

KOMMISSIONENS DELEGEREDE FORORDNING (EU) Nr. 876/2013

af 28. maj 2013

om supplerende regler til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 648/2012 for så vidt angår reguleringsmæssige tekniske standarder for kollegier for centrale modparter

(EØS-relevant tekst)

EUROPA-KOMMISSIONEN HAR —

under henvisning til traktaten om Den Europæiske Unions funktionsmåde,

under henvisning til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 648/2012 af 4. juli 2012 om OTC-derivater, centrale modparter og transaktionsregistre ⁽¹⁾, særlig artikel 18, stk. 6, og

ud fra følgende betragtninger:

- (1) For at sikre, at kollegierne fungerer på en ensartet og sammenhængende måde i hele Unionen, er det nødvendigt at fastlægge ordninger for deltagelse i kollegier for CCP'er for at lette udøvelsen af de opgaver, der er fastlagt i forordning (EU) nr. 648/2012.
- (2) Udelukkelsen af en centralbank, der udsteder en for de i CCP'en clearede finansielle instrumenter relevant EU-valuta, har ingen indflydelse på en sådan udstedende banks ret til at anmode om og modtage oplysninger i overensstemmelse med artikel 18, stk. 3, og artikel 84 i forordning (EU) nr. 648/2012.
- (3) En CCP's aktiviteter kan være relevante for en bestemt udstedende centralbank på grund af den volumen, som cleares i den valuta, der er udstedt af denne centralbank. En valutas relevans for en udstedende centralbanks deltagelse i CCP'ens kollegium bør dog bestemmes af den pågældende valutas andel af CCP'ens gennemsnitlige åbne clearede positioner for at sikre, at kollegiet har en rimelig størrelse.
- (4) For at sikre, at der opnås et effektivt resultat på kollegiets møder, bør formålene med alle kollegiets møder eller aktiviteter klart defineres af CCP'en kompetente myndighed i samråd med kollegiets medlemmer. Disse formål bør i god tid rundsendes til deltagerne sammen med den dokumentation, som CCP'ens kompetente myndighed eller andre medlemmer af kollegiet har udarbejdet, således at der skabes en effektiv debat.
- (5) Kollegierne har til formål at fremme udøvelsen af de opgaver, der er fastlagt i forordning (EU) nr. 648/2012,

og såvel de opgaver, kollegiemedlemmerne pålægges, som kollegiernes sammensætning, oprettelse og forvaltning, har lovgiveren i forordningen defineret som retlige forpligtelser, som derfor er bindende og gælder umiddelbart i hver medlemsstat. For at et kollegium kan fungere i praksis, bør medlemmerne af det pågældende kollegium vedtage en skriftlig aftale. For at sikre, at alle CCP-kollegier anvender skriftlige standardaftaler, hvori bedste praksis vedrørende kollegiernes virksomhed er indarbejdet, og at de kompetente myndigheder anvender ensartede procedurer, samt for at fremme en hurtig oprettelse af CCP-kollegier inden for de frister, der er fastsat ved artikel 18, stk. 1, i forordning (EU) nr. 648/2012, bør ESMA udstede retningslinjer og anbefalinger i overensstemmelse med proceduren i artikel 16 i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 1095/2010 af 24. november 2010 om oprettelse af en europæisk tilsynsmyndighed (Den Europæiske Værdipapir- og Markedstilsynsmyndighed) ⁽²⁾.

- (6) Der er intet i denne retsakt, der tilsidesætter Kommissionens beføjelse til at indlede traktatbrudsprocedure i overensstemmelse med artikel 258 i TEUF eller indbringe klager i henhold til artikel 265 og artikel 271, litra d), i TEUF.
- (7) For at sikre rettidig og opdateret udveksling af oplysninger mellem kollegiemedlemmerne bør kollegiet mødes regelmæssigt og give medlemmerne mulighed for at diskutere og komme med bidrag til den kompetente myndigheds revision af de ordninger, strategier, procedurer og mekanismer, som CCP'en har gennemført for at overholde bestemmelserne i forordning (EU) nr. 648/2012, samt drøfte den kompetente myndigheds evaluering af de risici, som CCP'en bliver eller kan blive udsat for, og som den selv kan udgøre.
- (8) For at sikre, at der tages behørigt hensyn til kollegiemedlemmernes synspunkter, bør den kompetente myndighed gøre sit yderste for at sikre, at enhver tvist mellem myndigheder, som skal være medlemmer af et kollegium, bilægges, før den skriftlige aftale om kollegiets oprettelse og drift færdiggøres. ESMA bør fremme færdiggørelsen af aftalen qua sin mæglerrolle, hvis det er relevant.
- (9) Denne forordning er baseret på det udkast til reguleringsmæssige tekniske standarder, som Den Europæiske Værdipapir- og Markedstilsynsmyndighed (ESMA) har fremsendt til Kommissionen.

⁽¹⁾ EUT L 201 af 27.7.2012, s. 1.

⁽²⁾ EUT L 331 af 15.12.2010, s. 84.

- (10) Hvor det er relevant, har ESMA hørt Den Europæiske Banktilsynsmyndighed (EBA), Det Europæiske Udvalg for Systemiske Risici og medlemmerne af det Europæiske System af Centralbanker (ESCB) før forelæggelsen af dette udkast til reguleringsmæssige tekniske standarder, som denne forordning er baseret på. I overensstemmelse med artikel 10 i forordning (EU) nr. 1095/2010 har ESMA afholdt åbne offentlige høringer om udkastet til reguleringsmæssige tekniske standarder, analyseret de potentielle omkostninger og fordele samt indhentet en udtalelse fra interessentgruppen for værdipapirer og markeder, der er nedsat i henhold til artikel 37 i forordning (EU) nr. 1095/2010 —

VEDTAGET DENNE FORORDNING:

Artikel 1

Bestemmelse af de mest relevante valutaer

1. De mest relevante EU-valutaer fastlægges på grundlag af hver valutas relative andel i CCP'ens gennemsnitlige åbne slutpositioner ved dagens afslutning for så vidt angår alle finansielle instrumenter, der er clearet af CCP'en, beregnet over en etårig periode.
2. De mest relevante EU-valutaer er de tre valutaer med den højeste relative andel beregnet i overensstemmelse med stk. 1, forudsat at hver enkelt andel er på over 10 %.
3. Beregningen af den relative andel af valutaerne foretages på årsbasis.

Artikel 2

Kollegiers operationelle organisation

1. Efter at CCP'ens kompetente myndighed har vurderet, om en ansøgning er fuldstændig, jf. artikel 17, stk. 3, i forordning (EU) nr. 648/2012, videresender den et forslag til en skriftlig aftale i henhold til artikel 18, stk. 5, i forordning (EU) nr. 648/2012 til de kollegiemedlemmer, der er fastsat i artikel 18, stk. 2, i forordning (EU) nr. 648/2012. Denne skriftlige aftale skal omfatte en procedure for årlige revisioner. Den skal også omfatte en ændringsprocedure, hvorefter CCP'ens kompetente myndighed eller andre medlemmer af kollegiet når som helst kan tage initiativ til ændringer med forbehold af kollegiets godkendelse i overensstemmelse med proceduren i denne artikel.
2. Hvis kollegiemedlemmerne, jf. stk. 1, ikke fremsætter nogen bemærkninger inden 10 kalenderdage, tager CCP'ens kompetente myndighed skridt til kollegiets vedtagelse af den skriftlige aftale og til oprettelse af kollegiet i overensstemmelse med artikel 18, stk. 1, i forordning (EU) nr. 648/2012.
3. Hvis kollegiemedlemmerne fremsætter bemærkninger vedrørende forslaget til den i henhold til stk. 1 videresendte skriftlige aftale, forelægger de disse bemærkninger sammen med en fylldig begrundelse for CCP'ens kompetente myndighed inden 10 kalenderdage. Hvis det er relevant, udarbejder CCP'ens

kompetente myndighed et revideret forslag og indkalder til et møde med henblik på at nå til enighed om den endelige skriftlige aftale under hensyntagen til den frist, der er fastsat i artikel 18, stk. 1, i forordning (EU) nr. 648/2012.

4. Kollegiet anses for oprettet, når den skriftlige aftale er vedtaget.

5. Alle kollegiemedlemmerne vil blive bundet af den skriftlige aftale, der er vedtaget i overensstemmelse med stk. 1, 2 og 3.

Artikel 3

Deltagelse i kollegierne

1. Hvis en kompetent myndighed i en medlemsstat, der ikke er medlem af kollegiet, i overensstemmelse med artikel 18, stk. 3, i forordning (EU) nr. 648/2012 anmoder kollegiet om oplysninger, træffer CCP'ens kompetente myndighed, efter at have hørt kollegiet, beslutning om den mest hensigtsmæssige måde at give og indhente oplysninger til og fra myndigheder, der ikke er medlemmer af kollegiet.
2. Hvert medlem af kollegiet udpeger én deltager, der deltager i kollegiets møder, og eventuelt én suppleant, med undtagelse af CCP'ens kompetente myndighed, som kan kræve yderligere deltagere, som ikke har stemmeret.
3. Hvis den udstedende centralbank for en af de mest relevante EU-valutaer er mere end én centralbank, udpeger de pågældende centralbanker én enkelt repræsentant, der deltager i kollegiet.
4. Hvis en myndighed har ret til at deltage i kollegiet i henhold til mere end et af litraerne c)-h) i artikel 18, stk. 2, i forordning (EU) nr. 648/2012, kan den udpege yderligere deltagere, som ikke har stemmeret.
5. Hvis der i overensstemmelse med denne artikel er mere end én deltager fra et kollegiemedlem, eller hvis der er flere kollegiemedlemmer fra samme medlemsstat end antallet af stemmer, som disse kollegiemedlemmer råder over i overensstemmelse med artikel 19, stk. 3, i forordning (EU) nr. 648/2012, underretter det pågældende kollegiemedlem eller de pågældende kollegiemedlemmer kollegiet om, hvilke deltagere der er stemmeberettigede.

Artikel 4

Kollegiernes forvaltning

1. CCP'ens kompetente myndighed sikrer, at kollegiets arbejde letter de opgaver, der skal udføres i henhold til forordning (EU) nr. 648/2012.
2. Kollegiet underretter ESMA om alle opgaver, som kollegiet udfører i henhold til stk. 1. ESMA skal have en koordinerende rolle med hensyn til overvågning af de opgaver, som et kollegium udfører, og skal sikre, at dets målsætninger så vidt muligt er i overensstemmelse med andre kollegiers målsætninger.

3. CCP'ens kompetente myndighed skal mindst sikre, at:
- formålene med alle kollegiets møder eller aktiviteter er klart defineret
 - kollegiets møder eller aktiviteter er effektive, samtidig med at det sikres, at alle kollegiemedlemmerne er fuldt ud informeret om de kollegieaktiviteter, der er relevante for dem
 - tidsplanen for kollegiets møder eller aktiviteter er fastlagt, således at resultaterne heraf understøtter tilsynet med CCP'en
 - CCP'en og andre centrale aktører har en klar forståelse af kollegiets rolle og drift
 - kollegiets aktiviteter regelmæssigt revideres, og at der træffes afhjælpende foranstaltninger, hvis kollegiet ikke fungerer effektivt
 - der er fastsat en dagsorden for et årligt krisestyringsplanlægningsmøde for kollegiemedlemmerne om nødvendigt i samarbejde med CCP'en.

4. For at sikre kollegiets effektivitet fungerer CCP'ens kompetente myndighed som centralt kontaktpunkt for alle spørgsmål i forbindelse med kollegiets praktiske organisation. CCP'ens kompetente myndighed udfører som minimum følgende opgaver:

- udarbejdelse, opdatering og videresendelse af en kontaktlister over kollegiemedlemmerne
- videresendelse af dagsordenen samt dokumentationen for kollegiets møder eller aktiviteter
- udarbejdelse af referat af møderne og formalisering af indsatspunkter
- forvaltning af kollegiets websted eller eventuel anden elektronisk mekanisme for udveksling af oplysninger
- hvis det er praktisk muligt, tilvejebringelse af oplysninger og specialteam, der skal hjælpe kollegiet med dets opgaver
- passende formidling af oplysninger blandt kollegiets medlemmer.

5. CCP'en kompetente myndighed afgør, hvor ofte kollegiet skal mødes, idet der tages hensyn til CCP'ens størrelse, art, omfang og kompleksitet, CCP'ens systemiske konsekvenser for forskellige jurisdiktioner og valutaer, de mulige virkninger af CCP'ens aktiviteter, eksterne omstændigheder og eventuelle

anmodninger fra kollegiets medlemmer. Kollegiet skal mødes mindst en gang om året, og hvis CCP'ens kompetente myndighed anser det for nødvendigt, skal der afholdes et møde, hver gang der skal træffes en afgørelse i henhold til forordning (EU) nr. 648/2012. CCP'ens kompetente myndighed tilrettelægger regelmæssigt møder mellem kollegiets medlemmer og CCP'ens øverste ledelse.

6. I den skriftlige aftale, der er omhandlet i artikel 2, fastsættes, at to tredjedele af de stemmeberettigede medlemmer skal være til stede på kollegiets møder, for at kollegiet er beslutningsdygtigt.

7. CCP'ens kompetente myndighed bestræber sig på at sikre, at kollegiet er beslutningsdygtigt på alle møder. Hvis dette ikke er tilfældet, sikrer formanden, at alle beslutninger, der skal træffes, udskydes, indtil det fornødne antal medlemmer er til stede, idet der tages hensyn til de relevante frister, der er fastsat i forordning (EU) nr. 648/2012.

Artikel 5

Udveksling af oplysninger mellem myndigheder

1. Hvert kollegiemedlem forelægger rettidigt alle oplysninger, der er nødvendige for kollegiets operationelle drift og for udførelsen af de nøgleaktiviteter, som medlemmet deltager i, for CCP'ens kompetente myndighed. CCP'ens kompetente myndighed forelægger rettidigt lignende oplysninger for kollegiemedlemmerne.

2. CCP'ens kompetente myndighed skal mindst forelægge følgende oplysninger for kollegiet:

- væsentlige ændringer af CCP-gruppens struktur og ejerskab
- væsentlige ændringer i CCP'ens kapitalniveau
- ændringer i organisationen, den øverste ledelse, processer eller ordninger, hvis disse ændringer har væsentlig indvirkning på forvaltningen eller risikostyringen
- en liste over CCP'ens clearingmedlemmer
- nærmere oplysninger om de myndigheder, der er inddraget i tilsynet med CCP'en, herunder ændringer i deres ansvarsområder
- oplysninger om væsentlige trusler mod CCP'ens evne til at overholde forordning (EU) nr. 648/2012 og relevante delegerede forordninger og gennemførelsesforordninger

- g) vanskeligheder, der har potentielt betydelige afsmittende virkninger
- h) faktorer, der indikerer en potentielt høj risiko for afsmitning
- i) væsentlig udvikling i CCP'ens finansielle situation
- j) tidlig varsling af mulige likviditetsproblemer eller alvorlige tilfælde af svig
- k) tilfælde af misligholdelse hos et medlem og alle opfølgende aktioner
- l) sanktioner og ekstraordinære tilsynsforanstaltninger
- m) rapporter om resultatmæssige problemer eller indtrufne hændelser og de afhjælpende foranstaltninger, der er truffet
- n) regelmæssige data om CCP'ens aktiviteter, hvis omfang og hyppighed fastlægges som led i den i artikel 2 beskrevne skriftlige aftale
- o) oversigt over vigtige kommercielle forslag, herunder nye produkter eller tjenester, der skal tilbydes
- p) ændringer i CCP'ens risikomodel, stresstestning og backtestning
- q) ændringer i CCP'ens interoperabilitetsordninger, hvis det er relevant.

3. Udvekslingen af oplysninger mellem kollegiemedlemmerne skal afspejle deres ansvarsområder og informationsbehov. For at undgå unødvendige informationsstrømme skal udvekslingen af oplysninger være forholdsmæssig og risikofokuseret.

4. Kollegiemedlemmerne overvejer, hvilke kommunikationsmåder der er mest effektive til at sikre kontinuerlig, rettidig og forholdsmæssig udveksling af oplysninger.

5. Risikovurderingsrapporten, der skal udarbejdes af CCP'ens kompetente myndighed i overensstemmelse med artikel 19, stk. 1, i forordning (EU) nr. 648/2012, forelægges for kollegiet inden for en passende tidsfrist for at sikre, at kollegiemedlemmerne kan gennemgå den og om nødvendigt bidrage til den.

Artikel 6

Frivillig fordeling og delegation af opgaver

1. Kollegiemedlemmerne skal nå til enighed om detaljerede vilkår for specifikke delegeringsaftaler og aftaler om frivillig overdragelse af opgaver til andre medlemmer, navnlig i de tilfælde, hvor delegationer fører til, at et medlems vigtigste tilsynsopgaver delegeres.

2. Parterne, der indgår specifikke delegeringsaftaler og aftaler om frivillig overdragelse af opgaver, skal nå til enighed om detaljerede vilkår, som mindst dækker følgende aspekter:

- a) hvilke specifikke aktiviteter på klart fastlagte områder der vil blive overdraget eller delegeret
- b) hvilke procedurer og processer der skal anvendes
- c) de enkelte parter roller og ansvarsområder
- d) hvilken type oplysninger der skal udveksles mellem parterne.

3. Fordelingen og delegationen af opgaver indebærer ikke en ændring i fordelingen af CCP'ens kompetente myndigheds beslutningsbeføjelser.

Artikel 7

Ikrafttræden

Denne forordning træder i kraft på tyvendedagen efter offentliggørelsen i *Den Europæiske Unions Tidende*.

Denne forordning er bindende i alle enkeltheder og gælder umiddelbart i hver medlemsstat.

Udfærdiget i Bruxelles, den 28. maj 2013.

På Kommissionens vegne

José Manuel BARROSO

Formand