intrekking) De TR stelt ESMA, de TR-deelnemers, de overige betrokken TR's en NBA's (conform richtsnoer 25) ten minste vóór de beoogde datum van beëindiging van zijn activiteiten in kennis van zijn verzoek om zijn registratie in te trekken (indien de intrekking geschiedt op verzoek van de TR).

Of:

(Niet-vrijwillige intrekking) ESMA stelt de nieuwe TR('s) en de NBA's ervan in kennis dat de nieuwe TR('s) gegevens dient (dienen) te ontvangen die oorspronkelijk aan de oude TR werden gerapporteerd (indien de intrekking niet geschiedt op verzoek van de TR).

B. Planning en voorbereiding

De oude TR informeert de TR-deelnemers van zijn voornemen om zijn activiteiten te beëindigen. De TR('s) bereidt (bereiden) het migratieplan voor, zoals in detail is beschreven in richtsnoer 3, en legt (leggen) het voor aan ESMA en de nieuwe TR('s). ESMA en de overige betrokken TR's uiten eventuele bezwaren of zorgen, en nadat deze bezwaren en zorgen zijn weggenomen, bereiken alle partijen overeenstemming over de details van het migratieplan.

De oude TR identificeert de derivaten die voorwerp van de overdracht zijn, en verstrekt ESMA en de overige betrokken TR's (als onderdeel van het migratieplan of apart) de volgende informatie betreffende de derivaten die voorwerp van overdracht zijn, per TR:

- het totale aantal uitstaande derivaten;
- het totale aantal vastleggingen betreffende levenscyclusgebeurtenissen behorende bij de uitstaande derivaten;
- het totale aantal vastleggingen betreffende beëindigde, gecomprimeerde en vervallen derivaten;
- het totale aantal vastleggingen betreffende foute derivaten;
- het aantal ingangen in het rapportageboek.

C. Uitvoering van de overdracht

Zodra het aantal derivaten en vastleggingen is bevestigd, genereert de oude TR het relevante bestand, of de relevante bestanden, overeenkomstig richtsnoer 5.

De oude TR en de nieuwe TR('s) voeren het migratieplan uit. De gegenereerde bestanden worden overgedragen van de oude TR naar de nieuwe TR('s), die elke overdracht bevestigen.

De in richtsnoer 15 uiteengezette prioriteitsvolgorde van derivaten en vastleggingen wordt aangehouden.

Indien mogelijk worden uitstaande derivaten tijdens en binnen een weekend overgedragen, terwijl de bijbehorende levenscyclusgebeurtenissen en waarderingen/zekerheden zo snel mogelijk, doch uiterlijk in de week erna worden overgedragen.

Indien dit niet mogelijk is, worden uitstaande derivaten per TR-deelnemer verdeeld in twee of meer batches die in opeenvolgende weekends worden overgedragen. De bijbehorende levenscyclusgebeurtenissen per batch worden zo snel mogelijk, doch uiterlijk aan het einde van de week volgend op de overdracht van de relevante batch uitstaande derivaten overgedragen.

De overige derivaten worden zo snel mogelijk, maar in ieder geval binnen een maand na de voltooiing van de overdracht van de uitstaande derivaten overgedragen.

De eventueel geïdentificeerde problemen en de gemaakte vorderingen worden op regelmatige basis en tijdig aan ESMA gerapporteerd.

D. Verificatie van de overgedragen gegevens

De nieuwe TR('s) bepaalt (bepalen) de volgende cijfers en informatie voor de ontvangen gegevens en controleert (controleren) de volledigheid van de overdracht:

- de laatste stand van de ontvangen uitstaande derivaten, dat wil zeggen, de 'stand van de handel';
- het totale aantal uitstaande derivaten;
- het totale aantal vastleggingen betreffende levenscyclusgebeurtenissen behorende bij de uitstaande derivaten;
- het totale aantal vastleggingen betreffende beëindigde, gecomprimeerde en vervallen derivaten;
- het totale aantal vastleggingen betreffende foute derivaten;
- het aantal ingangen in het rapportageboek.

De nieuwe TR's stellen ESMA en de oude TR in kennis van de uitkomst van de verificatie. In geval de verificatie is mislukt, onderzoeken beide partijen (oude TR en nieuwe TR's) de diepere oorzaak en wordt de overdrachtsprocedure herhaald tot de gegevensoverdracht is geslaagd.

E. Definitieve kennisgevingen

De nieuwe TR's stellen de betrokken TR-deelnemers, alle overige TR's en de respectieve NBA's (per e-mail) in kennis van de geslaagde afronding van de overdracht.

F. Bijhouden van gegevens en veilige verwijdering van gegevens

De oude TR houdt de overgedragen gegevens bij zoals vóór de overdracht zolang als in detail is bepaald in richtsnoer 28 en overeenkomstig de vereisten in EMIR.

De oude TR vernietigt/verwijdert de overgedragen gegevens wanneer dit is toegestaan, en volgt daarbij de toepasselijke beginselen voor veilige vernietiging/verwijdering in richtsnoer 28.