

KOMISIJAS DELEĢĒTĀ REGULA (ES) 2023/451**(2022. gada 25. novembris),****ar ko precizē kritērijus, kas kompetentajai iestādei un uzraudzības kolēģijai jāņem vērā, novērtējot centrālo darījumu partneru atveseļošanas plānu****(Dokuments attiecas uz EEZ)**

EIROPAS KOMISIJA,

ņemot vērā Līgumu par Eiropas Savienības darbību,

ņemot vērā Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) 2021/23 (2020. gada 16. decembris) par centrālo darījumu partneru atveseļošanas un noregulējuma režīmu un ar ko groza Regulas (ES) Nr. 1095/2010, (ES) Nr. 648/2012, (ES) Nr. 600/2014, (ES) Nr. 806/2014 un (ES) 2015/2365 un Direktīvas 2002/47/EK, 2004/25/EK, 2007/36/EK, 2014/59/ES un (ES) 2017/1132 ⁽¹⁾, un jo īpaši tās 10. panta 12. punktu,

tā kā:

- (1) Kad kompetentās iestādes un uzraudzības kolēģijas CCP atveseļošanas plāna novērtēšanas nolūkā ņem vērā attiecīgā CCP kapitāla struktūru un riska profilu, tām būtu jāapsver, vai atveseļošanas plāns ir piemērots CCP finanšu resursu pietiekamības nodrošināšanai, tai skaitā vajadzības gadījumā CCP savlaicīgas rekapitalizācijas nodrošināšanai, tā priekšfinansēto resursu papildināšanai un iespējama finansējuma un likviditātes deficīta novēršanai.
- (2) Kad kompetentās iestādes un uzraudzības kolēģijas CCP atveseļošanas plāna novērtēšanas nolūkā ņem vērā attiecīgā CCP secību saistību neizpildes gadījumā, tām būtu jāapsver, vai attiecīgā CCP secības struktūra saistību neizpildes gadījumā un zaudējumu sadales noteikumu struktūra ir piemērota visu paredzēto saistību neizpildes zaudējumu scenāriju gadījumā un vai minētie zaudējumu sadales noteikumi ir juridiski izpildāmi.
- (3) Kad kompetentās iestādes un uzraudzības kolēģijas CCP atveseļošanas plāna novērtēšanas nolūkā ņem vērā attiecīgā CCP organizatoriskās struktūras sarežģītību, tām būtu jāapsver, vai attiecīgā CCP īpašumtiesību struktūra un pārvaldības kārtība ir pietiekami skaidra un praktiski īstenojama, lai apstiprinātu atveseļošanas plāna īstenojamību un nodrošinātu atveseļošanas pasākumu raitu īstenošanu.
- (4) Kad kompetentās iestādes un uzraudzības kolēģijas CCP atveseļošanas plāna novērtēšanas nolūkā ņem vērā attiecīgā CCP darbību aizstājamību, tām būtu jāapsver, kā attiecīgā CCP atveseļošanas plānā ir paredzēts, ka daļu vai visus CCP tūrvērtē pakalpojumus varētu sniegt citi atļauju saņēmēji Savienības CCP vai atzīti trešo valstu CCP, lai mazinātu reālajai ekonomikai un finanšu stabilitātei būtisku pakalpojumu sniegšanas traucējumu risku.
- (5) Kad kompetentās iestādes un uzraudzības kolēģijas CCP atveseļošanas plāna novērtēšanas nolūkā ņem vērā attiecīgā CCP riska profilu, tām būtu jāapsver attiecīgā CCP darījumdarbības iezīmes un pārvaldības un juridiskie riski, lai novērtētu, vai attiecīgais CCP spēj ātri un efektīvi veikt atveseļošanas plānā paredzētos pasākumus neatkarīgi no šā CCP īpašajiem apstākļiem.
- (6) Kad kompetentās iestādes un uzraudzības kolēģijas CCP atveseļošanas plāna novērtēšanas nolūkā ņem vērā attiecīgā CCP gatavību pārvarēt spriedzi, kas varētu apdraudēt CCP dzīvotspēju, tām būtu jāapsver atveseļošanas plānā iekļauto scenāriju un rādītāju piemērotība, ņemot vērā attiecīgā CCP īpašos apstākļus šā CCP gatavības līmeņa šādas spriedzes pārvarēšanai uzticamības nodrošināšanai.

⁽¹⁾ OV L 22, 22.1.2021., 1. lpp.

- (7) Kad kompetentās iestādes un uzraudzības kolēģijas CCP atvēršanas plāna novērtēšanas nolūkā ņem vērā attiecīgā CCP darījumdarbības modeli, tām būtu jāapsver minētajā atvēršanas plānā paredzēto kritiski svarīgo funkciju piemērotība un kā atvēršanas plānā ir paredzēts veikt aktīvu vai darījumdarbības virzienu pārdošanu, lai paredzētu atvēršanas plāna aktivizēšanas ietekmi uz tīrvērtes dalībniekiem, to klientiem un netiešajiem klientiem un ārpakalpojumu izmantošanu.
- (8) Kad kompetentās iestādes un uzraudzības kolēģijas ņem vērā CCP atvēršanas plāna ietekmi uz konkrētām vienībām saistībā ar saziņu, tām būtu jāapsver CCP saziņas un izpaušanas procedūru piemērotība pēc iespējas pārredzamākai informācijas apmaiņai un potenciāli negatīvu tirgus reakciju uz CCP grūtībām pārvarēšanai.
- (9) Kad kompetentās iestādes un uzraudzības kolēģijas ņem vērā CCP atvēršanas plāna ietekmi uz tīrvērtes dalībniekiem, tām būtu jāapsver, kā attiecīgais CCP izvērtē savas tīrvērtes dalības sarežģītību, lai paredzētu atvēršanas plāna ietekmi uz tīrvērtes dalībnieku klientiem un netiešajiem klientiem, un jāapsver to līgumsaistības jebkurā atvēršanas scenārijā.
- (10) Kad kompetentās iestādes un uzraudzības kolēģijas ņem vērā CCP atvēršanas plāna ietekmi uz saistītajām tirgus infrastruktūrām, tām būtu jāapsver, vai attiecīgā CCP atvēršanas pasākumu īstenošana var ietekmēt saistītas infrastruktūras veiktās darbības, lai varētu pareizi izvērtēt noregulējuma plāna ietekmi sadarbības ziņā.
- (11) Kad kompetentās iestādes un uzraudzības kolēģijas ņem vērā CCP atvēršanas plāna ietekmi uz finanšu tirgiem, ko apkalpo CCP, tai skaitā uz tirdzniecības vietām, tām būtu jāapsver jebkāda saikne ar attiecīgā CCP tirdzniecības vietām, lai paredzētu jebkādu būtisku ietekmi, kāda atvēršanas pasākumiem varētu būt uz tirdzniecības vietas spēju apstrādāt darījumus vai noteikt cenas.
- (12) Kad kompetentās iestādes un uzraudzības kolēģijas ņem vērā CCP atvēršanas plāna ietekmi uz ikvienas dalībvalsts un visas Savienības finanšu sistēmu, tām būtu jāizvērtē atvēršanas pasākumu ietekme uz vienībām, kas būtiski saistītas ar attiecīgo CCP, tīrvērtes dalībniekiem un FTI, lai ņemtu vērā jebkādu kaitīgas ietekmes izplatīšanās risku, kas var rasties atvēršanas plāna aktivizēšanas rezultātā. Tām būtu arī jāapsver atvēršanas plāna ieviesto stimulu piemērotība, lai spētu nodrošināt, ka atvēršanas pasākumi un zaudējumu sadales instrumenti spēj optimizēt sekmīgas atvēršanas iespējamību ar tainīgu un samērīgu izmaksu sadalīšanu starp attiecīgā CCP akcionāriem, tīrvērtes dalībniekiem un to klientiem.
- (13) Šī regula ir balstīta uz regulatīvo tehnisko standartu projektu, ko Komisijai iesniegusi Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestāde (EVTI).
- (14) EVTI izstrādāja tehnisko standartu projektu, kas ir šīs regulas pamatā, sadarbībā ar Eiropas Centrālo banku sistēmu un Eiropas Sistēmisko risku kolēģiju. EVTI organizēja atklātu sabiedrisko apspriešanu par šādu regulatīvo tehnisko standartu projektu, analizēja iespējamās saistītās izmaksas un ieguvumus un pieprasīja Vērtspapīru un tirgu nozares ieinteresēto personu grupas, kas izveidota saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 1095/2010 ⁽²⁾ 37. pantu, atzinumu,

⁽²⁾ Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) Nr. 1095/2010 (2010. gada 24. novembris), ar ko izveido Eiropas Uzraudzības iestādi (Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestādi), groza Lēmumu Nr. 716/2009/EK un atceļ Komisijas Lēmumu 2009/77/EK (OV L 331, 15.12.2010., 84. lpp.).

IR PIEŅĒMUSI ŠO REGULU.

1. pants

CCP kapitāla struktūras un finanšu riska novērtējums

Kad kompetentās iestādes un uzraudzības kolēģijas novērtē CCP atveseļošanas plāna atbilstību attiecībā uz šā CCP kapitāla struktūru un finanšu risku, tās ņem vērā visus šos kritērijus:

- a) vai pastāv neatbilstības starp CCP kapitāla struktūru un atveseļošanas pasākumiem, kas paredzēti, lai nodrošinātu CCP savlaicīgu rekapitalizāciju, ja tā kapitāla līmenis noslīd zem paziņošanas robežvērtības vai neatbilst kapitāla prasībām;
- b) vai atveseļošanas plānā ir pienācīgi ņemta vērā Regulas (ES) 2021/23 9. panta 14. punktā minētā priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildu summa;
- c) vai, ņemot vērā to produktu veidus, kuriem veikta tīrvērte, atveseļošanas plānā paredzētie pasākumi ir labi izstrādāti, īstenojami, ticami un piemēroti CCP, lai:
 - i) atjaunotu CCP savietoto portfeli un kapitālu,
 - ii) papildinātu priekšfinansēto resursu apjomu,
 - iii) saglabātu pieeju pietiekamiem likviditātes avotiem,
 - iv) saglabātu vai atjaunotu CCP finansiālo dzīvotspēju un finanšu stabilitāti, izmantojot konkrētus atveseļošanas instrumentus vai pasākumus, tai skaitā tādus zaudējumu sadales instrumentus kā atveseļošanas skaidras naudas pieprasījumi, tādas peļņas vērtības samazinājumu, kas CCP jāmaksā saistības pildošiem tīrvērtes dalībniekiem, pozīciju sadali un citas likviditātes darbības;
- d) vai atveseļošanas plānā paredzētie pasākumi ir pienācīgi testēti attiecībā uz sadali un cenu atklāšanu;
- e) vai atveseļošanas plānā paredzētie pasākumi un c) apakšpunkta iv) punktā minētie instrumenti ir pietiekami uzticami un ātri pieejami gan idiosinkrātisku, gan sistēmisku atveseļošanas notikumu gadījumā;
- f) vai atveseļošanas plānā ir paredzēti pasākumi gan finansējuma deficīta, gan pagaidu likviditātes deficīta novēršanai, kā arī norādīti CCP pieejamie likviditātes mehānismi;
- g) vai atveseļošanas plānā paredzētajos pasākumos ir ņemti vērā drošības rezerves modelis un drošības rezerves procesi, kā arī nodrošinājuma sistēma, tai skaitā CCP iekšēji pieņemta nodrošinājuma un nodrošinājuma diskontu saraksts, un jo īpaši:
 - i) CCP iekasētās drošības rezerves maksimālā summa,
 - ii) attiecīgā gadījumā katram CCP fondam saistību neizpildes gadījumiem – maksimālā prasītās iemaksas summa fondā saistību neizpildes gadījumiem,
 - iii) aplēse par kopējo lielāko summu, kas pienācīgā termiņā varētu būt jāmaksā maksājumu saistībās vienā dienā, ja viens vai divi lielākie tīrvērtes dalībnieki un to saistītie uzņēmumi nespēj pildīt saistības ārkārtējos, bet iespējamajos tirgus apstākļos,
 - iv) resursu vai likviditātes pārvešanas iespējas starp darījumdarbības virzieniem;
- h) vai atveseļošanas plānā ir paredzēts izmantot pastāvīgos centrālās bankas mehānismus un ir skaidri identificēti aktīvi, attiecībā uz kuriem tiek sagaidīts, ka tie saskaņā ar centrālās bankas mehānisma noteikumiem tiks kvalificēti kā nodrošinājums.

2. pants

Novērtējums par CCP secību saistību neizpildes gadījumā

Kompetentās iestādes un uzraudzības kolēģijas novērtē CCP atveseļošanas plāna atbilstību attiecībā uz šā CCP secību saistību neizpildes gadījumā, ņemot vērā visus šos kritērijus:

- a) vai ir skaidri norādīta secība saistību neizpildes gadījumā un dažādi zaudējumu izplatīšanās ceļi un vai ir modelētas jebkādu zaudējumu sekas saskaņā ar noteikumiem par šo zaudējumu sadali, tai skaitā pieņemto kārtību starp CCP un tā tīrvērtes dalībniekiem un CCP vispārējo riska pārvaldības sistēmu, piemēram, CCP noteikumu kopumu;

- b) vai ir novērtēti un risināti attiecīgie juridiskie riski saistībā ar šīs secības izpildāmību, tai skaitā attiecībā uz tīrvērtes dalībniekiem, kuri pastāvīgi uzturas trešo valstu jurisdikcijās.

3. pants

CCP organizatoriskās struktūras novērtējums

Kompetentās iestādes un uzraudzības kolēģijas novērtē CCP atveseļošanas plāna atbilstību attiecībā uz organizatoriskās struktūras sarežģītības līmeni, ņemot vērā visus šos kritērijus:

- a) vai CCP īpašumtiesību struktūra varētu ietekmēt atveseļošanas plānu;
- b) kā CCP īpašumtiesību struktūra ir atspoguļota CCP stimulu struktūrās vai lēmumu pieņemšanas procesos;
- c) kā īpašniekiem noteiktās prasības atveseļošanas plānā varētu ietekmēt atveseļošanas plānu, tai skaitā gadījumos, kad līgumiski nolīgumi par mātesuzņēmumu vai grupas atbalstu veido daļu no atveseļošanas plāna, un jo īpaši novērtē:
- i) šāda atbalsta uzticamību un izpildāmību,
- ii) vai atveseļošanas plānā ir pienācīgi ņemti vērā un risināti gadījumi, kad minētos atbalsta nolīgumus nevar izpildīt;
- d) vai ir pietiekami novērtēta CCP saistība ar jebkuru tās pašas grupas vienību, lai nodrošinātu, ka tiek ņemts vērā jebkāds negatīvās ietekmes izplatīšanās risks, kas varētu rasties gadījumā, ja kāds grupas uzņēmums būtu pakļauts finansiāliem ierobežojumiem vai neizpildītu saistības, un novērtē to, kā šī saistība varētu ietekmēt atveseļošanas plānā paredzēto pasākumu piemērojamību;
- e) vai politika un procedūras, kas reglamentē atveseļošanas plāna apstiprināšanu un to organizācijas personu identificēšanu, kuras atbild par atveseļošanas plāna izstrādi un ieviešanu, ir piemērotas, skaidras un praktiski īstenojamas;
- f) vai atveseļošanas plāns atbilst CCP korporatīvās pārvaldības struktūrai un CCP lēmumu pieņemšanas procesiem un iekšējai pārvaldībai;
- g) vai CCP iekšējās organizācijas sarežģītība varētu kavēt savlaicīgu rīcību, vai arī procesi, visticamāk, darbosies efektīvi ar skaidrām lēmumu pieņemšanas ķēdēm un skaidri noteiktiem pienākumiem;
- h) vai atveseļošanas plāns ir skaidrs un praktiski īstenojams procedūrās un rīcības plānos, tai skaitā lēmumu pieņemšanas procesu procedūrās, detalizētās kontaktdatu lapās par ikvienu personu, kas saistīta ar atveseļošanas plāna procesu, attālinātās piekļuves iespējās un pieejamībā lēmumu pieņēmējiem, un vai atveseļošanas plānā ir procedūras, kā piekļūt svarīgākajām personām gan uz vietas, gan ārpusē;
- i) vai atveseļošanas plāns vajadzības gadījumā ir faktiski iekļauts CCP darbības noteikumos;
- j) vai CCP ir ieviesis attiecīgus noteikumus un procedūras, lai regulāri pārbaudītu savu atveseļošanas plānu ar saviem tīrvērtes dalībniekiem un, ja iespējams, identificētu to klientus un netiešos klientus.

4. pants

CCP darbību aizstājamības novērtējums

Kompetentās iestādes un uzraudzības kolēģijas novērtē CCP atveseļošanas plāna atbilstību attiecībā uz šā CCP darbību aizstājamību, ņemot vērā visus šos kritērijus:

- a) vai atveseļošanas plānā ir ņemts vērā tas, vai citi CCP, kas saņēmuši atļauju vai ir atzīti saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 648/2012 ⁽¹⁾ 14. vai 25. pantu, sniedz dažus vai visus tīrvērtes pakalpojumus, ko sniedz šis CCP;

⁽¹⁾ Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) Nr. 648/2012 (2012. gada 4. jūlijs) par ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, centrālajiem darījumu partneriem un darījumu reģistriem (OV L 201, 27.7.2012., 1. lpp.).

- b) cik lielā mērā atveseļošanas plānā, izmantojot CCP pieejamo informāciju, ir sniegta sīkāka informācija par to, kā ir identificēti cita CCP sniegtie tūrvērtes pakalpojumi un vai šādi identificētie citu CCP sniegtie pakalpojumi ir jau sen izveidoti pakalpojumi vai nesen izveidoti tūrvērtes pakalpojumi;
- c) ja atveseļošanas plānā ir paredzēta darījumu pārvedamība vai tādu darbību daļēja vai pilnīga nodošana citam pakalpojumu sniedzējam, kuras nav kritiski svarīgas, un:
 - i) vai minētā iespēja ir iesniegta kopā ar tās dzīvotspējas novērtējumu, izmantojot CCP pieejamo informāciju,
 - ii) kā atveseļošanas plānā ņemta vērā iespējamība, ka šādas darījumu pārvedamības īstenošana vai tādu darbību nodošana, kuras nav kritiski svarīgas, varētu nebūt iespējama.

5. pants

CCP riska profila novērtējums

1. Kompetentās iestādes un uzraudzības kolēģijas novērtē CCP atveseļošanas plāna atbilstību attiecībā uz šā CCP riska profilu, ņemot vērā visus šos kritērijus:
 - a) vai CCP atveseļošanas plāns kopumā ietver un paredz piemērotus pasākumus dažādu veidu risku novēršanai un to iespējamās kombinācijas, saistībā ar kurām varētu būt nepieciešams izmantot 1. panta c) punkta iv) apakšpunktā minētos atveseļošanas instrumentus;
 - b) vai atveseļošanas plānā ir novērtēts un mazināts to traucējumu risks, kas radušies gan no CCP, gan citu vienību un pakalpojumu sniedzēju puses, kurām pakļauts CCP, ieskaitot tūrvērti, ieguldījumus, kontu turēšanu un maksājumus;
 - c) vai atveseļošanas plānā ir ņemta vērā CCP darījumdarbības būtība, apjoms un sarežģītība, un tas, kā šie elementi atspoguļoti CCP ierosinātajos pasākumos;
 - d) vai CCP var neatkarīgi piemērot atveseļošanas plānu bez citu tās pašas uzņēmumu grupas vienību iejaukšanās un, ja iespējams, vai ir skaidri identificēta jebkāda plašāka ietekme uz citām grupas vienībām un savstarpējā finansiālā atkarība;
 - e) vai atveseļošanas plānā ir ņemti vērā vides riski un kibernetizācijas risks, kas varētu izraisīt CCP finanšu stāvokļa būtisku pasliktināšanos, un jebkādi citi riski, kas konstatēti spriedzes testos, kas veikti saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 49. panta 1. punktu un Regulas (ES) Nr. 1095/2010 21. panta 2. punktu, kad tas ir būtiski attiecībā uz atveseļošanas plānu;
 - f) vai atveseļošanas plānā ir novērtēti juridiskie riski un jo īpaši tas, vai visi atveseļošanas plānā paredzētie pasākumi ir likumīgi, spēkā, saistoši un izpildāmi;
 - g) vai vienošanās, nolīgumi un līgumi, tai skaitā CCP darbības noteikumi un nolīgumi ar pakalpojumu sniedzējiem, ir skaidri, likumīgi, spēkā, saistoši un izpildāmi, un tiesiski apstrīdami, nolūkā nodrošināt, ka tiek pārvaldīti un samazināti tiesiskās apstrīdēšanas un tiesvedības riski;
 - h) vai vajadzības gadījumā ir savākti juridiskie atzinumi, lai pierādītu atgūšanas pasākumu un nolīgumu juridisko spēkā esamību un izpildāmību, jo īpaši, ja nolīguma darījumu partneris atrodas trešā valstī;
 - i) vai tad, ja CCP valde, apstiprinot CCP atveseļošanas plānu, ir nolēmusi neņemt vērā riska komitejas ieteikumu, pamatojums, ko CCP sniedzis gan riska komitejas locekļiem, gan tā kompetentajai iestādei saskaņā ar Regulas (ES) 2021/23 9. panta 18. punktu, ir atbilstīgs.
2. Šā panta 1. punkta a) apakšpunktā risku veidi, kas jāņem vērā, atkarībā no konkrētā CCP ietver operacionālos riskus, kredītrisku, likviditātes risku, vispārējo darījumdarbības risku, turēšanas risku, norēķinu risku, ieguldījumu risku, tirgus, sistēmiskos, vides un klimata riskus.
3. Šā panta 1. punkta c) apakšpunktā norādītos aspektus var novērtēt atveseļošanas plānā, ņemot vērā visus šos CCP darījumdarbības aspektus:
 - a) to finanšu instrumentu veidu, kuriem CCP veic vai veiks tūrvērti;

- b) finanšu instrumentus, kuriem tūrvērti veic vai veiks CCP, uz kuru attiecas Regulas (ES) Nr. 648/2012 4. pantā minētais tūrvērtes pienākums;
- c) vidējās vērtības, kurām CCP viena gada laikā veicis tūrvērti, pēc produkta veida un valūtas absolūtos skaitļos un attiecībā pret CCP kapitālu katram tūrvērtes dalībniekam un, ja iespējams, katram klientam;
- d) to, vai darījumi, kuriem CCP veicis tūrvērti, ir izpildīti ES tirdzniecības vietā, trešās valsts tirdzniecības vietā, ko uzskata par līdzvērtīgu saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 2.a pantu, vai ārpusbiržas darījumā;
- e) dalībvalstis, kurās CCP veic vai plāno veikt pakalpojumu sniegšanu un citas CCP pārrobežu darbības.

6. pants

CCP riska profila novērtējums saistībā ar CCP gatavību

Kompetentās iestādes un uzraudzības kolēģijas novērtē CCP atveseļošanas plāna atbilstību atveseļošanas plānā ietvertajiem termiņiem, scenārijiem un rādītājiem. Veicot minēto novērtējumu, kompetentās iestādes un uzraudzības kolēģijas ņem vērā visus šos kritērijus:

- a) vai atveseļošanas plāna plānotā piemērošana un izstrādātā stratēģija:
 - i) atspoguļo CCP riska profilu, kas izriet no tā darījumdarbības modeļa un produktu klāsta, tai skaitā apsvērumus par tā tirgus likviditāti, tirgus koncentrāciju, tiešo tūrvērtes dalībnieku un to klientu lomu, norēķinu metodiku, valūtām un tūrvērtes stundām, kā arī apkalpotajām tirdzniecības vietām,
 - ii) ņem vērā CCP īpašo struktūru un organizatorisko struktūru, tai skaitā apsvērumus par tā secības saistību neizpildes gadījumā nošķiršanu un riska apvienošanas iespējām dažādiem pakalpojumiem,
 - iii) ņem vērā CCP atkarību no attiecīgajām vienībām, tai skaitā saistītajām grupas vienībām un trešām personām;
- b) vai atveseļošanas plānā iekļautā kvantitatīvo un kvalitatīvo rādītāju sistēma nosaka apstākļus, kuros jāveic atveseļošanas plānā paredzētie pasākumi.

7. pants

CCP riska profila novērtējums saistībā ar darījumdarbības modeli

Kompetentās iestādes un uzraudzības kolēģijas novērtē CCP atveseļošanas plāna atbilstību attiecībā uz šā CCP darījumdarbības modeļa operacionālo risku, ņemot vērā visus šos kritērijus:

- a) vai CCP kritiski svarīgās funkcijas ir pienācīgi identificētas;
- b) vai atveseļošanas plānā paredzētie sagatavošanas darbi, kas sekmē aktīvu vai darījumdarbības virzienu pārdošanu, ir piemēroti CCP, ņemot vērā visu turpmāk minēto:
 - i) vai vērtības un tirgspējas noteikšanas procedūras attiecībā uz CCP galvenajiem darījumdarbības virzieniem, darbībām un aktīviem ir piemērotas ātrai un uzticamai novērtēšanai,
 - ii) vai termiņš, kas paredzēts, lai sagatavotu pārdošanu, ir piemērots, ņemot vērā to instrumentu veidu, kuriem veikta tūrvērtē, un pārdošanas apjomu,
 - iii) vai novērtējums par šādas pārdošanas iespējamo ietekmi uz CCP darbībām atspoguļo CCP konkrētās darbības, t. i., to produktu veidu, kuriem veikta tūrvērtē, vai drošības rezerves noteikšanas metodes, ko piemēro produktiem un kontu struktūrām,
 - iv) vai ir pietiekami novērtēta darījumdarbības virzienu sagatavošanas darbu ietekme uz tūrvērtes dalībniekiem un to klientiem un netiešajiem klientiem, ja tos iespējams identificēt, un vai ir mazināta jebkāda negatīva ietekme;

- c) ja CCP veic tīrvērti vairākiem produktiem, vai CCP ir apsvēris iespēju sadalīt pārdošanu starp produktiem un vai šādas sadalīšanas ietekmē ir konstatēti kādi šķēršļi, vai arī ir konstatēta jebkāda cita šādas dalītas pārdošanas ietekme uz atveseļošanas plānu;
- d) vai atveseļošanas plānā ir novērtēts dažādu saikņu ar vienībām, tai skaitā likviditātes nodrošinātājiem, norēķinu bankām, platformām, turētājbankām, ieguldījumu aģentiem, bankām vai pakalpojumu sniedzējiem, skaits un nozīme un tas, kā šīs saiknes ietekmē atveseļošanas pasākumus un atveseļošanas plāna efektivitāti;
- e) vai ir novērtēts, cik katra no šīm saiknēm ir svarīga vai būtiska, tai skaitā attiecībā uz apjomiem, kam veikta tīrvērte, un finanšu riska darījumiem saskaņā ar šo kārtību;
- f) vai ir pietiekami novērtēti ārpakalpojumi, kas ietver daļu no CCP pamatfunkcijām, un vai konstatētie riski ir mazināti;
- g) kā ir novērtēta atveseļošanas plāna juridiskā izpildāmība attiecībā pret f) apakšpunktā minētajiem ārpakalpojumiem un vai ir apmierinoši novērtēta šādu ārpakalpojumu sniedzēju nespēja izpildīt ārpakalpojumu līgumos paredzētās saistības, un kā atveseļošanas plānā ir mazināti minētie riski.

8. pants

Novērtējums par vispārējo ietekmi uz konkrētām vienībām saistībā ar CCP saziņas un izpaušanas plānu

Kompetentās iestādes un uzraudzības kolēģijas novērtē CCP atveseļošanas plāna atbilstību attiecībā uz šā CCP saziņas un izpaušanas plānu, ņemot vērā vispārējo ietekmi, kāda atveseļošanas plāna īstenošanai būtu uz Regulas (ES) 2021/23 10. panta 3. punkta b) apakšpunktā minētajām vienībām vai tirgiem, un jo īpaši ņemot vērā visus šos kritērijus:

- a) vai CCP saziņas un izpaušanas plāns atbilst Regulas (ES) 2021/23 pielikuma A iedaļas 3. punktam, un jo īpaši to, vai CCP saziņas un izpaušanas plāns:
 - i) paredz, kā pēc iespējas pārredzamāk apmainīties ar informāciju ar CCP ieinteresētajām personām, tai skaitā tīrvērtes dalībniekiem un finanšu tirgu kopumā,
 - ii) sniedz skaidrus norādījumus par to, kā rīkoties attiecībā uz gaidīto, un paredz, kā mazināt potenciāli negatīvu tirgus reakciju uz informācijas izpaušanu;
- b) vai CCP saziņas un izpaušanas plānā ir ietvertas skaidras procedūras attiecībā uz to, kā un kad apmainīties ar informāciju ar dažādām vienībām, un sniegts skaidrs apraksts par to, kā šādās procedūrās ir ņemtas vērā juridiskās prasības un citas saistošas prasības.

9. pants

Novērtējums par CCP atveseļošanas plāna vispārējo ietekmi uz tīrvērtes dalībniekiem, to klientiem un netiešajiem klientiem

Kompetentās iestādes un uzraudzības kolēģijas novērtē atveseļošanas plāna atbilstību attiecībā uz tā vispārējo ietekmi uz CCP tīrvērtes dalībniekiem un, ja minētā informācija ir pieejama CCP, uz to klientiem un netiešajiem klientiem, ieskaitot gadījumus, kad tie ir izraudzīti par citām sistēmiski nozīmīgām iestādēm (C-SNI), ņemot vērā visus šos kritērijus:

- a) vai atveseļošanas plāns pareizi atspoguļo CCP tīrvērtes dalības sarežģītību, ieskaitot visu turpmāk minēto:
 - i) klienta tīrvērtes līmeni CCP;
 - ii) iedibināto tīrvērtes dalībnieku skaitu:
 - (1) CCP jurisdikcijā,

- (2) citā dalībvalstī,
- (3) trešā valstī;
- iii) dalībnieku koncentrāciju;
- b) vai atvēršanas plānā ir ņemta vērā vispārējā ietekme uz tūrvērtes dalībniekiem un, ja minētā informācija ir pieejama CCP, uz to klientiem un netiešajiem klientiem, kādu radītu CCP sniegto tūrvērtes pakalpojumu iespējami traucējumi, tai skaitā iespējamā ietekme uz piekļuvi tūrvērtei un cita ietekme, kas izriet no CCP darbības noteikumiem;
- c) vai atvēršanas plānā ir ņemta vērā saskaņā ar atvēršanas plānu veicamo saskaņoto pasākumu iespējamā ietekme uz tūrvērtes dalībniekiem un attiecīgā gadījumā uz to klientiem un netiešajiem klientiem;
- d) vai saskaņā ar CCP darbības noteikumiem tūrvērtes dalībnieki un attiecīgā gadījumā to klienti un netiešie klienti ir vienojušies par jebkādam finansālām vai līgumiskām saistībām, tai skaitā par to, kā tiek aprēķināta saistību summa, vai tiek piemērota kāda maksimālā robeža, vai šī summa ir iepriekš saskaņota summa, vai arī tiks aprēķināta kā dalībnieka vai klienta riska darījumu funkcija, un kā šādi resursi tiktu pieprasīti.

10. pants

Novērtējums par CCP atvēršanas plāna vispārējo ietekmi uz saistītām FTI

Kompetentās iestādes un uzraudzības kolēģijas novērtē CCP atvēršanas plāna atbilstību attiecībā uz tā vispārējo ietekmi uz iespējamām saistītām finanšu tirgus infrastruktūrām (FTI), ņemot vērā visus šos kritērijus:

- a) vai atvēršanas plānā ir novērtēta atvēršanas pasākumu piemērošanas iespējamā ietekme uz ikvienu sadarbībspējīgu CCP un citām ar šo CCP saistītām FTI, novērtējot CCP iesaistes būtiskumu minētajās vienībās;
- b) vai atvēršanas plānā ir minēti sadarbības vai kompensējošas pozīcijas aprēķināšanas nolīgumi ar citiem CCP un šādu mehānismu darbības joma, tai skaitā apjomi, kuriem veikta tūrvērte, un finanšu resursi, ar kuriem notikusi apmaiņa minēto mehānismu ietvaros;
- c) vai kāda atvēršanas plāna pasākuma īstenošanas ietekme varētu ietekmēt piekļuvi citām FTI, un, ja ir konstatēti šķēršļi vai ierobežojumi, kā tie tiek mazināti;
- d) vai saistītās FTI un ieinteresētās personas, kas uzņemtos zaudējumus, segtu izmaksas vai veiktu iemaksas, lai segtu likviditātes deficītu atvēršanas plāna īstenošanas gadījumā, ir efektīvi un pieņemamā veidā iesaistītas minētā plāna sagatavošanas procesā saskaņā ar Regulas (ES) 2021/23 9. panta 16. punktu.

11. pants

Novērtējums par CCP atvēršanas plāna vispārējo ietekmi uz finanšu tirgiem, tai skaitā tirdzniecības vietām, ko apkalpo CCP

Kompetentās iestādes un uzraudzības kolēģijas novērtē CCP atvēršanas plāna atbilstību attiecībā uz tā vispārējo ietekmi uz finanšu tirgiem, tai skaitā tirdzniecības vietām, ko apkalpo CCP, ņemot vērā visus šos kritērijus:

- a) vai atvēršanas plānā ir novērtēta atvēršanas pasākumu piemērošanas iespējamā ietekme uz tirdzniecības vietām, kā arī jebkādiem citiem ar CCP saistītiem tirdzniecības avotiem, tai skaitā novērtējums par CCP iesaistes būtiskumu minētajās vienībās un to, vai šī ietekme ir apdraudējums attiecīgo vienību stabilitātei;
- b) vai CCP bez tūrvērtes pakalpojumiem sniedz arī jebkādu citu vai papildu būtiskus vai svarīgus pakalpojumus, kas saistīti ar tūrvērti, un to, vai kāds atvēršanas plāna pasākums varētu ietekmēt finanšu tirgu, ko apkalpo CCP, kur CCP sniedz šādus citu vai papildu būtiskus vai svarīgus pakalpojumus.

12. pants

Novērtējums par CCP atveseļošanas plāna vispārējo ietekmi uz ikvienas dalībvalsts un visas Savienības finanšu sistēmu

Kompetentās iestādes un uzraudzības kolēģijas novērtē CCP atveseļošanas plāna vispārējo ietekmi uz ikvienas dalībvalsts un visas Savienības finanšu sistēmu, ņemot vērā visus šos kritērijus:

- a) vai ir novērtēta atveseļošanas plāna iespējamā ietekme uz:
 - i) ikvienas dalībvalsts un visas Savienības finanšu stabilitāti, kas rodas iespējamās kaitīgas ietekmes izplatīšanās rezultātā, tai skaitā saistībā ar kredītrisku, likviditātes risku vai operacionālajiem riskiem tīrvērtes dalībniekiem un savstarpēji atkarīgām FTI,
 - ii) ikvienas dalībvalsts un visas Savienības finanšu sistēmu, kas rodas atveseļošanas plāna ietekmes dēļ uz vienu vai vairākām vienībām, kas saistītas ar CCP, vai uz pašu CCP;
- b) vai atveseļošanas plāna plašākā sistēmiskā riska novērtēšanas nolūkā atveseļošanas plānā tiek ņemti vērā un pārdomāti EVTI ik pa laikam veikto analīžu rezultāti, ja tie ir būtiski atveseļošanas plānam, un vai minētajā plānā pēc iespējas ir mazināti iespējami būtiski atklājumi vai bažas;
- c) vai ir ņemta vērā būtiska saistība ar vienībām, tai skaitā likviditātes nodrošinātājiem, norēķinu bankām, platformām, turētājbankām, ieguldījumu aģentiem, bankām vai pakalpojumu sniedzējiem, novērtējot, kā atveseļošanas plāns varētu ietekmēt saistīto vienību darbības, un vai atveseļošanas plānā ietvertie pasākumi ir piemēroti un īstenojami vienībām, ar kurām ir konstatēta būtiska saistība, vai arī tam varētu būt būtiska negatīva ietekme uz ikvienas dalībvalsts un visas Savienības finanšu sistēmu;
- d) vai likviditātes nodrošinātāji, ja tos uzrauga CCP kompetentā iestāde vai ciktāl ir pieejama informācija par to likviditātes riska darījumiem, rada koncentrētus likviditātes riska darījumus dažādo funkciju dēļ, kādas šiem likviditātes nodrošinātājiem var būt attiecībā uz vairākiem CCP, ieskaitot tīrvērtes dalībnieka, maksājumu bankas, ieguldījumu bankas, turētājbankas vai likviditātes atbalsta mehānisma funkcijas.

13. pants

Stimuli

Kompetentās iestādes un uzraudzības kolēģijas novērtē CCP atveseļošanas plāna atbilstību attiecībā uz piemērotu stimulu radīšanu CCP īpašniekiem, tīrvērtes dalībniekiem un, ja iespējams, attiecīgā gadījumā to klientiem, lai kontrolētu riska apjomu, ko sistēmā rada vai ar ko saskaras minētie CCP īpašnieki, tīrvērtes dalībnieki un to klienti, uzraudzītu CCP riska uzņemšanās un riska pārvaldības darbības un dotu ieguldījumu CCP saistību neizpildes pārvaldības procesā, ņemot vērā visus šos kritērijus:

- a) vai šie stimuli palielina sekmīgas atveseļošanas iespējamību un vai atveseļošanas plānā ir norādīti stimuli dažādām ieinteresētajām personām, attiecīgā gadījumā minot piemērus tam, kā krīzes laikā varētu veicināt brīvprātīgas vai fakultatīvas iemaksas papildus ieguldījumiem, par kuriem panākta vienošanās saskaņā ar CCP darbības noteikumiem;
- b) vai resursu, iemaksu vai izmaksu sadalīšanas pieprasījumi saistībā ar atveseļošanas plānu rada atbilstīgus stimulus CCP, tā tīrvērtes dalībniekiem, to klientiem un netiešajiem klientiem, ciktāl šie tiešie un netiešie klienti ir zināmi, akcionāriem un citām tās pašas grupas vienībām rīkoties tā, lai līdz samazinātu riskus un iespējamās izmaksas;
- c) vai saistību neizpildes pārvaldības procesa struktūra stimulē dalību tīrvērtes dalībnieku un to klientu saistību neizpildes pārvaldībā, izmantojot atveseļošanas instrumentus un resursus, kas CCP nodrošināmi atveseļošanas procesā, tai skaitā sankcijas gadījumā, ja nav nodrošināti atvēlētie resursi, ja par to ir panākta vienošanās, ieskaitot norīkotā personāla nodrošināšanu, lai palīdzētu atveseļošanas pārvaldībā vai iesaistītos konkurētspējīgā solīšanā izsolē;
- d) vai saistības nepildošo dalībnieku pozīciju izsoļu kārtība un pasākumi pietiekami stimulē saistības pildošus tīrvērtes dalībniekus tajās konkurētspējīgi piedalīties un ir labi organizēti un vai šī kārtība un pasākumi rada atveseļošanas plānā paredzētos stimulus;

- e) vai saistība starp tīrvērtes dalībnieku darbību un to iespējamiem zaudējumiem, kas izriet no atveseļošanas plāna, rada pienācīgu stimulu panākt to, ka atveseļošanās, visticamāk, būs sekmīga, tai skaitā, vai zaudējumi vai iespējamo zaudējumu maksimālā robeža ir samērīga ar dalībnieka darbības rādītāju, pamatojoties uz mainīgo drošības rezervi, sākotnējo drošības rezervi, iemaksām fondā saistību neizpildes gadījumiem vai citiem uz risku un darbību balstītiem rādītājiem;
- f) vai CCP mehānismi saistīto FTI un ieinteresēto personu iesaistīšanai, kuras uzņemtos zaudējumus, segtu izmaksas vai veiktu iemaksas, lai segtu likviditātes deficītu gadījumā, ja minētā plāna sagatavošanas procesā un piedaloties attiecīgajās riska pārvaldības diskusijās tiktu īstenots atveseļošanas plāns, ir labi organizēti un rada piemērotus stimulus, lai nodrošinātu līdzsvaru starp saistīto FTI un ieinteresēto personu interesēm;
- g) vai tīrvērtes dalībnieku un, iespējams, to klientu vai citu ar CCP saistītu vienību iesaistīšana pakalpojumu sniegšanā, lai risinātu zaudējumu mazināšanas problēmu atveseļošanas gadījumā, ietver īstos stimulus sniegt CCP piemērotus pakalpojumus, tai skaitā darboties kā repo darījuma partnerim un nodrošināt likviditāti.

14. pants

Stāšanās spēkā

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

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

Briselē, 2022. gada 25. novembrī

Komisijas vārdā –
priekšsēdētāja
Ursula VON DER LEYEN