

KOMISIJAS ĪSTENOŠANAS REGULA (ES) Nr. 484/2014**(2014. gada 12. maijs),****ar ko nosaka īstenošanas tehniskos standartus attiecībā uz centrālā darījumu partnera hipotētisko kapitālu saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 648/2012****(Dokuments attiecas uz EEZ)**

EIROPAS KOMISIJA,

ņemot vērā Līgumu par Eiropas Savienības darbību,

ņemot vērā Eiropas Parlamenta un Padomes 2012. gada 4. jūlija Regulu (ES) Nr. 648/2012 par ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, centrālajiem darījumu partneriem un darījumu reģistriem ⁽¹⁾ un jo īpaši tās 50.a panta 4. punkta trešo daļu un 50.c panta 3. punkta trešo daļu,

tā kā:

- (1) Saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 575/2013 ⁽²⁾ Savienībā izveidotas iestādes šobrīd katru ceturksni ziņo par savu atbilstību pašu kapitāla prasībām. Lai mazinātu neatbilstības starp iestādēm noteiktajiem atsauces datumiem un centrālajiem darījumu partneriem (CCP) noteiktajiem datumiem attiecībā uz hipotētiskā kapitāla aprēķinu un ar to saistītās informācijas paziņošanu, CCP noteiktajiem atsauces datumiem būtu vismaz jāaptver iestādēm jau noteiktie atsauces datumi. Tomēr līdz ar hipotētisko kapitālu saistītas informācijas biežāku ziņošanu būtu jāņem vērā arī tas, ka trešās valstīs izveidotiem tīrvērtes dalībniekiem var būt atšķirīgi atsauces datumi. Turklāt var pastāvēt plašas pašu kapitāla prasību variācijas, un, lai iegūtu jaunāko informāciju par šīm prasībām, tīrvērtes dalībnieki un to komptentās iestādes varētu vēlēties uzraudzīt šos riska darījumus biežāk, nekā reizi ceturksnī.
- (2) Parastos apstākļos CCP ziņošanas datumiem nevajadzētu būt vēlāk kā vienu nedēļu pēc aprēķinu datuma. Nedēļa ir pietiekams laiks, lai CCP veiktu visas iekšējās kontroles un pabeigtu nepieciešamo apstiprināšanas procedūru pirms prasīto datu ziņošanas. Ja CCP izstrādā pilnībā automatizētu sistēmu, tad ziņošanas datums var būtu tuvu aprēķinu datumam. Tomēr šobrīd CCP varētu nebūt spējīgi pabeigt visu procesu šajā laikā, un tāpēc, lai to paveiktu, tiem varētu būt jāizveido savas iekšējās procedūras un infrastruktūra. Ņemot vērā iepriekš minēto, būtu jāparedz pārejas noteikums, lai dotu CCP pietiekami daudz laika izveidot nepieciešamās iekšējās procedūras un infrastruktūru un vienlaikus uzsākt ar hipotētisko kapitālu saistītas informācijas paziņošanu viņu tīrvērtes dalībniekiem.
- (3) Saskaņā ar Regulu (ES) Nr. 648/2012 zaudējumus, kas izriet no tīrvērtes dalībnieka saistību neizpildes, pirmajā reizē segtu no sākotnējās maržas un paša dalībnieka iemaksām saistību neizpildes fondā. Ja ar to nepietiek, tad zaudējumus sedz no priekšfinansētajiem finanšu resursiem, kurus CCP ir paredzējuši savās attiecīgajās saistību neizpildes secības principa sistēmās, un no to dalībnieku iemaksām priekšfinansētajā saistību neizpildes fondā, kuri nav saistību nepildītāji. Šajā laikā ziņošanai vajadzētu būt biežākai, lai citiem tīrvērtes dalībniekiem, kuri nav saistību nepildītāji, un kompetentajām iestādēm būtu pieejama visa jaunākā ar hipotētisko kapitālu saistītā informācija, kas nepieciešama tīrvērtes dalībnieku pašu kapitāla prasību aprēķināšanai. CCP vajadzētu būt tehniskām spējām un izveidotām iekšējām procedūrām, lai šādās stresa situācijās aprēķinātu un paziņotu ar hipotētisko kapitālu saistīto informāciju.
- (4) Saskaņā ar Regulu (ES) Nr. 648/2012 CCP viena mēneša laikā jāpapildina savi priekšfinansētie finanšu resursi saistību neizpildes secības principa sistēmā. Šajā nolūkā aprēķinu veikšanas un ziņošanas biežumam šajās situācijās vajadzētu būt lielākam par normu. Ar hipotētisko kapitālu saistītas informācijas ziņošana katru dienu varētu nebūt tik lietderīga, jo zaudējumu, kas izriet no tīrvērtes dalībnieka saistību neizpildes, kopējā apjoma noteikšana

⁽¹⁾ OV L 201, 27.7.2012., 1. lpp.⁽²⁾ Eiropas Parlamenta un Padomes 2013. gada 26. jūnija Regula (ES) Nr. 575/2013 par prudenciālajām prasībām attiecībā uz kredītiestādēm un ieguldījumu brokeru sabiedrībām, un ar ko groza Regulu (ES) Nr. 648/2012 (OV L 176, 27.6.2013., 1. lpp.).

varētu aizņemt laiku. Ievērojot to, ka kompetentajām iestādēm var nākties saskarties ar dažādiem plaša spektra scenārijiem, tām vajadzētu būt iespējai pieprasīt lielāku biežumu stresa periodos, pamatojoties uz situācijas izvērtējumu, kurā būtu jāņem vērā to priekšfinansēto finanšu resursu faktiskā un paredzamā izsmelšana, kas pieejami CCP (attiecas gan uz CCP, gan uz tūrvērtes dalībnieku nodrošinātajiem finanšu resursiem). Šāds lielāks ziņošanas biežums būtu jāpiemēro, kamēr minētos resursus atjauno līmenī, kāds nepieciešams saskaņā ar attiecīgajiem tiesību aktiem.

- (5) Bieža ziņošana stresa periodos var būt ļoti sarežģīta, ņemot vērā nesen ieviesto ziņošanas prasību. Vismaz dažiem CCP tas var radīt problēmas saistībā ar tehnisko īstenošanu. To novēršanai ir lietderīgi noteikt vēlāku piemērošanas datumu attiecībā uz biežākas ziņošanas prasībām. Tas ļaus CCP uzlabot savas iekšējās procedūras un atjaunināt savas sistēmas.
- (6) Šīs regulas noteikumi ir cieši saistīti, jo tie attiecas uz CCP hipotētiskā kapitāla aprēķināšanu un ziņošanu par to. Lai nodrošinātu saskaņotību starp šiem noteikumiem, kuriem būtu jāstājas spēkā vienlaicīgi, un sekmētu to, ka personām, uz kurām attiecas šie pienākumi, ir iespējams to visaptverošs pārskats un viegla piekļuve tiem, ir vēlams visus Regulas (ES) Nr. 648/2012 paredzētos attiecīgos īstenošanas tehniskos standartus iekļaut vienā regulā.
- (7) Šīs regulas pamatā ir īstenošanas tehnisko standartu projekts, ko Eiropas Komisijai iesniedzi Eiropas Banku iestāde.
- (8) Eiropas Banku iestāde ir veikusi atklātu sabiedrisko apspriešanu par īstenošanas tehnisko standartu projektu, kas ir šīs regulas pamatā, izvērtējusi potenciālās saistītās izmaksas un ieguvumus un pieprasījusi saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 1093/2010 37. pantu ⁽¹⁾ izveidotās Banku nozares ieinteresēto personu grupas atzinumu,

IR PIENĒMUSI ŠO REGULU.

1. pants

Regulas (ES) Nr. 648/2012 50.a panta 3. punktā paredzētā aprēķina biežums un datumi

1. Regulas (ES) Nr. 648/2012 50.a panta 3. punktā minētā aprēķina biežums ir reizi mēnesī, izņemot gadījumā, ja īsteno šīs regulas 3. panta 1. punktā paredzēto rīcības brīvību, kad šī aprēķina biežums ir reizi nedēļā vai katru dienu.
2. Ja 1. punktā minētā aprēķina biežums ir reizi mēnesī, tad CCP piemēro šādus noteikumus:
 - a) atsaucē datumi minētajam aprēķinam ir šādi:

31. janvāris, 28. februāris (vai 29. februāris garajā gadā), 31. marts, 30. aprīlis, 31. maijs, 30. jūnijs, 31. jūlijs, 31. augusts, 30. septembris, 31. oktobris, 30. novembris, 31. decembris;
 - b) datums, kurā CCP veic minēto aprēķinu (aprēķina datums), attiecīgi ir:

1. februāris, 1. marts, 1. aprīlis, 1. maijs, 1. jūnijs, 1. jūlijs, 1. augusts, 1. septembris, 1. oktobris, 1. novembris, 1. decembris, 1. janvāris.
3. Ja 1. punktā minētais aprēķina biežums ir reizi nedēļā vai katru dienu, pirmais aprēķina datums ir nākamā diena pēc tās dienas, kurā kompetentā iestāde iesniedz pieprasījumu. Pirmais atsaucē datums ir diena, kurā kompetentā iestāde iesniedz pieprasījumu. Nākamajiem aprēķiniem atsaucē datums ir diena pirms aprēķina datuma. Ja aprēķinu veic reizi nedēļā, tad laiks starp aprēķina datumiem ir piecas darba dienas.

⁽¹⁾ Eiropas Parlamenta un Padomes 2010. gada 24. novembra Regula (ES) Nr. 1093/2010, ar ko izveido Eiropas Uzraudzības iestādi (Eiropas Banku iestādi), groza Lēmumu Nr. 716/2009/EK un atceļ Komisijas Lēmumu 2009/78/EK (OV L 331, 15.12.2010., 12. lpp.).

4. Ja aprēķina datums ir svētku brīvdiena, sestdiena vai svētdiena, tad aprēķinu veic nākamajā darba dienā.

2. pants

Regulas (ES) Nr. 648/2012 50.c panta 2. punktā un 89. panta 5.a punktā paredzētās ziņošanas biežums, datumi un vienotā forma

1. Regulas (ES) Nr. 648/2012 50.c panta 2. punktā un attiecīgā gadījumā 89. panta 5.a punkta trešajā daļā paredzētās ziņošanas biežums ir reizi mēnesī, izņemot gadījumā, ja īsteno šīs regulas 3. panta 1. punktā paredzēto rīcības brīvību, kad šīs ziņošanas biežums ir reizi nedēļā vai katru dienu.
2. Ja ziņošanas biežums saskaņā ar 1. punktu ir reizi mēnesī, tad ziņošanas datums ir piektajā darba dienā pēc 1. pantā minētā aprēķina datuma vai agrāk, ja iespējams.
3. Ja 1. punktā minētās ziņošanas biežums ir katru dienu vai reizi nedēļā, tad atsauces datums ir nākamā diena pēc aprēķina datuma.
4. Ja ziņošanas datums ir svētku brīvdiena, sestdiena vai svētdiena, tad ziņošanas datums ir nākamā darba diena.
5. CCP ziņo 1. punktā minēto informāciju, izmantojot I pielikumā iekļauto veidni (Ar hipotētisko kapitālu saistītā informācija), kuru aizpilda atbilstoši II pielikumā iekļautajām norādēm (Norādes ar hipotētisko kapitālu saistītās informācijas ziņošanai).

3. pants

Nosacījumi biežākai aprēķinu veikšanai un ziņošanai saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 50.a panta 3. punktu un 50.c panta 2. punktu

1. Tādas iestādes kompetentās iestādes, kura veic tīrvērtes dalībnieka funkcijas, var prasīt jebkuram CCP, kurā minētā iestāde veic tīrvērtes dalībnieka funkcijas, veikt 1. panta 1. punktā minēto aprēķinu un 2. panta 1. punktā minēto ziņošanu vai nu katru dienu vai reizi nedēļā kādā no šādiem gadījumiem:
 - a) ja CCP – pēc tīrvērtes dalībnieka saistību neizpildes – ir pienākums izmantot jebkuru daļu no priekšfinansētajiem finanšu resursiem, ko tas paredzējis saistību neizpildes secības principa sistēmā saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 43. pantu;
 - b) ja CCP – pēc tīrvērtes dalībnieka saistību neizpildes – ir pienākums izmantot tīrvērtes dalībnieku, kuri nav saistību nepildītāji, iemaksas saistību neizpildes fondā saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 42. pantu.
2. Kompetentās iestādes izvēlas, vai aprēķins un ziņošana veicama katru dienu vai reizi nedēļā, kā noteikts 1. punktā, ievērojot priekšfinansēto finanšu resursu faktisko un paredzamo izsmelšanu.
3. Ja kompetentajām iestādēm ir vajadzīgs, lai CCP biežāk veiktu aprēķinu un ziņošanu saskaņā ar 1. punkta a) apakšpunktu, tad šādu lielāku biežumu piemēro, kamēr priekšfinansētie finanšu resursi, ko saistību neizpildes secības principa sistēmā paredzējuši CCP, ir atjaunoti līmenī, kāds noteikts Komisijas Deleģētās regulas (ES) Nr. 153/2013 35. pantā ⁽¹⁾.
4. Ja kompetentajām iestādēm ir vajadzīgs, lai CCP biežāk veiktu aprēķinu un ziņošanu saskaņā ar 1. punkta b) apakšpunktu, tad šādu lielāku biežumu piemēro, kamēr CCP dalībnieku, kuri nav saistību nepildītāji, iemaksas saistību neizpildes fondā ir atjaunotas līmenī, kāds noteikts Regulas (ES) Nr. 648/2012 42. pantā.

⁽¹⁾ Komisijas 2012. gada 19. decembra Deleģētā regula (ES) Nr. 153/2013, ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 648/2012 attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par prasībām centrālajiem darījumu partneriem (OV L 52, 23.2.2013., 41. lpp.).

*4. pants***Pārejas noteikums**

Atkāpjoties no 2. panta 2. punkta, laikā no šīs regulas piemērošanas datuma līdz 2014. gada 31. decembrim CCP ziņo minētajā punktā norādīto informāciju vēlākais piecpadsmit darba dienās pēc atsauces datuma vai agrāk, ja iespējams.

*5. pants***Stāšanās spēkā un piemērošanas diena**

Šī regula stājas spēkā divdesmitajā dienā pēc tās publicēšanas *Eiropas Savienības Oficiālajā Vēstnesī*.

To piemēro no 2014. gada 2. jūnija, izņemot 1. panta 3. punktu, 2. panta 3. punktu un 3. pantu, ko piemēro no 2015. gada 1. janvāra.

Šī regula uzliek saistības kopumā un ir tieši piemērojama visās dalībvalstīs.

Briselē, 2014. gada 12. maijā

Komisijas vārdā –
priekšsēdētājs
José Manuel BARROSO

I PIELIKUMS

Ar hipotētisko kapitālu saistītā informācija

ID	Postenis	Atsauces uz tiesību aktiem	Summa
10	Centrālais darījumu partneris	—	
20	Saistību neizpildes fonda identifikators	Regulas (ES) Nr. 648/2012 50.c panta 1. punkts	
30	Aprēķina datums	Komisijas Īstenošanas regulas (ES) Nr. 484/2014 1. panta 2. punkts	
40	Hipotētiskais kapitāls (K_{CCP})	Regulas (ES) Nr. 648/2012 50.c panta 1. punkta a) apakšpunkts	
50	Priekšfinansēto iemaksu summa (DF_{CM})	Regulas (ES) Nr. 648/2012 50.c panta 1. punkta b) apakšpunkts	
60	Priekšfinansēto finanšu resursu summa, kas centrālajam darījuma partnerim jāizlieto pirms pārējo tīrvērtes dalībnieku saistību neizpildes fonda iemaksu izmantošanas (DF_{CCP})	Regulas (ES) Nr. 648/2012 50.c panta 1. punkta c) apakšpunkts	
70	Kopējais tīrvērtes dalībnieku skaits (N)	Regulas (ES) Nr. 648/2012 50.c panta 1. punkta d) apakšpunkts	
80	Koncentrācijas faktors (β)	Regulas (ES) Nr. 648/2012 50.c panta 1. punkta e) apakšpunkts	
90	Sākotnējās maržas kopējā summa	Regulas (ES) Nr. 648/2012 89. panta 5.a punkta trešā daļa	

II PIELIKUMS

NORĀDES AR HIPOTĒTISKO KAPITĀLU SAISTĪTĀS INFORMĀCIJAS ZIŅOŠANAI

1. Šajā pielikumā ietvertas papildu norādes I pielikumā minētās tabulas aizpildīšanai

VISPĀRĒJĀS NORĀDES

2. Biežums
- 2.1. Ziņošanu, izmantojot veidni, veic tik bieži, kā noteikts šīs regulas 1. pantā.
3. Nosūtīšanas datumi
- 3.1. Nosūtīšanas datumi ir norādīti 2. pantā

NORĀDES SAISTĪBĀ AR VEIDNI

4. Zīmju konvencija
- 4.1. Visas summas norāda kā pozitīvus skaitļus
- 4.2. Aizpildot veidnes, ņem vērā šādus formātus un atsauces uz tiesību aktiem

Veidnes ID	Norādes	
10	Centrālā darījumu partnera (CCP) nosaukums	
	Formāts	Teksts, jebkāds zīmju skaits
20	Saistību neizpildes fonda identifikators	
	Atsauces uz tiesību aktiem	Regulas (ES) Nr. 648/2012 50.c panta 1. punkts
	Norāde	Atbilstīgi 50.c panta 1. punktam, ja CCP ir vairāk nekā viens saistību neizpildes fonds, tad tas paziņo minētā panta pirmajā punktā norādīto informāciju attiecībā uz katru saistību neizpildes fondu atsevišķi
	Formāts	Teksts, jebkāds zīmju skaits
	Aprēķins	Nav
30	Aprēķina datums	
	Atsauces uz tiesību aktiem	Šīs regulas 1. panta 2. punkts
	Piezīme	Aprēķina datums saskaņā ar šīs regulas 1. panta 2. punktu atkarībā no vajadzīgā biežuma
	Formāts	GGGG-MM-DD Četrpārpu gads, defise, divpārpu mēnesis, defise, divpārpu diena
	Aprēķins	Nav
40	Hipotētiskais kapitāls (K_{CCP})	
	Atsauces uz tiesību aktiem	Regulas (ES) Nr. 648/2012 50.c panta 1. punkta a) apakšpunkts
	Norādes	Pārskata valūtu identificē, izmantojot ISO 4217 valūtas kodu, kam seko atstarpe un summa. Skaitļus var noapaļot ar noapaļošanas kļūdu, kas ir mazāka par 1 %
	Formāts	Summa ar ISO-kodu
	Aprēķins	Hipotētisko kapitālu aprēķina atbilstīgi Regulas (ES) Nr. 648/2012 50.a panta 2. punktam.

Veidnes ID	Norādes	
50	Priekšfinansēto iemaksu summa (DF_{CM})	
	Atsauces uz tiesību aktiem	Regulas (ES) Nr. 648/2012 50.c panta 1. punkta b) apakšpunkts.
	Aprēķins	Priekšfinansētās iemaksas aprēķina kā tīrvērtes dalībnieku priekšfinansēto iemaksu summu, kā noteikts Regulas (ES) Nr. 575/2013 308. panta 2. punktā.
	Norādes	Pārskata valūtu identificē, izmantojot ISO 4217 valūtas kodu, kam seko atstarpe un summa. Skaitļus var noapaļot ar noapaļošanas kļūdu, kas ir mazāka par 1 %.
	Formāts	Summa ar ISO-kodu
60	Priekšfinansēto finanšu resursu summa, kas centrālajam darījumam partnerim jāizlieto pirms pārējo tīrvērtes dalībnieku saistību neizpildes fonda iemaksu izmantošanas (DF_{CCP})	
	Atsauces uz tiesību aktiem	Regulas (ES) Nr. 648/2012 50.c panta 1. punkta c) apakšpunkts
	Aprēķins	Visu CCP tīrvērtes dalībnieku priekšfinansēto iemaksu summu aprēķina atbilstīgi Regulas (ES) Nr. 575/2013 308. panta 3. punkta c) apakšpunktam.
	Norādes	Pārskata valūtu identificē, izmantojot ISO 4217 valūtas kodu, kam seko atstarpe un summa. Skaitļus var noapaļot ar noapaļošanas kļūdu, kas ir mazāka par 1 %.
	Formāts	Summa ar ISO-kodu
70	Kopējais tīrvērtes dalībnieku skaits (N)	
	Atsauces uz tiesību aktiem	Regulas (ES) Nr. 648/2012 50.c panta 1. punkta d) apakšpunkts
	Aprēķins	CCP tīrvērtes dalībnieku skaits
	Formāts	Vesels skaits
80	Koncentrācijas faktors (β)	
	Atsauces uz tiesību aktiem	Regulas (ES) Nr. 648/2012 50.c panta 1. punkta e) apakšpunkts
	Aprēķins	Koncentrācijas faktoru aprēķina atbilstīgi Regulas (ES) Nr. 648/2012 50.d panta c. punktam.
	Norādes	Pārskata valūtu identificē, izmantojot ISO 4217 valūtas kodu, kam seko atstarpe un summa. Skaitļus var noapaļot ar noapaļošanas kļūdu, kas ir mazāka par 1 %.
	Formāts	Summa ar ISO-kodu

Veidnes ID	Norādes	
90	Sākotnējās maržas kopējā summa	
	Atsauces uz tiesību aktiem	Regulas (ES) Nr. 648/2012 89. panta 5.a punkta trešā daļa
	Aprēķins	Kopējo sākotnējo maržu, ko CCP saņēmis no saviem tīrvērtes dalībniekiem, aprēķina atbilstīgi Deleģētās regulas (ES) Nr. 153/2013 24. līdz 27. pantam.
	Norādes	Šo informāciju ziņo tikai vajadzības gadījumā. Pārskata valūtu identificē, izmantojot ISO 4217 valūtas kodu, kam seko atstarpe un summa. Skaitļus var noapaļot ar noapaļošanas kļūdu, kas ir mazāka par 1 %.
	Formāts	Summa ar ISO kodu