

II

(Niet-wetgevingshandelingen)

VERORDENINGEN

GEDELEGEERDE VERORDENING (EU) 2018/1229 VAN DE COMMISSIE

van 25 mei 2018

tot aanvulling van Verordening (EU) nr. 909/2014 van het Europees Parlement en de Raad met technische reguleringsnormen inzake afwikkelingsdiscipline

(Voor de EER relevante tekst)

DE EUROPESE COMMISSIE,

Gezien het Verdrag betreffende de werking van de Europese Unie,

Gezien Verordening (EU) nr. 909/2014 van het Europees Parlement en de Raad van 23 juli 2014 betreffende de verbetering van de effectenafwikkeling in de Europese Unie, betreffende centrale effectenbewaarinstellingen en tot wijziging van Richtlijnen 98/26/EG en 2014/65/EU en Verordening (EU) nr. 236/2012 ⁽¹⁾, en met name artikel 6, lid 5, en artikel 7, lid 15,

Overwegende hetgeen volgt:

- (1) De bepalingen in deze verordening zijn onderling nauw verweven, omdat zij handelen over maatregelen om mislukte afwikkelingsoperaties te voorkomen en aan te pakken en afwikkelingsdiscipline aan te moedigen, door monitoring van mislukte afwikkelingsoperaties, door het innen en uitkeren van geldboeten voor mislukte afwikkelingsoperaties en door de operationele aspecten van het buy-inproces nader in te vullen. Om de samenhang tussen die bepalingen te verzekeren en om de personen voor wie deze verplichtingen gelden, een volledig beeld van en een compacte toegang tot deze bepalingen te bieden, dienen deze bepalingen in één enkele verordening te worden opgenomen.
- (2) Gezien het mondiale karakter van financiële markten dient de nodige aandacht te worden geschonken aan de door het Committee on Payment and Settlement Systems en de International Organization of Securities Commissions in april 2012 vastgestelde beginselen voor de infrastructuur van de financiële markten („de CPSS-IOSCO-beginselen”), die als internationale benchmark voor regelgevingsvereisten voor centrale effectenbewaarinstellingen (hierna „CSD’s” genoemd) dienen. Ook dient rekening te worden gehouden met de door het Committee on Payment and Settlement Systems en de International Organization of Securities Commissions uitgebrachte aanbevelingen voor effectenafwikkelingssystemen, die transactiebevestiging, afwikkelingscycli en uitlening van effecten bestrijken.
- (3) Om de coherente toepassing van Verordening (EU) nr. 909/2014 te verzekeren en om nadere invulling te geven aan de technische termen die voor de toepassing van deze verordening nodig zijn, dient een aantal termen te worden gedefinieerd.
- (4) Beleggingsondernemingen dienen ervoor te zorgen dat zij met het oog op een doeltreffende en doelmatige afwikkeling tijdig over alle nodige afwikkelingsgegevens beschikken. Meer bepaald dienen beleggingsondernemingen die niet over de nodige afwikkelingsgegevens beschikken, met hun cliënten te communiceren om de informatie te ontvangen die van belang is voor een doelmatige afwikkeling, daaronder begrepen de gestandaardiseerde gegevens die nodig zijn voor het afwikkelingsproces.
- (5) Volautomatische verwerking van begin tot einde (straight-through processing — „STP”) dient te worden aangemoedigd, omdat marktbreed gebruik van STP van wezenlijk belang is voor zowel het handhaven van hoge afwikkelingspercentages naarmate volumes toenemen als voor het garanderen van snelle afwikkeling van grensoverschrijdende transacties. Bovendien dienen zowel directe als indirecte marktdeelnemers over de interne automatisering te beschikken die nodig is om de beschikbare STP-oplossingen optimaal te kunnen benutten.

⁽¹⁾ PBL 257 van 28.8.2014, blz. 1.

In dit verband dienen beleggingsondernemingen hun professionele cliënten de mogelijkheid te bieden om langs elektronische weg bevestigingen en nadere gegevens over toewijzingen te zenden, met name door gebruik te maken van internationale open communicatieprocedures en -normen voor berichtenverkeer en referentiedata. Voorts dienen CSD's STP te bevorderen en dienen zij bij het verwerken van afwikkelingsinstructies processen te gebruiken die zijn ontworpen om standaard op automatische basis te functioneren.

- (6) CSD's dienen de hele dag door matchingmogelijkheden aan te bieden om snelle afwikkeling op de beoogde afwikkelingsdatum te bevorderen.
- (7) CSD's dienen te verlangen dat deelnemers aan hun effectenafwikkelingssysteem een lijst van verplichte matchingvelden gebruiken voor het matchen van afwikkelingsinstructies, teneinde afwikkeling te faciliteren en coherentie tussen effectenafwikkelingssystemen te verzekeren.
- (8) CSD's dienen over gedegen en doelmatige systeemfunctionaliteiten, gedragslijnen en procedures te beschikken waarmee zij afwikkeling op de beoogde afwikkelingsdatum kunnen faciliteren en bevorderen.
- (9) CSD's dienen deelnemers realtime toegang te bieden tot informatie over de status van hun afwikkelingsinstructies in de effectenafwikkelingssysteem die zij exploiteren, om snelle afwikkeling door die deelnemers aan te moedigen en te bevorderen.
- (10) CSD's dienen een realtimebrutovereenkomst (RTGS) aan te bieden aan deelnemers aan hun effectenafwikkelingssysteem, of ten minste meerdere dagelijkse afwikkelingsmogelijkheden gedurende de werkdag om intraday definitieve afwikkeling af te ronden.
- (11) De verplichting voor CSD's om over systeemfunctionaliteiten te beschikken, dient af te hangen van de afwikkelingsefficiëntie van die CSD's. Bepaalde systeemfunctionaliteiten dienen derhalve niet verplicht te zijn indien de waarde en het percentage van mislukte afwikkelingsoperaties in het door een CSD geëxploiteerd effectenafwikkelingssysteem bepaalde, vooraf vastgestelde drempels niet overschrijdt.
- (12) Om de monitoring van mislukte afwikkelingsoperaties te faciliteren, dienen CSD's gebruik te maken van een geharmoniseerde methodiek om mislukte afwikkelingsoperaties te rapporteren aan de bevoegde autoriteiten en de relevante autoriteiten. Die methodiek dient een gemeenschappelijke lijst van te rapporteren items te omvatten, alsmede de frequentie waarmee moet worden gerapporteerd. Afwikkelingsinstructies die in het door CSD's geëxploiteerde effectenafwikkelingssysteem zijn ingevoerd, dienen dagelijks te worden gemonitord totdat zij zijn afgewikkeld of geannuleerd.
- (13) CSD's dienen werkafspraken aan te gaan met de deelnemers die het hoogste percentage mislukte afwikkelingsoperaties hebben, alsmede, voor zover doenbaar, met de desbetreffende centrale tegenpartijen (hierna „CTP's" genoemd) en handelsplatformen, om de belangrijkste redenen voor mislukte afwikkelingsoperaties in kaart te brengen.
- (14) CSD's dienen maandelijks over mislukte afwikkelingsoperaties te rapporteren aan hun bevoegde autoriteiten en relevante autoriteiten. Bevoegde autoriteiten dienen ook gemachtigd te zijn om over mislukte afwikkelingsoperaties aanvullende informatie te vragen of, zo nodig, frequentere rapportage, zodat zij hun taken kunnen uitoefenen. Die aanvullende informatie of rapportage dient door de verzoekende bevoegde autoriteit onverwijld te worden gedeeld met de relevante autoriteiten.
- (15) Met het oog op transparantie en om de vergelijkbaarheid van mislukte afwikkelingsoperaties over de hele Unie te bevorderen, dienen CSD's gebruik te maken van één template voor openbaarmaking van gegevens over mislukte afwikkelingsoperaties aan het brede publiek.
- (16) Ter wille van de coherente toepassing van vereisten inzake afwikkelingsdiscipline voor CSD's dienen nadere bepalingen te worden vastgesteld met betrekking tot de identificatie van alle transacties die „onafgewikkeld" blijven na de beoogde afwikkelingsdatum, de uitvoering van het buy-inproces (in voorkomend geval) en de toepassing van sanctiemechanismen ingesteld door een CSD, daaronder begrepen het tijdstip van berekening en de inning en uitkering van geldboeten.
- (17) Regels met betrekking tot de processen voor de inning en uitkering van geldboeten voor mislukte afwikkelingsoperaties dienen te worden toegepast in samenhang met Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/389 van de Commissie (¹).

⁽¹⁾ Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/389 van de Commissie van 11 november 2016 van het Europees Parlement en de Raad tot aanvulling van Verordening (EU) nr. 909/2014 wat betreft de parameters voor de berekening van geldboeten voor mislukte afwikkelingsoperaties en de bedrijfsactiviteiten van CSD's in lidstaten van ontvangst (PB L 65 van 10.3.2017, blz. 1).

- (18) Om ervoor te zorgen dat geldboeten voor mislukte afwikkelingsoperaties consequent worden toegepast, dienen CSD's op regelmatige basis geldboeten op te leggen, te innen en uit te keren, en dit ten minste eenmaal per maand. Daarnaast dienen CSD's, om te voorkomen dat hun risicoprofiel aangetast wordt door het functioneren van het sanctiemechanisme, onder meer wanneer nalatige deelnemers geldboeten niet zoals vereist voldoen, alleen belast te zijn met het opleggen, innen en uitkeren van die geldboeten. Aangezien een deelnemer ook als agent voor zijn cliënten kan fungeren, dienen CSD's deelnemers voldoende nadere gegevens te verschaffen met betrekking tot de berekening van de geldboete, zodat zij de geldboeten bij hun cliënten kunnen invorderen.
- (19) Het is van belang dat de geldboete die wordt opgelegd in geval van een mislukte afwikkelingsoperatie, geen inkomstenbron voor CSD's vormt. Bijgevolg dient de geldboete te worden gestort op een afzonderlijke rekening van de CSD, die uitsluitend voor de inning en uitkering van die geldboeten dient te worden gebruikt. De geldboeten die worden geïnd, mogen niet worden gebruikt om de implementatie, het onderhoud of de exploitatie van het sanctiemechanisme te bekostigen.
- (20) In bepaalde gevallen kan een transactie onderdeel zijn van een keten van transacties, in welk geval één afwikkelingsinstructie kan afhangen van een andere afwikkelingsinstructie en de afwikkeling van één instructie de afwikkeling van meerdere instructies in die keten mogelijk kan maken. Het mislukken van één afwikkelingsinstructie kan dus domino-effecten hebben, waardoor opeenvolgende afwikkelingsinstructies mislukken.
- (21) Om het aantal geldoverboekingen te beperken, dienen CSD's bijgevolg het aan deelnemers verschuldigde bedrag te salderen met het bedrag dat die deelnemers verschuldigd zijn, en dienen zij ervoor te zorgen dat het volledige bedrag aan geldboeten binnen de afwikkelingsketen passend wordt verdeeld over de deelnemers die van de mislukte afwikkelingsoperatie te lijden hadden. CSD's dienen deelnemers voldoende informatie te verschaffen over de berekening van de te ontvangen bedragen, zodat die deelnemers, waar passend, de aan hun cliënten verschuldigde bedragen kunnen overboeken.
- (22) Het sanctiemechanisme dient van toepassing te zijn op alle mislukte afwikkelingsoperaties, daaronder begrepen geclearde transacties. Wanneer de nalatige deelnemer echter een CTP is, dient de geldboete niet verschuldigd te zijn door die CTP, maar door het betrokken clearinglid dat de mislukte afwikkelingsoperatie heeft veroorzaakt. Met het oog daarop dienen CSD's CTP's alle nodige informatie te verschaffen over de mislukte afwikkelingsoperatie en de berekening van de geldboeten, om CTP's in staat te stellen een geldboete op te leggen aan het betrokken clearinglid en om het geïnde bedrag uit te keren aan het clearinglid dat te lijden had van de daarop volgende mislukte afwikkelingsoperatie van diezelfde financiële instrumenten.
- (23) CSD's die gebruikmaken van een gemeenschappelijke afwikkelingsinfrastructuur, dienen nauw samen te werken om de passende implementatie van het sanctiemechanisme te verzekeren.
- (24) Om een geïntegreerde markt voor effectenafwikkeling te ondersteunen, dient het buy-inproces te worden geharmoniseerd. Gezien het belang van het bevorderen van een tijdig optreden om mislukte afwikkelingsoperaties aan te pakken, is het van belang om alle relevante betrokken partijen tijdens het buy-inproces op de hoogte te houden.
- (25) Een afwikkelingsinstructie kan mislukken voor alle in die instructie opgenomen financiële instrumenten, zelfs indien sommige financiële instrumenten op de rekening van de nalatige deelnemer voor levering beschikbaar zijn. Het doel van een buy-inproces is het verbeteren van de afwikkelingsefficiëntie. Om het aantal buy-ins zo veel mogelijk te beperken, dient voor een buy-inproces de gedeeltelijke afwikkeling verplicht te worden toegepast op de desbetreffende afwikkelingsinstructie.
- (26) Met de verplichte gedeeltelijke afwikkeling op de laatste werkdag van de in artikel 7, lid 3, van Verordening (EU) nr. 909/2014 genoemde verlengingstermijn wordt het juiste evenwicht gehouden tussen de rechten van de koper om de gekochte financiële instrumenten te ontvangen, en de noodzaak om het aantal financiële instrumenten waarop een buy-in wordt toegepast zo veel mogelijk te beperken. Ieder financieel instrument waarvoor buy-in heeft plaatsgevonden, dient dus aan de koper te worden geleverd, zelfs indien met het aantal financiële instrumenten waarvoor buy-in heeft plaatsgevonden, de betreffende afwikkelingsinstructie niet volledig kan worden afgewikkeld.
- (27) Er mag geen verplichte gedeeltelijke afwikkeling gelden voor afwikkelingsinstructies die door een deelnemer zijn opgeschort omdat de desbetreffende financiële instrumenten op de betrokken rekening mogelijk niet toebehoren aan de cliënt voor wie de afwikkelingsinstructie in het effectenafwikkelingssysteem is ingevoerd.
- (28) Om de nakoming van de in Verordening (EU) nr. 909/2014 uiteengezette verplichtingen te garanderen, dienen alle partijen in de afwikkelingsketen te beschikken over contractuele regelingen met hun relevante tegenpartijen die verplichtingen inzake het buy-inproces bevatten en die in alle relevante jurisdicties afdwingbaar zijn.

- (29) Om de afwikkelingsefficiëntie te verbeteren, dient steeds eerst te worden nagegaan of een buy-inproces mogelijk is ten aanzien van de betrokken transacties en de partijen daarbij.
- (30) Alle bij het buy-inproces betrokken entiteiten dienen op alle cruciale tijdstippen op de hoogte te zijn van de status van het buy-inproces. Die informatie dient te worden uitgewisseld via een kennisgeving zodat de betrokken entiteiten zijn gewaarschuwd over de status van de maatregelen om de transactie af te wikkelen, en zo nodig verdere maatregelen kunnen treffen.
- (31) Voor transacties die niet door een CTP worden geclarend, dienen, met het oog op het opzetten van een effectief buy-inproces en om te vermijden dat andere partijen in de afwikkelingsketen of deelnemers aansprakelijk worden voor verplichtingen aangegaan door de leden van het handelsplatform of handelende partijen, en om het risico-profiel van CSD's of handelsplatformen niet te vergroten, de partijen die oorspronkelijk de betrokken transactie hebben afgesloten, aansprakelijk te zijn voor de uitvoering van de buy-in.
- (32) Ten aanzien van de afwikkeling van een effectentransactie handelen deelnemers voor eigen rekening of voeren zij, op verzoek van hun cliënten, in het door een CSD geëxploiteerd effectenafwikkelingssysteem afwikkelingsinstructies in. Bij die cliënten kan het gaan om een CTP en haar clearingleden, leden van een handelsplatform of, wanneer de transactie niet op een handelsplatform wordt uitgevoerd, handelende partijen. Een buy-in dient dus te worden uitgevoerd op het niveau waar de contractuele verplichtingen om effecten te kopen en te verkopen, zijn gecreëerd.
- (33) Aangezien de buy-inagent dient te handelen op verzoek van een partij die niet de aan het optreden van de buy-inagent verbonden kosten draagt, dient de buy-inagent te handelen in overeenstemming met de vereisten inzake optimale uitvoering en dient hij het belang van het nalatige clearinglid, het nalatige lid van het handelsplatform of de nalatige handelende partij te beschermen.
- (34) Om het aantal buy-ins te beperken en om de liquiditeit van de markt voor de betrokken financiële instrumenten te behouden, dient het nalatige clearinglid, het nalatige lid van het handelsplatform of de nalatige handelende partij, al naargelang, de mogelijkheid te hebben om, via hun deelnemers, financiële instrumenten te leveren aan de CTP, de ontvangende leden van het handelsplatform of de ontvangende handelende partijen tot op het moment dat zij zijn geïnformeerd dat de buy-inagent is aangesteld of dat een veiling van start is gegaan. Vanaf dat tijdstip dienen alleen die partijen te kunnen deelnemen aan de veiling van de financiële instrumenten of deze aan de buy-inagent te leveren, na diens voorafgaande goedkeuring, teneinde te vermijden dat het ontvangende clearinglid, het ontvangende lid van het handelsplatform of de ontvangende handelende partij de financiële instrumenten tweemaal ontvangt. Bij het buy-inproces betrokken partijen zouden ook het aantal buy-ins kunnen beperken door hun acties onderling te coördineren, en door de CSD daarover te informeren, wanneer een transactie deel uitmaakt van een keten van transacties en in verschillende afwikkelingsinstructies kan resulteren.
- (35) Niet door een CTP geclearde transacties zijn doorgaans niet door zekerheden gedekt en bijgevolg draagt ieder lid van het handelsplatform of iedere handelende partij het tegenpartijrisico. Het risico doorschuiven naar andere entiteiten, zoals hun deelnemers, zou deze laatsten dwingen om hun blootstelling aan tegenpartijrisico met zekerheden af te dekken. Een en ander zou de kosten voor effectenafwikkeling onevenredig kunnen doen stijgen. Daarom dient in de eerste plaats het nalatige clearinglid, het nalatige lid van het handelsplatform of de nalatige handelende partij, al naargelang, de verantwoordelijkheid te dragen voor het voldoen van de buy-inkosten, het prijsverschil en de geldelijke vergoeding. Wanneer het nalatige lid van het handelsplatform of de nalatige handelende partij zijn verplichting tot het voldoen van die bedragen niet nakomt, dient hun deelnemer, in zijn hoedanigheid van nalatige deelnemer, wel de buy-inkosten en het prijsverschil te voldoen, maar niet de geldelijke vergoeding.
- (36) Leveringsverplichtingen van financiële instrumenten waarvoor buy-in heeft plaatsgevonden, of het voldoen van de geldelijke vergoeding of eventuele prijsverschillen in de financiële instrumenten die onder de buy-in vallen, dienen uiteindelijk via de ontvangst van de betrokken financiële instrumenten of de gelden te worden voldaan door de CTP, de ontvangende leden van het handelsplatform of de ontvangende handelende partijen via hun deelnemers.
- (37) Wanneer de buy-in mislukt en bij gebreke van uitdrukkelijke communicatie over de eventuele verlenging van het buy-inproces binnen de voorgeschreven termijn, dient de geldelijke vergoeding te worden voldaan, om de belangen van de partijen te beschermen en onzekerheid als gevolg van de mislukte buy-in te vermijden.
- (38) Teneinde complexiteit te vermijden en de CTP, het ontvangende lid van het handelsplatform of de ontvangende handelende partij te beschermen, dienen de financiële instrumenten waarvoor buy-in heeft plaatsgevonden, aan de CTP, het ontvangende lid van het handelsplatform of de ontvangende handelende partij te worden geleverd via de betrokken ontvangende deelnemer, in plaats van via de nalatige deelnemer. Om diezelfde redenen dient de oorspronkelijke afwikkelingsinstructie die het buy-inproces heeft geactiveerd, te worden opgeschort en uiteindelijk te worden geannuleerd.

- (39) Met het oog op een correcte berekening en oplegging van geldboeten voor mislukte afwikkelingsoperaties na afloop van de verlengingstermijn, dienen de desbetreffende afwikkelingsinstructies te worden geannuleerd en vervangen door nieuwe afwikkelingsinstructies op elke werkdag waarop CTP's, leden van handelsplatformen of handelende partijen, via hun deelnemers, financiële instrumenten ontvangen als gevolg van de uitvoering van een buy-in. Geldboeten dienen te worden opgelegd voor iedere nieuwe afwikkelingsinstructie vanaf de dag waarop deze in het effectenafwikkelingssysteem zijn ingevoerd.
- (40) Om de door CSD's geëxploiteerde effectenafwikkelingssystemen soepel te laten functioneren en om zekerheid te garanderen over het tijdschema voor het buy-inproces en voor het voldoen van de geldboeten voor mislukte afwikkelingsoperaties, dienen mislukte afwikkelingsinstructies te worden geannuleerd bij de levering van de financiële instrumenten of, indien deze niet worden geleverd, bij het voldoen van de geldelijke vergoeding, of uiterlijk op de tweede werkdag na de kennisgeving van het aan geldelijke vergoeding verschuldigde bedrag.
- (41) Wanneer de op het tijdstip van de transactie overeengekomen prijs van de financiële instrumenten lager is dan de prijs die bij de uitvoering van de buy-in wordt betaald, dient het prijsverschil door het nalatige clearinglid, het nalatige lid van het handelsplatform of de nalatige handelende partij, al naargelang, te worden voldaan om de belangen van de ontvangende partijen te beschermen. Wanneer de op het tijdstip van de transactie overeengekomen prijs van de financiële instrumenten hoger is dan de prijs die bij de uitvoering van die buy-in wordt betaald, dient de in artikel 7, lid 6, van Verordening (EU) nr. 909/2014 bedoelde verplichting van de nalatige deelnemer geacht te worden te zijn vervuld omdat ontvangende clearingleden, leden van een handelsplatform of handelende partijen daadwerkelijk betalen voor de financiële instrumenten waarvoor buy-in heeft plaatsgevonden.
- (42) Een doelmatig afwikkelingsproces vereist dat de verlengingstermijn, die loopt voordat het buy-inproces van start gaat, wordt aangepast aan de soorten activa en aan de liquiditeit van de financiële instrumenten. Wanneer de markt voor aandelen voldoende liquide is zodat deze gemakkelijk kunnen worden verkregen, dient de verlengingstermijn voordat het buy-inproces van start gaat niet te worden verlengd, zodat de betrokken partijen ertoe worden aangemoedigd om mislukte transacties tijdig af te wikkelen. Voor aandelen waarvoor geen liquide markt bestaat, dient evenwel een langere verlengingstermijn te gelden. Ook voor schuldinstrumenten dient een langere verlengingstermijn te gelden, gezien hun grotere grensoverschrijdende dimensie en het belang ervan voor het soepele en ordelijke functioneren van de financiële markten.
- (43) De maatregelen om mislukte afwikkelingsoperaties aan te pakken door middel van buy-in en geldboeten, vergen mogelijk aanzienlijke aanpassingen van IT-systemen, markttoetsen en aanpassingen van juridische regelingen tussen de betrokken partijen, daaronder begrepen CSD's en andere marktdeelnemers. Bijgevolg dient voldoende tijd te worden gegeven voor de toepassing van die maatregelen, zodat de betrokken partijen aan de nodige vereisten kunnen voldoen.
- (44) Deze verordening is gebaseerd op de ontwerpen van technische reguleringsnormen die ESMA volgens de procedure van artikel 10 van Verordening (EU) nr. 1095/2010 van het Europees Parlement en de Raad ⁽¹⁾ aan de Commissie heeft voorgelegd.
- (45) ESMA heeft open publieke consultaties gehouden over deze ontwerpen van technische reguleringsnormen, de mogelijke kosten en baten ervan geanalyseerd en heeft het advies ingewonnen van de Stakeholdersgroep effecten en markten die overeenkomstig artikel 37 van Verordening (EU) nr. 1095/2010 is opgericht. Bij het uitwerken van de ontwerpen van technische reguleringsnormen heeft ESMA ook nauw samengewerkt met de leden van het Europees Stelsel van centrale banken (ESCB),

HEEFT DE VOLGENDE VERORDENING VASTGESTELD:

HOOFDSTUK I

Algemeen

Artikel 1

Definities

Voor de toepassing van deze verordening wordt verstaan onder:

- a) „clearinglid”: een onderneming in de zin van artikel 2, punt 14, van Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad ⁽²⁾;

⁽¹⁾ Verordening (EU) nr. 1095/2010 van het Europees Parlement en de Raad van 24 november 2010 tot oprichting van een Europese toezichthoudende autoriteit (Europese Autoriteit voor effecten en markten), tot wijziging van Besluit nr. 716/2009/EG en tot intrekking van Besluit 2009/77/EG van de Commissie (PB L 331 van 15.12.2010, blz. 84).

⁽²⁾ Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad van 4 juli 2012 betreffende otc-derivaten, centrale tegenpartijen en transactieregisters (PB L 201 van 27.7.2012, blz. 1).

- b) „beursverhandeld fonds (exchange-traded fund, ETF)”: een fonds in de zin van artikel 4, lid 1, punt 46, van Richtlijn 2014/65/EU van het Europees Parlement en de Raad ⁽¹⁾;
- c) „uitvoering van orders”: uitvoering van orders voor rekening van cliënten in de zin van artikel 4, lid 1, punt 5, van Richtlijn 2014/65/EU;
- d) „niet-professionele cliënt”: een niet-professionele cliënt in de zin van artikel 4, lid 1, punt 11, van Richtlijn 2014/65/EU;
- e) „afwikkelingsinstructie”: een overboekingsopdracht in de zin van artikel 2, punt i), van Richtlijn 98/26/EG van het Europees Parlement en de Raad ⁽²⁾;
- f) „handelende partij”: een partij die handelt als principaal bij een effectentransactie als bedoeld in artikel 7, lid 10, eerste alinea, onder c), van Verordening (EU) nr. 909/2014;
- g) „lid van een handelsplatform”: een lid van of deelnemer aan een handelsplatform.

HOOFDSTUK II

Maatregelen ter voorkoming van mislukte afwikkelingsoperaties

Artikel 2

Maatregelen met betrekking tot professionele cliënten

1. Beleggingsondernemingen verlangen van hun professionele cliënten dat dezen hun schriftelijke toewijzingen van effecten of van gelden aan in artikel 5, lid 1, van Verordening (EU) nr. 909/2014 genoemde transacties zenden, met identificatie van de te crediteren of debiteren rekeningen. Die schriftelijke toewijzingen vermelden het volgende:

- a) een van de volgende types transacties:
 - i) aankoop of verkoop van effecten;
 - ii) transacties in verband met zekerhedenbeheer;
 - iii) uitleningen/leningen van effecten;
 - iv) retrocessietransacties;
 - v) andere transacties, die kunnen worden geïdentificeerd via gedetailleerdere ISO-codes;
- b) het International Securities Identification Number (ISIN) van het financiële instrument of, wanneer het ISIN niet beschikbaar is, een andere identificatiecode van het financiële instrument;
- c) de levering of de ontvangst van financiële instrumenten of gelden;
- d) de nominale waarde voor schuldinstrumenten, en de hoeveelheid voor andere financiële instrumenten;
- e) de transactiedatum;
- f) de transactieprijs van het financiële instrument;
- g) de valuta waarin de transactie luidt;
- h) de beoogde afwikkelingsdatum van de transactie;
- i) het totale bedrag aan te leveren of te ontvangen gelden;
- j) de identificatiecode van de entiteit waar de effecten worden gehouden;
- k) de identificatiecode van de entiteit waar de gelden worden gehouden;
- l) de namen en nummers van de te crediteren of debiteren effecten- of kasrekeningen.

Schriftelijke toewijzingen omvatten alle andere informatie die de beleggingsonderneming nodig heeft om de afwikkeling van de transactie te faciliteren.

Beleggingsondernemingen die bevestiging hebben ontvangen van de uitvoering van een transactieorder dat door een professionele cliënt is geplaatst, zorgen er via contractuele regelingen voor dat de professionele cliënt binnen de in lid 2 bepaalde termijnen schriftelijk zijn instemming met de voorwaarden van de transactie bevestigt. Die schriftelijke bevestiging mag ook worden opgenomen in de schriftelijke toewijzing.

⁽¹⁾ Richtlijn 2014/65/EU van het Europees Parlement en de Raad van 15 mei 2014 betreffende markten voor financiële instrumenten en tot wijziging van Richtlijn 2002/92/EG en Richtlijn 2011/61/EU (PB L 173 van 12.6.2014, blz. 349).

⁽²⁾ Richtlijn 98/26/EG van het Europees Parlement en de Raad van 19 mei 1998 betreffende het definitieve karakter van de afwikkeling van betalings- en effectentransacties in betalings- en afwikkelingsystemen (PB L 166 van 11.6.1998, blz. 45).

Beleggingsondernemingen bieden hun professionele cliënten de mogelijkheid om de schriftelijke toewijzing en de schriftelijke bevestiging elektronisch te zenden, via de internationale open communicatieprocedures en -normen voor berichtenverkeer en referentiedata als bedoeld in artikel 35 van Verordening (EU) nr. 909/2014.

2. Professionele cliënten zorgen ervoor dat de beleggingsonderneming de in lid 1 genoemde schriftelijke toewijzingen en schriftelijke bevestigingen ontvangt binnen een van de volgende termijnen:

- a) tegen het einde van de werkdag waarop de transactie heeft plaatsgevonden, wanneer de beleggingsonderneming en de betrokken professionele cliënt zich in dezelfde tijdszone bevinden;
- b) tegen 12.00 CET op de werkdag na de dag waarop de transactie heeft plaatsgevonden, wanneer een van de volgende situaties zich voordoet:
 - i) tussen de tijdszone van de beleggingsonderneming en de tijdszone van de betrokken professionele cliënt is er een verschil van meer dan twee uur;
 - ii) de orders zijn uitgevoerd na 16.00 CET van de werkdag in de tijdszone van de beleggingsonderneming.

Beleggingsondernemingen bevestigen de ontvangst van de schriftelijke toewijzing en van de schriftelijke bevestiging binnen twee uur na de ontvangst ervan. Wanneer een beleggingsonderneming de schriftelijke toewijzing en de schriftelijke bevestiging ontvangt minder dan één uur vóór het eind van haar handelsactiviteiten, bevestigt die beleggingsonderneming de ontvangst van de schriftelijke toewijzing en de schriftelijke bevestiging binnen één uur na het begin van de handelsactiviteiten op de volgende werkdag.

3. Wanneer beleggingsondernemingen de in lid 1 bedoelde noodzakelijke afwikkelingsgegevens ontvangen vóór de in lid 2 genoemde termijnen, kunnen zij schriftelijk met hun professionele cliënten overeenkomen dat de betrokken schriftelijke toewijzingen en schriftelijke bevestigingen niet hoeven te worden gezonden.

4. De leden 1, 2 en 3 zijn niet van toepassing op professionele cliënten die bij dezelfde beleggingsonderneming de voor de afwikkeling relevante effecten en gelden aanhouden.

Artikel 3

Maatregelen met betrekking tot niet-professionele cliënten

Beleggingsondernemingen verlangen van hun niet-professionele cliënten dat dezen hun alle afwikkelingsgegevens die relevant zijn voor de in artikel 5, lid 1, van Verordening (EU) nr. 909/2014 genoemde transacties, zenden tegen 12.00 CET op de werkdag na de dag waarop de transactie heeft plaatsgevonden binnen de tijdszone van de beleggingsonderneming, tenzij die cliënt de betrokken financiële instrumenten en gelden bij diezelfde beleggingsonderneming aanhoudt.

Artikel 4

Faciliteren en verwerken van afwikkeling

1. CSD's verwerken alle afwikkelingsinstructies op geautomatiseerde basis.
2. CSD's die op de in lid 3, onder a) of b), genoemde wijze handmatig hebben ingegrepen in het geautomatiseerde afwikkelingsproces, stellen de bevoegde autoriteit in kennis van de reden voor die ingreep binnen 30 dagen nadat deze heeft plaatsgevonden, tenzij reeds voor vroegere ingrepen is kennis gegeven van diezelfde reden.
3. Een handmatig ingrijpen in het geautomatiseerde afwikkelingsproces vindt plaats in de volgende omstandigheden:
 - a) wanneer de stroom van een ontvangen afwikkelingsinstructie naar het effectenafwikkelingssysteem is vertraagd of gewijzigd of wanneer die afwikkelingsinstructie zelf is gewijzigd buiten de geautomatiseerde procedures om;
 - b) wanneer bij de verwerking van ontvangen afwikkelingsinstructies in het afwikkelingsplatform een ingreep plaatsvindt buiten de geautomatiseerde procedures om, daaronder begrepen het beheer van IT-incidenten.
4. Bevoegde autoriteiten kunnen CSD's te allen tijde ervan in kennis stellen dat een bepaalde reden geen handmatige ingrepen in het geautomatiseerde afwikkelingsproces rechtvaardigt. CSD's mogen nadien op grond van die reden niet handmatig in het geautomatiseerde afwikkelingsproces ingrijpen.

Artikel 5

Matching en invulling van afwikkelingsinstructies

1. CSD's bieden deelnemers een functionaliteit die volledig geautomatiseerde, continue realltime matching van afwikkelingsinstructies gedurende elke werkdag ondersteunt.
2. CSD's verlangen van deelnemers dat zij hun afwikkelingsinstructies met de in lid 1 bedoelde functionaliteit matchen vóór de afwikkeling ervan, behalve in de volgende omstandigheden:
 - a) wanneer de CSD ermee heeft ingestemd dat de afwikkelingsinstructies al zijn gematcht door handelsplatformen, CTP's of andere entiteiten;
 - b) wanneer de CSD de afwikkelingsinstructies zelf heeft gematcht;
 - c) in het geval van afwikkelingsinstructies zonder betaling (*free of payment* — FoP) als bedoeld in artikel 13, lid 1, onder g), i), die bestaan in overboekingsopdrachten van financiële instrumenten tussen verschillende rekeningen die op naam van dezelfde deelnemer zijn geopend of die door dezelfde rekeningbeheerder worden beheerd.

De onder c) genoemde rekeningbeheerders omvatten entiteiten die met een CSD een contractuele relatie hebben en door die CSD aangehouden effectenrekeningen beheren door middel van girale vastlegging in die effectenrekeningen.

3. CSD's verlangen van deelnemers dat zij de in hun afwikkelingsinstructies de volgende matchingvelden gebruiken voor het matchen van afwikkelingsinstructies:
 - a) het type afwikkelingsinstructie als bedoeld in artikel 13, lid 1, onder g);
 - b) de beoogde afwikkelingsdatum van de afwikkelingsinstructie;
 - c) de transactiedatum;
 - d) de valuta, behalve in het geval van FoP-afwikkelingsinstructies;
 - e) het afwikkelingsbedrag, behalve in het geval van FoP-afwikkelingsinstructies;
 - f) de nominale waarde voor schuldinstrumenten, of de hoeveelheid voor andere financiële instrumenten;
 - g) de levering of de ontvangst van de financiële instrumenten of gelden;
 - h) het ISIN van het financiële instrument;
 - i) de identificatiecode van de deelnemer die de financiële instrumenten of gelden levert;
 - j) de identificatiecode van de deelnemer die de financiële instrumenten of gelden ontvangt;
 - k) de identificatiecode van de CSD van de tegenpartij van de deelnemer, in het geval van CSD's die gebruikmaken van een gemeenschappelijke afwikkelingsinfrastructuur, onder meer in de in artikel 30, lid 5, van Verordening (EU) nr. 909/2014 bedoelde omstandigheden;
 - l) andere matchingvelden die de CSD voor het faciliteren van de afwikkeling van transacties verlangt.
4. Naast de in lid 3 genoemde velden verlangen CSD's dat hun deelnemers een veld gebruiken voor het vermelden van het transactietype in hun afwikkelingsinstructies op basis van de volgende taxonomie:
 - a) aankoop of verkoop van effecten;
 - b) transacties in verband met zekerhedenbeheer;
 - c) uitleningen/leningen van effecten;
 - d) retrocessietransacties;
 - e) andere transacties (die kunnen worden geïdentificeerd via gedetailleerdere ISO-codes als verschaft door de CSD).

Artikel 6

Tolerantieniveaus

Ten behoeve van de matching stellen CSD's tolerantieniveaus vast voor afwikkelingsbedragen.

Het tolerantieniveau geeft het maximale verschil aan tussen de afwikkelingsbedragen in twee overeenstemmende afwikkelingsinstructies waarmee nog steeds matching mogelijk is.

Voor afwikkelingsinstructies in euro wordt het tolerantieniveau per afwikkelingsinstructie bepaald op 2 EUR voor afwikkelingsbedragen tot 100 000 EUR en op 25 EUR voor afwikkelingsbedragen van meer dan 100 000 EUR. Voor afwikkelingsinstructies in andere valuta's is het tolerantieniveau per afwikkelingsinstructie het equivalente bedrag op basis van de officiële wisselkoers van de ECB, voor zover beschikbaar.

Artikel 7

Annuleringsfaciliteit

CSD's zetten een bilaterale annuleringsfaciliteit op waarmee deelnemers bilateraal gematchte afwikkelingsinstructies die deel uitmaken van dezelfde transactie, kunnen annuleren.

Artikel 8

Hold/release-mechanisme

CSD's zetten een hold/release-mechanisme op dat uit de volgende onderdelen bestaat:

- a) een hold-mechanisme waarmee de opdrachtgevende deelnemer uitstaande afwikkelingsinstructies kan blokkeren ten behoeve van afwikkeling;
- b) een release-mechanisme waarmee uitstaande afwikkelingsinstructies die de opdrachtgevende deelnemer heeft geblokkeerd, kunnen worden vrijgegeven ten behoeve van afwikkeling.

Artikel 9

Recycling

CSD's recyclen afwikkelingsinstructies die in een mislukte afwikkelingsoperatie hebben geresulteerd totdat deze zijn afgewikkeld of bilateraal zijn geannuleerd.

Artikel 10

Gedeeltelijke afwikkeling

CSD's bieden de mogelijkheid om afwikkelingsinstructies gedeeltelijk af te wikkelen.

Artikel 11

Aanvullende faciliteiten en informatie

1. CSD's bieden deelnemers de mogelijkheid om te worden geïnformeerd over een uitstaande afwikkelingsinstructie van hun tegenpartijen, hetzij binnen één uur na de eerste mislukte poging om die instructie te matchen, hetzij onmiddellijk na een dergelijke mislukte poging wanneer die poging heeft plaatsgevonden binnen een periode van vijf uur vóór de afsluiting van de beoogde afwikkelingsdatum of na de beoogde afwikkelingsdatum.
2. CSD's bieden deelnemers realtime-informatie over de status van hun afwikkelingsinstructies in het effectenafwikkelingssysteem, met inbegrip van informatie over:
 - a) uitstaande afwikkelingsinstructies die nog op de beoogde afwikkelingsdatum kunnen worden afgewikkeld;
 - b) mislukte afwikkelingsinstructies die niet meer op de beoogde afwikkelingsdatum kunnen worden afgewikkeld;
 - c) volledig afgewikkelde afwikkelingsinstructies;
 - d) gedeeltelijk afgewikkelde afwikkelingsinstructies, met vermelding van het afgewikkelde en het niet-afgewikkelde gedeelte van ofwel financiële instrumenten, ofwel gelden;
 - e) geannuleerde afwikkelingsinstructies, met vermelding of die instructies door het systeem of door de deelnemer zijn geannuleerd.

3. De in lid 2 bedoelde realtime-informatie omvat het volgende:
 - a) het feit of de afwikkelingsinstructie al dan niet is gematcht;
 - b) het feit of de afwikkelingsinstructie al dan niet nog gedeeltelijk kan worden afgewikkeld;
 - c) het feit of de afwikkelingsinstructie al dan niet in de wacht staat;
 - d) de redenen waarom instructies nog uitstaan of mislukken.
4. CSD's bieden hun deelnemers ofwel een realtimebrutoverevening gedurende de hele werkdag of een minimum van drie afwikkelingsbatches per werkdag. De drie afwikkelingsbatches zijn over de werkdag gespreid volgens de behoeften van de markt, op basis van een verzoek door het gebruikerscomité van de CSD.

Artikel 12

Vrijstelling van bepaalde maatregelen ter voorkoming van mislukte afwikkelingsoperaties

1. De artikelen 8 en 10 zijn niet van toepassing wanneer het door een CSD geëxploiteerde effectenafwikkelingsstelsel aan de volgende voorwaarden voldoet:
 - a) de waarde van mislukte afwikkelingsoperaties bedraagt niet meer dan 2,5 miljard EUR per jaar;
 - b) het percentage mislukte afwikkelingsoperaties, op basis van ofwel het aantal afwikkelingsinstructies, ofwel de waarde van afwikkelingsinstructies, bedraagt minder dan 0,5 % per jaar.

Het percentage mislukte afwikkelingsoperaties op basis van het aantal afwikkelingsinstructies wordt berekend door het aantal mislukte afwikkelingsoperaties te delen door het aantal in de betrokken periode in het effectenafwikkelingsstelsel ingevoerde afwikkelingsinstructies.

Het percentage mislukte afwikkelingsoperaties op basis van de waarde van afwikkelingsinstructies wordt berekend door de waarde in euro van mislukte afwikkelingsoperaties te delen door de waarde van in de betrokken periode in het effectenafwikkelingsstelsel ingevoerde afwikkelingsinstructies.

2. Uiterlijk 20 januari van elk jaar beoordelen CSD's of de in lid 1 genoemde voorwaarden zijn vervuld en stellen zij de bevoegde autoriteit in kennis van de uitkomsten van die beoordeling overeenkomstig bijlage II.

Wanneer door de beoordeling wordt bevestigd dat ten minste aan één van de in lid 1 genoemde voorwaarden niet langer is voldaan, passen CSD's de artikelen 8 en 10 toe binnen één jaar te rekenen vanaf de datum van de in de eerste alinea genoemde kennisgeving.

HOOFDSTUK III

Maatregelen voor het aanpakken van mislukte afwikkelingsoperaties

Afdeling I

Monitoring van mislukte afwikkelingsoperaties

Artikel 13

Nadere gegevens over het stelsel voor monitoring van mislukte afwikkelingsoperaties

1. CSD's zetten een stelsel op waarmee zij voor elke beoogde afwikkelingsdatum het aantal en de waarde van mislukte afwikkelingsoperaties kunnen monitoren, daaronder begrepen de duur van elke mislukte afwikkelingsoperatie uitgedrukt in werkdagen. Dat stelsel verzamelt voor elke mislukte afwikkelingsoperatie de volgende gegevens:
 - a) de reden voor de mislukte afwikkelingsoperatie, op basis van de voor de CSD beschikbare informatie;
 - b) eventuele afwikkelingsbeperkingen zoals het reserveren, blokkeren of oormerken van financiële instrumenten of gelden waardoor die financiële instrumenten of gelden niet voor afwikkeling beschikbaar zijn;

- c) het door de mislukte afwikkelingsoperatie geraakte type financieel instrument, volgens de onderstaande categorieën:
- i) effecten in de zin van artikel 4, lid 1, punt 44, onder a), van Richtlijn 2014/65/EU;
 - ii) overheidsschuld in de zin van artikel 4, lid 1, punt 61, van Richtlijn 2014/65/EU;
 - iii) effecten in de zin van artikel 4, lid 1, punt 44, onder b), van Richtlijn 2014/65/EU, niet zijnde overheidsschuld in de zin van punt ii);
 - iv) effecten in de zin van artikel 4, lid 1, punt 44, onder c), van Richtlijn 2014/65/EU;
 - v) beursverhandelde fondsen (ETF's);
 - vi) rechten van deelneming in instellingen voor collectieve belegging, niet zijnde ETF's;
 - vii) geldmarktinstrumenten, niet zijnde overheidsschuld in de zin van punt ii);
 - viii) emissierechten;
 - ix) overige financiële instrumenten;
- d) het door de mislukte afwikkelingsoperatie geraakte type transactie, volgens de onderstaande categorieën:
- i) aankoop of verkoop van financiële instrumenten;
 - ii) transacties in verband met zekerhedenbeheer;
 - iii) uitleningen/leningen van effecten;
 - iv) retrocessietransacties;
 - v) andere transacties, die kunnen worden geïdentificeerd via gedetailleerdere ISO-codes als verschaft door de CSD;
- e) de handels- en clearinglocatie van de geraakte financiële instrumenten, voor zover beschikbaar;
- f) het door de mislukte afwikkelingsoperatie geraakte type afwikkelingsinstructie, volgens de onderstaande categorieën:
- i) een intra-CSD afwikkelingsinstructie, wanneer de nalatige en de ontvangende partijen beiden deelnemers zijn aan hetzelfde effectenafwikkelingssysteem, of
 - ii) een inter-CSD afwikkelingsinstructie, wanneer de nalatige en de ontvangende partijen deelnemers zijn aan twee verschillende effectenafwikkelingssystemen of een van de deelnemers een CSD is;
- g) het door de mislukte afwikkelingsoperatie geraakte type afwikkelingsinstructie, volgens de onderstaande categorieën:
- i) FoP-afwikkelingsinstructies, die bestaan uit afwikkelingsinstructies voor levering zonder betaling (*deliver free of payment* — DFP) en voor ontvangst zonder betaling (*receive free of payment* — RFP);
 - ii) afwikkelingsinstructies voor levering tegen betaling (*delivery versus payment* — DVP) en voor ontvangst tegen betaling (*receive versus payment* — RVP);
 - iii) afwikkelingsinstructies voor levering met betaling (*delivery with payment* — DWP) en voor ontvangst met betaling (*receive with payment* — RWP), of
 - iv) afwikkelingsinstructies met betaling zonder levering (*payment free of delivery* — PFOD), bestaande uit afwikkelingsinstructies met debitering betaling zonder levering (*debiting payment free of delivery* — DPFOD) en creditering betaling zonder levering (*crediting payment free of delivery* — CPFOD).
- h) het type effectenrekeningen dat bij de mislukte afwikkelingsoperatie betrokken is, waaronder:
- i) een eigen rekening van een deelnemer;
 - ii) een individuele cliëntenrekening van een deelnemer;
 - iii) een omnibuscliëntenrekening van een deelnemer;
- i) de valuta waarin de afwikkelingsinstructies luiden.

2. CSD's leggen werkafspraken vast met de in de velden 17 en 18 van tabel 1 in bijlage I genoemde deelnemers die de grootste impact hebben op hun effectenafwikkelingssystemen en, voor zover van toepassing, met relevante CTP's en handelsplatformen, teneinde de belangrijkste redenen voor de mislukte afwikkelingsoperaties te analyseren.

*Artikel 14***Rapportage van mislukte afwikkelingsoperaties**

1. CSD's delen de in bijlage I genoemde gegevens mee aan de bevoegde autoriteit en de relevante autoriteiten op maandbasis en tegen het eind van de vijfde werkdag van de volgende maand.

Die gegevens omvatten de desbetreffende waarden in euro. Waarden worden omgerekend in euro aan de hand van de officiële wisselkoers van de ECB op de laatste dag van de rapportageperiode wanneer die officiële ECB-wisselkoers beschikbaar is.

Indien de bevoegde autoriteit daarom verzoekt, rapporteren CSD's frequenter en verschaffen zij aanvullende informatie over mislukte afwikkelingsoperaties.

2. Uiterlijk 20 januari van elk jaar rapporteren CSD's aan de bevoegde autoriteit en de relevante autoriteiten de in bijlage II vermelde gegevens, daaronder begrepen de door CSD's en hun deelnemers geplande of genomen maatregelen ter verbetering van de afwikkelingsefficiëntie van de effectenafwikkelingsystemen die zij exploiteren.

CSD's monitoren op regelmatige basis de toepassing van de in de eerste alinea bedoelde maatregelen en verschaffen de bevoegde autoriteiten en de relevante autoriteit, op verzoek, alle relevante bevindingen welke die monitoring oplevert.

3. De in de leden 1 en 2 bedoelde gegevens wordt in een machineleesbaar formaat verschaft.

4. De in de bijlagen I, II en III bedoelde waarde van de afwikkelingsinstructies wordt als volgt berekend:

- a) bij afwikkelingsinstructies tegen betaling: het afwikkelingsbedrag van de geldzijde;
- b) bij FoP-afwikkelingsinstructies: de in artikel 32, lid 3, bedoelde marktwaarde van de financiële instrumenten of, indien deze niet voorhanden is, de nominale waarde van de financiële instrumenten.

*Artikel 15***Openbaarmaking met betrekking tot mislukte afwikkelingsoperaties**

CSD's maken voor het effectenafwikkelingssysteem dat zij exploiteren, de in bijlage III vermelde gegevens kosteloos openbaar, daaronder begrepen de desbetreffende waarden in euro.

Waarden worden omgerekend in euro aan de hand van de officiële wisselkoers van de ECB op de laatste dag van de rapportageperiode wanneer die officiële ECB-wisselkoers beschikbaar is.

De in de eerste alinea bedoelde gegevens worden jaarlijks en in een in internationale financiële kringen gangbare taal bekendgemaakt en zijn machineleesbaar.

*Afdeling 2***Geldboeten***Artikel 16***Berekening en oplegging van geldboeten**

1. De in artikel 7, lid 2, van Verordening (EU) nr. 909/2014 genoemde geldboeten worden door CSD's berekend en opgelegd voor elke afwikkelingsinstructie die niet afgewikkeld geraakt.

De in de eerste alinea bedoelde berekening omvat ook afwikkelingsinstructies die door een deelnemer in de wacht zijn gezet.

Wanneer overeenkomstig artikel 5, lid 2, matching is vereist, worden geldboeten alleen opgelegd voor gematchte afwikkelingsinstructies.

2. Geldboeten worden berekend en opgelegd aan het eind van elke werkdag waarop de afwikkelingsinstructie niet afgewikkeld geraakt.

3. Wanneer een afwikkelingsinstructie in het effectenafwikkelingssysteem is ingevoerd of is gematcht na de beoogde afwikkelingsdatum, worden geldboeten berekend en opgelegd vanaf de beoogde afwikkelingsdatum.

Wanneer in overeenstemming met artikel 27, lid 10, artikel 29, lid 11, of artikel 31, lid 11, nieuwe afwikkelingsinstructies voor niet-geleverde financiële instrumenten in het effectenafwikkelingssysteem worden ingevoerd, worden geldboeten voor de nieuwe afwikkelingsinstructies opgelegd vanaf de dag waarop die instructies in het effectenafwikkelingssysteem zijn ingevoerd.

Wanneer afwikkelingsinstructies zijn gematcht na de beoogde afwikkelingsdatum, worden geldboeten voor de periode tussen de beoogde afwikkelingsdatum en de werkdag vóór de dag waarop de matching heeft plaatsgevonden, voldaan door de laatste deelnemer die de betrokken afwikkelingsinstructie in het effectenafwikkelingssysteem heeft ingevoerd of aangepast.

4. CSD's verschaffen elke betrokken deelnemer dagelijks nadere gegevens over de berekening van de geldboeten voor elke mislukte afwikkelingsoperatie, daaronder begrepen nadere gegevens over de rekening waarnaar elke mislukte afwikkelingsoperatie verwijst.

Artikel 17

Inning en uitkering van geldboeten

1. CSD's leggen ten minste maandelijks het door elke nalatige deelnemer verschuldigde nettobedrag aan geldboeten op en innen dat.

Geldboeten worden gestort op een daartoe bestemde kasrekening.

2. CSD's keren ten minste maandelijks het in lid 1 genoemde nettobedrag aan geldboeten uit aan ontvangende deelnemers die door mislukte afwikkelingsoperaties zijn geraakt.

Artikel 18

Kosten van het sanctiemechanisme

1. CSD's gebruiken geldboeten niet om de kosten met betrekking tot het sanctiemechanisme te dekken.

2. CSD's maken in detail het in lid 1 bedoelde kostenbedrag aan deelnemers bekend.

3. CSD's brengen de kosten van het sanctiemechanisme afzonderlijk aan deelnemers in rekening. Die kosten worden niet berekend op basis van brutogeldboeten die aan elke deelnemer worden opgelegd.

Artikel 19

Sanctiemechanisme ingeval de deelnemer een CTP is

Wanneer de nalatige of de ontvangende deelnemer een CTP is, zorgen CSD's ervoor dat:

- a) CTP's de berekening van de geldboeten voor de door die CTP's ingediende mislukte afwikkelingsoperaties ontvangen;
- b) CTP's de in onder a) bedoelde geldboeten innen bij de clearingleden die de mislukte afwikkelingsoperaties veroorzaakt hebben;
- c) CTP's de in onder b) bedoelde geldboeten uitkeren aan de clearingleden die door de mislukte afwikkelingsoperaties geraakt zijn;
- d) CTP's aan de CSD maandelijks rapporteren over de geldboeten die geïnd en uitgekeerd zijn.

Artikel 20

Van een gemeenschappelijke afwikkelingsinfrastructuur gebruikmakende CSD's

CSD's die gebruikmaken van een gemeenschappelijke afwikkelingsinfrastructuur, ook wanneer een aantal van hun diensten of activiteiten zijn uitbesteed als bedoeld in artikel 30, lid 5, van Verordening (EU) nr. 909/2014, zetten gezamenlijk het in artikel 7, lid 2, van Verordening (EU) nr. 909/2014 bedoelde sanctiemechanisme op en beheren gezamenlijk de concrete voorwaarden voor de berekening, oplegging, inning en uitkering van geldboeten in overeenstemming met deze verordening.

Afdeling 3

Nadere bijzonderheden over het buy-inproces

Onderafdeling 1

Algemeen

Artikel 21

Buy-in niet mogelijk

Een buy-in wordt alleen geacht onmogelijk te zijn wanneer:

- a) de betrokken financiële instrumenten niet meer bestaan;
- b) voor niet door een CTP geclarede transacties, het nalatige lid van het handelsplatform of de nalatige handelende partij aan een insolventieprocedure is onderworpen.

Voor de toepassing van punt b) wordt onder „insolventieprocedure” het volgende verstaan: iedere collectieve maatregel waarin de wetgeving van een lidstaat of van een derde land voorziet, met het oog op de liquidatie of de sanering van het lid van het handelsplatform of de handelende partij, indien een dergelijke maatregel gepaard gaat met opschorting van of oplegging van beperkingen aan overboekingen of betalingen.

Artikel 22

Ineffectief buy-inproces

1. Voor de toepassing van artikel 7, lid 4, onder b), van Verordening (EU) nr. 909/2014 worden de volgende verrichtingen geacht te bestaan uit meerdere transacties:

- a) verrichtingen waarbij één partij financiële instrumenten tegen contanten verkoopt („eerste transactie”), met een toezegging van de wederpartij om gelijkwaardige financiële instrumenten aan de eerste partij te verkopen tegen een prijs die is of kan worden vastgesteld („tweede transactie”);
- b) verrichtingen waarbij één partij financiële instrumenten aan een andere partij overdraagt („eerste transactie”), met een toezegging van die wederpartij om op haar beurt gelijkwaardige financiële instrumenten aan de eerste partij te leveren („tweede transactie”).

2. Wanneer lid 1 van toepassing is, wordt het buy-inproces als ineffectief beschouwd wanneer de beoogde afwikkelingsdatum van de tweede transactie is vastgesteld binnen 30 werkdagen na de beoogde afwikkelingsdatum van de eerste transactie.

Artikel 23

Toepassing van gedeeltelijke afwikkeling

1. Wanneer op de laatste werkdag van de in artikel 7, lid 3, van Verordening (EU) nr. 909/2014 bedoelde verlengings-termijn, een aantal van de betrokken financiële instrumenten beschikbaar is voor levering aan de ontvangende deelnemer, wikkelen de ontvangende en nalatige clearingleden, leden van een handelsplatform of handelende partijen, al naargelang, de oorspronkelijke afwikkelingsinstructie gedeeltelijk af, tenzij de in artikel 12, lid 1, van deze verordening genoemde voorwaarden zijn vervuld.

2. Lid 1 is niet van toepassing wanneer de betrokken afwikkelingsinstructie in overeenstemming met artikel 8 is opgeschort.

Artikel 24

Buy-inagent

Een buy-inagent heeft geen belangenconflict bij het uitvoeren van een buy-in en voert de buy-in uit tegen de voorwaarden die het voordeligst zijn voor het nalatige clearinglid, het nalatige lid van een handelsplatform of de nalatige handelende partij, al naargelang, in overeenstemming met artikel 27 van Richtlijn 2014/65/EU.

Artikel 25

Contractuele regelingen en procedures

1. Partijen in de afwikkelingsketen stellen contractuele regelingen vast met hun betrokken tegenpartijen waarin de in lid 2 aangegeven vereisten voor het buy-inproces en de in lid 3 aangegeven procedures zijn geïntegreerd.

2. In de in lid 1 bedoelde contractuele regelingen zijn de in artikel 7 van Verordening (EU) nr. 909/2014 en de artikelen 26 tot en met 38 van deze verordening beschreven toepasselijke vereisten volledig geïntegreerd. Iedere partij in de afwikkelingsketen zorgt ervoor dat de met haar betrokken tegenpartijen vastgestelde contractuele regelingen in alle betrokken jurisdicties afdwingbaar zijn.
3. CTP's, clearingleden, leden van een handelsplatform of handelende partijen leggen de nodige procedures vast voor het binnen de vereiste termijnen uitvoeren van de buy-in en voldoen van de geldelijke vergoeding, het prijsverschil en de buy-inkosten. De in dit artikel bedoelde contractuele regelingen en procedures omvatten de nodige bepalingen die ervoor zorgen dat de betrokken partijen in de afwikkelingsketen de gegevens ontvangen die nodig zijn om hun rechten en plichten uit te voeren binnen de in de artikelen 26 tot en met 35 van deze verordening bepaalde termijnen.
4. De deelnemers leggen de nodige contractuele regelingen met hun cliënten vast om ervoor te zorgen dat de in deze verordening beschreven buy-invereisten afdwingbaar zijn in alle jurisdicties waaronder de partijen bij de afwikkelingsketen vallen.
5. De financiële instrumenten waarvoor buy-in heeft plaatsgevonden, kunnen voor de toepassing van de artikelen 27, 29 en 31 alleen als geleverd worden beschouwd wanneer die instrumenten in het door de CSD geëxploiteerde effectenafwikkelingssysteem zijn ontvangen door de ontvangende deelnemers die handelen namens de CTP, de ontvangende clearingleden, leden van het handelsplatform of handelende partijen.
6. De in artikel 33 genoemde geldelijke vergoeding en het in artikel 35, lid 1, genoemde prijsverschil mogen pas als voldaan worden beschouwd wanneer de geldelijke vergoeding is ontvangen door de ontvangende deelnemers die handelen namens de CTP, de ontvangende clearingleden, leden van het handelsplatform of handelende partijen.

Onderafdeling 2

Buy-inproces voor door een CTP geclearde transacties

Artikel 26

Initiële controle

1. Op de werkdag na het verstrijken van de verlengingstermijn gaan CTP's na of met betrekking tot door hen geclearde transacties een buy-in mogelijk is in overeenstemming met artikel 21, onder a).
2. Wanneer een buy-in niet mogelijk is in overeenstemming met artikel 21, onder a), stelt de CTP het nalatige clearinglid in kennis van het in overeenstemming met artikel 32 berekende bedrag van de geldelijke vergoeding. De geldelijke vergoeding wordt voldaan in overeenstemming met artikel 33, lid 1.
3. Wanneer een buy-in mogelijk is, is artikel 27 van toepassing.

Artikel 27

Buy-inprocedure en -kennisgevingen

1. Wanneer een buy-in mogelijk is, organiseren CTP's een veiling of stellen zij een buy-inagent aan op de werkdag na het verstrijken van de verlengingstermijn en stellen zij de nalatige en ontvangende clearingleden daarvan in kennis.
2. Na ontvangst van de in lid 1 bedoelde kennisgeving zorgt het nalatige clearinglid ervoor dat alle desbetreffende afwikkelingsinstructies met betrekking tot de mislukte afwikkelingsoperatie worden opgeschort.
3. Na ontvangst van de in lid 1 bedoelde kennisgeving mag het nalatige clearinglid de financiële instrumenten alleen als volgt leveren:
 - a) aan de buy-inagent wanneer de buy-inagent daarin vooraf heeft toegestemd;
 - b) aan de CTP wanneer de geveilde instrumenten zijn toegewezen aan dat nalatige clearinglid.

Vóór ontvangst van de in lid 1 bedoelde kennisgeving mag het nalatige clearinglid de financiële instrumenten nog steeds rechtstreeks aan de CTP leveren.

4. De CTP stelt de nalatige en ontvangende clearingleden en de betrokken CSD uiterlijk op de laatste werkdag van de in overeenstemming met artikel 37 vastgestelde periode in kennis van de resultaten van de buy-in.
5. Wanneer de buy-in volledig of gedeeltelijk slaagt, bevat de in lid 4 bedoelde kennisgeving de hoeveelheid en de prijs van de financiële instrumenten waarvoor buy-in heeft plaatsgevonden.
6. Wanneer de buy-in volledig of gedeeltelijk mislukt, bevat de in lid 4 bedoelde kennisgeving van het in overeenstemming met artikel 32 berekende bedrag van de geldelijke vergoeding, tenzij in die kennisgeving is aangegeven dat de uitvoering van de buy-in is uitgesteld.
7. Wanneer de uitvoering van de buy-in is uitgesteld, stelt de CTP de nalatige en ontvangende clearingleden en de betrokken CSD uiterlijk op de laatste werkdag van de in artikel 38 genoemde uitstelperiode in kennis van de resultaten van die uitgestelde buy-in.
8. Wanneer de in lid 7 bedoelde buy-in volledig of gedeeltelijk slaagt, bevat de in dat lid bedoelde kennisgeving de hoeveelheid en de prijs van de financiële instrumenten waarvoor buy-in heeft plaatsgevonden.
9. Wanneer de in lid 7 bedoelde buy-in volledig of gedeeltelijk mislukt, bevat de in dat lid bedoelde kennisgeving het in overeenstemming met artikel 32 berekende bedrag van de geldelijke vergoeding.
10. De CTP accepteert en betaalt voor de in de leden 5 en 8 bedoelde financiële instrumenten waarvoor buy-in heeft plaatsgevonden, en zorgt ervoor dat het volgende wordt uitgevoerd aan het eind van elke werkdag waarop de CTP die financiële instrumenten ontvangt:
 - a) de financiële instrumenten waarvoor buy-in heeft plaatsgevonden, worden geleverd aan de ontvangende clearingleden;
 - b) de afwikkelingsinstructies met betrekking tot de mislukte afwikkelingsoperatie worden geannuleerd;
 - c) voor alle niet-geleverde financiële instrumenten worden nieuwe afwikkelingsinstructies in het effectenafwikkelingsstelsel ingevoerd en de CSD ontvangt de informatie die nodig is om dergelijke nieuwe afwikkelingsinstructies dienovereenkomstig te identificeren.
11. De CTP zorgt ervoor dat de afwikkelingsinstructies met betrekking tot de mislukte afwikkelingsoperatie worden geannuleerd na betaling van de in de leden 6 en 9 genoemde geldelijke vergoeding of uiterlijk op de tweede werkdag na de in deze bepalingen bedoelde kennisgeving.

Onderafdeling 3

Buy-inproces voor transacties niet geclareerd door een CTP, maar uitgevoerd op een handelsplatform

Artikel 28

Initiële controle

1. Voor transacties niet geclareerd door een CTP, maar uitgevoerd op een handelsplatform informeren ontvangende deelnemers, via hun cliënten, ontvangende leden van het handelsplatform onverwijld over mislukte afwikkelingsoperaties.
2. Het handelsplatform maakt op verzoek de identiteit van de nalatige leden van het handelsplatform aan het ontvangende lid van het handelsplatform bekend. Op de werkdag na het verstrijken van de verlengingstermijn gaat het ontvangende lid van het handelsplatform na of een buy-in mogelijk is in overeenstemming met artikel 21.
3. Wanneer een buy-in niet mogelijk is in overeenstemming met artikel 21, stelt het ontvangende lid van het handelsplatform het nalatige lid van het handelsplatform in kennis van de uitkomsten van de controle en van het in overeenstemming met artikel 32 berekende bedrag van de geldelijke vergoeding. De geldelijke vergoeding wordt voldaan in overeenstemming met artikel 33, lid 2.
4. Wanneer een buy-in mogelijk is, is artikel 29 van toepassing.

Artikel 29

Buy-inprocedure en -kennisgevingen

1. Wanneer een buy-in mogelijk is, stelt het ontvangende lid van het handelsplatform een buy-inagent aan op de werkdag na het verstrijken van de verlengingstermijn en stelt hij het nalatige lid van het handelsplatform daarvan in kennis.

2. Na ontvangst van de in lid 1 bedoelde kennisgeving zorgt het nalatige lid van het handelsplatform ervoor dat alle desbetreffende afwikkelingsinstructies met betrekking tot de mislukte afwikkelingsoperatie worden opgeschort.

3. Na ontvangst van de in lid 1 bedoelde kennisgeving mag het nalatige lid van het handelsplatform de financiële instrumenten alleen aan de buy-inagent leveren wanneer de buy-inagent daarin vooraf heeft toegestemd.

Vóór ontvangst van de in lid 1 bedoelde kennisgeving mag het nalatige lid van het handelsplatform de financiële instrumenten nog steeds rechtstreeks aan het ontvangende lid van het handelsplatform leveren.

4. Het ontvangende lid van het handelsplatform stelt het nalatige lid van het handelsplatform en de betrokken CSD uiterlijk op de laatste werkdag van de in overeenstemming met artikel 37 vastgestelde periode in kennis van de resultaten van de buy-in.

5. Wanneer de buy-in volledig of gedeeltelijk slaagt, bevat de in lid 4 bedoelde kennisgeving de hoeveelheid en de prijs van de financiële instrumenten waarvoor buy-in heeft plaatsgevonden.

6. Wanneer de buy-in volledig of gedeeltelijk mislukt, bevat de in lid 4 bedoelde kennisgeving van het in overeenstemming met artikel 32 berekende bedrag van de geldelijke vergoeding, tenzij in die kennisgeving is aangegeven dat de uitvoering van de buy-in is uitgesteld.

7. Wanneer de uitvoering van de buy-in is uitgesteld, stelt het ontvangende lid van het handelsplatform het nalatige lid van het handelsplatform en de betrokken CSD uiterlijk op de laatste werkdag van de in artikel 38 genoemde uitstelperiode in kennis van de resultaten van die uitgestelde buy-in.

8. Wanneer de in lid 7 bedoelde buy-in volledig of gedeeltelijk slaagt, bevat de in dat lid bedoelde kennisgeving de hoeveelheid en de prijs van de financiële instrumenten waarvoor buy-in heeft plaatsgevonden.

9. Wanneer de in lid 7 bedoelde buy-in volledig of gedeeltelijk mislukt, bevat de in dat lid bedoelde kennisgeving het in overeenstemming met artikel 32 berekende bedrag van de geldelijke vergoeding.

10. Het ontvangende lid van het handelsplatform accepteert en betaalt voor de in de leden 5 en 8 bedoelde financiële instrumenten waarvoor buy-in heeft plaatsgevonden.

11. De ontvangende en de nalatige leden van het handelsplatform zorgen ervoor dat het volgende wordt uitgevoerd aan het eind van elke werkdag waarop het ontvangende lid van het handelsplatform de in de leden 5 en 8 bedoelde financiële instrumenten ontvangt:

- a) de afwikkelingsinstructies met betrekking tot de mislukte afwikkelingsoperatie worden geannuleerd;
- b) voor alle niet-geleverde financiële instrumenten worden nieuwe afwikkelingsinstructies ingevoerd in het effectenafwikkelingssysteem en de CSD ontvangt de informatie die nodig is om dergelijke nieuwe afwikkelingsinstructies dienovereenkomstig te identificeren.

12. Het nalatige lid van het handelsplatform voldoet de in de leden 6 en 9 genoemde geldelijke vergoeding in overeenstemming met artikel 33, lid 2.

13. De nalatige en ontvangende leden van het handelsplatform zorgen ervoor dat de betrokken afwikkelingsinstructies met betrekking tot de mislukte afwikkelingsoperatie worden geannuleerd na betaling van de in de leden 6 en 9 bedoelde geldelijke vergoeding of uiterlijk op de tweede werkdag na de kennisgeving van het bedrag van de geldelijke vergoeding.

Onderafdeling 4

Buy-inproces voor transacties niet gecleard door een CTP en niet uitgevoerd op een handelsplatform

Artikel 30

Initiële controle

1. Voor transacties niet gecleard door een CTP en niet uitgevoerd op een handelsplatform informeren ontvangende deelnemers, via hun cliënten, ontvangende handelende partijen onverwijld over mislukte afwikkelingsoperaties.

2. Op de werkdag na het verstrijken van de verlengingstermijn gaan de ontvangende handelende partijen na of een buy-in mogelijk is in overeenstemming met artikel 21.

3. Wanneer een buy-in niet mogelijk is in overeenstemming met artikel 21, stellen de ontvangende handelende partijen de nalatige handelende partij in kennis van de uitkomsten van de controle en van het in overeenstemming met artikel 32 berekende bedrag van de geldelijke vergoeding. De geldelijke vergoeding wordt voldaan in overeenstemming met artikel 33, lid 2.

4. Wanneer de buy-in mogelijk is, is artikel 31 van toepassing.

Artikel 31

Buy-inprocedure en -kennisgevingen

1. Wanneer de buy-in mogelijk is, stelt de ontvangende handelende partij een buy-inagent aan op de werkdag na het verstrijken van de verlengingstermijn en stelt zij de nalatige handelende partij daarvan in kennis.

2. Na ontvangst van de in lid 1 bedoelde kennisgeving zorgt de nalatige handelende partij ervoor dat alle desbetreffende afwikkelingsinstructies met betrekking tot de mislukte afwikkelingsoperatie worden opgeschort.

3. Na ontvangst van de in lid 1 bedoelde kennisgeving mag de nalatige handelende partij de financiële instrumenten alleen aan de buy-inagent leveren wanneer de buy-inagent daarin vooraf heeft toegestemd.

Vóór ontvangst van de in lid 1 bedoelde kennisgeving mag de nalatige handelende partij de financiële instrumenten nog steeds rechtstreeks aan de ontvangende handelende partij leveren.

4. De ontvangende handelende partij stelt de nalatige handelende partij uiterlijk op de laatste werkdag van de in overeenstemming met artikel 37 vastgestelde toepasselijke periode in kennis van de resultaten van de buy-in. De ontvangende handelende partij zorgt ervoor dat de betrokken CSD de informatie waarvan kennis is gegeven, onverwijld ontvangt.

5. Wanneer de buy-in volledig of gedeeltelijk slaagt, bevat de in lid 4 bedoelde kennisgeving de hoeveelheid en de prijs van de financiële instrumenten waarvoor buy-in heeft plaatsgevonden.

6. Wanneer de buy-in volledig of gedeeltelijk mislukt, bevat de in lid 4 bedoelde kennisgeving van het in overeenstemming met artikel 32 berekende bedrag van de geldelijke vergoeding, tenzij in die kennisgeving is aangegeven dat de uitvoering van de buy-in is uitgesteld.

7. Wanneer de uitvoering van de buy-in is uitgesteld, stelt de ontvangende handelende partij de nalatige handelende partij uiterlijk op de laatste werkdag van de in artikel 38 genoemde uitstelperiode in kennis van de resultaten van die uitgestelde buy-in. De ontvangende handelende partij zorgt ervoor dat de betrokken CSD de informatie waarvan kennis is gegeven, onverwijld ontvangt.

8. Wanneer de in lid 7 bedoelde buy-in volledig of gedeeltelijk slaagt, bevat de in dat lid bedoelde kennisgeving de hoeveelheid en de prijs van de financiële instrumenten waarvoor buy-in heeft plaatsgevonden.

9. Wanneer de in lid 7 bedoelde buy-in volledig of gedeeltelijk mislukt, bevat de in dat lid bedoelde kennisgeving het in overeenstemming met artikel 32 berekende bedrag van de geldelijke vergoeding.

10. De ontvangende handelende partij accepteert en betaalt voor de in de leden 5 en 8 bedoelde financiële instrumenten waarvoor buy-in heeft plaatsgevonden.

11. De ontvangende en de nalatige handelende partijen zorgen ervoor dat het volgende wordt uitgevoerd aan het eind van elke werkdag waarop de ontvangende handelende partij de in de leden 5 en 8 bedoelde financiële instrumenten ontvangt:

- a) de afwikkelingsinstructies met betrekking tot de mislukte afwikkelingsoperatie worden geannuleerd;
- b) voor alle niet-geleverde financiële instrumenten worden nieuwe afwikkelingsinstructies in het effectenafwikkelings-systeem ingevoerd en de CSD ontvangt de informatie die nodig is om dergelijke nieuwe afwikkelingsinstructies dienovereenkomstig te identificeren.

12. De nalatige handelende partij voldoet de in de leden 6 en 9 genoemde geldelijke vergoeding in overeenstemming met artikel 33, lid 3.

13. De nalatige en ontvangende handelende partijen zorgen ervoor dat de betrokken afwikkelingsinstructies met betrekking tot de mislukte afwikkelingsoperatie worden geannuleerd na betaling van de in de leden 6 en 9 genoemde geldelijke vergoeding of uiterlijk op de tweede werkdag na de kennisgeving van het bedrag van de geldelijke vergoeding.

Onderafdeling 5

Berekening en betaling van de geldelijke vergoeding, de buy-inkosten en het daarmee samenhangende prijsverschil

Artikel 32

Berekening van de geldelijke vergoeding

1. De in overeenstemming met artikel 7, lid 7, van Verordening (EU) nr. 909/2014 verschuldigde geldelijke vergoeding wordt op een van de volgende wijzen berekend:
 - a) voor afwikkelingsinstructies tegen betaling: het verschil tussen de marktwaarde van de betrokken financiële instrumenten op de werkdag vóór de betaling van de geldelijke vergoeding en het in de mislukte afwikkelingsinstructie opgenomen afwikkelingsbedrag wanneer dat afwikkelingsbedrag lager is dan die marktwaarde;
 - b) voor afwikkelingsinstructies zonder betaling: het verschil tussen de marktwaarde van de betrokken financiële instrumenten op de werkdag vóór de betaling van de geldelijke vergoeding en de marktwaarde van die financiële instrumenten op de dag waarop zij worden verhandeld, wanneer de marktwaarde van die financiële instrumenten op de dag waarop zij worden verhandeld, lager is dan op de werkdag vóór de betaling van de geldelijke vergoeding.
2. Voor zover de in overeenstemming met artikel 7, lid 7, van Verordening (EU) nr. 909/2014 verschuldigde geldelijke vergoeding niet reeds is opgenomen in de marktwaarde van het financiële instrument, omvat deze een component die wisselkoersfluctuaties, zakelijke rechten en opgelopen rente tot uiting brengt.
3. De in lid 1 bedoelde marktwaarde wordt als volgt bepaald:
 - a) voor de in artikel 3, lid 1, van Verordening (EU) nr. 600/2014 van het Europees Parlement en de Raad ⁽¹⁾ genoemde financiële instrumenten die tot de handel op een handelsplatform in de Unie zijn toegelaten: de waarde bepaald op basis van de slotkoers op de qua liquiditeit meest relevante markt als bedoeld in artikel 4, lid 6, onder b), van genoemde verordening;
 - b) voor tot de handel op een handelsplatform in de Unie toegelaten financiële instrumenten niet zijnde die bedoeld in punt a): de waarde bepaald op basis van de slotkoers op het handelsplatform in de Unie met de hoogste omzet;
 - c) voor financiële instrumenten niet zijnde die bedoeld in de punten a) en b): de waarde bepaald op basis van een prijs die is berekend volgens een vooraf bepaalde, door de bevoegde autoriteit van de CSD goedgekeurde methodiek die is gebaseerd op met marktgegevens samenhangende criteria, zoals op handelsplatformen of bij beleggingsondernemingen beschikbare marktprijzen.
4. De in lid 1 bedoelde marktwaarde en de in lid 2 bedoelde component die wisselkoersfluctuaties, zakelijke rechten en opgelopen rente tot uiting brengt, worden aan clearingleden, leden van een handelsplatform en handelende partijen bekendgemaakt in de vorm van een gedetailleerde uitsplitsing.

Artikel 33

Betaling van de geldelijke vergoeding

1. Voor transacties gecleard door een CTP int de CTP de geldelijke vergoeding bij de nalatige clearingleden en betaalt zij de geldelijke vergoeding aan de ontvangende clearingleden.
2. Wanneer transacties niet door een CTP zijn gecleard, maar op een handelsplatform worden uitgevoerd, betalen de nalatige leden van het handelsplatform de geldelijke vergoeding aan de ontvangende leden van het handelsplatform.
3. Wanneer transacties niet door een CTP zijn gecleard en niet op een handelsplatform zijn uitgevoerd, betalen de nalatige handelende partijen de geldelijke vergoeding aan de ontvangende handelende partijen.

⁽¹⁾ 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 (PB L 173 van 12.6.2014, blz. 84).

*Artikel 34***Betaling van de kosten van de buy-in**

De in artikel 7, lid 8, van Verordening (EU) nr. 909/2014 bedoelde bedragen worden betaald door de nalatige clearingleden, nalatige leden van een handelsplatform of nalatige handelende partijen, al naargelang.

*Artikel 35***Betaling van het prijsverschil**

1. Wanneer de op het tijdstip van de transactie overeengekomen prijs van de in artikel 5, lid 1, van Verordening (EU) nr. 909/2014 genoemde financiële instrumenten lager is dan de prijs die in overeenstemming met artikel 27, lid 10, artikel 29, lid 10, en artikel 31, lid 10, daadwerkelijk voor die financiële instrumenten is betaald, betalen de nalatige clearingleden, nalatige leden van een handelsplatform of nalatige handelende partijen het prijsverschil aan de CTP, de ontvangende leden van het handelsplatform of de ontvangende handelende partijen, al naargelang.

Wanneer transacties door een CTP zijn gecleard, wordt het in de eerste alinea bedoelde prijsverschil door de CTP bij nalatige clearingleden geïnd en aan de ontvangende clearingleden betaald.

2. Wanneer de op het tijdstip van de transactie overeengekomen prijs van de aandelen hoger is dan de prijs die in overeenstemming met artikel 27, lid 10, artikel 29, lid 10, en artikel 31, lid 10, daadwerkelijk voor die aandelen is betaald, wordt het overeenkomstige verschil als bedoeld in artikel 7, lid 6, van Verordening (EU) nr. 909/2014 geacht te zijn betaald.

*Afdeling 4***Termijnen voor het buy-inproces***Artikel 36***Verlengingstermijnen**

In overeenstemming met artikel 7, lid 4, onder a), van Verordening (EU) nr. 909/2014 wordt de verlengingstermijn voor de in artikel 5, lid 1, van Verordening (EU) nr. 909/2014 genoemde financiële instrumenten verlengd van vier tot zeven werkdagen voor alle financiële instrumenten niet zijnde aandelen waarvoor een liquide markt bestaat in de zin van artikel 2, lid 1, punt 17, onder b), van Verordening (EU) nr. 600/2014.

*Artikel 37***Termijn voor de levering van financiële instrumenten**

Na het buy-inproces worden de in artikel 5, lid 1, eerste alinea, van Verordening (EU) nr. 909/2014 genoemde financiële instrumenten binnen de volgende termijnen geleverd aan de ontvangende deelnemers die handelen namens de CTP, de ontvangende clearingleden, de leden van het handelsplatform of de handelende partijen:

- a) vier werkdagen na de in artikel 36 bedoelde verlengingstermijn voor aandelen met een liquide markt;
- b) zeven werkdagen na de in artikel 36 bedoelde verlengingstermijn voor financiële instrumenten niet zijnde aandelen met een liquide markt;
- c) zeven werkdagen na de in artikel 7, lid 3, tweede alinea, van Verordening (EU) nr. 909/2014 bedoelde verlengingstermijn voor op mkb-groeimarkten verhandelde financiële instrumenten;
- d) wanneer onder a) bedoelde aandelen op mkb-groeimarkten worden verhandeld, is punt c) van toepassing.

*Artikel 38***Duur van het uitstel van de uitvoering van een buy-in**

Wanneer de CTP, het ontvangende lid van een handelsplatform of de ontvangende handelende partij de uitvoering van de buy-in uitstelt, wordt de duur van de in artikel 7, lid 7, van Verordening (EU) nr. 909/2014 bedoelde uitstelperiode vastgesteld overeenkomstig de in artikel 37 genoemde termijnen.

Afdeling 5

Systematisch leveringsverzuim

Artikel 39

Consequent en systematisch verzuim om effecten te leveren

1. Er wordt geacht sprake te zijn van consequent en systematisch verzuim door de deelnemer om effecten te leveren in een effectenafwikkelingssysteem, als bedoeld in artikel 7, lid 9, van Verordening (EU) nr. 909/2014, wanneer zijn afwikkelingsefficiëntiepercentage, bepaald aan de hand van het aantal of de waarde van de afwikkelingsinstructies, gedurende ten minste een relevant aantal dagen in de voorafgaande twaalf maanden ten minste 15 % lager ligt dan het afwikkelingsefficiëntiepercentage van dat effectenafwikkelingssysteem.

Het relevante aantal dagen wordt voor elke deelnemer bepaald op 10 % van het aantal dagen dat die deelnemer aan het effectenafwikkelingssysteem de voorafgaande twaalf maanden actief was.

2. Bij het berekenen van het afwikkelingsefficiëntiepercentage van een deelnemer wordt uitsluitend rekening gehouden met de door die deelnemer veroorzaakte mislukte afwikkelingsoperaties.

Afdeling 6

Afwikkelingsgegevens

Artikel 40

Afwikkelingsgegevens voor CTP's en handelsplatformen

De in artikel 7, lid 10, tweede alinea, van Verordening (EU) nr. 909/2014 bedoelde afwikkelingsgegevens omvatten de identificatie van de betrokken transacties, de deelnemers en de betrokken afwikkelingsinstructies. Die gegevens zijn gebaseerd op de gegevens in het effectenafwikkelingssysteem dat de CSD exploiteert.

Artikel 41

Afwikkelingsgegevens bij gebreke van directe transactiestromen vanuit het handelsplatform

Voor op een handelsplatform uitgevoerde transacties die niet door een CTP worden gecleard, identificeren deelnemers bij gebreke van een directe transactiestroom vanuit het handelsplatform naar de CSD, het handelsplatform en de transacties in hun afwikkelingsinstructies. Bij gebreke van dergelijke gegevens beschouwen CSD's de transacties als niet uitgevoerd op een handelsplatform.

HOOFDSTUK IV

Slotbepalingen

Artikel 42

Deze verordening treedt in werking 24 maanden na de dag van de bekendmaking ervan in het *Publicatieblad van de Europese Unie*.

Deze verordening is verbindend in al haar onderdelen en is rechtstreeks toepasselijk in elke lidstaat.

Gedaan te Brussel, 25 mei 2018.

Voor de Commissie
De voorzitter
Jean-Claude JUNCKER

BIJLAGE I

Tabel 1

Algemene informatie over mislukte afwikkelingsoperaties op maandbasis door CSD's te rapporteren aan de bevoegde autoriteiten en relevante autoriteiten

Nr.	Te rapporteren gegevens	Formaat
1.	Landcode voor de jurisdictie waar de CSD is gevestigd	ISO 3166 landcode (twee tekens)
2.	Door CSD geëxploiteerd effectenafwikkelingssysteem	Vrije tekst
3.	Tijdstempel rapportage (CSD aan bevoegde/relevante autoriteit)	Datum volgens ISO 8601 in formaat voor UTC-tijd JJJJ-MM-DDThh:mm:ssZ
4.	Rapportageperiode: begin- en einddatum rapportageperiode	Datum volgens ISO 8601 in formaat JJJJ-MM-DD-JJJJ-MM-DD
5.	Legal Entity Identifier CSD	Identificatiecode voor juridische entiteiten (LEI) volgens ISO 17442 (twintig alfanumerieke tekens)
6.	Handelsnaam CSD	Vrije tekst
7.	Naam persoon verantwoordelijk voor rapportage door CSD	Vrije tekst
8.	Functie persoon verantwoordelijk voor rapportage door CSD	Vrije tekst
9.	Telefoonnummer persoon verantwoordelijk voor rapportage door CSD	Gebruik alleen cijfers. Geef het telefoonnummer met de landcode en het netnummer. Gebruik geen speciale tekens.
10.	E-mailadres persoon verantwoordelijk voor rapportage door CSD	Gebruik voor e-mailadressen het standaard e-mailformaat.
11.	Aantal afwikkelingsinstructies tijdens de rapportageperiode	Maximaal twintig numerieke tekens, gerapporteerd als gehele getallen, zonder decimalen
12.	Aantal mislukte afwikkelingsoperaties tijdens de rapportageperiode (door zowel gebrek aan effecten als gebrek aan gelden)	Maximaal twintig numerieke tekens, gerapporteerd als gehele getallen, zonder decimalen
13.	Percentage mislukte afwikkelingsoperaties op basis van volume (aantal mislukte afwikkelingsoperaties/aantal afwikkelingsinstructies tijdens de rapportageperiode) (door zowel gebrek aan effecten als gebrek aan gelden)	Percentage met maximaal twee decimalen

Nr.	Te rapporteren gegevens	Formaat	
14.	Percentage mislukte ontwikkelingsoperaties op basis van waarde (in EUR) (waarde mislukte ontwikkelingsoperaties/waarde ontwikkelingsinstructies tijdens de rapportageperiode) (door zowel gebrek aan effecten als gebrek aan gelden)	Percentage met maximaal twee decimalen	
15.	Waarde ontwikkelingsinstructies (in EUR) tijdens de rapportageperiode	Maximaal twintig numerieke tekens, inclusief decimalen. Vul ten minste één teken voor en één teken na het decimaalteken in. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld.	
16.	Waarde mislukte ontwikkelingsoperaties (in EUR) tijdens de rapportageperiode (door zowel gebrek aan effecten als gebrek aan gelden)	Maximaal twintig numerieke tekens, inclusief decimalen. Vul ten minste één teken voor en één teken na het decimaalteken in. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld.	
17.	Top 10 deelnemers met hoogste percentages mislukte ontwikkelingsoperaties tijdens de rapportageperiode op basis van volume (op basis van aantal ontwikkelingsinstructies)	Voor iedere deelnemer geïdentificeerd met LEI	
		LEI deelnemer	Identificatiecode voor juridische entiteiten (LEI) volgens ISO 17442 (twintig alfanumerieke tekens)
		Totaal aantal ontwikkelingsinstructies per deelnemer	Maximaal twintig numerieke tekens, gerapporteerd als gehele getallen, zonder decimalen
		Aantal mislukte ontwikkelingsoperaties per deelnemer	Maximaal twintig numerieke tekens, gerapporteerd als gehele getallen, zonder decimalen
		Percentage mislukte ontwikkelingsoperaties	Percentage met maximaal twee decimalen
		Totale waarde (in EUR) van ontwikkelingsinstructies per deelnemer	Maximaal twintig numerieke tekens, inclusief decimalen. Vul ten minste één teken voor en één teken na het decimaalteken in. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld.
		Waarde (in EUR) van mislukte ontwikkelingsoperaties per deelnemer	Maximaal twintig numerieke tekens, inclusief decimalen. Vul ten minste één teken voor en één teken na het decimaalteken in. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld.
Percentage mislukte ontwikkelingsoperaties	Percentage met maximaal twee decimalen		
18.	Top 10 deelnemers met hoogste percentages mislukte ontwikkelingsoperaties tijdens rapportageperiode (op basis van waarde (in EUR) ontwikkelingsinstructies)	Voor iedere deelnemer geïdentificeerd met LEI:	
		LEI deelnemer	Identificatiecode voor juridische entiteiten (LEI) volgens ISO 17442 (twintig alfanumerieke tekens)

Nr.	Te rapporteren gegevens	Formaat	
		Totale waarde (in EUR) van afwikkelingsinstructies per deelnemer	Maximaal twintig numerieke tekens, inclusief decimalen. Vul ten minste één teken voor en één teken na het decimaalteken in. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld.
		Waarde (in EUR) mislukte afwikkelingsoperaties per deelnemer	Maximaal twintig numerieke tekens, inclusief decimalen. Vul ten minste één teken voor en één teken na het decimaalteken in. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld.
		Percentage mislukte afwikkelingsoperaties	Percentage met maximaal twee decimalen
		Totaal aantal afwikkelingsinstructies per deelnemer	Maximaal twintig numerieke tekens, gerapporteerd als gehele getallen, zonder decimalen
		Aantal mislukte afwikkelingsoperaties per deelnemer	Maximaal twintig numerieke tekens, gerapporteerd als gehele getallen, zonder decimalen
		Percentage mislukte afwikkelingsoperaties	Percentage met maximaal twee decimalen
19.	Aantal afwikkelingsinstructies per valuta waarin de afwikkelingsinstructies luiden, tijdens de rapportageperiode	Druk voor elke ISO 4217 valutacode van drie tekens het volume uit in maximaal twintig numerieke tekens, gerapporteerd als gehele getallen, zonder decimalen.	
20.	Aantal mislukte afwikkelingsoperaties per valuta waarin de afwikkelingsinstructies luiden, tijdens de rapportageperiode	Druk voor elke ISO 4217 valutacode van drie tekens het volume uit in maximaal twintig numerieke tekens, gerapporteerd als gehele getallen, zonder decimalen.	
21.	Percentage mislukte afwikkelingsoperaties per valuta waarin de afwikkelingsinstructies luiden, op basis van volume (aantal mislukte afwikkelingsoperaties/aantal afwikkelingsinstructies per valuta, tijdens de rapportageperiode)	Druk voor elke ISO 4217 valutacode van drie tekens het percentage uit als percentage met maximaal twee decimalen.	
22.	Waarde afwikkelingsinstructies per valuta waarin de afwikkelingsinstructies luiden, tijdens de rapportageperiode	Druk voor elke ISO 4217 valutacode van drie tekens de waarde uit in maximaal twintig numerieke tekens, inclusief decimalen. Vul ten minste één teken voor en één teken na het decimaalteken in. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld.	
23.	Waarde mislukte afwikkelingsoperaties per valuta waarin de afwikkelingsinstructies luiden, tijdens de rapportageperiode	Druk voor elke ISO 4217 valutacode van drie tekens de waarde uit in maximaal twintig numerieke tekens, inclusief decimalen. Vul ten minste één teken voor en één teken na het decimaalteken in. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld.	

Nr.	Te rapporteren gegevens	Formaat
24.	Percentage mislukte afwikkelingsoperaties per valuta waarin de afwikkelingsinstructies luiden, op basis van waarde (waarde mislukte afwikkelingsoperaties/waarde afwikkelingsinstructies per valuta, tijdens de rapportageperiode)	Druk voor elke ISO 4217 valutacode van drie tekens het percentage uit als percentage met maximaal twee decimalen.
25.	Aantal afwikkelingsinstructies per type financieel instrument tijdens de rapportageperiode	Voor elk type financieel instrument: Maximaal twintig numerieke tekens, gerapporteerd als gehele getallen, zonder decimalen
26.	Aantal mislukte afwikkelingsoperaties (door zowel gebrek aan effecten als gebrek aan gelden) per type financieel instrument tijdens de rapportageperiode	Voor elk type financieel instrument: Maximaal twintig numerieke tekens, gerapporteerd als gehele getallen, zonder decimalen
27.	Percentage mislukte afwikkelingsoperaties per type financieel instrument, op basis van volume (aantal mislukte afwikkelingsoperaties/aantal afwikkelingsinstructies per type financieel instrument tijdens de rapportageperiode)	Druk per type financieel instrument het percentage uit als percentage met maximaal twee decimalen.
28.	Waarde (in EUR) van afwikkelingsinstructies per type financieel instrument	Druk per type financieel instrument de waarde uit in maximaal twintig numerieke tekens, inclusief decimalen. Vul ten minste één teken voor en één teken na het decimaalteken in. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld.
29.	Waarde (in EUR) van mislukte afwikkelingsoperaties (door zowel gebrek aan effecten als gebrek aan gelden) per type financieel instrument	Druk per type financieel instrument de waarde uit in maximaal twintig numerieke tekens, inclusief decimalen. Vul ten minste één teken voor en één teken na het decimaalteken in. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld.
30.	Percentage mislukte afwikkelingsoperaties per type financieel instrument op basis van waarde (waarde van mislukte afwikkelingsoperaties/waarde afwikkelingsinstructies per type financieel instrument tijdens de rapportageperiode)	Druk per type financieel instrument het percentage uit als percentage met maximaal twee decimalen.
31.	Aantal afwikkelingsinstructies per type transactie tijdens de rapportageperiode	Druk per type transactie het volume uit in maximaal twintig numerieke tekens, gerapporteerd als gehele getallen, zonder decimalen.
32.	Aantal mislukte afwikkelingsoperaties (door zowel gebrek aan effecten als gebrek aan gelden) per type transactie tijdens de rapportageperiode	Druk per type transactie het volume uit in maximaal twintig numerieke tekens, gerapporteerd als gehele getallen, zonder decimalen.

Nr.	Te rapporteren gegevens	Formaat
33.	Percentage mislukte afwikkelingsoperaties per type transactie, op basis van volume (aantal mislukte afwikkelingsoperaties/aantal afwikkelingsinstructies per type transactie tijdens de rapportageperiode)	Druk per type transactie het percentage uit als percentage met maximaal twee decimalen.
34.	Waarde (in EUR) van afwikkelingsinstructies per type transactie	Druk per type transactie de waarde uit in maximaal twintig numerieke tekens, inclusief decimalen. Vul ten minste één teken voor en één teken na het decimaalteken in. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld.
35.	Waarde (in EUR) van mislukte afwikkelingsoperaties (door zowel gebrek aan effecten als gebrek aan gelden) per type transactie	Druk per type transactie de waarde uit in maximaal twintig numerieke tekens, inclusief decimalen. Vul ten minste één teken voor en één teken na het decimaalteken in. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld.
36.	Percentage mislukte afwikkelingsoperaties per type transactie, op basis van waarde (waarde mislukte afwikkelingsoperaties/waarde afwikkelingsinstructies per type transactie tijdens de rapportageperiode)	Druk per type transactie het percentage uit als percentage met maximaal twee decimalen.
37.	Top 20 ISIN's met mislukte afwikkelingsoperaties, op basis van het volume van mislukte afwikkelingsoperaties	ISIN-code
38.	Top 20 ISIN's met mislukte afwikkelingsoperaties, op basis van de waarde (in EUR) van mislukte afwikkelingsoperaties	ISIN-code
39.	Totaal aantal door de CSD opgelegde geldboeten als bedoeld in artikel 7, lid 2, van Verordening (EU) nr. 909/2014	Maximaal twintig numerieke tekens, gerapporteerd als gehele getallen, zonder decimalen
40.	Totale waarde (in EUR) van door de CSD opgelegde geldboeten als bedoeld in artikel 7, lid 2, van Verordening (EU) nr. 909/2014	Maximaal twintig numerieke tekens, inclusief decimalen. Vul ten minste één teken voor en één teken na het decimaalteken in. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld.
41.	Gemiddelde duur van mislukte afwikkelingsoperaties als aantal dagen (verschil tussen reële afwikkelingsdatum en beoogde afwikkelingsdatum, gewogen voor de waarde van de mislukte afwikkelingsoperatie)	Aantal dagen gerapporteerd als getal met één decimaal
42.	Belangrijkste redenen voor het mislukken van afwikkelingsoperaties	Vrije tekst
43.	Maatregelen ter verbetering van de afwikkelingsefficiëntie	Vrije tekst

Tabel 2

Dagelijkse gegevens over mislukte afwikkelingsoperaties op maandbasis door CSD's te rapporteren aan de bevoegde autoriteiten en relevante autoriteiten

Datum (voor elke rapportagedag in de maand)																
Type financieel instrument	Type transactie	Intern vs systeemoverschrijdend	Type instructie	Niet-levering effecten						Niet-levering gelden						
				Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		
				Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	
Effecten in de zin van artikel 4, lid 1, punt 44, onder a), van Richtlijn 2014/65/EU	Aankoop of verkoop financiële instrumenten	Intra-CSD	DVP ⁽¹⁾													
			DWP ⁽²⁾													
			PFOD ⁽³⁾													
			FoP ⁽⁴⁾													
		Inter-CSD	DVP													
			DWP													
			PFOD													
			FoP													
	Transacties i.v.m. zekerhedenbeheer	Intra-CSD	DVP													
			DWP													
			PFOD													
			FoP													
Inter-CSD		DVP														
		DWP														

Datum (voor elke rapportagedag in de maand)

Type financieel instrument	Type transactie	Intern vs systeemoverschrijdend	Type instructie	Niet-levering effecten						Niet-levering gelden						
				Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		
				Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	
			PFOD													
			FoP													
	Uitlenen en lenen van effecten	Intra-CSD	DVP													
DWP																
PFOD																
FoP																
		Inter-CSD	DVP													
DWP																
PFOD																
FoP																
	Retrocessietransacties	Intra-CSD	DVP													
DWP																
PFOD																
FoP																
		Inter-CSD	DVP													
DWP																
PFOD																
FoP																

Datum (voor elke rapportagedag in de maand)

Type financieel instrument	Type transactie	Intern vs systeemoverschrijdend	Type instructie	Niet-levering effecten						Niet-levering gelden					
				Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt	
				Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)
	Andere transacties	Intra-CSD	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												
		Inter-CSD	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												
Overheidsschuld in de zin van artikel 4, lid 1, punt 61, van Richtlijn 2014/65/EU	Aankoop of verkoop financiële instrumenten	Intra-CSD	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												
		Inter-CSD	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												

Datum (voor elke rapportagedag in de maand)

Type financieel instrument	Type transactie	Intern vs systeemoverschrijdend	Type instructie	Niet-levering effecten						Niet-levering gelden					
				Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt	
				Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)
Transacties i.v.m. zekerhedenbeheer	Intra-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Inter-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
Uitlenen en lenen van effecten	Intra-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Inter-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													

Datum (voor elke rapportagedag in de maand)

Type financieel instrument	Type transactie	Intern vs systeemoverschrijdend	Type instructie	Niet-levering effecten						Niet-levering gelden						
				Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		
				Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	
	Retrocessietransacties	Intra-CSD	DVP													
			DWP													
			PFOD													
			FoP													
		Inter-CSD	DVP													
			DWP													
			PFOD													
			FoP													
	Andere transacties	Intra-CSD	DVP													
			DWP													
			PFOD													
			FoP													
		Inter-CSD	DVP													
			DWP													
			PFOD													
			FoP													

Datum (voor elke rapportagedag in de maand)

Type financieel instrument	Type transactie	Intern vs systeemoverschrijdend	Type instructie	Niet-levering effecten						Niet-levering gelden						
				Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		
				Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	
Effecten in de zin van artikel 4, lid 1, punt 44, onder b), van Richtlijn 2014/65/EU, niet zijnde overheidsschuld in de zin van artikel 4, lid 1, punt 61, van Richtlijn 2014/65/EU	Aankoop of verkoop financiële instrumenten	Intra-CSD	DVP													
			DWP													
			PFOD													
			FoP													
		Inter-CSD	DVP													
			DWP													
			PFOD													
			FoP													
Transacties i.v.m. zekerhedenbeheer	Intra-CSD	DVP														
		DWP														
		PFOD														
		FoP														
	Inter-CSD	DVP														
		DWP														
		PFOD														
		FoP														

Datum (voor elke rapportagedag in de maand)

Type financieel instrument	Type transactie	Intern vs systeemoverschrijdend	Type instructie	Niet-levering effecten						Niet-levering gelden					
				Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt	
				Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)
Uitlenen en lenen van effecten	Intra-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Inter-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
Retrocessietransacties	Intra-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Inter-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													

Datum (voor elke rapportagedag in de maand)

Type financieel instrument	Type transactie	Intern vs systeemoverschrijdend	Type instructie	Niet-levering effecten						Niet-levering gelden					
				Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt	
				Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)
	Andere transacties	Intra-CSD	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												
		Inter-CSD	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												
Effecten in de zin van artikel 4, lid 1, punt 44, onder c), van Richtlijn 2014/65/EU	Aankoop of verkoop financiële instrumenten	Intra-CSD	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												
		Inter-CSD	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												

Datum (voor elke rapportagedag in de maand)

Type financieel instrument	Type transactie	Intern vs systeemoverschrijdend	Type instructie	Niet-levering effecten						Niet-levering gelden					
				Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt	
				Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)
Transacties i.v.m. zekerhedenbeheer	Intra-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Inter-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
Uitlenen en lenen van effecten	Intra-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Inter-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													

Datum (voor elke rapportagedag in de maand)

Type financieel instrument	Type transactie	Intern vs systeemoverschrijdend	Type instructie	Niet-levering effecten						Niet-levering gelden						
				Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		
				Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	
	Retrocessietransacties	Intra-CSD	DVP													
			DWP													
			PFOD													
			FoP													
		Inter-CSD	DVP													
			DWP													
			PFOD													
			FoP													
	Andere transacties	Intra-CSD	DVP													
			DWP													
			PFOD													
			FoP													
		Inter-CSD	DVP													
			DWP													
			PFOD													
			FoP													

Datum (voor elke rapportagedag in de maand)

Type financieel instrument	Type transactie	Intern vs systeemoverschrijdend	Type instructie	Niet-levering effecten						Niet-levering gelden					
				Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt	
				Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)
Beursverhandelde fondsen in de zin van artikel 4, lid 1, punt 46, van Richtlijn 2014/65/EU	Aankoop of verkoop financiële instrumenten	Intra-CSD	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												
		Inter-CSD	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												
Transacties i.v.m. zekerhedenbeheer	Intra-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Inter-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													

Datum (voor elke rapportagedag in de maand)

Type financieel instrument	Type transactie	Intern vs systeemoverschrijdend	Type instructie	Niet-levering effecten						Niet-levering gelden					
				Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt	
				Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)
Uitlenen en lenen van effecten	Intra-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Inter-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
Retrocessietransacties	Intra-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Inter-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													

Datum (voor elke rapportagedag in de maand)

Type financieel instrument	Type transactie	Intern vs systeemoverschrijdend	Type instructie	Niet-levering effecten						Niet-levering gelden					
				Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt	
				Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)
	Andere transacties	Intra-CSD	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												
		Inter-CSD	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												
Rechten van deelneming in instellingen voor collectieve belegging, niet zijnde ETF's	Aankoop of verkoop financiële instrumenten	Intra-CSD	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												
		Inter-CSD	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												

Datum (voor elke rapportagedag in de maand)

Type financieel instrument	Type transactie	Intern vs systeemoverschrijdend	Type instructie	Niet-levering effecten						Niet-levering gelden					
				Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt	
				Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)
Transacties i.v.m. zekerhedenbeheer	Intra-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Inter-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
Uitlenen en lenen van effecten	Intra-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Inter-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													

Datum (voor elke rapportagedag in de maand)

Type financieel instrument	Type transactie	Intern vs systeemoverschrijdend	Type instructie	Niet-levering effecten						Niet-levering gelden							
				Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt			
				Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)		
	Retrocessietransacties	Intra-CSD	DVP														
			DWP														
			PFOD														
			FoP														
		Inter-CSD	DVP														
			DWP														
			PFOD														
			FoP														
	Andere transacties	Intra-CSD	DVP														
			DWP														
			PFOD														
			FoP														
		Inter-CSD	DVP														
			DWP														
			PFOD														
			FoP														

Datum (voor elke rapportagedag in de maand)

Type financieel instrument	Type transactie	Intern vs systeemoverschrijdend	Type instructie	Niet-levering effecten						Niet-levering gelden						
				Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		
				Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	
Geldmarktinstrumenten, niet zijnde overheidsschuld in de zin van artikel 4, lid 1, punt 61, van Richtlijn 2014/65/EU	Aankoop of verkoop financiële instrumenten	Intra-CSD	DVP													
			DWP													
			PFOD													
			FoP													
		Inter-CSD	DVP													
			DWP													
			PFOD													
			FoP													
Transacties i.v.m. zekerhedenbeheer	Intra-CSD	DVP														
		DWP														
		PFOD														
		FoP														
	Inter-CSD	DVP														
		DWP														
		PFOD														
		FoP														

Datum (voor elke rapportagedag in de maand)

Type financieel instrument	Type transactie	Intern vs systeemoverschrijdend	Type instructie	Niet-levering effecten						Niet-levering gelden					
				Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt	
				Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)
Uitlenen en lenen van effecten	Intra-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Inter-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
Retrocessietransacties	Intra-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Inter-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													

Datum (voor elke rapportagedag in de maand)

Type financieel instrument	Type transactie	Intern vs systeemoverschrijdend	Type instructie	Niet-levering effecten						Niet-levering gelden					
				Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt	
				Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)
	Andere transacties	Intra-CSD	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												
		Inter-CSD	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												
Emissierechten	Aankoop of verkoop financiële instrumenten	Intra-CSD	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												
		Inter-CSD	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												

Datum (voor elke rapportagedag in de maand)

Type financieel instrument	Type transactie	Intern vs systeemoverschrijdend	Type instructie	Niet-levering effecten						Niet-levering gelden					
				Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt	
				Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)
Transacties i.v.m. zekerhedenbeheer	Intra-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Inter-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
Uitlenen en lenen van effecten	Intra-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Inter-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													

Datum (voor elke rapportagedag in de maand)

Type financieel instrument	Type transactie	Intern vs systeemoverschrijdend	Type instructie	Niet-levering effecten						Niet-levering gelden						
				Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		
				Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	
	Retrocessietransacties	Intra-CSD	DVP													
			DWP													
			PFOD													
			FoP													
		Inter-CSD	DVP													
			DWP													
			PFOD													
			FoP													
	Andere transacties	Intra-CSD	DVP													
			DWP													
			PFOD													
			FoP													
		Inter-CSD	DVP													
			DWP													
			PFOD													
			FoP													

Datum (voor elke rapportagedag in de maand)

Type financieel instrument	Type transactie	Intern vs systeemoverschrijdend	Type instructie	Niet-levering effecten						Niet-levering gelden						
				Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		
				Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	
Overige financiële instrumenten	Aankoop of verkoop financiële instrumenten	Intra-CSD	DVP													
			DWP													
			PFOD													
			FoP													
		Inter-CSD	DVP													
			DWP													
			PFOD													
			FoP													
	Transacties i.v.m. zekerhedenbeheer	Intra-CSD	DVP													
			DWP													
			PFOD													
			FoP													
		Inter-CSD	DVP													
			DWP													
			PFOD													
			FoP													

Datum (voor elke rapportagedag in de maand)

Type financieel instrument	Type transactie	Intern vs systeemoverschrijdend	Type instructie	Niet-levering effecten						Niet-levering gelden					
				Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt	
				Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)
Uitlenen en lenen van effecten	Intra-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Inter-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
Retrocessietransacties	Intra-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Inter-CSD	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													

Datum (voor elke rapportagedag in de maand)																
Type financieel instrument	Type transactie	Intern vs systeemoverschrijdend	Type instructie	Niet-levering effecten						Niet-levering gelden						
				Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		Mislukte afwikkelingsoperaties		Totaal instructies		Percentage mislukt		
				Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	Volume	Waarde (EUR)	
	Andere transacties	Intra-CSD	DVP													
			DWP													
			PFOD													
			FoP													
		Inter-CSD	DVP													
			DWP													
			PFOD													
			FoP													

(¹) Omvat DVP- en RVP-afwikkelingsinstructies.

(²) Omvat DWP- en RWP-afwikkelingsinstructies.

(³) Omvat DPFOD- en CPFOD-afwikkelingsinstructies.

(⁴) Omvat DFP- en RFP-afwikkelingsinstructies.

BIJLAGE II

Informatie over mislukte afwikkelingsoperaties op jaarbasis door CSD's te rapporteren aan de bevoegde autoriteiten en relevante autoriteiten

Tabel 1

Nr.	Te rapporteren gegevens	Formaat
1.	Landcode voor de jurisdictie waar de CSD is gevestigd	ISO 3166 landcode (twee tekens)
2.	Door CSD geëxploiteerd effectenafwikkelingssysteem	Vrije tekst
3.	Tijdstempel rapportage (CSD aan bevoegde/relevante autoriteit)	Datum volgens ISO 8601 in formaat voor UTC-tijd JJJJ-MM-DDThh:mm:ssZ
4.	Rapportageperiode: begin- en einddatum rapportageperiode	Datum volgens ISO 8601 in formaat JJJJ-MM-DD-JJJJ-MM-DD
5.	Legal Entity Identifier CSD	Identificatiecode voor juridische entiteiten (LEI) volgens ISO 17442 (twintig alfanumerieke tekens)
6.	Handelsnaam CSD	Vrije tekst
7.	Naam persoon verantwoordelijk voor rapportage door CSD	Vrije tekst
8.	Functie persoon verantwoordelijk voor rapportage door CSD	Vrije tekst
9.	Telefoonnummer persoon verantwoordelijk voor rapportage door CSD	Gebruik alleen cijfers. Geef het telefoonnummer met de landcode en het netnummer. Gebruik geen speciale tekens.
10.	E-mailadres persoon verantwoordelijk voor rapportage door CSD	Gebruik voor e-mailadressen het standaard e-mailformaat.
11.	Maatregelen ter verbetering van de afwikkelingsefficiëntie	Vrije tekst
12.	Belangrijkste redenen voor het mislukken van afwikkelingsoperaties (jaaroverzicht redenen voor mislukking afwikkelingsoperaties opgenomen in de maandelijkse rapportage)	Vrije tekst
13.	Jaarvolume afwikkelingsinstructies	Maximaal twintig numerieke tekens, gerapporteerd als gehele getallen, zonder decimalen
14.	Jaarvolume mislukte afwikkelingsoperaties (door zowel gebrek aan effecten als gebrek aan gelden)	Maximaal twintig numerieke tekens, gerapporteerd als gehele getallen, zonder decimalen
15.	Jaarpercentage mislukte afwikkelingsoperaties op basis van volume (jaarlijks aantal mislukte afwikkelingsoperaties/jaarlijks aantal afwikkelingsinstructies) (door zowel gebrek aan effecten als gebrek aan gelden)	Percentage met maximaal twee decimalen
16.	Jaarwaarde (in EUR) afwikkelingsinstructies	Maximaal twintig numerieke tekens, inclusief decimalen. Vul ten minste één teken voor en één teken na het decimaalteken in. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld.

Nr.	Te rapporteren gegevens	Formaat
17.	Jaarwaarde (in EUR) mislukte ontwikkelingsoperaties (door zowel gebrek aan effecten als gebrek aan gelden)	Maximaal twintig numerieke tekens, inclusief decimalen. Vul ten minste één teken voor en één teken na het decimaalteken in. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld.
18.	Jaarpercentage mislukte ontwikkelingsoperaties op basis van waarde (jaarwaarde mislukte ontwikkelingsoperaties/jaarwaarde ontwikkelingsinstructies) (door zowel gebrek aan effecten als gebrek aan gelden)	Percentage met maximaal twee decimalen
19.	Komt in aanmerking voor vrijstelling op grond van artikel 12 van de gedelegeerde verordening inzake afwikkelingsdiscipline. Geef ook aan waarom.	JA/NEEN Vrije tekst

BIJLAGE III

Op jaarbasis openbaar te maken verslag over mislukte afwikkelingsoperaties

Tabel 1

Nr.	Bekend te maken nadere gegevens	Formaat
1.	Verslagperiode	Datum volgens ISO 8601 in formaat JJJJ-MM-DD-JJJJ-MM-DD
2.	Legal Entity Identifier CSD	Identificatiecode voor juridische entiteiten (LEI) volgens ISO 17442 (twintig alfanumerieke tekens)
3.	Door CSD geëxploiteerd effectenafwikkelingssysteem	Vrije tekst
4.	Aantal afwikkelingsinstructies tijdens de verslagperiode	Maximaal twintig numerieke tekens, gerapporteerd als gehele getallen, zonder decimalen
5.	Waarde (in EUR) afwikkelingsinstructies tijdens de verslagperiode	Maximaal twintig numerieke tekens, inclusief decimalen. Vul ten minste één teken voor en één teken na het decimaalteken in. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld.
Gegevens over niet-levering effecten		
6.	Aantal mislukte afwikkelingsoperaties door niet-levering effecten	Maximaal twintig numerieke tekens, gerapporteerd als gehele getallen, zonder decimalen
7.	Waarde (in EUR) mislukte afwikkelingsoperaties door niet-levering effecten	Maximaal twintig numerieke tekens, inclusief decimalen. Vul ten minste één teken voor en één teken na het decimaalteken in. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld.
8.	Percentage mislukte afwikkelingsoperaties op basis van volume afwikkelingsinstructies	Percentage met maximaal twee decimalen
9.	Percentage mislukte afwikkelingsoperaties op basis van waarde afwikkelingsinstructies	Percentage met maximaal twee decimalen
Gegevens over niet-levering gelden		
10.	Aantal mislukte afwikkelingsoperaties door niet-levering gelden	Maximaal twintig numerieke tekens, gerapporteerd als gehele getallen, zonder decimalen
11.	Waarde (in EUR) mislukte afwikkelingsoperaties door niet-levering gelden	Maximaal twintig numerieke tekens, inclusief decimalen. Vul ten minste één teken voor en één teken na het decimaalteken in. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld.
12.	Percentage mislukte afwikkelingsoperaties op basis van volume afwikkelingsinstructies	Percentage met maximaal twee decimalen
13.	Percentage mislukte afwikkelingsoperaties op basis van waarde (in EUR) afwikkelingsinstructies	Percentage met maximaal twee decimalen
Gegevens over mislukte afwikkelingsoperaties door zowel gebrek aan effecten als gebrek aan gelden		
14.	Totaal aantal mislukte afwikkelingsoperaties (door zowel gebrek aan effecten als gebrek aan gelden)	Maximaal twintig numerieke tekens, gerapporteerd als gehele getallen, zonder decimalen

Nr.	Bekend te maken nadere gegevens	Formaat
15.	Totale waarde (in EUR) mislukte afwikkelingsoperaties (door zowel gebrek aan effecten als gebrek aan gelden)	Maximaal twintig numerieke tekens, inclusief decimalen. Vul ten minste één teken voor en één teken na het decimaalteken in. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld.
16.	Percentage mislukte afwikkelingsoperaties op basis van volume afwikkelingsinstructies	Percentage met maximaal twee decimalen
17.	Percentage mislukte afwikkelingsoperaties op basis van waarde afwikkelingsinstructies	Maximaal vijf numerieke tekens, inclusief decimalen. Vul ten minste één teken voor en één teken na het decimaalteken in. Het decimaalteken wordt niet als numeriek teken geteld.
18.	Maatregelen ter verbetering van de afwikkelingsefficiëntie	Vrije tekst