

## DELEGIERTE VERORDNUNG (EU) Nr. 151/2013 DER KOMMISSION

vom 19. Dezember 2012

zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister im Hinblick auf technische Regulierungsstandards für die von Transaktionsregistern zu veröffentlichenden und zugänglich zu machenden Daten sowie operationelle Standards für die Zusammenstellung und den Vergleich von Daten sowie den Datenzugang

(Text von Bedeutung für den EWR)

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

nach Stellungnahme der Europäischen Zentralbank <sup>(1)</sup>,

gestützt auf die Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 4. Juli 2012 über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister <sup>(2)</sup>, insbesondere auf Artikel 81 Absatz 5,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) Es ist unerlässlich, dass einschlägige Kontrakte und deren betreffende Gegenparteien eindeutig identifiziert werden. Nach einem funktionalen Ansatz sollte bei Stellen, die auf die Daten von Transaktionsregistern zugreifen, berücksichtigt werden, welche Befugnisse sie haben und welche Funktionen sie wahrnehmen.
- (2) Die Europäische Wertpapieraufsichtsbehörde (ESMA) sollte für die Zwecke der Transaktionsregisterbeaufsichtigung Zugang zu allen von Transaktionsregistern auf Transaktionsebene vorgehaltenen Daten erhalten, damit sie um Auskünfte ersuchen, angemessene Aufsichtsmaßnahmen ergreifen und außerdem überwachen kann, ob die Registrierung als Transaktionsregister aufrechterhalten oder widerrufen werden sollte.
- (3) Angesichts ihrer Aufgaben im Rahmen der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde) <sup>(3)</sup> und der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 sollte die ESMA aufgrund verschiedener Mandate Zugang erhalten. Der Datenzugang einzelner Mitarbeiter der ESMA sollte jeweils mit diesen spezifischen Einzelmandaten in Einklang stehen.
- (4) Der Europäische Ausschuss für Systemrisiken (ESRB), die ESMA und die einschlägigen Mitglieder des Europäischen Systems der Zentralbanken (ESZB), einschließlich bestimmter nationaler Zentralbanken und einschlägiger Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörden der Union, haben ein Mandat, die Finanzstabilität in der Union zu überwachen und zu erhalten, und sollten daher für die Zwecke ihrer diesbezüglichen jeweiligen Aufgaben auf Transaktionsdaten in Bezug auf alle Gegenparteien zugreifen können.
- (5) Aufsichtsbehörden und Überwachungsinstanzen zentraler Gegenparteien (CCPs) brauchen den Zugang, um ihre

Pflichten in Bezug auf solche Einrichtungen effektiv erfüllen zu können, und sollten daher Zugang zu allen Informationen erhalten, die für ein solches Mandat nötig sind.

- (6) Der Zugang der einschlägigen Mitglieder des ESZB dient der Erfüllung ihrer grundlegenden Aufgaben, insbesondere der Funktionen einer zentralen Notenbank, ihres Finanzstabilitätsmandats und in einigen Fällen der Beaufsichtigung bestimmter Gegenparteien. Da einige Mitglieder des ESZB im Rahmen der nationalen Rechtsvorschriften verschiedene Mandate haben, sollten sie entsprechend den verschiedenen in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Mandaten Datenzugang erhalten.
- (7) Die einschlägigen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörden der Union sind in erster Linie mit dem Anlegerschutz in ihrem jeweiligen Rechtsraum beauftragt und sollten Zugang zu Transaktionsdaten über Märkte, Teilnehmer, Produkte und Basiswerte erhalten, die unter ihre Aufsichts- und Durchsetzungsmandate fallen.
- (8) Die gemäß Artikel 4 der Richtlinie 2004/25/EG des Europäischen Parlaments und des Rates vom 21. April 2004 betreffend Übernahmeangebote <sup>(4)</sup> benannten Behörden sollten Zugang zu den Transaktionen mit Eigenkapitalderivaten erhalten, sofern der Basiswert entweder in ihrem Rechtsraum zum Handel auf einem geregelten Markt zugelassen ist, seine offizielle Anschrift in ihrem Rechtsraum unterhält oder ein Bieter um eine in ihrem Rechtsraum zum Handel auf einem geregelten Markt zugelassene Gesellschaft ist und die von ihm angebotene Gegenleistung Wertpapiere beinhaltet.
- (9) Die Agentur für die Zusammenarbeit der Energieregulierungsbehörden (ACER) sollte für die Zwecke der Überwachung der Energiegroßhandelsmärkte zur Aufdeckung und Verhinderung von Marktmissbrauch in Zusammenarbeit mit den nationalen Regulierungsbehörden und für die Zwecke der Überwachung der Energiegroßhandelsmärkte zur Aufdeckung und Verhinderung von Marktmissbrauch gemäß der Verordnung (EU) Nr. 1227/2011 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 25. Oktober 2011 über die Integrität und Transparenz des Energiegroßhandelsmarkts (REMIT) <sup>(5)</sup> Zugang erhalten. Folglich sollte die ACER Zugang zu allen Daten haben, die ein Transaktionsregister in Bezug auf Energiederivate vorhält.

<sup>(1)</sup> Noch nicht im Amtsblatt veröffentlicht.

<sup>(2)</sup> ABl. L 201 vom 27.7.2012, S. 1.

<sup>(3)</sup> ABl. L 331 vom 15.12.2010, S. 84.

<sup>(4)</sup> ABl. L 142 vom 30.4.2004, S. 12.

<sup>(5)</sup> ABl. L 326 vom 8.12.2011, S. 1.

- (10) Die Verordnung (EU) Nr. 648/2012 erstreckt sich nur auf Handelsdaten und nicht auf Vorhandelsdaten wie die nach der Verordnung (EU) Nr. 1227/2011 aufzeichnungspflichtigen Handelsaufträge. Daher sollten Transaktionsregister für die ACER in dieser Hinsicht nicht als geeignete Informationsquelle angesehen werden.
- (11) Bei einem funktionalen Ansatz in Bezug auf den Zugang zu den Daten von Transaktionsregistern ist die Aufsicht eine wichtige Komponente. Ebenso könnten verschiedene Behörden ein Aufsichtsmandat haben. Aus diesem Grund sollte der Zugang zu Transaktionsdaten über die einschlägigen Einrichtungen für alle in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Behörden sichergestellt werden.
- (12) Stellen, die im Rahmen von Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 auf Transaktionsregisterdaten zugreifen, sollten sicherstellen, dass sie Grundsätze aufrechterhalten und durchsetzen, die gewährleisten, dass nur die einschlägigen Personen zu einem klar definierten und rechtlich begründeten Zweck auf die Informationen zugreifen, wobei auch klargestellt werden sollte, welche etwaigen anderen Personen zum Zugriff auf diese Daten befugt sind.
- (13) Der Datenzugang sollte auf drei Aggregationsebenen betrachtet werden. Transaktionsdaten sollten Einzelheiten zu einzelnen Geschäftsabschlüssen enthalten; Positionsdaten sollten sich auf die aggregierten Positionsdaten nach Basiswert/Produkt für einzelne Gegenparteien beziehen; und aggregierte nominale Daten sollten den Gesamtpositionen nach Basiswert/Produkt ohne Angaben zur Gegenpartei entsprechen. Der Zugang zu Transaktionsdaten würde auch den Zugang zu Positionsdaten und aggregierten Daten beinhalten. Der Zugang zu Positionsdaten würde auch den Zugang zu aggregierten Daten beinhalten, nicht aber zu Transaktionsdaten. Umgekehrt sollte der Zugang zu aggregierten nominalen Daten der weniger granularen Kategorie entsprechen und sollte keinen Zugang zu Positions- oder Transaktionsdaten beinhalten.
- (14) Diese Verordnung stützt sich auf den Entwurf technischer Regulierungsstandards, der der Kommission von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) vorgelegt wurde.
- (15) Gemäß Artikel 10 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 hat die ESMA vor der Vorlage des Entwurfs technischer Regulierungsstandards, auf den sich die vorliegende Verordnung stützt, die einschlägigen Behörden und die Mitglieder des Europäischen Systems der Zentralbanken (ESZB) konsultiert. Die ESMA hat außerdem eine offene öffentliche Konsultation zu diesem Entwurf technischer Regulierungsstandards durchgeführt, die damit verbundenen potenziellen Kosten- und Nutzeneffekte analysiert und die Stellungnahme der nach Artikel 37 der genannten Verordnung eingesetzten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte eingeholt —
- a) eine Aufschlüsselung der aggregierten offenen Positionen nach folgenden Derivatekategorien:
- i) Warenderivate,
  - ii) Kreditderivate,
  - iii) Devisenderivate,
  - iv) Aktienderivate,
  - v) Zinsderivate,
  - vi) Sonstige;
- b) eine Aufschlüsselung der aggregierten Transaktionsvolumen nach folgenden Derivatekategorien:
- i) Warenderivate,
  - ii) Kreditderivate,
  - iii) Devisenderivate,
  - iv) Aktienderivate,
  - v) Zinsderivate,
  - vi) Sonstige;
- c) eine Aufschlüsselung der aggregierten Werte nach folgenden Derivatekategorien:
- i) Warenderivate,
  - ii) Kreditderivate,
  - iii) Devisenderivate,
  - iv) Aktienderivate,
  - v) Zinsderivate,
  - vi) Sonstige.
- (2) Die Daten werden auf einer Website oder über ein Online-Portal veröffentlicht, die für die Öffentlichkeit leicht zugänglich sind und mindestens einmal wöchentlich aktualisiert werden.

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

#### Artikel 1

##### Veröffentlichung aggregierter Daten

- (1) Transaktionsregister veröffentlichen die in Artikel 81 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 vorgesehenen Daten, die mindestens Folgendes beinhalten:

#### Artikel 2

##### Datenzugang einschlägiger Behörden

- (1) Ein Transaktionsregister verschafft der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) zwecks Wahrnehmung ihrer Aufsichtsbefugnisse Zugang zu allen Transaktionsdaten.

(2) Die ESMA setzt interne Verfahren in Kraft, um einen angemessenen Mitarbeiterzugang und etwaige relevante Zugangsbeschränkungen im Zusammenhang mit nichtaufsichtlichen Tätigkeiten im Rahmen des Mandats der ESMA sicherzustellen.

(3) Ein Transaktionsregister verschafft der Behörde für die Zusammenarbeit der Energieregulierungsbehörden (ACER) Zugang zu allen Transaktionsdaten über Derivate, sofern es sich beim Basiswert um Energie oder Emissionszertifikate handelt.

(4) Ein Transaktionsregister verschafft einer für die Beaufsichtigung einer CCP zuständigen Behörde und, falls anwendbar, dem für die Überwachung der CCP relevanten Mitglied des Europäischen Systems der Zentralbanken (ESZB) Zugang zu den Daten über alle Transaktionen, die von der CCP gecleart oder gemeldet wurden.

(5) Ein Transaktionsregister verschafft einer für die Beaufsichtigung der Ausführungsplätze der gemeldeten Kontrakte zuständigen Behörde Zugang zu allen Transaktionsdaten über die an diesen Plätzen ausgeführten Kontrakte.

(6) Ein Transaktionsregister verschafft einer gemäß Artikel 4 der Richtlinie 2004/25/EG benannten Aufsichtsbehörde Zugang zu allen Transaktionsdaten über Derivate, wenn der Basiswert ein Wertpapier ist, das von einer Gesellschaft ausgegeben wurde, die eine der folgenden Bedingungen erfüllt:

- a) Sie ist in ihrem Rechtsraum zum Handel auf einem geregelten Markt zugelassen;
- b) sie unterhält ihren satzungsmäßigen Sitz oder, sofern sie keinen satzungsmäßigen Sitz hat, ihre Hauptverwaltung in ihrem Rechtsraum;
- c) sie ist Bieter um ein unter den Buchstaben a oder b vorgesehene Unternehmen und die von ihr angebotene Gegenleistung beinhaltet Wertpapiere.

(7) Die gemäß Absatz 6 zur Verfügung zu stellenden Daten beinhalten Angaben zu Folgendem:

- a) Wertpapiere, die den Basiswert darstellen,
- b) Derivatekategorie,
- c) Zeichen der Position,
- d) Anzahl der Referenzpapiere,
- e) Gegenparteien des Derivats.

(8) Ein Transaktionsregister verschafft den in Artikel 81 Absatz 3 Buchstabe h der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten einschlägigen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörden der

Union Zugang zu allen Transaktionsdaten über Märkte, Teilnehmer, Kontrakte und Basiswerte, die gemäß ihrer jeweiligen Aufsichtszuständigkeiten und -mandate in ihren Bereich fallen.

(9) Ein Transaktionsregister stellt dem Europäischen Ausschuss für Systemrisiken (ESRB), der ESMA und den einschlägigen Mitgliedern des ESZB Daten auf Transaktionsebene zur Verfügung:

- a) für alle Gegenparteien in ihrem jeweiligen Rechtsraum,
- b) für Derivatekontrakte, bei denen das Referenzunternehmen des Derivatekontrakts in ihrem jeweiligen Rechtsraum sitzt oder die Referenzverpflichtung ein staatlicher Schuldtitle des jeweiligen Rechtsraums ist.

(10) Ein Transaktionsregister verschafft einem einschlägigen Mitglied des ESZB Zugang zu Positionsdaten für Derivatekontrakte in der von diesem Mitglied ausgegebenen Währung.

(11) Ein Transaktionsregister verschafft den in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten einschlägigen Stellen für die Beaufsichtigung meldepflichtiger Gegenparteien Zugang zu allen Transaktionsdaten dieser Gegenparteien.

### Artikel 3

#### Behörden von Drittstaaten

(1) Im Verhältnis zu einer einschlägigen Behörde eines Drittstaates, der eine internationale Übereinkunft im Sinne des Artikels 75 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 mit der Union geschlossen hat, gewährt ein Transaktionsregister Zugang zu Daten unter Berücksichtigung des Mandats und der Aufgaben der Behörde des Drittstaates und in Einklang mit den Bestimmungen der jeweiligen internationalen Übereinkunft.

(2) Im Verhältnis zu einer einschlägigen Behörde eines Drittstaates, der eine Kooperationsvereinbarung im Sinne des Artikels 76 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 mit der Union geschlossen hat, gewährt ein Transaktionsregister Zugang zu Daten unter Berücksichtigung des Mandats und der Aufgaben der Behörde des Drittstaates und in Einklang mit den Bestimmungen der jeweiligen Kooperationsvereinbarung.

### Artikel 4

#### Operationelle Standards für die Zusammenstellung und den Vergleich von Daten

(1) Ein Transaktionsregister verschafft den in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Stellen Zugang nach Maßgabe der Kommunikationsprotokolle, Datenaustausch-Normen und Referenzdaten, die auf internationaler Ebene gebräuchlich sind.

(2) Die Gegenparteien eines Geschäftsabschlusses generieren für jeden Derivatekontrakt eine eindeutige Geschäftsabschluss-Kennziffer (Unique Trade Identifier), um den Transaktionsregistern die Zusammenstellung und den Vergleich von Daten zwischen verschiedenen Transaktionsregistern zu ermöglichen.

*Artikel 5***Operationelle Standards für den Zugang zu Daten**

(1) Ein Transaktionsregister zeichnet Informationen über den Datenzugang, der den in Artikel 81 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 genannten Stellen gewährt wurde, auf.

(2) Die in Absatz 1 genannten Informationen beinhalten:

a) den Umfang der Daten, auf die zugegriffen wurde,

b) einen Verweis auf die Rechtsvorschriften, die zum Zugang zu diesen Daten im Rahmen der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 und der vorliegenden Verordnung berechtigen.

*Artikel 6***Inkrafttreten**

Diese Verordnung tritt am zwanzigsten Tag nach ihrer Veröffentlichung im *Amtsblatt der Europäischen Union* in Kraft.

Diese Verordnung ist in allen ihren Teilen verbindlich und gilt unmittelbar in jedem Mitgliedstaat.

Brüssel, den 19. Dezember 2012

*Für die Kommission*  
*Der Präsident*  
José Manuel BARROSO

---