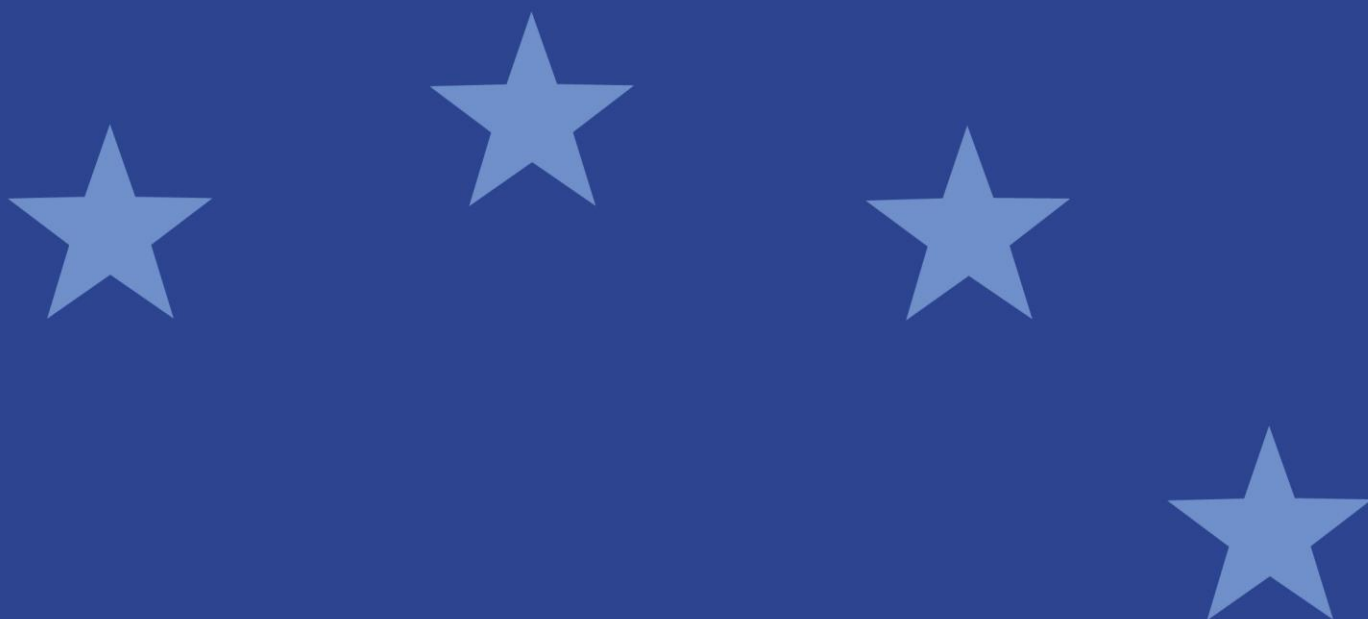


Wytyczne

dotyczące przenoszenia danych pomiędzy Repozytoriami Transakcji



Spis treści

1	Zakres stosowania	3
2	Glosariusz pojęć i terminów	4
3	Użyte skróty	5
4	Cel	6
5	Zgodność z prawem	7
6	Wytyczne.....	7
7	Załącznik I - Procedura przeniesienia informacji na żądanie uczestnika TR	12
8	Załącznik II - Procedura migracji w przypadku wycofania rejestracji	14

1 Zakres stosowania

Kto?

1. Niniejsze wytyczne stosuje się do Repozytoriów Transakcji (TR) zarejestrowanych lub uznawanych zgodnie z rozporządzeniem EMIR.

Co?

2. Niniejsze wytyczne mają zastosowanie w odniesieniu do:
 - a. Zgłaszania bez dublowania szczegółowych informacji o instrumentach pochodnych przez kontrahentów i CCP zgodnie z art. 9 ust. 1 rozporządzenia EMIR,
 - b. Przenoszenia danych dotyczących instrumentach pochodnych pomiędzy repozytoriami transakcji na żądanie kontrahentów instrumentów pochodnych lub podmiotu dokonującego zgłoszenia w ich imieniu bądź w sytuacji objętej art. 79 ust. 3 rozporządzenia EMIR, oraz
 - c. Ewidencjonowania szczegółowych informacji o instrumentach pochodnych zgodnie z art. 80 ust. 3 rozporządzenia EMIR.

Kiedy?

3. Niniejsze wytyczne obowiązują od dnia 16 października 2017 r.

2 Glosariusz pojęć i terminów

4. Wszystkie definicje, pojęcia i terminy, które zostały użyte w rozporządzeniu EMIR, aktualnych RTS i ITS dotyczących dokonywania zgłoszeń¹, zmienionych RTS i ITS dotyczących dokonywania zgłoszeń², Q&A oraz w niniejszych wytycznych posiadają takie samo znaczenie.
5. Ponadto dla celu niniejszych wytycznych ESMA określa następujące pojęcia, które zostaną użyte w celu lepszego zilustrowania różnych sytuacji, które mogą nastąpić.
6. Pojęcie „podmiot dokonujący zgłoszenia” (zwany dalej RSE), stanowiące jedno z pól kontrahentów zmienionych standardów technicznych dotyczących dokonywania zgłoszeń³, należy rozumieć jako podmiot, który wszedł w stosunek umowny z zarejestrowanym lub uznawanym TR oraz:
 - a. Zgłasza wyłącznie swoją stronę kontraktu pochodnego, w którym to przypadku byłby tożsamy z kontrahentem zgłaszającym kontrakt
 - b. Zgłasza wyłącznie instrumenty pochodne, jeśli jest jednym z kontrahentów, w którym to przypadku byłby tożsamy z kontrahentem zgłaszającym kontrakt lub innym kontrahentem, oraz
 - c. Zgłasza instrumenty pochodne, jeśli jest lub nie jednym z kontrahentów.
7. „Uczestnik TR”⁴ jest podmiotem, który jest stroną stosunku umownego z przynajmniej jednym zarejestrowanym lub uznawanym TR mającego na celu zgłaszanie kontraktów pochodnych zgodnie z art. 9 rozporządzenia EMIR. Uczestnik TR może być RSE lub

¹ 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 repozytorium transakcji, L52. Dz.U. z 23.2.2013, s. 1

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 repozytoriów transakcji, Dz.U. L 352 z 21.12.2012, s. 20.

² ROZPORZĄDZENIE DELEGOWANE KOMISJI (UE) nr 2017/104 z dnia 19 października 2016 r. zmieniające rozporządzenie delegowane (UE) nr 148/2013 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 repozytorium transakcji, Dz. U. L17 z 21.1.2017, s. 1

ROZPORZĄDZENIE WYKONAWCZE KOMISJI (UE) nr 2017/105 z dnia 19 października 2016 r. zmieniające rozporządzenie wykonawcze (UE) nr 1247/2012 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 repozytoriów transakcji, Dz. U. L17 z 21.1.2017, s. 17

³ https://www.esma.europa.eu/system/files/force/library/2015/11/2015-esma-1645_-_final_report_emir_article_9_rts_its.pdf

⁴ Niektóre TR mogą ponadto określać rodzaje uczestników TR, takie jak uczestnicy zgłaszający, ogólnie zgłaszający, niezgłaszający, etc. Takie podkategorie są przejrzyste z perspektywy niniejszych wytycznych.

zgłaszającym kontrahentem bądź CCP posiadającym dostęp do TR ograniczający się do „przeoglądania”.

3 Użyte skróty

CCP	Kontrahent centralny
Rozporządzenie EMIR	Rozporządzenie w sprawie infrastruktury unijnego rynku kapitałowego – Rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i repozytoriów transakcji – zwane również „Rozporządzeniem”
ESMA	Europejski Urząd Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych
UE	Unia Europejska
ISO	Międzynarodowa Organizacja Normalizacyjna
ITS	Wykonawcze standardy techniczne
LEI	Identyfikator podmiotu prawnego
MAR	Rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 596/2014 z dnia 16 kwietnia 2014 r. w sprawie nadużyć na rynku (rozporządzenie w sprawie nadużyć na rynku).
MiFIR	Rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 600/2014 w sprawie rynków instrumentów finansowych oraz zmieniające rozporządzenie (UE) nr 648/2012
MMSR	Rozporządzenie Europejskiego Banku Centralnego (UE) nr 1333/2014 z dnia 26 listopada 2014 r. w sprawie statystyki rynków pieniężnych
NCA	Właściwy organ nadzoru
Dz.U.	Dziennik Urzędowy Unii Europejskiej
OTC	Będący przedmiotem obrotu poza obrotem zorganizowanym
Q&A	Pytania i odpowiedzi
RTS	Regulacyjne standardy techniczne

SFTR	Rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 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 648/2012
TR	Repozytorium transakcji
UTI	Niepowtarzalny identyfikator transakcji
XML	Rozszerzalny język znaczników
XSD	Definicja schematu XML

4 Cel

8. W związku z powyższym niniejsze wytyczne zmierzają do osiągnięcia trzech celów:

- a. Usunięcia przeszkód w zakresie możliwości przenoszenia z konkurencyjnego środowiska TR stanowiącego podstawę rozporządzenia EMIR oraz zapewnić uczestnikom TR możliwość korzystania ze środowiska obejmującego wiele TR;
- b. Zapewnienie jakości danych dostępnych dla organów, w tym agregacji dokonanych przez TR, nawet w przypadku gdy uczestnik TR zmienia TR, któremu dokonuje zgłoszeń, oraz bez względu na powód dokonania takiej zmiany;
- c. Zapewnieniu zgodnego i zharmonizowanego sposobu przenoszenia danych z jednego TR do innego TR oraz wspierać ciągłość dokonywania zgłoszeń i porozumienie we wszystkich sprawach, w tym wycofania rejestracji TR.

9. Potrzeba przeniesienia danych do innego TR może powstać z różnych przyczyn. W związku z tym wytyczne obejmują oddzielnie sytuacje, w przypadku których (i) przeniesienie jest spowodowane wycofaniem rejestracji TR, a oddzielnie sprawy, w przypadku których (ii) przeniesienie następuje dobrowolnie w zwykłych warunkach rynkowych. Przyczyny, jak i motywacja, określonych stron w każdym z obydwu przypadków będzie różna i dlatego konieczne jest stosowanie określonego podejścia w każdej konkretnej sytuacji.

10. W wytycznych ustalono ogólne zasady, które powinny być przestrzegane przez uczestników TR, np. RSE, kontrahentów i CCP z jednej strony oraz TR z drugiej strony. Zasady te zostały uzupełnione określonymi procedurami podanymi w sekcjach 7 i 8 niniejszego dokumentu w celu zapewnienia terminowego i właściwego przeniesienia danych o szczegółach informacjach o instrumentach pochodnych.

11. Niniejsze wytyczne nie obejmują jednak sytuacji, które nie wymagają przeniesienia danych, takich jak dane tych zgłaszających kontrahentów, którzy zdecydowali się dokonać zgłoszenia dwóm lub większej liczbie TR w tym samym czasie.

5 Zgodność z prawem

12. Niniejszy dokument zawiera wytyczne wydane na mocy art. 16 rozporządzenia w sprawie ESMA. Zgodnie z art. 16 ust. 3 rozporządzenia w sprawie ESMA właściwe organy i uczestnicy rynku finansowego mają obowiązek dołożyć wszelkich starań, aby zastosować się do wytycznych i zaleceń.

6 Wytyczne

1. Przeniesienie danych dotyczących instrumentów pochodnych powinno zostać dokonane wyłącznie przez stare TR i nowe TR. Nowe TR nie powinny przyjmować dublujących się zgłoszeń od uczestników TR dotyczących danych o tych instrumentach pochodnych, które podlegają przeniesieniu. Stare TR nie powinny przyjmować od uczestników TR zgłoszeń o rodzajach czynności „Anulowanie” i „Błąd” dotyczących instrumentów pochodnych podlegających przeniesieniu.
2. Przeniesienie danych powinno być dokonane przez TR zgodnie ze wspólnie uzgodnionym planem migracji. Plan migracji powinien zawierać szczegółowe rozplanowanie (harmonogram) oraz opis kontroli wymaganych do przeprowadzenia dla zapewnienia terminowego, kompletnego i dokładnego przeniesienia danych.
3. Wszystkie TR powinny korzystać ze standardowego szablonu planu migracji uzgodnionego wzajemnie przez wszystkie TR zgodnego z treścią określoną w wytycznej 4.
4. Plan migracji powinien zawierać następujące informacje:
 - i. Zakres przenoszonych danych (np. uczestnik (uczestnicy) TR, określone instrumenty pochodne, których dotyczy migracja, etc.)
 - ii. Szczegółowy opis ról i obowiązków zaangażowanych podmiotów
 - iii. Harmonogram i główne etapy dokonania przeniesienia
 - iv. Kontrole wymagane dla zapewnienia poufności przenoszonych danych (np. rodzaj stosowanego szyfrowania)
 - v. Kontrole wymagane dla zapewnienia integralności i dokładności przenoszonych danych (np. kryptograficzne sumy kontrolne i algorytmy haszujące)

- vi. Kontrole wymagane dla zapewnienia ciągłości działania i zachowania statusu zgodności pomiędzy TR przenoszonych danych dotyczących instrumentów pochodnych.
 - vii. Ostateczny termin i dostępność danych
 - viii. Wszelkie inne informacje ułatwiające i zabezpieczające sprawne przeniesienie danych.
5. TR powinny przenosić dane pomiędzy sobą, korzystając z formatu XML i szablonu określonego zgodnie z art. 4 zmienionych RTS 151/2013. Jednak w przypadku (i) danych o transakcjach na instrumentach pochodnych, których raportowanie nie jest zaległe w momencie przeniesienia, (ii) danych o transakcjach na instrumentach pochodnych, których raportowanie jest zaległe i które nie zostały zmienione po dacie wejścia w życie nowelizacji rozporządzenia delegowanego Komisji nr 148/2013, lub (iii) danych o transakcjach na instrumentach pochodnych, które zostały odrzucone, TR mogą korzystać z plików wartości przedzielonych przecinkiem (csv). W plikach, które zostaną przeniesione, stare TR powinno zamieścić wszystkie stosowne szczegółowe informacje o instrumentach pochodnych podlegających przeniesieniu.
 6. TR powinny korzystać z bezpiecznych protokołów *machine-to-machine*, w tym Protokołu Transferu Plików SSH, w celu przenoszenia danych pomiędzy sobą.
 7. TR powinny korzystać z zaawansowanych protokołów szyfrowania oraz powinny wymieniać określone publiczne klucze kryptograficzne ze swoimi partnerami. Aby zapewnić nieprzerwane kodowanie danych, TR powinny uprzednio sprawdzić czy są w stanie zakodować i odkodować swoje wzajemne pliki z danymi.
 8. Stare TR powinno obliczyć liczbę instrumentów pochodnych oraz liczbę powiązanych zdarzeń w cyklu życia, które zostaną przeniesione do nowego TR. Stare TR powinno zażądać potwierdzenia przez uczestnika TR liczb dotyczących danych o transakcjach na instrumentach pochodnych, których raportowanie jest zaległe oraz powinno usunąć wszelkie rozbieżności przy najbliższej okazji, ale nie później niż w terminie pięciu dni roboczych.
 9. Dla każdego wygenerowanego i przeniesionego pliku stare TR powinno wygenerować kryptograficzną sumę kontrolną i uwzględnić ją podczas przenoszenia danych zgodnie ze wzajemnie ustalonym algorytmem haszującym.
 10. Przeniesienie danych żądane przez uczestnika TR powinno zostać zrealizowane zasadniczo w dniu niebędącym dniem roboczym. Stare i nowe TR mogą jednak zgodzić się na jego realizację w dniu roboczym w zależności od oczekiwanego wolumenu danych do przeniesienia.
 11. Niezwłocznie po potwierdzeniu przez nowe TR przeniesienia danych o transakcjach na instrumentach pochodnych, których raportowanie jest zaległe, stare TR nie powinno

przyjmować zgłoszeń o zdarzeniach w cyklu życia oraz danych o pozycjach dotyczących instrumentów pochodnych podlegających przeniesieniu do nowego TR.

12. Do momentu zakończenia transferu wszystkich określonych plików podlegających przeniesieniu, nowe TR nie powinno przyjmować zdarzeń w cyklu życia ani danych o pozycjach dotyczących instrumentów pochodnych podlegających przeniesieniu. Dane o transakcjach na instrumentach pochodnych, których raportowanie jest zaległe powinny być udostępnione przez stare TR stosownym organom.
13. W momencie zakończenia transferu danych nowe TR powinno:
 - i. Udostępnić dane organom
 - ii. Włączyć dane podlegające przeniesieniu do stosownych agregacji publicznych i przeznaczonych wyłącznie dla organów
 - iii. Włączyć dane do procesu dokonywania uzgodnień pomiędzy TR, stosownie do przypadku.
14. Po przeniesieniu zapisów uczestnika TR do innego TR, stare TR nie powinno pobierać żadnych określonych opłat za ewidencjonowanie danych o transakcjach na instrumentach pochodnych, których raportowanie nie jest zaległe.
15. W przypadku gdy nie wszystkie dane w zakresie planu migracji mogą zostać przeniesione jednorazowo, TR powinny przenosić dane zgodnie z następującą kolejnością:
 - i. Aktualny stan otrzymanych danych o transakcjach na instrumentach pochodnych, których raportowanie jest zaległe, tj. „stan transakcji”;
 - ii. Zgłoszenia dotyczące zdarzeń w cyklu życia dotyczących danych o transakcjach na instrumentach pochodnych, których raportowanie jest zaległe;
 - iii. Wszystkie zbyte, skompresowane i płatne instrumenty pochodne, które nadal podlegają wymogowi art. 80 ust. 3 rozporządzenia EMIR, wraz z określonymi zdarzeniami w cyklu życia;
 - iv. Wszystkie błędne instrumenty pochodne, które nadal podlegają wymogowi art. 80 ust. 3 rozporządzenia EMIR, wraz z określonymi zdarzeniami w cyklu życia;
 - v. Wszystkie odrzucone instrumenty pochodne zgłoszone przez uczestnika TR, które nie przeszły walidacji danych (wyłącznie w przypadku wycofania rejestracji); oraz
 - vi. Rejestr zgłoszeń, w którym rejestruje się powód lub powody modyfikacji, datę, datownik i zrozumiały opis zmian (w tym stare i nowe treści określonych danych) dotyczące przenoszonych instrumentów pochodnych.

16. W przypadku przenoszenia danych na żądanie uczestnika TR, stare TR powinno określić, czy wszystkie lub niektóre instrumenty pochodne dotyczące kontrahentów będących niezgłaszającymi uczestnikami TR, które zostały zgłoszone przez uczestnika TR, powinny zostać przeniesione do nowego TR.
17. Jeśli w przypadku przenoszenia danych na żądanie uczestnika TR niezgłaszający uczestnik TR zdecyduje się pozostać u starego TR, mimo że jego zgłaszający uczestnik TR zażądał przeniesienia do innego TR, stare TR powinno oddzielić instrumenty pochodne złożone w imieniu niezgłaszającego uczestnika TR od przenoszonych instrumentów pochodnych.
18. W przypadku przenoszenia danych na żądanie uczestnika TR, kiedy rejestracja starego TR nie została wycofana ani nie jest w trakcie wycofywania, zakres danych powinien obejmować co najmniej:
 - i. Wszystkie dane o transakcjach na instrumentach pochodnych, których raportowanie jest zaległe, uczestnika TR lub, w przypadku gdy uczestnik TR jest RSE, instrumenty pochodne klientów uczestnika TR, którzy potwierdzili uczestnikowi TR swoją zgodę na przeniesienie instrumentów pochodnych do innego TR;
 - ii. Wszelkie zdarzenia w cyklu życia, takie jak modyfikacje, oceny, etc. dotyczące danych o transakcjach na instrumentach pochodnych, których raportowanie jest zaległe; oraz
 - iii. Rejestr zgłoszeń dotyczący przenoszonych instrumentów pochodnych.

Należy dokonać wszelkich starań, aby dane z ppkt. i oraz ii zostały przeniesione jednorazowo.

19. W przypadku przenoszenia danych na żądanie uczestnika TR proces opisany w załączniku I Procedura przeniesienia na żądanie uczestnika TR powinien zostać zrealizowany przez stare i nowe TR. TR powinny uzgodnić plan migracji w zakresie przeniesienia danych danego uczestnika TR tak szybko jak to możliwe oraz nie później niż w terminie pięciu dni roboczych od otrzymania żądania.
20. W przypadku przenoszenia danych na żądanie uczestnika TR, niezwłocznie po przeniesieniu danych o transakcjach na instrumentach pochodnych, których raportowanie jest zaległe, pochodnych uczestnika TR do nowego TR, nowe TR powinno potwierdzić przeniesienie uczestnikowi TR, staremu TR, pozostałym TR oraz właściwym organom mającym dostęp do instrumentów pochodnych zgłaszanych przez uczestnika TR.
21. W przypadku przenoszenia danych na żądanie uczestnika TR, stare TR powinno wyodrębnić i zabezpieczyć przenoszone dane, stosując takie same zasady polityki, procedury i zabezpieczenia do przenoszonych danych w zakresie ewidencjonowania jak w stosunku do pozostałych danych dotyczących instrumentów pochodnych zgłaszanych

temu TR przez co najmniej trzy miesiące oraz powinno zapewnić odzyskanie danych w terminie nie dłuższym niż siedem dni kalendarzowych.

22. W przypadku dokonywania przeniesienia na żądanie uczestnika TR wszelkie opłaty naliczane przez stare lub nowe TR powinny być uzasadnione kosztami, niedyskryminacyjne i ujęte w udostępnionej publicznie taryfie opłat określonego TR.
23. W przypadku wycofania rejestracji TR przeniesienie danych powinno obejmować wszelkie szczegółowe informacje o instrumentach pochodnych zgłoszonych do TR, w tym odrzuconych, oraz określony rejestr zgłoszeń. Należy kierować się kolejnością przenoszenia danych określoną w wytycznej 15.
24. W przypadku wycofania rejestracji TR plan(y) migracji dla przeniesienia danych powinny zostać włączone jako część planu likwidacji przedstawionego przez TR.
25. W przypadku gdy przeniesienie danych jest związane z wycofaniem rejestracji TR, stare TR i nowe TR powinny stosować procedurę określoną w załączniku II - Procedurę migracji w przypadku wycofania rejestracji. Należy odpowiednio kierować się kolejnością przenoszenia danych określoną w wytycznej 15. Stare TR, tj. TR, którego rejestracja ma zostać wycofana, powinno przekazać ESMA wystarczający dowód potwierdzający, że wszystkie transfery zostały pomyślnie przeprowadzone.
26. W przypadku wycofania rejestracji na żądanie TR, TR powinno uprzednio powiadomić ESMA o planowanej dacie zaprzestania prowadzenia operacji, a następnie powinno niezwłocznie powiadomić o tym uczestników TR i określone NCA. W przypadku TR posiadających ponad 500 uczestników TR powiadomienie powinno zostać przekazane co najmniej dziewięć miesięcy wcześniej, natomiast w przypadku TR posiadających poniżej 500 uczestników TR powiadomienie powinno zostać przekazane co najmniej sześć miesięcy wcześniej.
27. W przypadku wycofania rejestracji, po zakończeniu transferu(-ów), nowe TR powinno potwierdzić takie zakończenie uczestnikom TR, wszystkim pozostałym TR oraz odpowiednim NCA.
28. W przypadku wycofania rejestracji stare TR powinno wyodrębnić i zabezpieczyć przenoszone dane, stosując takie same zasady polityki, procedury i zabezpieczenia w zakresie ewidencjonowania w stosunku do przenoszonych danych jak w stosunku do pozostałych danych do dnia faktycznego zaprzestania prowadzenia operacji oraz powinno zapewnić terminowe wyszukiwanie danych w terminie nie dłuższym niż siedem dni kalendarzowych. W dniu faktycznego zaprzestania prowadzenia operacji stare TR powinno dokonać bezpiecznego zniszczenia/usunięcia danych zgodnie ze stosowanymi praktykami i dostępnymi najbardziej wiarygodnymi technikami, uniemożliwiając przywrócenie czy odzyskanie danych po tym dniu.
29. W przypadku wycofania rejestracji żadne z TR nie powinno pobierać opłat za przeniesienie danych.

7 Załącznik I - Procedura przeniesienia danych na żądanie uczestnika TR

<p>A. Planowanie i przygotowanie</p>
<p>Po podpisaniu odpowiedniego porozumienia umownego z uczestnikiem TR, nowe TR kontaktuje się ze starym TR i uzgadnia plan migracji opracowany zgodnie z wytyczną 3.</p> <p>Nowe TR powiadamia pocztą elektroniczną stosowne organy o dokonaniu transferu.</p>
<p>Stare TR określa i uzgadnia z uczestnikiem TR następujące informacje zbiorcze dotyczące instrumentów pochodnych uczestnika TR podlegających przeniesieniu:</p> <ul style="list-style-type: none"> ○ Całkowitą liczbę transakcji na instrumentach pochodnych, których raportowanie jest zaległe ○ Całkowitą liczbę zgłoszeń dotyczących zdarzeń w cyklu życia tych instrumentów pochodnych ○ Całkowitą liczbę zgłoszeń dotyczących zbytych, skompresowanych i płatnych instrumentów pochodnych (w przypadku gdy są przenoszone) ○ Całkowitą liczbę zgłoszeń dotyczących błędnych instrumentów pochodnych (w przypadku gdy są przenoszone)
<p>Stare TR powinno żądać od uczestnika TR potwierdzenia zgodności powyższych informacji z zapisami uczestnika TR⁵. W przypadku rozbieżności stare TR powinno ustalić z uczestnikiem TR odpowiednią liczbę i uzgodnić ostateczny wykaz zgłoszeń instrumentów pochodnych, które zostaną przeniesione. Stare TR powinno usunąć wszystkie rozbieżności przy najbliższej okazji, lecz nie później niż w terminie pięciu dni roboczych.</p>
<p>B. Realizacja transferu</p>
<p>Po potwierdzeniu liczby instrumentów pochodnych i zapisów, stare TR powinno przystąpić do wygenerowania odpowiedniego pliku (odpowiednich plików) zgodnie z wytyczną 5 oraz stosownymi zasadami ogólnymi.</p>
<p>Stare i nowe TR wykonują plan migracji. Stare TR powinno przenieść wygenerowane pliki do nowego TR, który potwierdza przeniesienie plików.</p> <p>W przypadku, gdy pozwala na to wielość plików, stare TR powinno przenieść w tym samym czasie plik (pliki) z danymi o transakcjach na instrumentach pochodnych, których raportowanie jest zaległe, jak również plik (pliki) ze zdarzeniami w ich cyklu życia.</p>

⁵ 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 TR, który dokonuje zgłoszenia w imieniu innych, powinien on korzystać również z własnych zapisów.

W przypadku gdy wielkość plików nie pozwala na jednoczesny transfer, należy kierować się kolejnością określoną w wytycznej 15.

W związku z tym dane o transakcjach na instrumentach pochodnych, których raportowanie jest zaległe powinny zostać przeniesione w trakcie wcześniej określonego weekendu, podczas gdy zdarzenia w cyklu życia przy najbliższej okazji w terminie kolejnego tygodnia kalendarzowego.

C. Weryfikacja przeniesionych danych

Nowe TR powinno określić następujące dane i informacje dotyczące otrzymanych zapisów i zweryfikować kompletność transferu:

- Aktualny stan otrzymanych danych o transakcjach na instrumentach pochodnych, których raportowanie jest zaległe, tj. „stan transakcji”
- Całkowitą liczbę transakcji na instrumentach pochodnych, których raportowanie jest zaległe
- Całkowitą liczbę zapisów dotyczących zdarzeń w cyklu życia transakcji na instrumentach pochodnych, których raportowanie jest zaległe
- Całkowitą liczbę zapisów dotyczących zbytych, skompresowanych i płatnych instrumentów pochodnych (w przypadku gdy są przenoszone)
- Całkowitą liczbę zgłoszeń dotyczących błędnych instrumentów pochodnych (w przypadku gdy są przenoszone)

Nowe TR powinno zażądać od uczestnika TR potwierdzenia zgodności powyższych informacji z zapisami uczestnika TR⁶. W przypadku rozbieżności obydwaj TR powinni starać się uzgodnić określoną liczbę z uczestnikiem TR do momentu osiągnięcia porozumienia.

D. Ostateczne powiadomienia

Nowe TR powinno powiadomić wszystkie TR o tym, że zgłaszający uczestnik zmienił TR. Informacja taka powinna być użyta w celu ułatwienia procesu dokonania uzgodnień dotyczących określonych instrumentów pochodnych, które zostały przeniesione do nowego TR.

Nowe TR powinno powiadomić odpowiednie NCA oraz ESMA o zakończeniu przenoszenia danych uczestnika TR oraz określić rodzaje przeniesionych instrumentów pochodnych.

E. Prowadzenie ewidencji i bezpieczne usuwanie danych

Stare TR powinno usunąć przeniesione transakcje na instrumentach pochodnych, których raportowanie jest zaległe, pochodne z agregacji danych.

Stare TR powinny zachować przeniesione dane tak długo jak jest to zalecane zgodnie z ogólnymi zasadami oraz zgodnie z wymogami rozporządzenia EMIR obowiązującymi przed dokonaniem transferu.

Stare TR powinno zachować rejestr zgłoszeń przez co najmniej 10 lat od zakończenia obowiązywania określonych kontraktów.

Stare TR zniszczy/usunie przeniesione dane, kiedy będzie to dozwolone, zgodnie z określonymi ogólnymi zasadami dotyczącymi bezpiecznego usuwania/niszczenia.

⁶ 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 TR, który dokonuje zgłoszenia w imieniu innych, powinien on korzystać również z własnych zapisów.

8 Załącznik II - Procedura migracji w przypadku wycofania rejestracji

<p>A. Powiadomienia wstępne</p> <p>(Wycofanie dobrowolne) TR powiadamia ESMA, uczestników TR, inne zaangażowane TR i NCA o złożeniu wniosku o wycofanie swojej rejestracji (zgodnie z wytyczną 25) co najmniej przed planowaną datą zaprzestania prowadzenia operacji (w przypadku, gdy wycofanie jest wnioskowane przez TR).</p> <p>Lub</p> <p>(Wycofanie niedobrowolne) ESMA powiadamia nowe TR i NCA o tym, że nowe TR powinno (powinny) otrzymać dane, które zostały pierwotnie zgłoszone do starego TR (w przypadku gdy wycofanie nie jest wnioskowane przez TR)</p>
<p>B. Planowanie i przygotowanie</p> <p>Stare TR informuje uczestników TR o zamiarze zaprzestania prowadzenia operacji. TR przygotowuje(-ą) plan migracji określony w wytycznej 3 oraz składa(-ją) go do ESMA oraz do nowego (nowych) TR. ESMA oraz inne zaangażowane TR zgłaszają ewentualne zastrzeżenia lub uwagi, a po ich przeanalizowaniu wszystkie strony uzgadniają szczegóły dotyczące planu migracji.</p> <p>Stare TR określa instrumenty pochodne podlegające przeniesieniu oraz przekazuje ESMA i innym zaangażowanym TR (w ramach planu migracji lub oddzielnie) następujące informacje dotyczące instrumentów pochodnych podlegających przeniesieniu, z podziałem na każde TR:</p> <ul style="list-style-type: none"> ○ Całkowitą liczbę transakcji na instrumentach pochodnych, których raportowanie jest zaległe ○ Całkowitą liczbę zapisów dotyczących zdarzeń w cyklu życia transakcji na instrumentach pochodnych, których raportowanie jest zaległe ○ Całkowitą liczbę zapisów dotyczących zbytych, skompresowanych i płatnych instrumentów pochodnych ○ Całkowitą liczbę zapisów dotyczących błędnych instrumentów pochodnych ○ Liczbę wpisów w rejestrze zgłoszeń
<p>C. Realizacja transferu</p> <p>Po potwierdzeniu liczby instrumentów pochodnych i zapisów, stare TR powinno przystąpić do wygenerowania odpowiedniego pliku (odpowiednich plików) zgodnie z wytyczną 5.</p> <p>Stare i nowe TR wykonują plan migracji. Wygenerowane pliki są przenoszone ze starego TR do nowego (nowych) TR, które potwierdzają każdy transfer.</p> <p>Należy przestrzegać określonych w wytycznej 15 priorytetów dotyczących kolejności przenoszenia instrumentów pochodnych i zapisów.</p>

<p>Jeśli to możliwe transakcje na instrumentach pochodnych, których raportowanie jest zaległe powinny zostać przeniesione w trakcie weekendu, natomiast zdarzenia w ich cyklu życia oraz wyceny/zabezpieczenia przy najbliższej okazji, ale nie później niż w terminie tygodnia.</p> <p>Jeśli nie jest to możliwe, wówczas transakcje na instrumentach pochodnych, których raportowanie jest zaległe, powinny zostać podzielone według uczestników TR na dwie lub trzy grupy, które zostaną przeniesione w trakcie kolejnych weekendów. Zdarzenia w cyklu życia obejmujące taką grupę powinny zostać przeniesione przy najbliższej okazji, ale nie później niż do końca tygodnia następującego po przeniesieniu określonej grupy transakcji na instrumentach pochodnych, których raportowanie jest zaległe.</p>
<p>Pozostałe instrumenty pochodne powinny zostać przeniesione jak najszybciej w terminie miesiąca od zakończenia transferu danych o transakcjach na instrumentach pochodnych, których raportowanie jest zaległe</p> <p>Wszelkie zidentyfikowane kwestie i dokonane postępy są zgłaszane regularnie ESMA w sposób terminowy.</p>
<p>D. Weryfikacja przeniesienia danych</p>
<p>Nowe TR powinno (powinny) określić następujące dane i informacje dotyczące otrzymanych zapisów i zweryfikować kompletność transferu:</p> <ul style="list-style-type: none"> ○ Aktualny stan otrzymanych danych o transakcjach na instrumentach pochodnych, których raportowanie jest zaległe, tj. „stan transakcji” ○ Całkowitą liczbę transakcji na instrumentach pochodnych, których raportowanie jest zaległe ○ Całkowitą liczbę zapisów dotyczących zdarzeń w cyklu życia transakcji na instrumentach pochodnych, których raportowanie jest zaległe ○ Całkowitą liczbę zapisów dotyczących zbytych, skompresowanych i płatnych instrumentów pochodnych ○ Całkowitą liczbę zapisów dotyczących błędnych instrumentów pochodnych ○ Liczbę wpisów w rejestrze zgłoszeń
<p>Nowe TR powinny powiadomić ESMA oraz stare TR o wyniku weryfikacji. W przypadku niepowodzenia weryfikacji podstawowa przyczyna jest badana przez obydwie strony (stare i nowe TR), a proces przeniesienia jest powtarzany do momentu pomyślnego przeprowadzenia przeniesienia danych.</p>
<p>E. Ostateczne powiadomienia</p>
<p>Nowe TR powinny powiadomić określonych uczestników TR, wszystkie pozostałe TR oraz odpowiednie NCA (pocztą elektroniczną) o pomyślnym zakończeniu przeniesienia.</p>
<p>F. Prowadzenie ewidencji i bezpieczne usuwanie danych</p>
<p>Stare TR powinno zachować przeniesione dane przez okres określony w wytycznej 28 oraz zgodnie z wymogami rozporządzenia EMIR obowiązującymi przed dokonaniem transferu.</p>
<p>Stare TR powinno zniszczyć/usunąć przeniesione dane, kiedy jest to dozwolone, zgodnie z określonymi zasadami dotyczącymi bezpiecznego usuwania/niszczania określonymi w wytycznej 28.</p>