

Eiropas Savienības Oficiālais Vēstnesis

L 52



Izdevums
latviešu valodā

Tiesību akti

56. sējums

2013. gada 23. februāris

Saturs

II Nelegislatīvi akti

REGULAS

- ★ Komisijas Deleģētā regula (ES) Nr. 148/2013 (2012. gada 19. decembris), ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 648/2012 par ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, centrālajiem darījumu partneriem un darījumu reģistriem un kas attiecas uz regulatīviem tehniskajiem standartiem par minimālajiem datiem, kuri jāsniedz darījumu reģistriem ⁽¹⁾ 1
- ★ Komisijas Deleģētā regula (ES) Nr. 149/2013 (2012. gada 19. decembris), ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 648/2012 attiecībā uz regulatīviem tehniskajiem standartiem par netiešās tīrvērtes mehānismu, tīrvērtes pienākumu, publisko reģistru, pieeju tirdzniecības vietai, nefinanšu darījuma partneriem un riska ierobežošanas paņēmieniem ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem, kuriem tīrvērti neveic centrālais darījuma partneris ⁽¹⁾ 11
- ★ Komisijas Deleģētā regula (ES) Nr. 150/2013 (2012. gada 19. decembris), ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 648/2012 par ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, centrālajiem darījumu partneriem un darījumu reģistriem attiecībā uz regulatīviem tehniskajiem standartiem, kuros precizētas ziņas, kas iekļaujamās darījumu reģistra reģistrācijas pieteikumā ⁽¹⁾ 25
- ★ Komisijas Deleģētā regula (ES) Nr. 151/2013 (2012. gada 19. decembris), ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 648/2012 par ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, centrālajiem darījumu partneriem un darījumu reģistriem attiecībā uz regulatīviem tehniskajiem standartiem, kas nosaka datus, kuri darījumu reģistriem ir jāpublicē un jādara pieejami, un darbības standartus saistībā ar datu apkopošanu un salīdzināšanu un piekļuvi datiem ⁽¹⁾ 33

Cena: EUR 4

(Turpinājums nākamajā lappusē)

⁽¹⁾ Dokuments attiecas uz EEZ

LV

Tiesību akti, kuru virsraksti ir gaišajā drukā, attiecas uz kārtējiem jautājumiem lauksaimniecības jomā un parasti ir spēkā tikai ierobežotu laika posmu.

Visu citu tiesību aktu virsraksti ir tumšajā drukā, un pirms tiem ir zvaigznīte.

★ Komisijas Delegētā regula (ES) Nr. 152/2013 (2012. gada 19. decembris), ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 648/2012 attiecībā uz regulatīviem tehniskajiem standartiem par kapitāla prasībām centrālajiem darījumu partneriem ⁽¹⁾	37
★ Komisijas Delegētā regula (ES) Nr. 153/2013 (2012. gada 19. decembris), ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 648/2012 attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par prasībām centrālajiem darījumu partneriem ⁽¹⁾	41



⁽¹⁾ Dokuments attiecas uz EEZ

II

(Nelegislatīvi akti)

REGULAS

KOMISIJAS DELEĢĒTĀ REGULA (ES) Nr. 148/2013

(2012. gada 19. decembris),

ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 648/2012 par ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, centrālajiem darījumu partneriem un darījumu reģistriem un kas attiecas uz regulatīviem tehniskajiem standartiem par minimālajiem datiem, kuri jāsniedz darījumu reģistriem

(Dokuments attiecas uz EEZ)

EIROPAS KOMISIJA,

ņemot vērā Līgumu par Eiropas Savienības darbību,

ņemot vērā Eiropas Centrālās bankas atzinumu ⁽¹⁾,

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 ⁽²⁾ un jo īpaši tās 9. panta 5. punktu,

tā kā:

- (1) Lai nodrošinātu elastību, darījuma partnerim vajadzētu būt iespējai deleģēt ziņojuma sniegšanu par līgumu otram darījuma partnerim vai trešai personai. Darījuma partneriem arī vajadzētu būt iespējai vienoties par ziņojuma sniegšanas deleģēšanu kopīgai trešai personai, tostarp centrālajam darījuma partnerim (CCP), un tādā gadījumā CCP darījumu reģistram iesniedz vienu ziņojumu, tostarp arī attiecīgo tabulu ar datu ailēm. Šādā gadījumā, un lai nodrošinātu datu kvalitāti, ziņojumā būtu jānorāda, ka tas ir sagatavots abu darījuma partneru vārdā un ietver visus datus, kas tiktu paziņoti, ja par līgumu ziņotu katrs darījuma partneris atsevišķi.
- (2) Lai izvairītos no nekonsekvencēm kopīgo datu tabulās, katram atvasināto instrumentu līguma darījuma partnerim būtu jānodrošina, ka abas darījuma puses ir vienojušās par kopīgajiem datiem, kas ietverti ziņojumā. Unikāls darījuma identifikators palīdzēs saskaņot datus gadījumā, ja darījuma partneri sniedz ziņojumus dažādiem darījumu reģistriem.

- (3) Lai izvairītos no divkāršiem ziņojumiem un lai samazinātu ar ziņojumu sniegšanu saistīto slogu, ja viens darījuma partneris vai CCP sniedz ziņojumu abu darījuma partneru vārdā, šim darījuma partnerim vai CCP vajadzētu būt iespējai darījumu reģistram nosūtīt vienu ziņojumu, kurā ietverta attiecīgā informācija.

- (4) Atvasināto finanšu instrumentu līgumu vērtēšana ir būtiska, lai regulatori varētu īstenot savas pilnvaras, it sevišķi saistībā ar finansiālo stabilitāti. Līguma vērtība, kas noteikta ar metodi, kura paredz vērtēšanu pēc tirgus vērtības vai pēc modeļa, norāda ar šo līgumu saistīto riska darījumu zīmi un apjomu un papildina informāciju par līgumā norādīto sākotnējo vērtību.

- (5) Ir svarīgi apkopot informāciju par nodrošinājumu, kas attiecas uz konkrētu līgumu, lai nodrošinātu riska darījumu pienācīgu uzraudzību. Lai tas būtu iespējams, darījuma partneriem, kas nodrošina savus darījumus, būtu jāziņo par šādu nodrošinājumu datiem darījuma līmenī. Ja nodrošinājumu aprēķina, pamatojoties uz neto pozīcijām, kas izriet no līgumu kopuma, un ja tas tādēļ nav izvietots darījuma līmenī, bet gan pamatojoties uz portfeli, darījuma partneriem vajadzētu būt iespējai ziņot par portfeli, izmantojot unikālu kodu vai numuru sistēmu saskaņā ar to, kā noteicis darījuma partneris. Šim unikālajam kodam būtu jāidentificē konkrētais portfelis, pret ko ir apmainīts nodrošinājums, ja darījuma partnerim ir vairāk par vienu portfeli, un būtu arī jānodrošina, ka atvasināto instrumentu līgumu var saistīt ar konkrētu portfeli, kuram tiek turēts nodrošinājums.

- (6) Šīs regulas pamatā ir regulatīvu tehnisko standartu projekts, ko Komisijai iesniegusi Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestāde (EVTI), un tā atspoguļo darījumu reģistru nozīmi, lai uzlabotu tirgu pārredzamību sabiedrībai un regulatoriem, datus, kuri darījuma partneriem ir jāsniedz darījumu reģistriem, kā arī datus, kas darījumu reģistriem jāapkopo un jāpublicē atkarībā no atvasināto instrumentu kategorijas un darījuma būtības.

⁽¹⁾ Oficiālajā Vēstnesī vēl nav publicēts.

⁽²⁾ OV L 201, 27.7.2012., 1. lpp.

- (7) EVTI pirms šīs regulas pamatā esošā regulatīvu tehnisko standartu projekta iesniegšanas ir apspriedusies ar attiecīgajām iestādēm un Eiropas Centrālo banku sistēmas (ECBS) locekļiem. Saskaņā ar 10. pantu Eiropas Parlamenta un Padomes 2010. gada 24. novembra Regulā (ES) Nr. 1095/2010, ar ko izveido Eiropas Uzraudzības iestādi (Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestādi)⁽¹⁾, EVTI arī organizēja atklātu sabiedrisko apspriešanu par šādu regulatīvo tehnisko standartu projektu, analizēja iespējamās saistītās izmaksas un ieguvumus un lūdza atzinumu no EVTI Vērtspapīru un tirgu nozares ieinteresēto personu grupas, kas izveidota saskaņā ar minētās regulas 37. pantu,

IR PIEŅĒMUSI ŠO REGULU.

1. pants

Dati, ko ietver ziņojumos saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 9. panta 1. un 3. punktu

1. Ziņojumos darījumu reģistriem ietver:
 - a) datus, kas izklāstīti pielikuma 1. tabulā, kurā ietverta informācija, kas attiecas uz līguma darījuma partneriem;
 - b) informāciju, kas izklāstīta pielikuma 2. tabulā, kurā ietverti dati, kas attiecas uz atvasināto instrumentu līgumu, kurš noslēgts starp diviem darījuma partneriem.
2. Šā panta 1. punktā līguma noslēgšana ir “darījuma veikšana”, kā minēts Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvas 2004/39/EK⁽²⁾ 25. panta 3. punktā.
3. Ja abu darījuma partneru vārdā iesniedz vienu ziņojumu, tajā ietver pielikuma 1. tabulā noteikto informāciju, kas attiecas uz katru no darījuma partneriem. Pielikuma 2. tabulā noteikto informāciju sniedz tikai vienreiz.
4. Ja abu darījuma partneru vārdā iesniedz vienu ziņojumu, to attiecīgi norāda, kā noteikts pielikuma 1. tabulas 9. ailē.

5. Ja viens darījuma partneris darījumu reģistram sniedz ziņojumu par līguma datiem cita darījuma partnera vārdā vai ja trešā persona darījumu reģistram sniedz ziņojumu par līgumu viena vai abu darījuma partneru vārdā, ziņojumā ietver visus datus, kas tiktu paziņoti, ja par līgumu darījumu reģistram ziņotu katrs darījuma partneris atsevišķi.

⁽¹⁾ OV L 331, 15.12.2010., 84. lpp.

⁽²⁾ OV L 145, 30.4.2004., 1. lpp.

6. Ja atvasināto instrumentu līgums ietver elementus, kas ir raksturīgi vairāk nekā vienam no bāzes aktīviem, kā noteikts pielikuma 2. tabulā, ziņojumā norāda aktīvu kategoriju, par kuru darījuma partneri pirms ziņojuma nosūtīšanas darījumu reģistram vienojušies, ka līgums tai visvairāk līdzinās.

2. pants

Darījumi, kam veikta tīrvērtē

1. Ja spēkā esošam līgumam CCP veic tīrvērti, ziņojumā informācija par šo tīrvērti ir jāsniedz kā par spēkā esošā līguma grozījumu.

2. Ja līgumu slēdz tirdzniecības vietā un ja tam CCP tīrvērti veic tādā veidā, ka darījuma partneris nav informēts par otra darījuma partnera identitāti, darījuma partneris, kas sniedz ziņojumu, norāda, ka CCP ir tā darījuma partneris.

3. pants

Ziņojumu sniegšana par riska darījumiem

1. Datus par nodrošinājumu, kā paredzēts pielikuma 1. tabulā, ietver visus izvietotos nodrošinājumus.
2. Ja darījuma partneris neizvieto nodrošinājumu darījuma līmenī, darījuma partneri darījumu reģistram sniedz ziņojumu par portfeļa līmenī izvietoto nodrošinājumu.
3. Ja par nodrošinājumu, kas saistīts ar līgumu, sniedz ziņojumu portfeļa līmenī, darījuma partneris, kurš sniedz ziņojumu, darījumu reģistram iesniedz arī kodu, kas identificē otram darījuma partnerim izvietotā nodrošinājuma portfeli, kurš saistīts ar līgumu, par ko sniedz ziņojumu.
4. Nefinanšu darījuma partneriem, izņemot tos, kas minēti Regulas (ES) Nr. 648/2012 10. pantā, nav jāsniedz ziņojums par līguma vērtējumiem pēc nodrošinājuma vai pēc tirgus vērtības, vai pēc modeļa, kā minēts pielikuma 1. tabulā.
5. Attiecībā uz līgumiem, kam tīrvērti veic CCP, vērtējumus pēc tirgus vērtības veic tikai CCP.

4. pants

Ziņojumu žurnāls

Darījumu reģistros reģistrēto datu grozījumus reģistrē žurnālā, kurā identificē personu vai personas, kas pieprasījušas grozījumus, tostarp attiecīgā gadījumā pašu darījumu reģistru, kā arī norāda šāda grozījuma iemeslu vai iemeslus, izmaiņu datumu un laika zīmogu un izmaiņu skaidru aprakstu, tostarp attiecīgo datu veco un jauno saturu, kā noteikts pielikuma 2. tabulas 58. un 59. laukā.

5. pants

Spēkā stāšanās

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, 2012. gada 19. decembrī

Komisijas vārdā –
priekšsēdētājs
José Manuel BARROSO

PIELIKUMS

Dati, kas jāietver ziņojumā darījumu reģistriem

1. tabula

Darījuma partnera dati

	Aile	Dati, kas jāietver ziņojumā
	Līguma puses	
1.	Ziņojuma iesniegšanas laika zīmogs	Darījumu reģistram iesniegtā ziņojuma datums un laiks.
2.	Darījuma partnera identifikācijas dati	Unikāls kods, kas identificē darījuma partneri, kas sniedz ziņojumu. Fiziskas personas gadījumā izmanto klienta kodu.
3.	Otra darījuma partnera identifikācijas dati	Unikāls kods, kas identificē otru līguma darījuma partneri. Šo lauku aizpilda no tā darījuma partnera perspektīvas, kurš sniedz ziņojumu. Fiziskas personas gadījumā izmanto klienta kodu.
4.	Darījuma partnera nosaukums	Darījuma partnera, kas sniedz ziņojumu, komercnosaukums. Šo aili var atstāt neaizpildītu, ja darījuma partnera identifikācijas dati jau ietver šo informāciju.
5.	Darījuma partnera galvenā uzņēmējdarbības vieta	Informācija par juridisko adresi, kurā ietilpst darījuma partnera, kas sniedz ziņojumu, pilni adreses dati, pilsēta un valsts. Šo aili var atstāt neaizpildītu, ja darījuma partnera identifikācijas dati jau ietver šo informāciju.
6.	Darījuma partnera uzņēmējdarbības sektors	Darījuma partnera, kas sniedz ziņojumu, uzņēmuma darbības specifika (banka, apdrošināšanas sabiedrība utt.). Šo aili var atstāt neaizpildītu, ja darījuma partnera identifikācijas dati jau ietver šo informāciju.
7.	Darījuma partnera finanšu vai nefinanšu raksturs	Jānorāda, vai darījuma partneris, kas sniedz ziņojumu, ir finanšu vai nefinanšu darījuma partneris saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 2. panta 8. un 9. punktu.
8.	Brokera identifikators	Ja brokeris rīkojas kā darījuma partnera, kas sniedz ziņojumu, starpnieks, nekļūstot par darījuma partneri, darījuma partneris, kurš sniedz ziņojumu, norāda šo brokeri ar unikālu kodu. Fiziskas personas gadījumā izmanto klienta kodu.
9.	Struktūras, kura sniedz ziņojumu, identifikators	Ja darījuma partneris, kas sniedz ziņojumu, ir deleģējis ziņojuma iesniegšanu trešai personai vai citam darījuma partnerim, šī struktūra ir jānorāda šajā laukā ar unikālu kodu. Pretējā gadījumā šo aili atstāj neaizpildītu. Fiziskas personas gadījumā izmanto klienta kodu, ko piešķirusi juridiskā struktūra, kuru darījuma veikšanai izmanto darījuma partneris, kas ir fiziska persona.
10.	Tīrvērtes dalībnieka identifikators	Gadījumā, ja darījuma partneris, kas sniedz ziņojumu, nav tīrvērtes loceklis, tā tīrvērtes locekli norāda šajā ailē ar unikālu kodu. Fiziskas personas gadījumā izmanto klienta kodu, ko piešķir CCP.
11.	Labuma guvēja identifikators	Puse, kam piemēro no līguma izrietošās tiesības un pienākumus. Ja darījumu veic, izmantojot struktūru, piemēram, trastu vai fondu, kas pārstāv vairākus labuma guvējus, labuma guvējs būtu jānorāda kā šī struktūra. Ja līguma labuma guvējs nav šā līguma darījuma partneris, darījuma partneris, kas sniedz ziņojumu, ir jānorāda šis labuma guvējs ar unikālu kodu vai fizisku personu gadījumā ar klienta kodu, kuru piešķirusi juridiska struktūra, ko izmanto fiziskā persona.

	Aile	Dati, kas jāietver ziņojumā
12.	Darījumu pilnvaras	Jānorāda, vai darījuma partneris, kas sniedz ziņojumu, ir noslēdzis līgumu principā uz sava rēķina (savā vārdā vai klienta vārdā) vai kā pārstāvis uz klienta rēķina un klienta vārdā.
13.	Darījuma partnera puse	Jānorāda, vai līguma mērķis bija pirkt vai pārdot. Procentu likmes atvasināto finanšu instrumentu līguma gadījumā pircēja puse ir 1. posma maksātājs, savukārt pārdevēja puse ir 2. posma maksātājs.
14.	Līgums ar Eiropas Ekonomikas zonā neietilpstošu darījuma partneri	Jānorāda, vai otra darījuma partnera juridiskā adrese ir ārpus Eiropas Ekonomikas zona.
15.	Tieši saistīts ar komercdarbību vai finanšu līdzekļu pārvaldības darbību	Informācija par to, vai līgums ir objektīvi novērtējams kā tieši saistīts ar darījuma partnera, kas sniedz ziņojumu, komercdarbību vai finanšu līdzekļu pārvaldības darbību, kā minēts Regulas (ES) Nr. 648/2012 10. panta 3. punktā. Šo aili atstāj neaizpildītu, ja darījuma partnera, kas sniedz ziņojumu, ir finanšu darījumu partneris, kā minēts Regulas (ES) Nr. 648/2012 2. panta 8. punktā.
16.	Tīrvērtes sliekšnis	Informācija par to, vai darījuma partnera, kas sniedz ziņojumu, rādītāji ir virs tīrvērtes sliekšņa, kā minēts Regulas (ES) Nr. 648/2012 10. panta 2. punktā. Šo lauku atstāj neaizpildītu, ja darījuma partneris, kas sniedz ziņojumu, ir finanšu darījumu partneris, kā minēts Regulas (ES) Nr. 648/2012 2. panta 8. punktā.
17.	Līguma vērtība pēc tirgus vērtības	Attiecīgos gadījumos līguma vērtības noteikšana ar metodi, kura paredz novērtēšanu pēc tirgus vērtības vai pēc modeļa, saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 11. panta 2. punktu.
18.	Valūta līguma vērtībai pēc tirgus vērtības	Attiecīgos gadījumos līguma vērtības noteikšanai ar metodi, kura paredz novērtēšanu pēc tirgus vērtības vai pēc modeļa, izmantotā valūta saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 11. panta 2. punktu.
19.	Vērtēšanas datums	Pēdējās vērtēšanas ar metodi, kura paredz novērtēšanu pēc tirgus vērtības vai pēc modeļa, datums.
20.	Vērtēšanas laiks	Pēdējās vērtēšanas ar metodi, kura paredz novērtēšanu pēc tirgus vērtības vai pēc modeļa, laiks.
21.	Vērtēšanas veids	Jānorāda, vai vērtēšanu veica ar metodi, kura paredz novērtēšanu pēc tirgus vērtības vai pēc modeļa.
22.	Nodrošinājums	Jānorāda, vai tika veikts nodrošinājums.
23.	Nodrošinājuma portfelis	Jānorāda, vai nodrošinājumu veica, pamatojoties uz portfeli. Portfelis nozīmē, ka nodrošinājumu aprēķināja, pamatojoties uz neto pozīcijām, kas izriet no līgumu kopuma, nevis no atsevišķiem darījumiem.
24.	Nodrošinājuma portfeļa kods	Ja par nodrošinājumu sniedz ziņojumu portfeļa līmenī, portfelis būtu jāidentificē ar unikālu kodu, ko nosaka darījuma partneris, kurš sniedz ziņojumu.
25.	Nodrošinājuma vērtība	Darījuma partnera, kurš sniedz ziņojumu, izvietotā nodrošinājuma vērtība otram darījuma partnerim. Ja nodrošinājumu izvieto portfeļa līmenī, šajā laukā būtu jāietver arī visu portfelim izvietoto nodrošinājumu vērtība.
26.	Nodrošinājuma vērtības valūta	Jānorāda nodrošinājuma vērtība 25. laukam.

2. tabula

Kopīgie dati

	Aile	Dati, kas jāietver ziņojumā	Izmantojamie atvasināto instrumentu līgumu veidi
	2.a iedaļa. Līguma veids		Visi līgumi
1.	Izmantotā klasifikācija	Līgumu identificē, izmantojot produkta identifikatoru.	
2.	Produkta 1. identifikators	Līgumu identificē, izmantojot produkta identifikatoru.	
3.	Produkta 2. identifikators	Līgumu identificē, izmantojot produkta identifikatoru.	
4.	Bāzes instruments	Bāzes instrumentu identificē, izmantojot šā bāzes instrumenta unikālu identifikatoru. Grozu vai indeksu gadījumā, ja nav pieejams unikāls identifikators, izmanto šā groza vai indeksa norādi.	
5.	1. nosacītā valūta	Nosacītās summas valūta. Procentu likmes atvasināto instrumentu līguma gadījumā tā būs 1. posma nosacītā valūta.	
6.	2. nosacītā valūta	Nosacītās summas valūta. Procentu likmes atvasināto finanšu instrumentu līguma gadījumā tā būs 2. posma nosacītā valūta.	
7.	Piegādājamā valūta	Valūta, kādā jāveic piegāde.	
	2.b iedaļa. Ziņas par darījumu		Visi līgumi
8.	Darījuma identifikācijas dati	Darījuma unikālais identifikators, par ko panākta vienošanās Eiropas līmenī un ko norāda darījuma partneris, kurš sniedz ziņojumu. Ja darījuma unikālais identifikators nav pieejams, būtu jāizstrādā unikāls kods un ar otru darījuma partneri par to jāvienojas.	
9.	Darījuma atsauces numurs	Darījuma unikālais identifikācijas numurs, ko iesniedz darījuma partneris, kurš sniedz ziņojumu, vai trešā persona, kas sniedz ziņojumu tā vārdā.	
10.	Izpildes vieta	Izpildes vietu identificē ar šīs vietas unikālu kodu. Tāda līguma gadījumā, kas noslēgts ārpus biržas, ir jānorāda, vai attiecīgais instruments ir pieņemts tirdzniecībai, bet tiek tirgots ārpus biržas, vai netiek pieņemts tirdzniecībai un tiek tirgots ārpus biržas.	
11.	Sablīvēšana	Jānorāda, vai līgums ir noslēgts sablīvēšanas rezultātā.	
12.	Cena/likme	Cena par katru atvasināto instrumentu, attiecīgos gadījumos izņemot komisijas maksu un uzkrātos procentus.	
13.	Cenas apzīmējums	Veids, kādā tiek izteikta cena.	
14.	Nosacītā summa	Līguma sākotnējā vērtība.	

	Aile	Dati, kas jāietver ziņojumā	Izmantojamie atvasināto instrumentu līgumu veidi
15.	Cenas reizinātājs	Finanšu instrumenta vienību skaits, kas ietilpst vienā tirdzniecības paketē, piemēram, vienā līgumā iekļauto atvasināto instrumentu skaits.	
16.	Daudzums	Ziņojumā iekļauto līgumu skaits, ja tiek ziņots par vairāk nekā vienu atvasināto instrumentu līgumu.	
17.	Avansa maksājums	Visu avansa maksājumu summas, ko darījuma partneris, kurš sniedz ziņojumu, ir saņēmis vai veicis.	
18.	Piegādes veids	Jānorāda, vai līgumu apmaksā fiziskos aktīvos vai skaidrā naudā.	
19.	Izpildes laika zīmogs	Kā noteikts 1. panta 2. punktā.	
20.	Spēkā stāšanās datums	Datums, kad stājas spēkā līgumā noteiktās saistības.	
21.	Termiņš	Ziņojumā iekļautā līguma sākotnējais termiņa beigu datums. Šajā ailē nesniedz informāciju par priekšlaicīgu izbeigšanu.	
22.	Izbeigšanas datums	Ziņojumā iekļautā līguma izbeigšanas datums. Ja tas neatšķiras no termiņa, šo aili atstāj neaizpildītu.	
23.	Norēķinu datums	Bāzes instrumenta norēķinu datums. Ja ir vairāk par vienu, var izmantot papildu ailes (piemēram, 23.A, 23.B, 23.C utt.).	
24.	Vispārējā nolīguma veids	Atsauce uz attiecīgā vispārējā nolīguma nosaukumu, ja tas ir izmantots līgumam, par ko sniedz ziņojumu (piemēram, Starptautisko mijmaiņas darījumu un atvasināto vērtspapīru asociācijas (turpmāk – ISDA) vispārējais nolīgums, elektroenerģijas iegādes un pārdošanas vispārējais nolīgums, starptautiskais ForEx vispārējais nolīgums, Eiropas vispārējais nolīgums vai jebkādi vietējie vispārējie nolīgumi).	
25.	Vispārējā nolīguma redakcija	Attiecīgā gadījumā atsauce uz ziņojumā iekļautā darījumā izmantotā vispārējā nolīguma redakcijas gadu (piemēram, 1992. gads, 2002. gads utt.).	
	2.c iedaļa. Riska mazināšana/ziņošana		Visi līgumi
26.	Apstiprinājuma laika zīmogs	Apstiprinājuma datums un laiks, kā noteikts Komisijas Deleģētajā regulā (ES) Nr. 149/2013 ⁽¹⁾ , tostarp laika zona, kurā apstiprinājums dots.	
27.	Apstiprināšanas veids	Jānorāda, vai līgums apstiprināts elektroniski, neelektroniski vai arī tas vēl nav apstiprināts.	
	2.d iedaļa. Tīrvērtē		Visi līgumi
28.	Tīrvērtes pienākums	Jānorāda, vai ziņojumā iekļautajam līgumam piemēro tīrvērtes pienākumu saskaņā ar Regulu (ES) Nr. 648/2012.	

	Aile	Dati, kas jāietver ziņojumā	Izmantojamie atvasināto instrumentu līgumu veidi
29.	Tīrvērtē ir veikta	Jānorāda, vai tīrvērtē ir veikta.	
30.	Tīrvērtē laika zīmogs	Tīrvērtē veikšanas laiks un datums.	
31.	CCP	Tāda līguma gadījumā, kam ir veikta tīrvērtē, tā CCP unikālais kods, kurš veica šā līguma tīrvērti.	
32.	Grupas iekšējais darījums	Jānorāda, vai līgumu noslēdza saistībā ar grupas iekšējo darījumu, kā noteikts Regulas (ES) Nr. 648/2012 3. pantā.	
	2.e iedaļa. Procentu likmes	Ja ziņojumā ir ietverts unikāls produkta identifikators, kas ietver visu turpmāk norādīto informāciju, par turpmāk norādīto nav jāsniedz ziņojums	Procentu likmju atvasinātie instrumenti
33.	1. posma nemainīgā likme	Attiecīgā gadījumā jānorāda izmantotā 1. posma nemainīgā likme.	
34.	2. posma nemainīgā likme	Attiecīgā gadījumā jānorāda izmantotā 2. posma nemainīgā likme.	
35.	Nemainīgās likmes dienu skaits	Attiecīgā gadījumā faktiskais dienu skaits attiecīgajā nemainīgās likmes maksātāja aprēķina periodā.	
36.	Nemainīgās likmes posma maksājumu regularitāte	Attiecīgā gadījumā nemainīgās likmes posma maksājumu regularitāte.	
37.	Mainīgās likmes posma maksājumu regularitāte	Attiecīgā gadījumā mainīgās likmes posma maksājumu regularitāte.	
38.	Mainīgās likmes pārskatīšanas regularitāte	Attiecīgā gadījumā mainīgās likmes pārskatīšanas regularitāte.	
39.	1. posma mainīgā likme	Attiecīgā gadījumā jānorāda izmantotās procentu likmes, ko pārskata iepriekš noteiktos intervālos, atsaucoties uz tirgus bāzes likmi.	
40.	2. posma mainīgā likme	Attiecīgā gadījumā jānorāda izmantotās procentu likmes, ko pārskata iepriekš noteiktos intervālos, atsaucoties uz tirgus bāzes likmi.	
	2.f iedaļa. Ārvalstu valūta	Ja ziņojumā ir ietverts unikāls produkta identifikators, kas ietver visu turpmāk norādīto informāciju, par turpmāk norādīto nav jāsniedz ziņojums	Valūtas atvasinātie instrumenti
41.	2. valūta	Starptautiskā, ja tā atšķiras no piegādes valūtas.	
42.	1. valūtas kurss	Līgumā noteiktais valūtu maiņas kurss.	
43.	Valūtas nākotnes kurss	Valūtas nākotnes kurss vērtēšanas datumā.	
44.	Valūtas kursa pamats	Jānorāda valūtas kursa pamats.	

	Aile	Dati, kas jāietver ziņojumā	Izmantojamie atvasināto instrumentu līgumu veidi
	2.g iedaļa. Preces	Ja ziņojumā ir ietverts unikāls produkta identifikators, kas ietver visu turpmāk norādīto informāciju, par turpmāk norādīto nav jāsniedz ziņojums, ja vien to neparedz Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) Nr. 1227/2011 ⁽²⁾	Preču atvasinātie instrumenti
	Vispārēji		
45.	Pamata prece	Jānorāda preces veids, kas ir pamatā līgumam.	
46.	Ziņas par preci	Ziņas par konkrēto preci papildus 45. ailē norādītajiem datiem.	
	Enerģētika	Attiecīgā gadījumā informācija, kas jāsniedz saskaņā ar Regulu (ES) Nr. 1227/2011.	
47.	Piegādes punkts vai zona	Tirgus reģiona(-u) piegādes punkts(-i).	
48.	Starpsavienojuma punkts	Jānorāda transportēšanas līguma robeža(-as) vai robežpunkts(-i).	
49.	Kravas veids	Tabulas 50.–54. ailes atkārtojamā sadaļa, kurā jānorāda produkta piegādes profils, kas atbilst dienas piegādes periodiem.	
50.	Piegādes sākuma datums un laiks	Piegādes sākuma datums un laiks.	
51.	Piegādes beigu datums un laiks	Piegādes beigu datums un laiks	
52.	Līguma kapacitāte	Daudzums katrā piegādes laika intervālā	
53.	Daudzuma vienība	Dienas vai stundas daudzums MWh vai kWh/d, kas atbilst bāzes precei	
54.	Cenas/laika intervāla daudzumi	Attiecīgā gadījumā cena par laika intervāla daudzumiem.	
	2.h iedaļa. Iespējas līgumi	Ja ziņojumā ir ietverts unikāls produkta identifikators, kas ietver visu turpmāk norādīto informāciju, par turpmāk norādīto nav jāsniedz ziņojums	Līgumi, kas ietver iespējas
55.	Iespējas līguma veids	Jānorāda, vai līgums ir pirkšanas iespējas līgums vai pārdošanas iespējas līgums	
56.	Iespējas līguma izpildes veids	Jānorāda, vai iespējas līgumu var izpildīt tikai konkrētā datumā (Eiropas un Āzijas izpildes veids), vairākos iepriekš noteiktos datumos (Bermudu) vai jebkurā brīdī līguma darbības laikā (Amerikas izpildes veids)	
57.	Norunas cena (augstākā/zemākā likmes robežvērtība)	Iespējas līguma norunas cena	

	Aile	Dati, kas jāietver ziņojumā	Izmantojamie atvasināto instrumentu līgumu veidi
	2.i iedaļa. Ziņojuma grozījumi		Visi līgumi
58.	Darbības veids	Ja ziņojums: — pirmo reizi ietver atvasināto instrumentu līgumu vai pēctirdzniecības notikumu, to apzīmē ar norādi “jauns”, — ietver iepriekš paziņota atvasināto instrumentu līguma datu grozījumu, to apzīmē ar norādi “grozīts”, — ietver nepareizi iesniegta ziņojuma atcelšanu, to apzīmē ar norādi “kļūda”, — ietver spēkā esoša līguma izbeigšanu, to apzīmē ar norādi “anulēts”, — ietver paziņota līguma sablīvēšanu, to apzīmē ar norādi “sablīvēts”, — ietver līguma vērtējuma atjauninājumu, to apzīmē ar norādi “vērtējuma atjaunināšana”, — ietver citus ziņojuma grozījumus, to apzīmē ar norādi “cits”	
59.	Ziņas par darbības veidu	Ja 58. laukā norāda “cits”, šajā ailē precizē šā grozījuma datus	

(¹) Skatīt šā *Oficiālā Vēstneša* 11. lpp.

(²) OV L 326, 8.12.2011., 1. lpp.

KOMISIJAS DELEĢĒTĀ REGULA (ES) Nr. 149/2013

(2012. gada 19. decembris),

ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 648/2012 attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par netiešas tīrvērtes mehānismu, tīrvērtes pienākumu, publisko reģistru, pieeju tirdzniecības vietai, nefinanšu darījuma partneriem un riska ierobežošanas paņēmieniem ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem, kuriem tīrvērti neveic centrālais darījuma partneris

(Dokuments attiecas uz EEZ)

EIROPAS KOMISIJA,

- (3) Nolūkā skaidri noteikt vairākus jēdzienus, kas balstās uz Regulu (ES) Nr. 648/2012, un precizēt tehniskos terminus, kas vajadzīgi šā tehniskā standarta izstrādei, būtu jādefinē vairāki termini.

ņemot vērā Līgumu par Eiropas Savienības darbību,

ņemot vērā Eiropas Centrālās bankas atzinumu ⁽¹⁾,

- (4) Netiešas tīrvērtes mehānisms nedrīkstētu pakļaut CCP, tīrvērtes dalībnieku, klientu vai netiešu klientu papildu darījuma partnera riskam, turklāt netieša klienta aktīviem un pozīcijām būtu jāpiemēro atbilstošs aizsardzības līmenis. Tādēļ ir būtiski, ka nolūkā garantēt to drošību visa veida netiešas tīrvērtes mehānismi atbilst minimālajām prasībām. Lai to panāktu, uz netiešas tīrvērtes mehānismā iesaistītajām pusēm attiecinā īpašas prasības. Šis mehānisms ir plašāks nekā līgumiskas attiecības starp netiešiem klientiem un tīrvērtes dalībnieka klientu, kas nodrošina netiešas tīrvērtes pakalpojumus.

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 ⁽²⁾ un jo īpaši tās 4. panta 4. punktu, 5. panta 1. punktu, 6. panta 4. punktu, 8. panta 5. punktu, 10. panta 4. punktu un 11. panta 14. punktu,

tā kā:

- (1) Ir vajadzīga sistēma, kas aptver tīrvērtes pienākumam piemērojamos noteikumus, tā piemērošanu, iespējamās izņēmumus un riska mazināšanas paņēmienus, kas nosakāmi gadījumiem, kad tīrvērtē ar centrālo darījuma partneri (CCP) nav iespējama. Lai nodrošinātu saskaņotību starp šiem noteikumiem, kuriem vajadzētu stāties spēkā vienlaicīgi, un sekmētu to, ka ieinteresētajām personām, jo īpaši tām, uz kurām attiecas šie pienākumi, ir to visaptverošs pārskats un viegla pieeja tiem, ir vēlams visus Regulas (ES) Nr. 648/2012 II sadaļā paredzētos tehniskos standartus iekļaut vienā regulā.

- (2) Saistībā ar to, ka ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu tirgum ir pasaules mērogs, šajā regulā būtu jāņem vērā attiecīgās starptautiskās pamatnostādnes un ieteikumi ārpusbiržas atvasināto instrumentu tirgus reformām un obligātajai tīrvērtē, un arī saistītie noteikumi, kas izstrādāti citās jurisdikcijās. Konkrētāk, sistēmā tīrvērtes pienākuma noteikšanai ņem vērā obligātās tīrvērtes prasības, kuras publicējusi Starptautiskā Vērtspapīru komisiju organizācija. Tādējādi iespējami vairāk tiks sekmēta konverģence ar pieejām citās jurisdikcijās.

- (5) Regulā (ES) Nr. 648/2012 ietverta prasība CCP būt par noteikto sistēmu atbilstīgi Eiropas Parlamenta un Padomes 1998. gada 19. maija Direktīvai 98/26/EK par norēķinu galīgumu maksājumu un vērtspapīru norēķinu sistēmās ⁽³⁾. Tas nozīmē, ka CCP tīrvērtes dalībnieki būtu jāuzskata par dalībniekiem minētās direktīvas izpratnē. Tādējādi, lai netiešiem klientiem nodrošinātu līdzvērtīgu aizsardzības līmeni tam, kas noteikts klientiem saskaņā ar Regulu (ES) Nr. 648/2012, ir jāgarantē, ka klienti, kas sniedz netiešas tīrvērtes pakalpojumus, ir kredītiestādes, ieguldījumu sabiedrības vai līdzvērtīgas trešo valstu kredītiestādes vai ieguldījumu sabiedrības.

- (6) Netiešas tīrvērtes mehānisms būtu jāizstrādā tāds, lai nodrošinātu, ka netiešiem klientiem saistību neizpildes gadījumā iespējams iegūt aizsardzības līmeni, kas līdzvērtīgs tiešiem klientiem piešķirtajam aizsardzības līmenim. Tīrvērtes dalībnieka bankrota gadījumā, kas iedarbina netiešas tīrvērtes mehānismu, netiešu klientu pozīcijas būtu jāpārceļ uz alternatīvu tīrvērtes dalībnieku saskaņā ar pārnēsāmības prasībām, kas noteiktas Regulas (ES) Nr. 648/2012 39. un 48. pantā. Netiešas tīrvērtes mehānismā būtu jānosaka arī piemēroti aizsardzības pasākumi pret klienta bankrotu, un tiem būtu jāsekmē netiešu klientu pozīciju pārceļšana uz alternatīvu tīrvērtes pakalpojumu sniedzēju.

⁽¹⁾ Oficiālajā Vēstnesī vēl nav publicēts.

⁽²⁾ OV L 201, 27.7.2012., 1. lpp.

⁽³⁾ OV L 166, 11.6.1998., 45. lpp.

- (7) Tā kā netiešas tīrvērtes mehānismi var radīt specifiskus riskus, visām netiešas tīrvērtes mehānismā iesaistītajām pusēm, tostarp tīrvērtes dalībniekiem un CCP, būtu regulāri jānosaka, jāuzrauga un jāpārvalda visi būtiskie riski, kas rodas no šāda mehānisma. Šajā kontekstā īpaši svarīga ir atbilstoša informācijas apmaiņa starp klientiem, kas nodrošina netiešas tīrvērtes pakalpojumus, un tīrvērtes dalībniekiem, kas šos pakalpojumus ļauj veikt. Tīrvērtes dalībniekiem būtu jāizmanto klientu sniegtā informācija tikai riska pārvaldības mērķiem, turklāt būtu jānovērš ļaunprātīga komerciāli svarīgas informācijas izmantošana, tostarp izmantojot efektīvas barjeras starp dažādām finanšu iestāžu nodaļām nolūkā izvairīties no interešu konfliktiem.
- (8) Kad kompetentā iestāde dod atļauju CCP veikt kādas ārpusbiržas atvasināto instrumentu kategorijas tīrvērti, kompetentajai iestādei par to būtu jāziņo Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestādei (EVTI). Šajā paziņojumā būtu jāiekļauj sīka informācija, kas EVTI vajadzīga, lai varētu veikt novērtēšanas procesu, tostarp informācija par attiecīgās ārpusbiržas atvasināto instrumentu kategorijas likviditāti un apjomu. Lai gan informāciju EVTI sniedz kompetentā iestāde, sākotnēji šo prasīto informāciju kompetentajai iestādei sniedz atļaujas pieprasītājs CCP, un kompetentā iestāde šo informāciju var pēc saviem ieskatiem papildināt.
- (9) Lai gan ir iespējams, ka visa kompetentās iestādes paziņojuma EVTI iekļaujamā informācija tīrvērtes pienākuma nolūkiem vienmēr nav pieejama, jo sevišķi saistībā ar jauniem produktiem, būtu jāsniedz pieejamās aplēses, skaidri norādot izmantotos pieņēmumus. Paziņojumā iekļauj arī informāciju, kas attiecas uz darījuma partneriem, piemēram, darījuma partneru veidu un skaitu, vajadzīgos pasākumus, kas jāveic, lai uzsāktu tīrvērti ar CCP, to tiesībspēju un darbības kapacitāti vai to riska pārvaldības sistēmu, lai dotu iespēju EVTI novērtēt aktīvo darījuma partneru spēju izpildīt tīrvērtes pienākumu, neradot tirgus darbības traucējumus.
- (10) Kompetentās iestādes paziņojumā EVTI būtu jāiekļauj informācija par standartizācijas pakāpi, likviditāti un cenu pieejamību, lai EVTI varētu novērtēt, vai uz ārpusbiržas atvasināto instrumentu kategoriju būtu jāattiecinā pienākums veikt tīrvērti. Kritēriji, kas attiecas uz atbilstošās ārpusbiržas atvasināto instrumentu kategorijas līguma nosacījumu un darbības procesu standartizāciju, ir ārpusbiržas atvasināto instrumentu kategorijas ekonomisko nosacījumu standartizācijas rādītājs, jo līguma nosacījumus un darbības procesus iespējams standartizēt tikai tad, ja ir standartizēti šie ekonomiskie nosacījumi. Kritērijus, kas saistīti ar likviditāti un cenu pieejamību, EVTI novērtē, ņemot vērā citus apsvērumus, nekā to darījusi kompetentā iestāde, izsniedzot atļauju CCP. Likviditāti šajā kontekstā novērtē plašākā perspektīvā, un tā atšķiras no likviditātes rādītāja, ko izmanto, lai noteiktu, vai piemērojams tīrvērtes pienākums. Konkrēti, fakts, ka līgums ir pietiekami likvids, lai CCP tam varētu veikt tīrvērti, nenozīmē, ka uz to būtu attiecināms pienākums veikt tīrvērti. EVTI novērtējumam nevajadzētu atkārtoti ietvert vai dublēt kompetentās iestādes jau veikto novērtējumu.
- (11) Informācijai, ko kompetentā iestāde sniedz tīrvērtes pienākuma noteikšanas nolūkā, būtu EVTI jānodrošina iespēja novērtēt cenu informācijas pieejamību. Šajā sakarībā CCP pieeja cenu informācijai noteiktā brīdī nenozīmē, ka tirgus dalībniekiem cenu informācija būs pieejama turpmāk. Tādējādi fakts, ka CCP ir pieeja vajadzīgajai cenu informācijai, lai noteiktā ārpusbiržas atvasināto instrumentu kategorijā pārvaldītu atvasināto instrumentu līgumu tīrvērtes risku, automātiski nenozīmē, ka uz šo ārpusbiržas atvasināto instrumentu kategoriju būtu jāattiecinā tīrvērtes pienākums.
- (12) Pieejamā informācijas detalizācijas pakāpe to ārpusbiržas atvasināto instrumentu kategoriju reģistrā, uz kurām attiecas pienākums veikt tīrvērti, atkarīga no šīs informācijas būtiskuma ārpusbiržas atvasināto instrumentu kategorijas noteikšanā. Tādējādi dažādām ārpusbiržas atvasināto instrumentu kategorijām reģistrā pieejamās informācijas detalizācijas pakāpe var atšķirties.
- (13) Vairāku CCP pieejas atļaušana tirdzniecības vietai varētu paplašināt dalībnieku pieeju šai vietai un tādējādi sekmēt kopējo likviditāti. Šādos apstākļos tomēr ir svarīgi konkrētizēt likviditātes sadrumstalotības jēdzienu tirdzniecības vietā, ja tā varētu apdraudēt vienmērīgu un sakārtotu tirgu darbību attiecībā uz to finanšu instrumentu kategoriju, par kuru veikts pieprasījums.
- (14) Kompetentās iestādes novērtējums tirdzniecības vietai, kurai CCP pieprasījis pieeju, un novērtējums CCP kompetentajai iestādei būtu jābalsta uz instrumentiem, kas pieejami, lai novērstu likviditātes sadrumstalotību tirdzniecības vietā.
- (15) Lai novērstu likviditātes sadrumstalotību, visiem tirdzniecības vietas dalībniekiem būtu jāspēj veikt tīrvērti starp tiem izpildītajiem darījumiem. Taču nebūtu samērīgi pieprasīt visiem jau esoša CCP tīrvērtes dalībniekiem kļūt par tīrvērtes dalībniekiem arī visos jaunajos CCP, kas apkalpo šādu tirdzniecības vietu. Ja ir struktūras, kas ir tīrvērtes dalībnieces abos CCP, tās nolūkā ierobežot likviditātes sadrumstalotības risku var veicināt pārcelšanu un tīrvērti darījumiem, ko veikuši tirgus dalībnieki, ko

atsevišķi apkalpo šie divi CCP. Taču ir svarīgi, ka CCP pieprasījums nodrošināt pieeju tirdzniecības vietai nesadrumstalo likviditāti tādā veidā, kas palielinātu riskus, kam ir pakļauts esošais CCP.

- (16) Atbilstīgi Regulas (ES) Nr. 648/2012 8. panta 4. punktam CCP pieejas pieprasījumam tirdzniecības vietai nebūtu vajadzīga sadarbība, un tādējādi šajā regulā sadarbība nebūtu jāparedz kā vienīgais likviditātes sadrumstalošanas risināšanas veids. Taču regulā nebūtu jāizslēdz iespēja CCP brīvprātīgi iesaistīties šādā mehānismā, ja izpildīti vajadzīgie nosacījumi.
- (17) Nolikā noteikt, kuru ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumi objektīvi mērāmā veidā mazina riskus, kuri ir tieši saistīti ar komercdarbību vai finanšu līdzekļu pārvaldību, nefinanšu darījuma partneriem būtu jāpiemēro viens vai vairāki šajā regulā minētie kritēriji, tostarp grāmatvedības definīcija, kas balstīta uz Starptautisko finanšu pārskatu standartu (SFPS) noteikumiem. Darījuma partneri var izmantot grāmatvedības definīciju pat tad, ja tie nepiemēro SFPS noteikumus. Attiecībā uz tiem nefinanšu darījuma partneriem, kas var izmantot vietējos grāmatvedības noteikumus, sagaidāms, ka lielākā daļa līgumu, kas saskaņā ar šiem vietējiem grāmatvedības noteikumiem klasificēti kā risku ierobežojoši, atbilst šajā regulā noteiktajai definīcijai līgumiem, kas samazina riskus, kuri tieši saistīti ar komercdarbību vai finanšu līdzekļu pārvaldību.
- (18) Noteiktos apstākļos var būt neiespējami ierobežot risku, izmantojot tieši saistītu atvasināto līgumu, proti, līgumu ar to pašu bāzes aktīvu un to pašu norēķinu dienu kā riskam, kas tiek segts. Šādā gadījumā nefinanšu darījuma partneris drīkst īstenot netiešu riska ierobežošanu (*proxy hedging*), riska darījuma segšanai izmantojot cieši saistītu instrumentu, piemēram, instrumentu ar atšķirīgu, bet, no ekonomiskās darbības viedokļa, ļoti tuvu bāzes aktīvu. Turklāt noteiktas nefinanšu darījuma partneru grupas, kas iesaistās ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumos, izmantojot vienu struktūru, sava riska ierobežošanai saistībā ar grupas kopējiem riskiem var izmantot risku makroierobežošanu vai portfeļa risku ierobežošanu. Šie risku makroierobežošanas, portfeļa risku ierobežošanas vai netieša riska ierobežošanas ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumi var tikt uzskatāmi par riska ierobežošanu šajā regulā noteiktajiem mērķiem, un tie būtu jāvērtē atbilstoši kritērijiem, kas paredzēti, lai noteiktu, kuri ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumi objektīvi samazina riskus.
- (19) Risks laika gaitā var mainīties, un, lai piemērotos riska izmaiņām, ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumi, kuri sākotnēji izpildīti, lai samazinātu risku, kas saistīts ar komercdarbību vai finanšu līdzekļu pārvaldību, var būt jālidzvaro, izmantojot papildu ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumus. Tādējādi, riska ierobežošanu var panākt, kombinējot ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumus, tostarp kompensējot ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumus, ar ko izbeidz ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumus, kas vairs nav saistīti ar komercdarbību vai finanšu līdzekļu pārvaldības darbību.
- (20) Ar komercdarbību vai finanšu līdzekļu pārvaldību saistīto risku spektrs ir ļoti plašs un mainās atkarībā no ekonomikas nozares. Ar komercdarbību saistītie riski parasti attiecas uz izlietojumu uzņēmuma ražošanas funkcijā un uzņēmuma ražotajām precēm vai sniegtajiem pakalpojumiem. Finanšu līdzekļu pārvaldības darbības parasti attiecas uz struktūras ilgtermiņa vai īstermiņa finansējuma pārvaldību, tostarp parādsaistību pārvaldību, un to, kā uzņēmums iegulda finanšu resursus, ko tas rada vai kas ir tā turējumā, tostarp naudas līdzekļus. Finanšu līdzekļu pārvaldības darbības vai komercdarbību var ietekmēt vieni un tie paši riska avoti, piemēram, valūtas maiņas likmes, izejvielu cenas, inflācija vai kredītrisks. Ņemot vērā, ka ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumi tiek noslēgti, lai ierobežotu noteiktu risku, analizējot riskus, kas tieši saistīti ar komercdarbību vai finanšu līdzekļu pārvaldības darbību, šie riski jādefinē konsekvēnti attiecībā uz abām darbībām. Turklāt abu jēdzienu nodalīšanai var būt neparedzētas sekas, ņemot vērā, ka atkarībā no nozares, kurā darbojas nefinanšu darījuma partneri, noteiktu risku var ierobežot vai nu saistībā ar komercdarbību, vai saistībā ar finanšu līdzekļu pārvaldības darbību.
- (21) Lai gan tūrvērtēs sliekšņi būtu jānosaka, ievērojot attiecīgo risku sistēmisko nozīmību, ir svarīgi ņemt vērā, ka ārpusbiržas atvasinātie instrumenti, kas samazina riskus, ir izslēgti no tūrvērtēs sliekšņu aprēķina un tūrvērtēs sliekšņi pieļauj izņēmumu tūrvērtēs veikšanas pienākuma principam tiem ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem, attiecībā uz kuriem uzskatāms, ka tie nav noslēgti riska ierobežošanas mērķiem. Konkrētāk, tūrvērtēs sliekšņu vērtības būtu regulāri jāpārskata un jānosaka atbilstīgi ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategorijām. Ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategorijas, kas noteiktas tūrvērtēs sliekšņu mērķim, var atšķirties no ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategorijām tūrvērtēs pienākuma noteikšanas mērķim. Nosakot tūrvērtēs sliekšņu vērtības, pienācīga uzmanība būtu jāpievērš nepieciešamībai definēt vienotu rādītāju, kas atspoguļotu neto pozīciju summas un riska darījumu summas

sistēmisko nozīmi katra darījuma partnera un katras ārpusbiržas atvasināto instrumentu aktīvu kategorijas griezumā. Turklāt, tā kā tīrvērtes sliekšņus izmanto nefinanšu darījuma partneri, tiem vajadzētu būt viegli īstenojamiem.

(22) Tīrvērtes sliekšņu vērtību noteikšanā būtu jāņem vērā katra darījuma partnera un katras ārpusbiržas atvasināto instrumentu kategorijas neto pozīciju un riska darījumu summas sistēmiskā nozīmība atbilstīgi Regulai (ES) Nr. 648/2012. Taču būtu jāpieņem, ka šīs neto pozīcijas un riska darījumi atšķiras no neto riska darījumu apjoma visiem darījumu partneriem un visām aktīvu kategorijām. Turklāt, lai iegūtu datus, kas jāņem vērā tīrvērtes sliekšņu noteikšanā, atbilstīgi Regulas (ES) Nr. 648/2012 noteikumiem šīs neto pozīcijas būtu jāskaita. Tā ir kopējā bruto summa, kas rodas no šo neto pozīciju saskaitīšanas un kura būtu jāņem vērā, nosakot tīrvērtes sliekšņus. Bruto nosacītā vērtība, kas iegūta no šīs saskaitīšanas darbības, būtu jāizmanto ka atsauce, nosakot tīrvērtes sliekšņus.

(23) Turklāt nefinanšu darījuma partneru ar ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem saistīto darbību struktūra parasti rada zemu savstarpējā ieskaita vērtību, jo ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumi ir noslēgti vienā virzienā. Tā rezultātā starpība starp neto pozīcijām un riska darījumiem katram darījuma partnerim un katrai ārpusbiržas atvasināto instrumentu kategorijai ir tuva līgumu bruto vērtībai. Šā iemesla dēļ un nolūkā vienkāršot aprēķinus ārpusbiržas atvasināto instrumentu bruto vērtība būtu izmantojama kā derīgs rādītājs attiecīgajai vērtībai, ko ņem vērā, nosakot tīrvērtes sliekšni.

(24) Tā kā nefinanšu darījuma partneriem, kas nepārsniedz tīrvērtes sliekšni, nav savi ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumi jānovērtē pēc tirgus vērtības, nebūtu pamatoti izmantot šo vērtību, lai noteiktu tīrvērtes sliekšņus, jo tādējādi nefinanšu darījuma partneriem tiktu uzlikts smags slogs, kas nebūtu samērīgs ar novērsto risku. Ja tā vietā izmantotu ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu nosacīto vērtību, tā būtu vienkārša pieeja, kas nav pakļauta nefinanšu darījuma partneru ārējiem notikumiem.

(25) Ja viena no vērtībām, kas noteikta konkrētai ārpusbiržas atvasināto instrumentu kategorijai, pārsniedz sliekšņa vērtību, tam būtu jāizraisa sliekšņa pārsniegšana visās kategorijās; ņemot vērā, ka riskus samazinošie ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumi nav iekļauti tīrvērtes sliekšņa aprēķinā, tīrvērtes sliekšņa pārsniegšanas sekas ir saistītas ne tikai ar tīrvērtes pienākumu, bet attiecas arī uz riska ierobežošanas paņēmieniem, un Regulā (ES) Nr. 648/2012 noteiktajiem attiecīgajiem pienākumiem, kas piemērojami nefinanšu darījuma partneriem, vajadzētu būt vienkāršiem, ņemot vērā, ka lielākajai daļai šo darījuma partneru nav specifisku zināšanu.

(26) Tiem ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, kam neveic tīrvērti, būtu jāpiemēro riska mazināšanas paņēmieni, piemēram, savlaicīga apstiprināšana. Ārpusbiržas atvasināto instrumentu apstiprināšana var būt saistīta ar vienu vai vairākiem vispārējiem nolīgumiem, vispārējiem apstiprināšanas nolīgumiem vai citiem standarta nosacījumiem. Tai var būt elektroniski sagatavots līgums vai dokuments, kuru parakstījuši abi darījuma partneri.

(27) Lai nodrošinātu vienotu izpratni un juridisko noteiktību par darījuma nosacījumiem, ir būtiski, lai darījuma partneri apstiprinātu darījuma nosacījumus, cik ātri vien tas iespējams pēc darījuma izpildes, jo sevišķi, ja darījums ir sagatavots vai apstrādāts elektroniski. Jo īpaši darījuma partneriem, kas iesaistās standarta vai sarežģītos ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumos, var būt nepieciešams ieviest instrumentus, lai nodrošinātu atbilstību prasībai savlaicīgi apstiprināt ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumus. Savlaicīga apstiprināšana paredzētu atbilstošas tirgus prakses veidošanos šajā jomā.

(28) Lai vēl vairāk mazinātu riskus, portfeļu saskaņošana nodrošina iespēju katram darījuma partnerim veikt visaptverošu portfeļa darījumu pārskatīšanu no tā darījuma partnera viedokļa nolūkā nekavējoties konstatēt jebkurus pārpratumus par galvenajiem darījumu nosacījumiem. Šādiem nosacījumiem būtu jāietver katra darījuma vērtējums, un tajā varētu iekļaut arī citas būtiskas ziņas, piemēram, darījuma datumu, paredzēto termiņu, visus maksājumu vai norēķinu datumus, līguma nosacīto vērtību un darījuma valūtu, bāzes instrumentu, darījuma partneru pozīciju, vienošanos par brīvdienās iekrītošajiem maksājumiem un jebkuras būtiskas fiksētās vai mainīgās likmes saistībā ar ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu.

- (29) Ņemot vērā atšķirīgos risku profilus un nolūkā panākt, ka portfeļu saskaņošana ir samērīgs riska mazināšanas paņēmienš, saskaņošanas biežumam un portfeļa lielumam, kas jāņem vērā, vajadzētu atšķirties atkarībā no darījuma partneru veida. Striktākas prasības būtu jāpiemēro gan finanšu, gan nefinanšu darījuma partneriem, kas pārsniedz tīrvērtes sliekšni, bet mazāks saskaņošanas biežums būtu jāattiecinā uz nefinanšu darījuma partneriem, kas nepārsniedz tīrvērtes sliekšni, neatkarīgi no kategorijas, kurai pieder tā darījuma partneris, kuram arī būtu piemērojama šāda retāka saskaņošana attiecībā uz konkrēto portfeļa daļu.
- (30) Arī portfeļu sablīvēšana var būt efektīvs instruments riska mazināšanas nolūkiem atkarībā no tādiem apstākļiem kā portfeļa apjoms ar darījuma partneri, ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu termiņš, mērķis un standartizācijas pakāpe. Finanšu darījuma partneriem un nefinanšu darījuma partneriem, kuriem ir šajā regulā noteikto līmeni pārsniedzošs ārpusbiržas atvasināto instrumentu portfelis, kam CCP nav veicis tīrvērti, vajadzētu būt noteiktām procedūrām portfeļu sablīvēšanas iespēju analīzei, kas tiem ļautu samazināt darījuma partnera kredītrisku.
- (31) Strīdu izšķiršana ir vērsta uz tādu risku mazināšanu, kas rodas no līgumiem, kam tīrvērti neveic centralizēti. Darījuma partneriem, veicot savstarpējus darījumus ar ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, vajadzētu vienoties par sistēmu, kā izšķirt attiecīgos strīdus, ja tādi rodas. Sistēmai vajadzētu saturēt atsauci uz strīdu izšķiršanas mehānismiem, piemēram, trešo pušu arbitražu vai tirgus aptaujas mehānismu. Šādas sistēmas mērķis ir izvairīties no neizšķirtu strīdu padziļināšanās un no darījuma partneru pakļaušanas papildu riskam. Strīdi būtu jākonstatē, jāpārvalda un pienācīgi jāatklāj.
- (32) Nolūkā konstatēt tirgus apstākļus, kas neļauj veikt novērtēšanu pēc tirgus vērtības, ir jānosaka neaktīvie tirgi. Tirgus var būt neaktīvs vairāku iemeslu dēļ, tostarp, ja nenotiek regulāri tirgus darījumi godīgas konkurences apstākļos, kur jēdzienu "godīgas konkurences apstākļos" izprot tāpat kā grāmatvedības vajadzībām.
- (33) Šī regula ir piemērojama finanšu darījuma partneriem un nefinanšu darījuma partneriem, kas pārsniedz tīrvērtes sliekšni, un tajā ņemta vērā Eiropas Parlamenta un Padomes 2006. gada 14. jūnija Direktīva 2006/49/EK par ieguldījumu sabiedrību un kredītiestāžu kapitāla pietiekamību⁽¹⁾, kurā arī noteiktas prasības, kas jāizpilda, veicot novērtēšanu pēc tirgus vērtības.
- (34) Lai gan novērtēšanā pēc modeļa izmantojamā modeļa struktūra var tikt izstrādāta gan iekšēji, gan ārēji, nolūkā nodrošināt pienācīgu pārskatatbildību modeļa apstiprināšanā ir direktoru padomes vai šādas padomes deleģētas komitejas pienākums.
- (35) Ja darījuma partneri var piemērot grupas iekšējo darījumu izņēmumu tūlīt pēc to paziņojuma kompetentajām iestādēm, negaidot šo kompetento iestāžu iebildumu neiesniegšanas perioda beigas, ir svarīgi nodrošināt, ka kompetentās iestādes savlaicīgi saņem atbilstošu un pietiekamu informāciju, lai novērtētu, vai tām būtu jāiebilst pret izņēmuma piemērošanu.
- (36) Grupas iekšējo ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu sagaidāmo lielumu, apjomu un biežumu var noteikt, pamatojoties uz darījuma partneru vēsturiskajiem grupas iekšējiem darījumiem, plānoto modeli un nākotnē sagaidāmo aktivitāti.
- (37) Ja darījuma partneri piemēro grupas iekšējo darījumu izņēmumu, tiem būtu jāpublisko informācija ar mērķi nodrošināt pārskatāmību attiecībā pret tirgus dalībniekiem un potenciālajiem kreditoriem. Tas ir jo īpaši svarīgi darījuma partneru iespējamajiem kreditoriem saistībā ar risku novērtēšanu. Informācijas publiskošanas mērķis ir novērst maldīgo priekšstatu, ka ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem tiek veikta centralizēta tīrvērtē vai uz tiem attiecas riska mazināšanas paņēmieni, gadījumos, kad tas tā nav.
- (38) Attiecībā uz termiņiem savlaicīgas apstiprināšanas panākšanai vajadzīgs ieviešanas darbs, tostarp tirgus prakses maiņa un IT sistēmu uzlabojumi. Ņemot vērā, ka ieviešanas process līdz prasību izpildei var atšķirties atkarībā no darījuma partneru kategorijas un ārpusbiržas atvasināto instrumentu kategorijas, pakāpenisku piemērošanas datumu noteikšana, kuros ņemtas vērā minētās atšķirības, ļautu noteikt agrākus apstiprināšanas termiņus tiem darījuma partneriem un produktiem, kas varētu būt gatavi jau ātrāk.
- (39) Portfeļu saskaņošanai, portfeļu sablīvēšanai vai strīdu izšķiršanai noteiktie standarti paredzētu nepieciešamību darījuma partneriem noteikt procedūras, politiku, procesus un izdarīt grozījumus dokumentācijā, kam būtu vajadzīgs laiks. Saistīto noteikumu stāšanās spēkā būtu jāaizkavē, lai nodrošinātu darījuma partneriem pietiekami daudz laika, lai īstenotu pasākumus atbilstības nodrošināšanai.
- (40) Šī regula ir balstīta uz regulatīvo tehnisko standartu projektu, ko Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestāde iesniegusi Komisijā.

(1) OV L 177, 30.6.2006., 201. lpp.

- (41) Atbilstīgi Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 1095/2010 ⁽¹⁾ 10. pantam EVTI ir veikusi atklātas sabiedriskās apspriešanas par šo regulatīvo tehnisko standartu projektu, izanalizējusi iespējamās saistītās izmaksas un ieguvumus un lūgusi saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 1095/2010 37. pantu izveidotās Eiropas Vērtspāpīru regulatoru komitejas viedokli,

IR PIEŅĒMUSI ŠO REGULU.

I NODAĻA

VISPĀRĪGA INFORMĀCIJA

1. pants

Definīcijas

Šīs regulas nolūkiem piemēro šādas definīcijas:

- a) “netiešs klients” ir tīrvērtes dalībnieka klienta klients;
- b) “netiešas tīrvērtes mehānisms” ir līgumisku attiecību kopums starp centrālo darījuma partneri (CCP), tīrvērtes dalībnieku, tīrvērtes dalībnieka klientu un netiešu klientu, kas ļauj tīrvērtes dalībnieka klientam sniegt tīrvērtes pakalpojumus netiešam klientam;
- c) “apstiprinājums” ir dokuments, kurā darījuma partneri apstiprina savu piekrišanu visiem ārpusbiržas atvasināto instrumentu līguma noteikumiem.

II NODAĻA

NETIEŠAS TĪRVĒRTES MEHĀNISMS

(Regulas (ES) Nr. 648/2012 4. panta 4. punkts)

2. pants

Netiešas tīrvērtes mehānisma struktūra

1. Ja tīrvērtes dalībnieks ir gatavs īstenot netiešas tīrvērtes izmantošanu, jebkuram šāda tīrvērtes dalībnieka klientam ir atļauts nodrošināt netiešas tīrvērtes pakalpojumus vienam vai vairākiem saviem klientiem, ja šis tīrvērtes dalībnieka klients ir licencēta kredītiestāde, ieguldījumu sabiedrība vai līdzvērtīga trešās valsts kredītiestāde vai ieguldījumu sabiedrība.
2. Par netiešas tīrvērtes mehānisma līgumiskajiem nosacījumiem vienojas tīrvērtes dalībnieka klients un netiešais klients pēc apspriešanās ar tīrvērtes dalībnieku par tiem aspektiem, kas var ietekmēt tīrvērtes dalībnieka darbību. Nosacījumos iekļauj līgumiskas prasības klientam izpildīt visus netieša klienta pienākumus pret tīrvērtes dalībnieku. Šīs prasības attiecas tikai uz darījumiem, kas radušies kā netiešas tīrvērtes mehānisma daļa, kura darbības jomu skaidri nosaka noslēgtajos līgumos.

⁽¹⁾ OV L 331, 15.12.2010., 84. lpp.

3. pants

CCP pienākumi

1. Uz netiešas tīrvērtes mehānismu neattiecinā CCP uzņēmējdarbības praksi, kas kavē tā izveidošanu, pamatojoties uz saprātīgiem komerciāliem nosacījumiem. Pēc tīrvērtes dalībnieka pieprasījuma CCP nodrošina atsevišķu datu uzskaiti un kontus, kas ļauj katram klientam CCP uzskaitē atšķirt klienta aktīvus un pozīcijas no klienta netiešo klientu aktīviem un pozīcijām.

2. CCP nosaka, uzrauga un pārvalda visus būtiskos riskus, kas rodas no netiešas tīrvērtes mehānisma un var ietekmēt CCP izturētspēju.

4. pants

Tīrvērtes dalībnieku pienākumi

1. Tīrvērtes dalībnieks, kas piedāvā īstenot netiešas tīrvērtes pakalpojumu sniegšanu, to dara, pamatojoties uz saprātīgiem komerciāliem nosacījumiem. Neskarot konfidencialitāti, kas attiecas uz noteikumiem līgumos ar individuāliem klientiem, tīrvērtes dalībnieks publisko vispārējos nosacījumus, saskaņā ar kuriem tas ir gatavs īstenot netiešas tīrvērtes pakalpojumu sniegšanu. Šajos nosacījumos var ietvert minimālās darbības prasības klientiem, kas sniedz netiešas tīrvērtes pakalpojumus.

2. Īstenojot netiešas tīrvērtes mehānismu, tīrvērtes dalībnieks īsteno jebkuru no šīm nošķiršanas sistēmām atbilstīgi klienta norādījumiem:

- a) uztur atsevišķu datu uzskaiti un kontus, kas ļauj katram klientam tīrvērtes dalībnieka uzskaitē atšķirt klienta aktīvus un pozīcijas no netiešo klientu aktīviem un pozīcijām;
- b) uztur atsevišķu datu uzskaiti un kontus, kas ļauj katram klientam tīrvērtes dalībnieka uzskaitē atšķirt viena netieša klienta aktīvus un pozīcijas no citu netiešu klientu aktīviem un pozīcijām.

3. Prasība veikt aktīvu un pozīciju nošķiršanu tīrvērtes dalībnieka uzskaitē uzskatāma par izpildītu, ja ir izpildīti Regulas (ES) Nr. 648/2012 39. panta 9. punkta nosacījumi.

4. Tīrvērtes dalībnieks izveido pilnvērtīgas procedūras, lai pārvaldītu klienta, kas sniedz netiešas tīrvērtes pakalpojumus, saistību neizpildi. Šīs procedūras ietver stabilu mehānismu pozīciju un aktīvu nodošanai alternatīvam klientam vai tīrvērtes dalībniekam atkarībā no tā, kāda ir vienošanās ar klientiem, kurus šī situācija ir skārusi. Klientam vai tīrvērtes dalībniekam nav pienākuma pieņemt šīs pozīcijas, izņemot, ja par to ir bijusi iepriekšēja līgumiska vienošanās.

5. Tīrvērtes dalībnieks arī garantē, ka tā procedūras dod iespēju nekavējoties likvidēt netiešo klientu aktīvus un pozīcijas un tīrvērtes dalībniekam pēc klienta saistību neizpildes ļauj veikt visus pienākošos naudas maksājumus netiešajiem klientiem.

6. Tīrvērtes dalībnieks nosaka, uzrauga un pārvalda visus riskus, kas rodas no netiešas tīrvērtes mehānisma īstenošanas, tostarp izmantojot informāciju, ko klienti snieguši saskaņā ar 4. panta 3. punktu. Tīrvērtes dalībnieks izveido pilnvērtīgas iekšējās procedūras nolūkā garantēt, ka šī informācija nevar tikt izmantota komerciāliem mērķiem.

5. pants

Klientu pienākumi

1. Klients, kas sniedz netiešas tīrvērtes pakalpojumus, nodrošina atsevišķu datu uzskaiti un kontus, kas ļauj atšķirt tā paša aktīvus un pozīcijas no tā netiešo klientu aktīviem un pozīcijām. Tas netiešajiem klientiem piedāvā izvēli starp alternatīvajām kontu nošķiršanas iespējām, kas raksturotas 4. panta 2. punktā, un garantē, ka klienti ir pilnībā informēti par riskiem, kas saistīti ar katru nošķiršanas iespēju. Informācija, ko klients sniedz netiešiem klientiem, ietver ziņas par sistēmu, kas izveidota pozīciju un kontu nodošanai alternatīvam klientam.

2. Klients, kas sniedz netiešas tīrvērtes pakalpojumus, iesniedz pieprasījumu tīrvērtes dalībniekam atvērt nošķirtu kontu CCP. Konts paredzēts vienīgi mērķim nodrošināt tā netiešo klientu aktīvu un pozīciju turējumu.

3. Klients tīrvērtes dalībniekam sniedz pietiekamu informāciju, lai noteiktu, uzraudzītu un pārvaldītu visus riskus, kas rodas no netiešas tīrvērtes mehānisma īstenošanas. Klienta saistību neizpildes gadījumā visu klienta rīcībā esošo informāciju, kas attiecas uz tā netiešajiem klientiem, nekavējoties dara pieejamu tīrvērtes dalībniekam.

III NODAĻA

PAZIŅOJUMS EVTI TĪRVĒRTES PIENĀKUMA MĒRĶIEM

(Regulas (ES) Nr. 648/2012 5. panta 1. punkts)

6. pants

Paziņojumā iekļaujamās ziņas

1. Paziņojumā tīrvērtes pienākuma mērķim ietver šādu informāciju:

- a) norādi par ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategoriju;
- b) norādi par ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategorijā;

c) citu informāciju, kas iekļaujama publiskajā reģistrā atbilstīgi 8. panta noteikumiem;

d) papildu raksturojumu, kas nepieciešams, lai atšķirtu ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumus vienā kategorijā no ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem ārpus šīs kategorijas;

e) pierādījumus par attiecīgās ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategorijas darbības procesu un līguma noteikumu standartizācijas pakāpi;

f) datus par ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategorijas apjomu;

g) datus par ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategorijas likviditāti;

h) pierādījumus par godīgas, uzticamas un vispārpieņemtas cenu informācijas pieejamību tirgus dalībniekiem attiecībā uz ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategoriju;

i) pierādījumus par tīrvērtes pienākuma ietekmi uz cenu informācijas pieejamību tirgus dalībniekiem.

2. Nolūkā novērtēt dienu vai dienas, no kuras(-ām) stājas spēkā tīrvērtes pienākums, tostarp jebkuru pakāpeniskas īstenošanas periodu, un arī darījumu partneru kategorijas, uz kurām attiecas pienākums veikt tīrvērti, paziņojumā tīrvērtes pienākuma mērķim iekļauj:

a) datus, kas ir svarīgi, lai novērtētu paredzamo ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategorijas apjomu, ja uz to sāk attiecināt tīrvērtes pienākumu;

b) pierādījumus par CCP spēju tikt galā ar paredzamo ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategorijas apjomu, ja uz to sāk attiecināt tīrvērtes pienākumu, un spēju pārvaldīt risku, kas rodas no attiecīgās ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategorijas tīrvērtes, tostarp ar klientu vai netiešu klientu tīrvērtes pakalpojumu starpniecību;

c) ziņas par to darījumu partneru veidu un skaitu, kuri ir aktīvi vai, sagaidāms, būs aktīvi attiecīgās ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategorijas tirgū, ja uz to sāk attiecināt tīrvērtes pienākumu;

- d) uzskaitījumu ar tiem pienākumiem, kas jāveic, lai varētu uzsākt tīrvērti ar CCP, norādot arī katra pienākuma izpildei vajadzīgo laiku;
- e) informāciju par attiecīgās ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategorijas tirgū aktīvo darījuma partneru risku pārvaldību, juridisko un darbības kapacitāti, ja uz šo kategoriju sāk attiecināt tīrvērtes pienākumu.

3. Datos par apjomu un likviditāti attiecībā uz katru ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategoriju un katru atvasināto instrumentu šajā kategorijā iekļauj būtisko tirgus informāciju, tostarp vēsturiskos datus, pašreizējos datus un jebkuras izmaiņas, kuras sagaidāmas, ja uz attiecīgo ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategoriju sāk attiecināt tīrvērtes pienākumu, proti:

- a) darījumu skaitu;
- b) kopējo apjomu;
- c) kopējo atvērto pozīciju apjomu;
- d) izpildāmo rīkojumu līmeni, tostarp vidējo rīkojumu skaitu un cenu piedāvājumu pieprasījumu skaitu;
- e) cenu starpību apmēru (*tightness of spreads*);
- f) likviditātes pasākumus saspringtos tirgus apstākļos;
- g) likviditātes pasākumus saistību neizpildes procedūru īstenošanai.

4. Informācija, kas saistīta ar darbības procesu un līguma nosacījumu standartizācijas pakāpi attiecīgajā 1. punkta e) apakšpunktā minētajā ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategorijā attiecībā uz katru ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategoriju un katru ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu šajā kategorijā, ietver datus par dienas atsaucē cenu un par dienu skaitu gadā ar tādu atsaucē cenu, kas uzskatāma par uzticamu vismaz pēdējo divpadsmit mēnešu laikā.

IV NODAĻA

KRITĒRIJI TO ĀRPUSBIRŽAS ATVASINĀTO INSTRUMENTU LĪGUMU KATEGORIJU NOTEIKŠANAI, UZ KURĀM ATTIECAS TĪRVĒRTES PIENĀKUMS

(Regulas (ES) Nr. 648/2012 5. panta 4. punkts)

7. pants

Kritēriji, kurus novērtē EVTI

1. Attiecībā uz attiecīgās ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategorijas darbības procesu un līguma noteikumu standartizācijas pakāpi Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestāde (EVTI) ņem vērā:

- a) to, vai attiecīgās ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategorijas līguma noteikumos ir iekļauta kopēja juridiskā dokumentācija, tostarp vispārēji nolīgumi par savstarpēju ieskaitu, definīcijas, standarta nosacījumi un apstiprinājumi, kuros noteikti līguma noteikumi, kurus parasti izmanto darījuma partneri;
- b) to, vai uz attiecīgās ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategorijas darbības procesiem attiecas automatizēta pēctirdzniecības apstrāde un turpmākie dzīves cikla notikumi, ko pārvalda kopīgi saskaņā ar grafiku, par kuru darījuma partneri savstarpēji vienojušies.

2. Attiecībā uz attiecīgās ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategorijas apjomu un likviditāti EVTI ņem vērā:

- a) to, vai CCP noteiktās drošības rezerves vai finansiālās prasības būtu samērīgas ar risku, ko paredzēts mazināt ar tīrvērtes pienākuma palīdzību;
- b) tirgus apjoma un dziļuma stabilitātes noturību laika gaitā attiecībā uz produktu;
- c) iespējamību, ka tīrvērtes dalībnieka saistību neizpildes gadījumā tirgus izkļiede saglabātos pietiekama;
- d) darījumu skaitu un vērtību.

3. Attiecībā uz godīgu, uzticamu un vispārpieņemtu cenu informāciju attiecīgajā ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategorijā EVTI ņem vērā to, vai informācija, kas vajadzīga, lai precīzi noteiktu līgumu cenu attiecīgajā ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategorijā, tirgus dalībniekiem ir viegli pieejama, balstoties uz pamatotiem komerciāliem nosacījumiem, un to, vai tā arī turpmāk būs viegli pieejama, ja uz attiecīgo ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategoriju sāks attiecināt tīrvērtes pienākumu.

V NODAĻA

PUBLISKAIS REĢISTRS

(Regulas (ES) Nr. 648/2012 6. panta 4. punkts)

8. pants

EVTI reģistrā iekļaujamie dati

1. EVTI publiskajā reģistrā attiecībā uz katru ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategoriju, uz kuru attiecas tīrvērtes pienākums, norāda:

- a) ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu aktīvu kategoriju;

- b) ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu veidu šajā kategorijā;
- c) ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu bāzes aktīvus šajā kategorijā;
- d) attiecībā uz bāzes aktīviem, kas ir finanšu instrumenti: norādi, vai bāzes aktīvs ir viens finanšu instruments vai emitents vai arī indekss vai portfelis;
- e) attiecībā uz citiem bāzes aktīviem: norādi par šo bāzes aktīvu kategoriju;
- f) nosacītās un norēķinu valūtas ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem šajā kategorijā;
- g) ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu termiņu diapazonu šajā kategorijā;
- h) ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu norēķinu nosacījumus šajā kategorijā;
- i) ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu maksājumu biežuma diapazonu šajā kategorijā;
- j) attiecīgās ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategorijas produkta identifikatoru;
- k) jebkuras citas pazīmes, kas vajadzīgas, lai atšķirtu vienu attiecīgās ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu kategorijas līgumu no citiem.

2. Attiecībā uz CCP, kas saņēmis atļauju vai atzīts tīrvērtes pienākuma mērķiem, EVTI publiskajā reģistrā par katru CCP norāda:

- a) identifikācijas kodu atbilstīgi Komisijas Īstenošanas regulas (ES) Nr. 1247/2012 ⁽¹⁾ 3. pantam;
- b) pilnu nosaukumu;
- c) valsti, kurā ir tā galvenā uzņēmējdarbības vieta;
- d) kompetento iestādi, kas norīkota saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 22. panta noteikumiem.

3. Attiecībā uz dienām, no kurām tīrvērtes pienākums stājas spēkā, tostarp pakāpeniskas ieviešanas gadījumā, EVTI publiskajā reģistrā norāda:

- a) darījuma partneru kategorijas, uz kurām attiecas katrs pakāpeniskas ieviešanas periods;

- b) jebkuru citu nosacījumu, kas, lai būtu piemērojams pakāpeniskas ieviešanas periods, jāizpilda saskaņā ar regulatīvajiem tehniskajiem standartiem, kas pieņemti atbilstīgi Regulas (ES) Nr. 648/2012 5. panta 2. punkta noteikumiem.

4. EVTI publiskajā reģistrā ietver atsauci uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem, kas pieņemti atbilstīgi Regulas (ES) Nr. 648/2012 5. panta 2. punktam un saskaņā ar kuriem noteikts tīrvērtes pienākums.

5. Attiecībā uz CCP, par kuru kompetenta iestāde paziņojusi EVTI, EVTI publiskajā reģistrā norāda vismaz:

- a) CCP identifikatoru;
- b) aktīvu kategoriju ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem, par kuriem paziņots;
- c) ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu veidu;
- d) paziņojuma datumu;
- e) paziņojuma sniedzējas kompetentās iestādes identifikatoru.

VI NODAĻA

LIKVIDITĀTES SADRUMSTALOTĪBA

(Regulas (ES) Nr. 648/2012 8. panta 5. punkts)

9. pants

Likviditātes sadrumstalotības koncepcijas konkretizējums

1. Uzskatāms, ka likviditātes sadrumstalotība rodas, ja tirdzniecības vietas dalībnieki nespēj noslēgt darījumu ar vienu vai vairākiem citiem dalībniekiem šajā tirdzniecības vietā, jo nav izveidots tīrvērtes mehānisms, kas būtu pieejams visiem dalībniekiem.

2. Nav uzskatāms, ka CCP pieeja tirdzniecības vietai, kuru jau apkalpo cits CCP, rada likviditātes sadrumstalotību tirdzniecības vietā, ja bez vajadzības noteikt sākotnējā CCP tīrvērtes dalībniekiem prasību kļūt par tīrvērtes dalībniekiem CCP, kas iesniedzis pieprasījumu, visi tirdzniecības vietas dalībnieki var tieši vai netieši veikt tīrvērti, izmantojot kādu no šiem:

- a) vismaz vienu kopēju CCP;
- b) CCP izveidotos tīrvērtes mehānismus.

3. Mehānismus, lai izpildītu 2. punkta a) vai b) apakšpunkta nosacījumus, nosaka, pirms CCP, kas iesniedzis pieprasījumu, uzsāk tīrvērtes pakalpojumu sniegšanu attiecīgajai tirdzniecības vietai.

4. Pieeju kopējam CCP, kā noteikts 2. punkta a) apakšpunktā, var izveidot ar divu vai vairāku tīrvērtes dalībnieku, divu vai vairāku klientu vai netiešu tīrvērtes mehānismu starpniecību.

⁽¹⁾ OV L 352, 21.12.2012., 20. lpp.

5. Tīrvērtes mehānismā, kas minēts 2. punkta b) apakšpunktā, var paredzēt šādu tirgus dalībnieku izpildīto darījumu pārcelšanu uz citu CCP tīrvērtes dalībniekiem. Lai gan CCP pieejai tirdzniecības vietai nebūtu vajadzīga sadarbība, sadarbības sistēma, par kuru vienojušies attiecīgie CCP un ko apstiprinājušas attiecīgās kompetentās iestādes, var tikt izmantota, lai izpildītu prasību par pieeju vienotam tīrvērtes mehānismam.

VII NODAĻA

NEFINANŠU DARĪJUMA PARTNERI

10. pants

(Regulas (ES) Nr. 648/2012 10. panta 4. punkta a) apakšpunkts)

Kritēriji, lai noteiktu, kuri ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumi objektīvi samazina riskus

1. Uzskatāms, ka ārpusbiržas atvasināto instrumentu līguma risku samazināšanas ietekme attiecībā uz riskiem, kas tieši saistīti ar nefinanšu darījuma partnera vai tā grupas komercdarbību vai finanšu līdzekļu pārvaldību, ir objektīvi izmērāma, ja šis līgums pats par sevi vai kombinācijā ar citiem atvasināto instrumentu līgumiem un tieši vai ar cieši saistītu instrumentu starpniecību atbilst vienam no šiem nosacījumiem:

- a) tas sedz riskus, kas rodas no potenciālajām izmaiņām aktīvos, pakalpojumos, izlietojumā, produktos, izejvielās vai saistībās, kas pieder darījuma partnerim vai tā grupai vai ko darījuma partneris vai tā grupa ražo, izgatavo, pārstrādā, nodrošina, pērk, izplata, iznomā, pārdod vai izmanto, vai plāno iegūt īpašumā, ražot, izgatavot, pārstrādāt, nodrošināt, pirkt, izplatīt, iznomāt, pārdot vai izmantot parastā uzņēmējdarbības gaitā;
- b) tas sedz riskus, kas rodas no potenciālās netiešās ietekmes uz a) apakšpunktā minēto aktīvu, pakalpojumu, izlietojuma, produktu, izejvielu vai saistību vērtību procentu likmju, inflācijas, valūtas maiņas likmju vai kredītriska svārstību rezultātā;
- c) tas ir atzīstams par riska ierobežošanas līgumu atbilstīgi Starptautiskajiem finanšu pārskatu standartiem (SFPS), kas pieņemti atbilstīgi Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (EK) Nr. 1606/2002 ⁽¹⁾ 3. panta noteikumiem.

11. pants

(Regulas (ES) Nr. 648/2012 10. panta 4. punkta b) apakšpunkts)

Tīrvērtes sliekšņi

Tīrvērtes sliekšņu vērtības tīrvērtes pienākuma mērķiem ir:

- a) bruto nosacītā vērtība EUR 1 miljards ārpusbiržas kredīta atvasināto instrumentu līgumiem;

- b) bruto nosacītā vērtība EUR 1 miljards ārpusbiržas kapitāla atvasināto instrumentu līgumiem;
- c) bruto nosacītā vērtība EUR 3 miljardi ārpusbiržas procentu likmju atvasināto instrumentu līgumiem;
- d) bruto nosacītā vērtība EUR 3 miljardi ārpusbiržas valūtas maiņas likmju atvasināto instrumentu līgumiem;
- e) bruto nosacītā vērtība EUR 3 miljardi ārpusbiržas preču atvasināto instrumentu līgumiem un citiem ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem, kas nav minēti a)–d) apakšpunktā.

VIII NODAĻA

RISKA IEROBEŽOŠANAS PAŅĒMIENI ĀRPUSBIRŽAS ATVASINĀTO INSTRUMENTU LĪGUMIEM, KAM CCP NEVEIC TĪRVĒRTI

12. pants

(Regulas (ES) Nr. 648/2012 11. panta 14. punkta a) apakšpunkts)

Savlaicīga apstiprināšana

1. Ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu, kas noslēgts starp Regulas (ES) Nr. 648/2012 10. pantā minētajiem finanšu darījuma partneriem vai nefinanšu darījuma partneriem un kuram CCP neveic tīrvērti, apstiprina elektroniskā veidā, ja vien tas iespējams, to darot pēc iespējas ātrāk un vēlākais:
- a) attiecībā uz kredītriska mijmaiņas darījumu līgumiem un procentu likmju mijmaiņas darījumu līgumiem, kas noslēgti līdz 2014. gada 28. februārim, – līdz otrās darbdienas beigām pēc ārpusbiržas atvasināto instrumentu līguma izpildes;
 - b) attiecībā uz kredītriska mijmaiņas darījumu līgumiem un procentu likmju mijmaiņas darījumu līgumiem, kas noslēgti pēc 2014. gada 28. februāra, – līdz nākamās darbdienas beigām pēc ārpusbiržas atvasināto instrumentu līguma izpildes;
 - c) attiecībā uz kapitāla mijmaiņas darījumu līgumiem, valūtas maiņas likmju mijmaiņas darījumu līgumiem, preču mijmaiņas darījumu līgumiem un visiem citiem atvasinātajiem instrumentiem, kas nav minēti a) apakšpunktā un kas noslēgti līdz 2013. gada 31. augustam ieskaitot, – līdz trešās darbdienas beigām pēc ārpusbiržas atvasināto instrumentu līguma izpildes;
 - d) attiecībā uz kapitāla mijmaiņas darījumu līgumiem, valūtas maiņas likmju mijmaiņas darījumu līgumiem, preču mijmaiņas darījumu līgumiem un visiem citiem atvasinātajiem instrumentiem, kas nav minēti a) apakšpunktā un kas noslēgti pēc 2013. gada 31. augusta līdz 2014. gada 31. augustam ieskaitot, – līdz otrās darbdienas beigām pēc ārpusbiržas atvasināto instrumentu līguma izpildes;

⁽¹⁾ OV L 243, 11.9.2002., 1. lpp.

e) attiecībā uz kapitāla mijmaiņas darījumu līgumiem, valūtas maiņas likmju mijmaiņas darījumu līgumiem, preču mijmaiņas darījumu līgumiem un visiem citiem atvasinātajiem instrumentiem, kas nav minēti a) apakšpunktā un kas noslēgti pēc 2014. gada 31. augusta, – līdz nākamās darbdienu beigām pēc ārpusbiržas atvasināto instrumentu līguma izpildes.

2. Ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu, kas noslēgti ar nefinanšu darījuma partneri, kas nav minēts Regulas (ES) Nr. 648/2012 10. pantā, apstiprina elektroniskā veidā, ja vien tas iespējams, to darot pēc iespējas ātrāk un vēlākais:

a) attiecībā uz kredītriska mijmaiņas darījumu līgumiem un procentu likmju mijmaiņas darījumu līgumiem, kas noslēgti līdz 2013. gada 31. augustam ieskaitot, – līdz piektās darbdienu beigām pēc ārpusbiržas atvasināto instrumentu līguma izpildes;

b) attiecībā uz kredītriska mijmaiņas darījumu līgumiem un procentu likmju mijmaiņas darījumu līgumiem, kas noslēgti pēc 2013. gada 31. augusta līdz 2014. gada 31. augustam ieskaitot, – līdz trešās darbdienu beigām pēc ārpusbiržas atvasināto instrumentu līguma izpildes;

c) attiecībā uz kredītriska mijmaiņas darījumu līgumiem un procentu likmju mijmaiņas darījumu līgumiem, kas noslēgti pēc 2014. gada 31. augusta, – līdz otrās darbdienu beigām pēc ārpusbiržas atvasināto instrumentu līguma izpildes;

d) attiecībā uz kapitāla mijmaiņas darījumu līgumiem, valūtas maiņas likmju mijmaiņas darījumu līgumiem, preču mijmaiņas darījumu līgumiem un visiem citiem atvasinātajiem instrumentiem, kas nav minēti a) apakšpunktā un kas noslēgti līdz 2013. gada 31. augustam ieskaitot, – līdz septītās darbdienu beigām pēc ārpusbiržas atvasināto instrumentu līguma izpildes;

e) attiecībā uz kapitāla mijmaiņas darījumu līgumiem, valūtas maiņas likmju mijmaiņas darījumu līgumiem, preču mijmaiņas darījumu līgumiem un visiem citiem atvasinātajiem instrumentiem, kas nav minēti a) apakšpunktā un kas noslēgti no 2013. gada 31. augusta līdz 2014. gada 31. augustam ieskaitot, – līdz ceturtais darbdienu beigām pēc ārpusbiržas atvasināto instrumentu līguma izpildes;

f) attiecībā uz kapitāla mijmaiņas darījumu līgumiem, valūtas maiņas likmju mijmaiņas darījumu līgumiem, preču mijmaiņas darījumu līgumiem un visiem citiem atvasinātajiem instrumentiem, kas nav minēti a) apakšpunktā un kas noslēgti pēc 2014. gada 31. augusta, – līdz otrās darbdienu beigām pēc ārpusbiržas atvasināto instrumentu līguma izpildes.

3. Ja 1. vai 2. punktā minētais darījums ir noslēgts pēc plkst. 16.00 pēc vietējā laika vai ar darījuma partneri, kas atrodas citā laika zonā, un tas neļauj nodrošināt apstiprinājumu līdz noteiktajam termiņam, apstiprinājumu veic iespējami ātrāk un vēlākais vienu darbdienu pēc attiecīgajiem 1. vai 2. punktā noteiktajiem termiņiem.

4. Finanšu darījuma partneriem ir izveidota vajadzīga procedūra, lai saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvas 2004/39/EK ⁽¹⁾ 48. pantu norīkotajai kompetentajai iestādei katru mēnesi sniegtu ziņojumu par neapstiprināto šā panta 1. un 2. punktā minēto ārpusbiržas atvasināto instrumentu darījumu skaitu, kuru apstiprinājums kavējas ilgāk nekā piecas darbdienu.

13. pants

(Regulas (ES) Nr. 648/2012 11. panta 14. punkta a) apakšpunkts)

Portfeļu saskaņošana

1. Gan finanšu, gan nefinanšu darījuma partneri, kas iesaistījušies ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumā, rakstiskā vai tai līdzvērtīgā elektroniskā formā ar katru no saviem darījuma partneriem vienojas par kārtību, kādā notiek portfeļu saskaņošana. Šāda vienošanās panākama pirms iesaistīšanās ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumā.

2. Portfeļu saskaņošanu vienam ar otru veic vai nu darījuma partneri, kas iesaistījušies ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumos, vai arī kvalificēta trešā puse, ko šim uzdevumam attiecīgi pilnvarojis darījuma partneris. Portfeļu saskaņošana attiecas uz būtiskajiem tirdzniecības nosacījumiem, kas identificē katru konkrēto ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu, un ietver vismaz vērtējumu, kas noteikts katram līgumam atbilstīgi Regulas (ES) Nr. 648/2012 11. panta 2. punktam.

3. Nolūkā jau pašā sākumposmā konstatēt pretrunas būtiskajos ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu nosacījumos, tostarp noteiktajā vērtībā, portfeļu saskaņošanu veic šādi:

a) finanšu darījuma partnerim vai nefinanšu darījuma partnerim, kas minēts Regulas (ES) Nr. 648/2012 10. pantā:

i) katru darbdienu, ja darījuma partneriem savstarpēji ir vismaz 500 neizpildīti ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumi;

ii) vienu reizi nedēļā, ja darījuma partneriem šīs nedēļas laikā jebkurā brīdī savstarpēji ir 51 līdz 499 neizpildīti ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumi;

iii) vienu reizi ceturksnī, ja darījuma partneriem šā ceturksņa laikā jebkurā brīdī savstarpēji ir 50 vai mazāk neizpildīti ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumi;

⁽¹⁾ OV L 145, 30.4.2004., 1. lpp.

b) finanšu darījuma partnerim vai nefinanšu darījuma partnerim, kas nav minēts Regulas (ES) Nr. 648/2012 10. pantā:

i) vienu reizi ceturksnī, ja darījuma partneriem šā ceturksņa laikā jebkurā brīdī savstarpēji ir vairāk nekā 100 neizpildīti ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumi;

ii) vienu reizi gadā, ja darījuma partneriem savstarpēji ir 100 vai mazāk neizpildīti ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumi.

14. pants

(Regulas (ES) Nr. 648/2012 11. panta 14. punkta a) apakšpunkts)

Portfeļu sablīvēšana

Finanšu darījuma partneriem un nefinanšu darījuma partneriem, kuriem ar darījuma partneri ir vismaz 500 neizpildīti ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumi, kuriem neveic centralizētu tīrvērti, izveido procedūras, lai regulāri un vismaz divas reizes gadā analizētu iespēju veikt portfeļu sablīvēšanu nolūkā samazināt darījuma partnera kredītrisku un iesaistīties šādā portfeļu sablīvēšanā.

Finanšu darījuma partneri un nefinanšu darījuma partneri garantē, ka tie kompetentajai iestādei spēj nodrošināt ticamu un pamatotu skaidrojumu secinājumam, ka portfeļu sablīvēšana nav piemērota.

15. pants

(Regulas (ES) Nr. 648/2012 11. panta 14. punkta a) apakšpunkts)

Strīdu izšķiršana

1. Savstarpēji noslēdzot ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumus, finanšu darījuma partneri un nefinanšu darījuma partneri ir vienojušies par detalizētām procedūrām un procesiem attiecībā uz:

a) tādu strīdu konstatēšanu, reģistrēšanu un uzraudzību, kas saistīti ar līgumu atzīšanu vai to vērtības noteikšanu un nodrošinājumu apmaiņu starp darījuma partneriem. Ar šo procedūru starpniecību reģistrē vismaz laiku, cik ilgi strīds ir neizšķirts, strīdā iesaistītos darījuma partnerus un summu, par kuru ir strīds;

b) savlaicīgu strīdu izšķiršanu, paredzot atsevišķu procesu tiem strīdiem, kuri netiek izšķirti piecu darbdienu laikā.

2. Finanšu darījuma partneri kompetentajai iestādei, kas norīkota saskaņā ar Direktīvas 2004/39/EK 48. pantu, ziņo par visiem strīdiem starp darījuma partneriem attiecībā uz ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem, to noteikto vērtību

vai nodrošinājuma apmaiņu par summu vai vērtību, kas pārsniedz EUR 15 miljonus, un kuri nav izpildīti vismaz 15 darbdienu laikā.

16. pants

(Regulas (ES) Nr. 648/2012 11. panta 14. punkta b) apakšpunkts)

Tirgus apstākļi, kas neļauj veikt novērtēšanu pēc tirgus vērtības

1. Uzskatāms, ka tirgus apstākļi, kas neļauj veikt ārpusbiržas atvasināto instrumentu līguma novērtēšanu pēc tirgus vērtības, ir iestājušies, ja:

a) tirgus nav aktīvs;

b) ticamu patieso vērtību aplēšu diapazons ir ievērojams un šīm dažādajām aplēsēm nav iespējams ticamā veidā noteikt varbūtības.

2. Ārpusbiržas atvasināto instrumentu līguma tirgus uzskatāms par neaktīvu, ja kotētās cenas nav nekavējoties un regulāri pieejamas un pieejamās cenas neatspoguļo faktiskus un regulāri notiekošus tirgus darījumus godīgas konkurences apstākļos.

17. pants

(Regulas (ES) Nr. 648/2012 11. panta 14. punkta b) apakšpunkts)

Kritēriji vērtēšanai pēc modeļa

Lai varētu izmantot vērtēšanu pēc modeļa, finanšu un nefinanšu darījuma partneriem ir modelis:

a) kas ietver visus faktoros, ko darījuma partneri ņemtu vērā cenas noteikšanā, tostarp iespējami plašāku vērtēšanas pēc tirgus vērtības informācijas izmantošanu;

b) kas atbilst pieņemtajām finanšu instrumentu cenu noteikšanas ekonomiskajām metodoloģijām;

c) kas ir kalibrēts un testēts nolūkā noteikt tā derīgumu, izmantojot cenu informāciju no visiem novērojamiem pašreizējiem tirgus darījumiem ar tādiem pašiem instrumentiem vai pamatojoties uz jebkuriem pieejamiem novērojamiem tirgus datiem;

d) ko ir apstiprinājusi un neatkarīgi kontrolē struktūrvienība, kas nav tā pati, kas uzņemas risku;

e) ko, cik bieži vien nepieciešams un pēc visām būtiskām izmaiņām, un vismaz reizi gadā, pienācīgi dokumentē un apstiprina direktoru padome. Šo apstiprināšanu iespējams deleģēt komitejai.

18. pants

(Regulas (ES) Nr. 648/2012 11. panta 14. punkta c) apakšpunkts)

Grupas iekšējā darījuma informācijas paziņojums kompetentajai iestādei

1. Pieteikums vai paziņojums kompetentajai iestādei par grupas iekšējā darījuma informāciju iesniedzams rakstiski, un tajā ietver:

- a) ziņas par darījumu juridiskajiem partneriem, tostarp to identifikācijas kodus atbilstīgi Īstenošanas regulas (ES) Nr. 1247/2012 3. pantam;
- b) ziņas par korporatīvajām attiecībām starp darījuma pusēm;
- c) ziņas par papildu līgumiskajām saistībām starp darījuma pusēm;
- d) ziņas par grupas iekšējā darījuma kategoriju, kā noteikts Regulas (ES) Nr. 648/2012 3. panta 1. punktā un 2. punkta a)–d) apakšpunktā;
- e) ziņas par darījumiem, par kuriem darījuma partneris pretendē uz izņēmuma piemērošanu, tostarp:
 - i) ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu aktīvu kategoriju;
 - ii) ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu veidu;
 - iii) bāzes aktīvu veidu;
 - iv) nosacīto un norēķinu valūtu;
 - v) diapazonu līdz beigu termiņam atlikušajiem līgumu periodiem;
 - vi) norēķinu veidu;
 - vii) ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu sagaidāmo lielumu, apjomu un biežumu gadā.

2. Kā daļu no pieteikuma vai paziņojuma attiecīgajai kompetentajai iestādei darījuma partneris iesniedz arī papildu informāciju, kas apliecina, ka ir izpildīti Regulas (ES) Nr. 648/2012 11. panta 6.–10. punkta nosacījumi. Papilddokumenti ietver: dokumentu riska pārvaldības procedūru kopijas, vēsturisku darījumu informāciju, attiecīgo starp pusēm noslēgto līgumu kopijas, turklāt pēc kompetentās iestādes pieprasījuma var būt jāpievieno juridisks atzinums.

19. pants

(Regulas (ES) Nr. 648/2012 11. panta 14. punkta d) apakšpunkts)

Grupas iekšējā darījuma informācijas paziņojums EVTI

1. Kompetentā iestāde grupas iekšējā darījuma informācijas paziņojumu EVTI iesniedz rakstiskā formā:

a) viena mēneša laikā no paziņojuma saņemšanas attiecībā uz paziņojumu, kas minēts Regulas (ES) Nr. 648/2012 11. panta 7. punktā vai 11. panta 9. punktā;

b) viena mēneša laikā no lēmuma paziņošanas darījuma partnerim attiecībā uz kompetentās iestādes lēmumu saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 11. panta 6. punktu, 11. panta 8. punktu vai 11. panta 10. punktu.

2. Paziņojumā EVTI ietver:

- a) informāciju, kas norādīta 18. pantā;
- b) norādi par to, vai lēmums ir pozitīvs vai negatīvs;
- c) pozitīva lēmuma gadījumā:
 - i) kopsavilkumu iemesliem, kas ļauj uzskatīt, ka Regulas (ES) Nr. 648/2012 11. panta 6. punkta, 11. panta 7. punkta, 11. panta 8. punkta, 11. panta 9. punkta vai 11. panta 10. punkta nosacījumi ir izpildīti;
 - ii) norādi, vai izņēmums ir pilnīgs izņēmums vai daļējs izņēmums attiecībā uz paziņojumu saistībā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 11. panta 6. punktu, 11. panta 8. punktu vai 11. panta 10. punktu;
- d) negatīva lēmuma gadījumā:
 - i) norādi par piemērojamajiem Regulas (ES) Nr. 648/2012 11. panta 6. punkta, 11. panta 7. punkta, 11. panta 8. punkta, 11. panta 9. punkta vai 11. panta 10. punkta nosacījumiem, kas nav izpildīti;
 - ii) kopsavilkumu iemesliem, kas ļauj uzskatīt, ka šie nosacījumi nav izpildīti.

20. pants

(Regulas (ES) Nr. 648/2012 11. panta 14. punkta d) apakšpunkts)

Par grupas iekšējo izņēmumu publiskojamā informācija

Par grupas iekšējo izņēmumu publiskojamajā informācijā ietver:

- a) ziņas par darījumu juridiskajiem partneriem, tostarp to identifikācijas kodus atbilstīgi Īstenošanas regulas (ES) Nr. 1247/2012 3. pantam;
- b) ziņas par attiecībām starp darījuma partneriem;
- c) norādi par to, vai izņēmums ir pilnīgs izņēmums vai daļējs izņēmums;
- d) nosacīto kopējo ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu vērtību, uz kuriem attiecas grupas iekšējais izņēmums.

21. pants

Stāšanās spēkā un piemērošana

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

Regulas 13., 14. un 15. pantu sāk piemērot sešus mēnešus pēc šīs regulas stāšanās spēkā.

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

Briselē, 2012. gada 19. decembrī

Komisijas vārdā –
priekšsēdētājs
José Manuel BARROSO

KOMISIJAS DELEĢĒTĀ REGULA (ES) Nr. 150/2013**(2012. gada 19. decembris),**

ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 648/2012 par ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, centrālajiem darījumu partneriem un darījumu reģistriem attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem, kuros precizētas ziņas, kas iekļaujamās darījumu reģistra reģistrācijas pieteikumā

(Dokuments attiecas uz EEZ)

EIROPAS KOMISIJA,

ņemot vērā Līgumu par Eiropas Savienības darbību,

ņemot vērā Eiropas Centrālās Bankas atzinumu ⁽¹⁾,

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 ⁽²⁾ un jo īpaši tās 56. panta 3. punktu,

tā kā:

- (1) Ir jānosaka noteikumi, kas precizē informāciju, kura jāsniedz Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestādei (EVTI) kā daļa no darījumu reģistra reģistrācijas pieteikuma.
- (2) Jebkurai personai, kas iesniedz darījumu reģistra reģistrācijas pieteikumu, būtu jāsniedz informācija par tā iekšējās kontroles struktūru un tā pārvaldības struktūru neatkarību, lai EVTI varētu novērtēt, vai uzņēmuma pārvaldības struktūra nodrošina darījumu reģistra neatkarību un vai šī struktūra un tās ziņojumu sniegšanas procedūras ir atbilstošas.
- (3) EVTI, kas izveidota ar Eiropas Parlamenta un Padomes 2010. gada 24. novembra Regulu (ES) Nr. 1095/2010, ar ko izveido Eiropas Uzraudzības iestādi (Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestādi) ⁽³⁾, ir atbildīga par darījumu reģistru reģistrāciju un uzraudzību atbilstoši Regulas (ES) Nr. 648/2012 VI sadaļai. Ar mērķi ļaut EVTI novērtēt paredzamā darījumu reģistra augstākās vadības labu reputāciju, kā arī pieredzi un prasmes, darījumu reģistra pieteikuma iesniedzējam būtu jāsniedz attiecīgā informācija, lai veiktu šādu novērtējumu.
- (4) Darījumu reģistra pieteikuma iesniedzējam būtu jāsniedz informācija EVTI, lai uzskatāmi parādītu, ka tā rīcībā ir nepieciešamie finanšu resursi pastāvīgai funkciju pildīšanai un atbilstoši noteikumi darbības nepārtrauktībai.

- (5) Arī tad, ja darījumu reģistrs darbojas, izmantojot filiāles, kas nav atsevišķas juridiskas personas, atsevišķa informācija par filiālēm būtu jāsniedz, lai EVTI varētu skaidri noteikt filiāļu pozīciju darījumu reģistra organizatoriskajā struktūrā, novērtēt filiāļu augstākās vadības atbilstību un piemērotību pienākumu veikšanai un novērtēt, vai kontroles mehānismi, atbilstība un citas funkcijas ir uzskatāmas par stabilām un pietiekamām, lai atbilstīgā veidā noteiktu, novērtētu un pārvaldītu filiāļu risku.
- (6) Ir svarīgi, lai pieteikuma iesniedzējs sniegtu EVTI informāciju par papildpakalpojumiem vai citiem uzņēmējdarbības veidiem, ko darījumu reģistrs piedāvā ārpus tā pamatdarbības – ziņošanas par atvasinātajiem instrumentiem, jo īpaši attiecībā uz tā galveno darbību, kas ir regulatīvā ziņošana.
- (7) Lai EVTI novērtētu reģistrācijai pieteiktā darījumu reģistra tehnoloģisko sistēmu nepārtrauktību un pareizu darbību, pieteikuma iesniedzējam būtu jāsniedz EVTI attiecīgo tehnoloģisko sistēmu apraksti un apraksti par to, kā tās ir pārvaldītas. Pieteikuma iesniedzējam būtu jāapraksta arī visi noteikumi par ārpakalpojumiem, kas ir būtiski tā pakalpojumu nodrošināšanai.
- (8) Maksas saistībā ar darījumu reģistru sniegtajiem pakalpojumiem ir svarīga informācija, lai tirgus dalībnieki varētu izdarīt informētu izvēli, un tādēļ informācija par tām būtu jāiekļauj darījumu reģistra reģistrācijas pieteikumā.
- (9) Ņemot vērā, ka tirgus dalībnieki un regulatori ir atkarīgi no darījumu reģistru uzturētajiem datiem, darījumu reģistra reģistrācijas pieteikumā būtu skaidri jānorāda stingras prasības saistībā ar darbību un reģistrācijas datu uzskaiti.
- (10) Lai tirgus dalībniekiem būtu iespējams izdarīt informētu izvēli, nepieciešams reģistrācijas pieteikuma elements ir riska pārvaldības modeļi, kas saistīti ar darījumu reģistra sniegtajiem pakalpojumiem.
- (11) Lai nodrošinātu pilnīgu piekļuvi darījumu reģistram, pakalpojumu sniedzējiem, kas ir trešās personas, bez jebkādas diskriminācijas piešķir piekļuvi darījumu reģistra uzturētajai informācijai ar nosacījumu, ka struktūra, kas sniedz datus, un attiecīgie darījuma partneri ir paiduši savu piekrišanu. Tādēļ darījumu reģistra pieteikuma iesniedzējam būtu jāsniedz EVTI informācija par piekļuves politiku un procedūram.

⁽¹⁾ Oficiālajā Vēstnesī vēl nav publicēts.

⁽²⁾ OV L 201, 27.7.2012., 1. lpp.

⁽³⁾ OV L 331, 15.12.2010., 84. lpp.

- (12) Lai spētu efektīvi veikt savu darbības atļaujas piešķiršanas uzdevumu, EVTI būtu jāsaņem visa informācija no darījumu reģistriem, ar tiem saistītām trešām personām un trešām personām, kuras darījumu reģistru operacionālās funkcijas un darbības nodrošina kā ārpakalpojumu. Šāda informācija ir vajadzīga, lai novērtētu vai papildinātu reģistrācijas pieteikuma un tajā ietverto dokumentu novērtējumu.
- (13) Šī regula balstās uz regulatīvo tehnisko standartu projektu, ko EVTI iesniegusi Komisijai.
- (14) Saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 1095/2010 10. pantu EVTI ir organizējusi atklātu sabiedrisko apspriešanu par regulatīvu tehnisko standartu projektu, izvērtējusi iespējamās saistītās izmaksas un ieguvumus un prasījusi atzinumu EVTI Vērtspapīru un tirgu nozares ieinteresēto personu grupai, kas izveidota saskaņā ar minētās regulas 37. pantu,
- f) to personu uzvārdi un kontaktinformācija, kas atbild par atbilstību, vai jebkuru citu tādu darbinieku uzvārdi un kontaktinformācija, kas iesaistīti pieteikuma iesniedzēja atbilstības novērtējumā;
- g) darbības programma, ietverot norādījumus par galvenās uzņēmējdarbības veikšanas vietu;
- h) visu meitasuzņēmumu identifikācija un attiecīgā gadījumā grupas struktūra;
- i) jebkurš pakalpojums, izņemot darījumu reģistra darbību, ko pieteikuma iesniedzējs plāno veikt;
- j) informācija par jebkuru juridisku, administratīvu, arbitražas vai jebkuru citu tiesvedību neatkarīgi no tās veida, kurā pieteikuma iesniedzējs ir iesaistīts, jo īpaši attiecībā uz nodokļu un maksātspējas lietām, kas var smagi skart tā reputāciju vai finanšu situāciju, vai jebkura informācija par pabeigtu procedūru, kas joprojām varētu būtiski ietekmēt darījumu reģistra izmaksas.

IR PIENĒMUSI ŠO REGULU.

1. NODAĻA

REĢISTRĀCIJA

1. IEDAĻA

Vispārīga informācija

1. pants

Atvasināto instrumentu identifikācija, juridiskais statuss un kategorija

1. Darījumu reģistra reģistrācijas pieteikumā ir identificēts pieteikuma iesniedzējs un definēta tā paredzamā darbība, kas prasa to reģistrēt kā darījumu reģistru.

2. Darījumu reģistra reģistrācijas pieteikumā iekļauj konkrēti šādu informāciju:

- a) pieteikuma iesniedzēja uzņēmuma nosaukums un juridiskā adrese Savienībā;
- b) izraksts no attiecīgā uzņēmumu vai tiesas reģistra vai cita veida apstiprināti pierādījumi par dibināšanas vietu un pieteikuma iesniedzēja uzņēmējdarbības jomu, kas ir derīgi pieteikuma iesniegšanas dienā;
- c) informācija par atvasināto instrumentu kategorijām, attiecībā uz kurām pieteikuma iesniedzējs vēlas reģistrēties;
- d) statūti un attiecīgā gadījumā citi dibināšanas dokumenti, kas apliecina, ka pieteikuma iesniedzējs sniegs darījumu reģistra pakalpojumus;
- e) tās sanāksmes protokols, kurā valde apstiprinājusi pieteikumu;

3. Pēc EVTI pieprasījuma iesniedzēji arī nosūta tai papildu informāciju reģistrācijas pieteikuma izskatīšanas laikā, ja šāda informācija ir nepieciešama, lai novērtētu pieteikuma iesniedzēju spēju ievērot prasības, kas minētas Regulas (ES) Nr. 648/2012 56. līdz 59. pantā, un lai ļautu EVTI pienācīgi interpretēt un analizēt iesniedzamos vai jau iesniegtos dokumentus.

4. Ja pieteikuma iesniedzējs uzskata, ka šīs regulas prasība tam nav piemērojama, tas skaidri to norāda savā pieteikumā un sniedz paskaidrojumu, kāpēc šāda prasība uz to neattiecas.

2. pants

Politika un procedūras

Ja ir jāsniedz informācija par politiku vai procedūrām, pieteikuma iesniedzējs nodrošina to, ka politika vai procedūras ietver visus turpmāk minētos elementus vai tām ir pievienoti šādi elementi:

- a) norāde par personu, kas ir atbildīga par politiku un procedūru apstiprināšanu un uzturēšanu;
- b) apraksts par to, kādā veidā tiks nodrošināta atbilstība politikai un procedūrām un to uzraudzība, un persona, kas ir atbildīga par atbilstības nodrošināšanu šai sakarā;
- c) apraksts par pasākumiem, kas jāpieņem gadījumā, kad ir pārkāpta politika un procedūras;
- d) norāde par ziņošanas procedūru EVTI par jebkuriem būtiskiem politiku vai procedūru pārkāpumiem, kuri var radīt situāciju, kad tiek pārkāpti sākotnējās reģistrācijas nosacījumi.

2. IEDAĻA

Īpašumtiesības

3. pants

Darījumu reģistra īpašumtiesības

1. Darījumu reģistra reģistrācijas pieteikums ietver:
 - a) to personu uzvārdu vai struktūru nosaukumu sarakstu, kam tieši vai netieši pieder 5 % vai vairāk no pieteikuma iesniedzēju kapitāla vai balsstiesībām vai kuru daļas ļauj ievērojami ietekmēt pieteikuma iesniedzēju pārvaldību;
 - b) visu to uzņēmumu sarakstu, kuros personai, kas minēta a) apakšpunktā, pieder 5 % vai vairāk no kapitāla vai balsstiesībām vai kuru pārvaldību tā var būtiski ietekmēt.
2. Ja pieteikuma iesniedzējam ir mātesuzņēmums, tas:
 - a) norāda juridisko adresi;
 - b) norāda, vai mātesuzņēmums ir saņēmis atļauju vai ir reģistrēts un pakļauts uzraudzībai, un, ja tas tā ir, norāda visus atsaucē numurus un atbildīgās uzraudzības iestādes nosaukumu.

4. pants

Īpašumtiesību struktūrshēma

1. Darījumu reģistra reģistrācijas pieteikums ietver shēmu, kas parāda īpašumtiesību saikni starp mātesuzņēmumu, meitasuzņēmumiem un jebkurām citām ar to saistītām struktūrām vai filiālēm.
2. Uzņēmumiem, kas minēti 1. punktā paredzētajā shēmā, norāda pilnu nosaukumu, juridisko statusu un juridisko adresi.

3. IEDAĻA

Organizatoriskā struktūra, pārvaldība un atbilstība

5. pants

Organizatoriskā struktūrshēma

1. Darījumu reģistra reģistrācijas pieteikums ietver organizatorisko struktūrshēmu, kurā precīzi norādīta pieteikuma iesniedzēja organizatoriskā struktūra, ietverot arī papildpakalpojumus.
2. Šī struktūrshēma satur informāciju par to personu identitāti, kuras atbildīgas par jebkurām nozīmīgām funkcijām, tostarp augstākās vadības un to personu identitāti, kas vada filiāļu darbību.

6. pants

Uzņēmuma pārvaldība

1. Darījumu reģistra reģistrācijas pieteikums ietver informāciju par pieteikuma iesniedzēja iekšējās uzņēmuma pārvaldības politiku un procedūrām un pilnvarojumiem, kas regulē darbību, ko veic tā augstākā vadība, tostarp valdes locekļi, locekļi, kas nav izpildlocekļi, un komitejas, ja tādas ir izveidotas.
2. Minētā informācija ietver aprakstu par augstākās vadības un valdes locekļu atlases procesu, iecelšanu amatā, izpildes novērtējumu un atcelšanu.
3. Ja pieteikuma iesniedzējs ievēro kādu atzītu korporatīvās pārvaldības rīcības kodeksu, darījumu reģistra reģistrācijas pieteikumā norāda šo kodeksu un sniedz paskaidrojumu par jebkuru situāciju, kad pieteikuma iesniedzējs nerīkojas saskaņā ar šo kodeksu.

7. pants

Iekšējā kontrole

1. Darījumu reģistra reģistrācijas pieteikums ietver pārskatu par pieteikuma iesniedzēja iekšējo kontroli. Tas ietver informāciju par tā atbilstības funkciju, pārskata funkciju, riska novērtēšanu, iekšējās kontroles mehānismiem un iekšējās revīzijas norises kārtību.
2. Pārskatā iekļauj informāciju par šādiem jautājumiem:
 - a) pieteikuma iesniedzēja iekšējās kontroles politika un procedūras;
 - b) pieteikuma iesniedzēja sistēmu piemērotības un efektivitātes pārbaude un novērtēšana;
 - c) pieteikuma iesniedzēja informācijas apstrādes sistēmu kontrole un aizsardzība;
 - d) iekšējās struktūras, kas ir atbildīgas par konstatējumu novērtējumu.
3. Darījumu reģistra reģistrācijas pieteikums satur šādu informāciju attiecībā uz pieteikuma iesniedzēja iekšējās revīzijas funkciju:
 - a) paskaidrojumu par to, kā ir izstrādāta un piemērota iekšējās revīzijas metodika, ņemot vērā pieteikuma iesniedzēja darbību raksturu, to sarežģītību un riskus;
 - b) darba plānu trim gadiem pēc pieteikuma iesniegšanas dienas.

8. pants

Normatīvā atbilstība

Darījumu reģistra reģistrācijas pieteikums ietver šādu informāciju par pieteikuma iesniedzēja politiku un procedūrām, kas nodrošina atbilstību Regulai (ES) Nr. 648/2012:

- a) darbības aprakstu attiecībā uz personām, kas ir atbildīgas par atbilstību, un pārējo personālu, kas ir iesaistīts atbilstības novērtējumos, tostarp saistībā ar to, kā tiks nodrošināta atbilstības funkciju neatkarība no pārējās uzņēmējdarbības;
- b) iekšējo politiku un procedūras, kas paredzētas, lai nodrošinātu, ka pieteikuma iesniedzējs, ieskaitot vadītājus un darbiniekus, atbilst visiem Regulas (ES) Nr. 648/2012 noteikumiem, tostarp aprakstam par valdes un augstākā līmeņa vadības uzdevumiem;
- c) ja iespējams, visjaunāko iekšējo ziņojumu, ko sagatavojušas personas, kas atbildīgas par atbilstību, vai jebkurš cits personāls pārstāvis, kas iesaistīts pieteikuma iesniedzēja atbilstības novērtēšanā.

9. pants

Augstākā vadība un valde

1. Darījumu reģistra reģistrācijas pieteikums ietver šādu informāciju attiecībā uz katru augstākās vadības locekli un katru valdes locekli:

- a) dzīves aprakstu (CV), lai varētu novērtēt pieredzes atbilstību un zināšanas, kas ļauj pienācīgi pildīt savus pienākumus;
- b) precīzu informāciju par jebkuru kriminālu sodāmību saistībā ar finanšu pakalpojumu vai datu pakalpojumu sniegšanu vai ja notikusi krāpšana vai līdzekļu piesavināšanās, konkrētāk, oficiālu izziņu, ja dalībvalsts tādu izsniedz;
- c) pašdeklarāciju par labu reputāciju saistībā ar finanšu vai datu pakalpojumu sniegšanu, kurā katrs augstākās vadības loceklis un valdes loceklis deklarē, vai:

i) viņš ir atzīts par vainīgu kādā noziedzīgā nodarījumā saistībā ar finanšu vai datu pakalpojumu sniegšanu vai saistībā ar krāpšanu vai līdzekļu piesavināšanos;

ii) attiecībā uz viņu ir pieņemts nelabvēlīgs lēmums jebkādā regulatīvās iestādes vai valdības iestādes vai aģentūras uzsāktā disciplinārlietas procedūrā vai pret viņu ir ierosināta šāda procedūra, kas nav pabeigta;

iii) attiecībā uz viņu ir pieņemts nelabvēlīgs tiesas konstatējums civillietas tiesvedībā saistībā ar finanšu vai datu

pakalpojumu sniegšanu vai par profesionālās ētikas pārkāpumiem vai krāpšanu uzņēmējdarbības pārvaldībā;

iv) viņš ir bijis tāda uzņēmuma valdes loceklis vai augstākās vadības pārstāvis, kura reģistrāciju vai atļauju ir anulējusi regulatīvā iestāde;

v) viņam tikušas atteiktas tiesības veikt darbības, kam nepieciešama regulatīvās iestādes apstiprināta reģistrācija vai atļauja;

vi) viņš bijis tāda uzņēmuma valdes vai augstākās vadības loceklis, kurš kļuvis maksātnespējīgs vai bankrotējis tad, kad attiecīgā persona ir bijusi saistīta ar uzņēmumu, vai gada laikā pēc tam, kad attiecīgā persona pārstājis būt saistīta ar uzņēmumu;

vii) viņš bijis tāda uzņēmuma valdes vai augstākās vadības loceklis, uz kuru attiecies nelabvēlīgs regulatīvās iestādes lēmums vai tās uzlikts sods;

viii) uz viņu attiecies valsts pārvaldes, regulatīvās iestādes vai profesionālas struktūras uzlikts naudas sods, kāda no tām šo personu uz laiku atcēlusi no amata, atstādinājusi vai citādi sodījusi saistībā ar krāpšanu vai līdzekļu piesavināšanos vai saistībā ar finanšu vai datu sniegšanas pakalpojumiem;

ix) viņš ir ticis atstādināts no direktora amata, atstādināts no darbības jebkurā vadītāja amatā, atlaists no algota darbinieka amata vai cita amata uzņēmumā saistībā ar amatpārkāpumiem un nelikumībām;

d) deklarāciju par visiem iespējamiem interešu konfliktiem, kas var būt augstākajai vadībai un valdes locekļiem, veicot savus pienākumus, un kā šie konflikti ir pārvaldīti.

2. Jebkuru informāciju, ko saskaņā ar 1. punktu saņēmusi EVTI, izmanto tikai pieteikuma iesniedzēja darījumu reģistra reģistrācijas nolūkiem un lai varētu pārbaudīt, vai tas pastāvīgi atbilst reģistrācijas nosacījumiem.

4. IEDAĻA

Personāls un atlīdzība

10. pants

Personāla komplektēšanas politika un procedūras

Darījumu reģistra reģistrācijas pieteikums ietver šādu dokumentu kopijas par politiku un procedūrām:

a) atlīdzības politika attiecībā uz augstāko vadību, valdes locekļiem un personālu, kas veic pieteikuma iesniedzēja riska pārvaldības un kontroles funkcijas;

b) to pasākumu apraksts, ko pieteikuma iesniedzējs ieviesis, lai mazinātu risku, kas saistīts ar pārmērīgu paļaušanos uz atsevišķiem darbiniekiem.

11. pants

Piemērotība un godprātība

Darījumu reģistra reģistrācijas pieteikums ietver šādu informāciju par pieteikuma iesniedzēja darbiniekiem:

- a) vispārēju nodarbinātā personāla sarakstu, tostarp darbinieku uzdevumus un kvalifikāciju atbilstoši uzdevumiem;
- b) konkrētu aprakstu par informācijas tehnoloģiju personālu, ko nodarbina darījumu reģistra pakalpojumu sniegšanai, tostarp katra darbinieka uzdevumus un kvalifikāciju;
- c) uzdevumu un kvalifikāciju aprakstu attiecībā uz katru darbinieku, kas ir atbildīgs par iekšējo revīziju, iekšējo kontroli, atbilstību, riska novērtējumu un iekšējo pārskatīšanu;
- d) īpašo personāla pārstāvju un to personāla pārstāvju, kuri darbojas saskaņā ar ārpalpojumu vienošanos, identifikāciju;
- e) sīkas ziņas par apmācību un attīstību, kas attiecas uz darījumu reģistra uzņēmējdarbību, tostarp jebkuras pārbaudes vai cita veida formālu novērtējumu, kas attiecas uz personālu saistībā ar darījumu reģistra darbību.

5. IEDAĻA

Finanšu resursi darījumu reģistra darbības veikšanai

12. pants

Finanšu pārskati un uzņēmējdarbības plāni

1. Darījumu reģistra reģistrācijas pieteikumā ir šāda finanšu un uzņēmējdarbības informācija par pieteikuma iesniedzēju:

- a) pilnīgi finanšu pārskati, kas sagatavoti atbilstoši starptautiskajiem grāmatvedības standartiem, kuri pieņemti saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes 2002. gada 19. jūlija Regulas (EK) Nr. 1606/2002 par starptautisko grāmatvedības standartu piemērošanu ⁽¹⁾ 3. pantu;
- b) ja uz pieteikuma iesniedzēja finanšu pārskatiem attiecas obligātā revīzija Eiropas Parlamenta un Padomes 2006. gada 17. maija Direktīvas 2006/43/EK, ar ko paredz gada pārskatu un konsolidēto pārskatu obligātās revīzijas ⁽²⁾, 2. panta 1. punkta nozīmē, tad finanšu pārskatos iekļauj revīzijas ziņojumu par gada un konsolidētajiem finanšu pārskatiem;

⁽¹⁾ OV L 243, 11.9.2002., 1. lpp.

⁽²⁾ OV L 157, 9.6.2006., 87. lpp.

c) ja pieteikuma iesniedzējam ir veikta revīzija, ārējā revidenta uzvārds un valsts reģistrācijas numurs;

d) uzņēmējdarbības finanšu plāns, kurā aplūkoti dažādi darījumu reģistra pakalpojumu uzņēmējdarbības scenāriji vismaz trīs gadu ilgā atsaucē laika posmā.

2. Ja iepriekšējā finanšu informācija, kas minēta 1. punktā, nav pieejama, tad darījumu reģistra reģistrācijas pieteikumā ietver šādu informāciju par pieteikuma iesniedzēju:

- a) formālu paziņojumu, kas apliecina pienācīgus resursus un paredzamo uzņēmējdarbības statusu sešus mēnešus pēc reģistrācijas piešķiršanas;
- b) starpperioda finanšu pārskatu, ja par attiecīgo laika posmu vēl nav pieejami finanšu pārskati;
- c) finanšu stāvokļa pārskatu, piemēram, bilanci, peļņas vai zaudējumu aprēķinu, pašu kapitāla un naudas plūsmas izmaiņas un piezīmes, kas ietver kopsavilkumu par grāmatvedības metodēm un citus paskaidrojumus.

3. Darījumu reģistra reģistrācijas pieteikums ietver revidētos gada finanšu pārskatus par visiem mātesuzņēmumiem par trim finanšu gadiem pirms pieteikuma iesniegšanas dienas.

4. Darījumu reģistra reģistrācijas pieteikumā ir arī šāda finanšu informācija par pieteikuma iesniedzēju:

- a) norāde par nākotnes plāniem attiecībā uz meitasuzņēmumiem un to atrašanās vietu;
- b) apraksts par uzņēmējdarbību, ko pieteikuma iesniedzējs plāno veikt, norādot visu meitasuzņēmumu vai filiāļu darbību.

6. IEDAĻA

Interēšu konflikti

13. pants

Interēšu konfliktu pārvaldība

Darījumu reģistra reģistrācijas pieteikumā ir šāda informācija par interēšu konfliktu pārvaldības politiku un procedūrām, ko ieviesis pieteikuma iesniedzējs:

- a) politika un procedūras attiecībā uz interēšu konfliktu konstatēšanu, pārvaldību un informācijas atklāšanu par tiem un apraksts par procesu, ko izmanto, lai nodrošinātu, ka attiecīgās personas ir informētas par politiku un procedūrām;

- b) jebkuri citi pasākumi un kontrole, lai nodrošinātu a) apakšpunktā minēto prasību izpildi attiecībā uz interešu konfliktu pārvaldību.

14. pants

Konfidencialitāte

1. Darījumu reģistra reģistrācijas pieteikums ietver iekšējo politiku un mehānismus, kas novērš jebkādu informācijas, kas glabājas potenciālajā darījumu reģistrā, izmantošanu:

- a) nelikumīgiem mērķiem;
- b) konfidenciālas informācijas izpaušanai;
- c) ja nav atļauta informācijas izmantošana komerciālos nolūkos.

2. Minētais pieteikums ietver aprakstu par iekšējām procedūrām attiecībā uz personāla atļaujām izmantot paroles piekļuvei datiem, norādot personāla nolūku, aplūkojamo datu apjomu un visus ierobežojumus datu izmantošanai.

3. Pieteikuma iesniedzēji sniedz EVTI informāciju par procesiem, kas paredzēti, lai uzturētu žurnālu, kurā identificē ikvienu darbinieku, kas piekļūst datiem, aplūkoto datu raksturu un piekļuves nolūku.

15. pants

Interesešu konfliktu uzskaitījums un mazināšana

1. Darījumu reģistra reģistrācijas pieteikums ietver atjauninātu uzskaitījumu par pieteikuma iesniegšanas laikā spēkā esošiem būtiskiem interešu konfliktiem saistībā ar jebkuriem papildu vai citiem saistītiem pakalpojumiem, ko sniedz pieteikuma iesniedzējs, un aprakstu, kā tie tiek pārvaldīti.

2. Ja pieteikuma iesniedzējs ietilpst uzņēmumu grupā, uzskaitījumā ietver visus būtiskos interešu konfliktus, kas izriet no citiem grupas uzņēmumiem, un to, kā šie konflikti tiek pārvaldīti.

7. IEDAĻA

Resursi un procedūras

16. pants

Informācijas tehnoloģiju resursi un ārpakalpojumi

Darījumu reģistra reģistrācijas pieteikumā ietver aprakstu, kurā aplūkoti šādi temati:

- a) lietotājiem paredzētas sistēmas un ierīces, ko pieteikuma iesniedzējs izstrādājis nolūkā sniegt pakalpojumus klientiem, tostarp lietotāja rokasgrāmatu un iekšējo procedūru apraksta kopijas;

- b) ieguldījumu un atjaunošanas politikas attiecībā uz pieteikuma iesniedzēja informācijas tehnoloģiju resursiem;

- c) vienošanās par ārpakalpojumiem, ko noslēdzis pieteikuma iesniedzējs, kā arī metodes, ko izmanto, lai uzraudzītu ārpakalpojumu sniedzējam uzticēto funkciju pakalpojuma līmeni, un to līgumu kopijas, ar kuriem regulē šādas vienošanās.

17. pants

Papildpakalpojumi

Ja pieteikuma iesniedzējs, tā grupas uzņēmums vai uzņēmums, ar kuru pieteikuma iesniedzējam ir būtisks nolīgums attiecībā uz tirdzniecību vai pēctirdzniecības pakalpojumiem, piedāvā vai plāno piedāvāt papildpakalpojumus, darījumu reģistra reģistrācijas pieteikumā ietver:

- a) aprakstu par papildpakalpojumiem, ko veic pieteikuma iesniedzējs vai tā mātesuzņēmuma grupa, un aprakstu par jebkuru nolīgumu, kas darījumu reģistram varētu būt ar uzņēmumiem, kuri piedāvā tirdzniecības, pēctirdzniecības vai citus ar to saistītus pakalpojumus, kā arī tādu nolīgumu kopijas;
- b) aprakstu par procedūrām un politiku, kas nodrošinās pieteikuma iesniedzēja darījumu reģistra pakalpojumu operatīvu nodalīšanu no citiem uzņēmējdarbības virzieniem, tostarp gadījumā, kad atsevišķu uzņēmējdarbības virzienu vada darījumu reģistrs, uzņēmums, kas pieder tā kontrolāciju sabiedrībai, vai jebkurš cits uzņēmums, kurā tam ir būtisks nolīgums saistībā ar tirdzniecību vai pēctirdzniecības darījumu ķēdi vai darījumu virzienu.

8. IEDAĻA

Piekļuves noteikumi

18. pants

Piekļuves noteikumu pārredzamība

Darījumu reģistra reģistrācijas pieteikums ietver:

- a) piekļuves politikas un procedūras, saskaņā ar kurām lietotāji piekļūst datiem darījumu reģistrā, tostarp jebkuru procesu, kas attiecas uz lietotājiem, ja nepieciešams grozīt vai mainīt reģistrētos līgumus;
- b) to noteikumu un nosacījumu kopiju, kas nosaka lietotāju tiesības un pienākumus;
- c) aprakstu par dažādiem piekļuves līmeņiem, kas pieejami lietotājiem, ja šie līmeņi ir vairāki;
- d) piekļuves politikas un procedūras, saskaņā ar kurām citi pakalpojumu sniedzēji var izmantot nediskriminējošu piekļuvi informācijai, ko uztur darījumu reģistrs, ja attiecīgie darījuma partneri ir devuši piekrišanu.

19. pants

Pārredzamība attiecībā uz atbilstības noteikumiem un datu precizitāti

Darījumu reģistra reģistrācijas pieteikums ietver procedūras, ko ieviešis iesniedzējs, lai pārbaudītu:

- a) darījuma partnera, kas iesniedz ziņojumu, vai ziņojuma iesniedzēja struktūras atbilstību ziņošanas prasībām;
- b) paziņotās informācijas pareizību;
- c) to, ka datus var salīdzināt starp darījumu reģistriem, ja darījuma partneri ziņo dažādiem darījumu reģistriem.

20. pants

Cenu politikas pārredzamība

Darījumu reģistra reģistrācijas pieteikums ietver aprakstu par šādiem jautājumiem attiecībā uz pieteikuma iesniedzēju:

- a) cenu politika, tostarp visas atlaides un rabati, un nosacījumi, lai varētu piemērot šādus samazinājumus;
- b) maksu struktūra attiecībā uz jebkuru papildpakalpojumu sniegšanu, tostarp darījumu reģistra pakalpojumu un papildpakalpojumu paredzamās izmaksas, līdztekus sīkākai informācijai par metodēm, ko izmanto, lai ņemtu vērā atsevišķas izmaksas, kas pieteikuma iesniedzējam var rasties, sniedzot darījumu reģistra pakalpojumus un papildpakalpojumus;
- c) metodes, kas izmantotas, lai nodrošinātu informācijas pieejamību klientiem, jo īpaši ziņošanas struktūrām, un potenciālajiem klientiem, tostarp maksu struktūras kopija, ja darījumu reģistra pakalpojumi un papildpakalpojumi ir nošķirti.

9. IEDAĻA

Darbības uzticamība

21. pants

Operacionālais risks

Darījumu reģistra reģistrācijas pieteikums ietver:

- a) sīku aprakstu par pieejamajiem resursiem un procedūrām, kas paredzētas, lai noteiktu un mazinātu operacionālo risku un jebkuru citu būtisku risku, kam pieteikuma iesniedzējs ir pakļauts, tostarp jebkuru attiecīgu rokasgrāmatu un iekšējo procedūru apraksta kopiju;

b) neto likvīdo aktīvu aprakstu, kurus finansē no pašu kapitāla, lai segtu iespējamus vispārējus uzņēmējdarbības zaudējumus nolūkā turpināt sniegt pakalpojumus, un novērtējumu par finanšu resursu pietiekamību, lai segtu darbības izbeigšanas vai svarīgāko operāciju un pakalpojumu reorganizācijas izmaksas vismaz sešu mēnešu periodā;

c) pieteikuma iesniedzēja darbības nepārtrauktības plānu un norādi par politiku plāna atjaunināšanai. Plāns ietver jo īpaši:

i) visus uzņēmējdarbības procesus, eskalācijas procedūras un saistītās sistēmas, kas ir kritiski nozīmīgas darījumu reģistra pieteikuma iesniedzēja pakalpojumu nodrošināšanai, tostarp visus attiecīgos ārpakalpojumus un darījumu reģistra stratēģiju, politiku un mērķus šo procesu nepārtrauktības sasniegšanai;

ii) spēkā esošos noteikumus, par kuriem panākta vienošanās ar citiem finanšu tirgus infrastruktūras pakalpojumu sniedzējiem, tostarp citiem darījumu reģistriem;

iii) noteikumus minimālā pakalpojuma apjoma nodrošināšanai attiecībā uz būtiskākajām funkcijām un šo procesu pilnīgai pabeigšanai paredzamo laiku;

iv) maksimāli pieļaujamo uzņēmējdarbības procesu un sistēmu atjaunošanas laiku, ņemot vērā darījumu reģistru ziņošanas termiņu, kā paredzēts Regulas (ES) Nr. 648/2012 9. pantā, un datu apjomu, kas darījumu reģistram šajā periodā ir jāapstrādā;

v) procedūras, kā rīkoties ar incidentu žurnālēšanu un pārbaudēm;

vi) testēšanas programmu un jebkuru testu rezultātus;

vii) pieejamo alternatīvu tehnisko un operatīvo vietņu skaitu, to atrašanās vietu, resursus salīdzinājumā ar galveno vietu un uzņēmējdarbības nepārtrauktības procedūras gadījumā, ja ir jāizmanto alternatīvas vietas;

viii) informāciju par piekļuvi sekundārai uzņēmējdarbības vietai, kas ļauj darbiniekiem nodrošināt pakalpojumu nepārtrauktību, ja nav pieejama galvenā biroja atrašanās vieta;

d) aprakstu par kārtību pieteikuma iesniedzēja darījumu reģistra darbības nodrošināšanai traucējumu gadījumā un darījumu reģistra lietotāju un citu trešo personu iesaisti šajā kārtībā.

10. IEDAĻA

Informācijas glabāšana

22. pants

Datu uzskaites politika

1. Darījumu reģistra reģistrācijas pieteikums satur informāciju par datu saņemšanu un administrēšanu, tostarp politiku un procedūras, ko ieviesis pieteikuma iesniedzējs, lai nodrošinātu:

- a) savlaicīgu un precīzu paziņotās informācijas reģistrāciju;
- b) datu saglabāšanu gan tiešsaistē, gan bezsaistē;
- c) datu pienācīgu nokopēšanu darbības nepārtrauktības mērķiem.

2. Darījumu reģistra reģistrācijas pieteikums ietver aprakstu par datu uzskaites sistēmām, politiku un procedūrām, kuras izmanto, lai nodrošinātu, ka informācija tiek grozīta pienācīgi un ka pozīcijas ir aprēķinātas pareizi saskaņā ar attiecīgām legislatīvām vai regulatīvām prasībām.

11. IEDAĻA

Datu pieejamība

23. pants

Datu pieejamības mehānismi

Darījumu reģistra reģistrācijas pieteikums ietver aprakstu par resursiem, metodēm un kanāliem, ko pieteikuma iesniedzējs izmanto, lai atvieglotu piekļuvi informācijai saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 81. panta (pārredzamība un datu pieejamība) 1., 3. un 5. punktu, kā arī:

- a) aprakstu par resursiem, metodēm un kanāliem, ko darījumu reģistrs izmanto, lai atvieglotu tā rīcībā esošo datu pieejamību sabiedrībai saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 81.

panta 1. punktu, un par atjaunināšanas biežumu, kā arī īpašu rokasgrāmatu un iekšējās politikas noteikumu kopiju;

- b) aprakstu par resursiem, metodēm un ierīcēm, ko darījumu reģistrs izmanto, lai atvieglotu piekļuvi tā rīcībā esošajai informācijai attiecīgajām iestādēm saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 81. panta 3. punktu, un par atjaunināšanas biežumu un kontroli un pārbaudi, ko darījumu reģistrs var izveidot piekļuves filtrēšanas procesam, kā arī īpašu rokasgrāmatu un iekšējo procedūru apraksta kopijas;
- c) aprakstu par resursiem, metodēm un kanāliem, ko darījumu reģistrs izmanto, lai atvieglotu darījuma partneru piekļuvi tā rīcībā esošajai informācijai par līgumiem saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 80. panta 5. punktu, un par atjaunināšanas biežumu, kā arī īpašu rokasgrāmatu un iekšējās politikas aprakstu kopijas.

24. pants

Pieteikuma precizitātes un pilnīguma pārbaude

1. Jebkurai reģistrācijas procesā EVTI iesniegtai informācijai pievieno vēstuli, ko parakstījis darījumu reģistra valdes un augstākās vadības loceklis un kas apliecina, ka iesniegtā informācija, ciktāl viņiem zināms, ir precīza un pilnīga dienā, kad to iesniedz.

2. Informācijai attiecīgā gadījumā pievieno arī atbilstīgu uzņēmuma juridisko dokumentāciju, kas apliecina datu precizitāti.

25. 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, 2012. gada 19. decembrī

Komisijas vārdā –

priekšsēdētājs

José Manuel BARROSO

KOMISIJAS DELEĢĒTĀ REGULA (ES) Nr. 151/2013

(2012. gada 19. decembris),

ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 648/2012 par ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, centrālajiem darījumu partneriem un darījumu reģistriem attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem, kas nosaka datus, kuri darījumu reģistriem ir jāpublicē un jādara pieejami, un darbības standartus saistībā ar datu apkopošanu un salīdzināšanu un piekļuvi datiem

(Dokuments attiecas uz EEZ)

EIROPAS KOMISIJA,

tām vajadzētu būt piekļuvei darījumu datiem par visiem darījumu partneriem, lai pildītu savus attiecīgos uzdevumus šajā jomā.

ņemot vērā Līgumu par Eiropas Savienības darbību,

ņemot vērā Eiropas Centrālās bankas atzinumu ⁽¹⁾,

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 ⁽²⁾ un jo īpaši tās 81. panta 5. punktu,

tā kā:

- (1) Ir svarīgi skaidri norādīt attiecīgos līgumus un to attiecīgos darījumu partnerus, levērojot funkcionālu pieeju, struktūras, kas piekļūst darījumu reģistru glabātiem datiem, būtu jāvērtē atbilstoši to kompetencei un funkcijām, ko tās veic.
- (2) Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestādei (EVTI) būtu jābūt piekļuvei visiem darījumu datiem, kas glabājas darījumu reģistros, lai varētu veikt šo darījumu reģistru uzraudzību, pieprasīt informāciju, veikt piemērotus uzraudzības pasākumus un pārbaudīt, vai darījumu reģistra reģistrācija būtu jā saglabā vai jāatceļ.
- (3) Ņemot vērā tās pienākumus saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes 2010. gada 24. novembra Regulu (ES) Nr. 1095/2010, ar ko izveido Eiropas Uzraudzības iestādi (Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestādi) ⁽³⁾, un Regulu (ES) Nr. 648/2012, EVTI būtu jānodrošina piekļuve atbilstoši tās dažādajām pilnvarām. Atsevišķu EVTI darbinieku piekļuvei datiem vajadzētu būt atbilstoši katrām no šīm īpašajām pilnvarām.
- (4) Eiropas Sistēmisko risku kolēģija (ESRK), EVTI un attiecīgās Eiropas Centrālo banku sistēmas (ECBS) dalībnieces, tostarp dažu valstu centrālās bankas, un attiecīgās Savienības vērtspapīru un tirgu iestādes ir pilnvarotas uzraudzīt un saglabāt finanšu stabilitāti Savienībā, un tāpēc

- (5) Centrālo darījumu partneru (CCP) uzraudzības iestādēm un pārraudzības iestādēm ir vajadzīga piekļuve, lai varētu efektīvi pildīt savus pienākumus attiecībā uz šādām struktūrām, un tāpēc tām vajadzētu būt piekļuvei visai informācijai, kas vajadzīga saistībā ar šīm pilnvarām.
- (6) Attiecīgo ECBS dalībnieku piekļuve palīdz pildīt to galvenos uzdevumus, jo īpaši centrālo banku emitētāju funkcijas, finansiālās stabilitātes pilnvaras un dažos gadījumos konsultatīvu uzraudzību dažiem darījumu partneriem. Tā kā dažiem ECBS dalībniekiem ir atšķirīgas pilnvaras saskaņā ar valsts tiesību aktiem, tiem būtu jāpiešķir piekļuve datiem saskaņā ar dažādām pilnvarām, kas minētas Regulas (ES) Nr. 648/2012 81. panta 3. punktā.
- (7) Attiecīgajām Savienības vērtspapīru un tirgu iestādēm galvenais pienākums ir ieguldītāju aizsardzība attiecīgajās jurisdikcijās, un tām būtu jāpiešķir piekļuve darījumu datiem par tirgiem, dalībniekiem, produktiem un bāzes aktīviem, uz kuriem attiecas to uzraudzības un īstenošanas pilnvaras.
- (8) Iestādēm, kas izraudzītas saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes 2004. gada 21. aprīļa Direktīvas 2004/25/EK par pārņemšanas piedāvājumiem ⁽⁴⁾ 4. pantu, būtu jāpiešķir piekļuve kapitāla vērtspapīru atvasināto instrumentu darījumiem, ja attiecīgā bāzes instrumenta emitents ir iekļauts regulētā tirgū attiecīgajā jurisdikcijā vai tā juridiskā adrese ir attiecīgās jurisdikcijas teritorijā, vai tas darbojas kā piedāvātājs attiecībā uz kādu no minētajiem uzņēmumiem un piedāvātā atbildība ietver vērtspapīrus.
- (9) Energoregulatoru sadarbības aģentūrai (ACER) būtu jāpiešķir piekļuve enerģijas vairumtirgu uzraudzības nolūkā, lai sadarbībā ar valsts regulatīvajām iestādēm atklātu un novērstu ļaunprātīgu tirgus izmantošanu, un enerģijas vairumtirgu uzraudzības nolūkā, lai saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes 2011. gada 25. oktobra Regulu (ES) Nr. 1227/2011 par enerģijas vairumtirgus integritāti un pārredzamību (REMIT) ⁽⁵⁾ atklātu un novērstu ļaunprātīgu tirgus izmantošanu. Tāpēc ACER vajadzētu būt piekļuvei visiem datiem, kas glabājas darījumu reģistrā attiecībā uz enerģijas atvasinātajiem instrumentiem.

⁽¹⁾ Oficiālajā Vēstnesī vēl nav publicēts.⁽²⁾ OV L 201, 27.7.2012., 1. lpp.⁽³⁾ OV L 331, 15.12.2010., 84. lpp.⁽⁴⁾ OV L 142, 30.4.2004., 12. lpp.⁽⁵⁾ OV L 326, 8.12.2011., 1. lpp.

- (10) Regula (ES) Nr. 648/2012 attiecas tikai uz tirdzniecības datiem, nevis uz pirmstirdzniecības datiem, piemēram, tirdzniecības rīkojumiem, ko nosaka Regula (ES) Nr. 1227/2011. Tāpēc darījumu reģistri nav jāuzskata par pienācīgu informācijas avotu ACER šajā jomā.
- (11) Atbilstoši funkcionālai pieejai attiecībā uz piekļuvi datiem, kas glabājas darījumu reģistros, prudenciālā uzraudzība ir būtisks komponents. Tāpat arī dažādām iestādēm varētu būt prudenciālās uzraudzības pilnvaras. Tādēļ piekļuve darījuma datiem saistībā ar attiecīgajām struktūrām būtu jānodrošina visām iestādēm, kas minētas Regulas (ES) Nr. 648/2012 81. panta 3. punktā.
- (12) Struktūrām, kam ir piekļuve darījumu reģistru datiem saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 81. panta 3. punktu, būtu jānodrošina, ka tās uztur un īsteno tādu politiku, kas nodrošina to, ka tikai attiecīgās personas piekļūst informācijai noteiktu un juridiski pamatotu iemeslu dēļ, un ir skaidri norādītas citas iespējamās personas, kas ir pilnvarotas piekļūt šiem datiem.
- (13) Piekļuve datiem būtu jāaplūko trijos apkopojuma līmeņos. Darījuma datiem būtu jāsaturs individuāla darījuma informācija; pozīcijas datiem būtu jāsaturs bāzes aktīva/kopprodukta apkopotie pozīcijas dati par individuāliem darījuma partneriem; un apkopotajiem nosacītajiem datiem būtu jāatbilst bāzes aktīva/produkta kopējām pozīcijām, neprecizējot darījuma partneru datus. Piekļuve darījuma datiem varētu arī dot piekļuvi pozīciju līmenī un apkopotajiem datiem. Piekļuve pozīcijas datiem varētu arī dot piekļuvi apkopotajiem datiem, bet ne darījuma līmeņa datiem. Turpretim piekļuve apkopotajiem nosacītajiem datiem, kas būtu vismazāk detalizētā kategorija, nedotu iespēju piekļūt pozīcijas vai darījuma līmeņa datiem.
- (14) Šīs regulas pamatā ir regulatīvo tehnisko standartu projekts, ko Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestāde iesniegusi Komisijai.
- (15) Saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 1095/2010 10. pantu EVTI ir apspriedusies ar attiecīgajām iestādēm un Eiropas Centrālo banku sistēmas (ECBS) dalībniekiem, pirms iesniegt regulatīvu tehnisko standartu projektu, kas ir šīs regulas pamatā. EVTI ir arī organizējusi regulatīvo tehnisko standartu projekta atklātu sabiedrisko apspriešanu, izvērtējusi iespējamās saistītās izmaksas un ieguvumus un prasījusi atzinumu EVTI Vērtspapīru un tirgu nozares ieinteresēto personu grupai, kas izveidota saskaņā ar minētās regulas 37. pantu,
- a) apkopotu atklāto pozīciju sadalījumu atbilstoši šādām atvasināto instrumentu kategorijām:
- i) preces;
 - ii) kredīts;
 - iii) ārvalstu valūta,
 - iv) kapitāla instrumenti;
 - v) procentu likme;
 - vi) cita;
- b) apkopotu darījumu apjoma sadalījumu atbilstoši šādām atvasināto instrumentu kategorijām:
- i) preces;
 - ii) kredīts;
 - iii) ārvalstu valūta;
 - iv) kapitāla instrumenti;
 - v) procentu likme;
 - vi) citas;
- c) kopējās vērtības sadalījumu atbilstoši šādām atvasināto instrumentu kategorijām:
- i) preces;
 - ii) kredīts;
 - iii) ārvalstu valūta,
 - iv) kapitāla instrumenti;
 - v) procentu likme;
 - vi) cita.

2. Datus publicē tīmekļa vietnē vai tiešsaistes portālā, kas ir viegli sabiedrībai pieejami un ko atjaunina vismaz reizi nedēļā.

IR PIENĒMUSI ŠO REGULU.

1. pants

Apkopotu datu publicēšana

1. Darījumu reģistri publicē datus, kas paredzēti Regulas (ES) Nr. 648/2012 81. panta 1. punktā, tostarp vismaz:

2. pants

Attiecīgo iestāžu piekļuve datiem

1. Darījumu reģistrs nodrošina piekļuvi visiem darījumu datiem Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestādei (EVTI), lai tā varētu pildīt savus uzraudzības uzdevumus.

2. EVTI izveido iekšējās procedūras, kas nodrošina atbilstīgu personāla piekļuvi un pienācīgus piekļuves ierobežojumus attiecībā uz darbībām, kas nav uzraudzības darbības saskaņā ar EVTI pilnvarām.

3. Darījumu reģistrs atļauj Energoregulatoru sadarbības aģentūrai (ACER) piekļuvi visiem darījumu datiem attiecībā uz atvasinātajiem instrumentiem, ja to bāzes aktīvs ir enerģijas produkti vai emisijas kvotas.

4. Darījumu reģistrs vajadzības gadījumā atļauj kompetentajai iestādei, kas uzrauga CCP, un attiecīgajam Eiropas Centrālo banku sistēmas (ECBS) dalībniekam, kas pārbauda CCP, piekļūt visu darījumu datiem, kam tīrvērti veicis vai ko paziņojis CCP.

5. Darījumu reģistrs atļauj kompetentajai iestādei, kas uzrauga paziņoto līgumu izpildes vietas, piekļūt visiem darījuma datiem par līgumu izpildi šajās izpildes vietās.

6. Darījumu reģistrs atļauj uzraudzības iestādei, kas izraudzīta saskaņā ar Direktīvas 2004/25/EK 4. pantu, piekļūt visiem darījumu datiem par atvasinātajiem instrumentiem, ja bāzes instruments ir vērtspapīrs, ko emitējis uzņēmums, kas atbilst vienam no šādiem nosacījumiem:

- a) tas ir iekļauts regulētā tirgū reģistra jurisdikcijas teritorijā;
- b) tam ir juridiskā adrese vai, ja tam nav juridiskās adreses, galvenais birojs, reģistra jurisdikcijas teritorijā;
- c) darbojas kā piedāvātājs attiecībā uz struktūrām, kas minētas a) vai b) apakšpunktā, un tā piedāvātā atbildība ietver vērtspapīrus.

7. Dati, kas jāiesniedz atbilstīgi 6. punktam, ietver informāciju par:

- a) bāzes vērtspapīriem;
- b) atvasināto instrumentu kategoriju;
- c) pozīcijas zīmi;
- d) atsauces vērtspapīru skaitu;
- e) atvasināto instrumentu darījuma partneriem.

8. Darījumu reģistrs atļauj attiecīgajām Savienības vērtspapīru un tirgus iestādēm, kas minētas Regulas (ES) Nr. 648/2012 81.

panta 3. punkta h) apakšpunktā, piekļūt visiem darījumu datiem par tirgiem, dalībniekiem, līgumiem un bāzes aktīviem, uz kuriem attiecas šīs iestādes darbības joma saskaņā ar tās attiecīgajiem uzraudzības pienākumiem un pilnvarām.

9. Darījumu reģistrs atļauj Eiropas Sistēmisko risku kolēģijai, EVTI un attiecīgajiem ECBS dalībniekiem piekļūt darījumu līmeņa datiem:

- a) par visiem darījuma partneriem attiecīgajās jurisdikcijās;
- b) par atvasināto instrumentu līgumiem, kuru atsauces struktūra atrodas attiecīgajā jurisdikcijā vai kuru atsauces parāds ir valsts parāds attiecīgajā jurisdikcijā.

10. Darījumu reģistrs atļauj attiecīgajai ECBS dalībniecei piekļūt pozīciju līmeņa datiem par atvasināto instrumentu līgumiem, kuru valūtu ir emitējusi šī dalībniece.

11. Prudenciālas uzraudzības īstenošanas nolūkā darījumu reģistrs atļauj attiecīgajām struktūrām, kas minētas Regulas (ES) Nr. 648/2012 81. panta 3. punktā, piekļūt visiem tādu darījumu partneru darījumu datiem, uz kuriem attiecas ziņošanas pienākums.

3. pants

Trešo valstu iestādes

1. Saistībā ar attiecīgo iestādi trešā valstī, kas ir noslēgusi starptautisku nolīgumu ar Savienību, kā minēts Regulas (ES) Nr. 648/2012 75. pantā, darījumu reģistrs atļauj piekļūt datiem, ņemot vērā trešās valsts iestādes pilnvaras un pienākumus un saskaņā ar attiecīgā starptautiskā nolīguma noteikumiem.

2. Saistībā ar attiecīgo iestādi trešā valstī, kas ir noslēgusi sadarbības nolīgumu ar EVTI, kā minēts Regulas (ES) Nr. 648/2012 76. pantā, darījumu reģistrs atļauj piekļūt datiem, ņemot vērā trešās valsts iestādes pilnvaras un pienākumus un saskaņā ar attiecīgā sadarbības nolīguma noteikumiem.

4. pants

Darbības standarti datu apkopošanai un salīdzināšanai

1. Darījumu reģistrs nodrošina piekļuvi datiem struktūrām, kuras ir minētas Regulas (ES) Nr. 648/2012 81. panta 3. punktā, saskaņā ar saziņas procedūrām, standartiem attiecībā uz saziņu un atsauces datiem, ko parasti izmanto starptautiskā līmenī.

2. Darījumu partneri izveido unikālu identifikatoru katram atvasināto instrumentu līgumam, lai darījumu reģistri varētu apkopot un salīdzināt datus starp dažādiem darījumu reģistriem.

5. pants**Darbības standarti saistībā ar piekļuvi datiem**

1. Darījumu reģistrs reģistrē informāciju par piekļuvi datiem, kas sniegta struktūrām, kas minētas Regulas (ES) Nr. 648/2012 81. panta 3. punktā.

2. Šā panta 1. punktā minētajā informācijā ietver:

a) datu apjomu, kam nodrošināta piekļuve;

b) atsauci uz juridiskajiem noteikumiem, kas atļauj piekļūt šādiem datiem saskaņā ar Regulu (ES) Nr. 648/2012 un šo regulu.

6. 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, 2012. gada 19. decembrī

Komisijas vārdā –
priekšsēdētājs
José Manuel BARROSO

KOMISIJAS DELEĢĒTĀ REGULA (ES) Nr. 152/2013**(2012. gada 19. decembris),****ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 648/2012 attiecībā uz regulatīviem tehniskajiem standartiem par kapitāla prasībām centrālajiem darījumu partneriem****(Dokuments attiecas uz EEZ)**

EIROPAS KOMISIJA,

ņemot vērā Līgumu par Eiropas Savienības darbību,

ņemot vērā Eiropas Centrālās bankas atzinumu ⁽¹⁾,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 ⁽²⁾ un jo īpaši tās 16. panta 3. punktu,

tā kā:

(1) Regulā (ES) Nr. 648/2012 cita starpā ir noteiktas prudenčuālās uzraudzības prasības attiecībā uz centrālajiem darījumu partneriem (turpmāk – CCP), lai nodrošinātu, ka tie ir droši un stabili, kā arī vienmēr atbilst kapitāla prasībām. Ņemot vērā, ka no tūrvērtēs darbībām izrietošos riskus lielā mērā sedz speciāli finanšu resursi, šādām kapitāla prasībām vajadzētu nodrošināt, ka CCP ir vienmēr pienācīgi nodrošināts ar kapitālu pret kredītriskiem, darījumu partnera riskiem, tirgus riskiem, operacionālajiem riskiem, juridiskajiem un uzņēmējdarbības riskiem, ja tie jau nav nodrošināti ar speciāliem finanšu resursiem, un ka vajadzības gadījumā tas spēj savas darbības organizēti izbeigt vai pārstrukturēt.

(2) Saistībā ar tehniskajiem standartiem jo īpaši būtu jāņem vērā kredītiestāžu un ieguldījumu sabiedrību kapitāla prasības, jo CCP, īstenojot nesegtas darbības, ir pakļauti riskiem, kas ir līdzīgi riskiem, ar kuriem saskaras kredītiestādes un ieguldījumu sabiedrības. Tāpat būtu jāņem vērā attiecīgās daļas Maksājumu un norēķinu sistēmu komitejas un Starptautiskās Vērtspapīru komisiju organizācijas izdotajos finanšu tirgus infrastruktūru principos (turpmāk – CPSS-IOSCO principi). Lai nodrošinātu, ka CCP spēj savas darbības organizēti izbeigt vai pārstrukturēt, to rīcībā vajadzētu būt pietiekamiem finanšu resursiem, lai atbilstīgā laikposmā spētu segt darbības izdevumus. CCP būtu šādā laikposmā jāspēj īstenot jebkāda veida pasākumi, lai pārstrukturētu savas kritiski svarīgās darbības, tostarp veiktu rekapitalizāciju, aizvietotu vadību, pārskatītu savas uzņēmējdarbības stratēģijas jomas, izmaksu vai maksu struktūras, pārstrukturētu pakalpojumus, ko tas sniedz, likvidētu savu tūrvērtēs portfeli vai apvienotos ar citu CCP, vai nodotu savas tūrvērtēs darbības citam CCP. Darbību izbeigšanas vai pārstrukturēšanas laikā CCP joprojām ir jāturpina darboties. Lai gan šajā gadījumā dažas no izmaksām, piemēram, mārketinga

izmaksas, var samazināties, citas izmaksas, piemēram, juridiskās izmaksas, var palielināties. Tādēļ gada bruto darbības izdevumus uzskata par atbilstīgu aptuvenu rādītāju, kas atspoguļo faktiskos izdevumus CCP darbību izbeigšanas vai pārstrukturēšanas laikā. Lai ņemtu vērā CCP izmantoto grāmatvedības prakšu dažādību, darbības izdevumi būtu jāaplūko saskaņā ar starptautiskajiem finanšu pārskatu standartiem (turpmāk – IFRS), kas pieņemti saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes 2002. gada 19. jūlija Regulu (EK) Nr. 1606/2002 par starptautisko grāmatvedības standartu piemērošanu ⁽³⁾, vai saskaņā ar vairākiem citiem ierobežotiem noteikumiem, kuri piemērojami šajā jomā, kā noteikts Savienības tiesību aktos.

(3) Tā kā kapitālam vienmēr jābūt pietiekamam, lai nodrošinātu darbību organizētu izbeigšanu un atbilstīgu aizsardzību pret attiecīgajiem riskiem, kā noteikts Regulas (ES) Nr. 648/2012 16. panta 2. punktā, ir jāizstrādā agrīnas brīdināšanas instruments, lai kompetentās iestādes varētu saņemt informāciju pietiekami savlaicīgi pirms situācijas, kurā CCP kapitāls tuvojās kapitāla prasībai, ieviešot paziņošanas sliekšni, kas noteikts 110 % apmērā no kapitāla prasības.

(4) Neraugoties uz grūtībām saistībā ar operacionālā riska kvantificēšanu, Eiropas Parlamenta un Padomes 2006. gada 14. jūnija Direktīvā 2006/48/EK par kredītiestāžu darbības sākšanu un veikšanu ⁽⁴⁾ ir paredzēts attiecīgais sliekšnis, ko piemēro, lai noteiktu kapitāla prasību CCP. Atbilstīgi Direktīvai 2006/48/EK operacionālā riska definīcijā būtu jāietver juridiskais risks saistībā ar tehniskajiem standartiem par centrālo darījuma partneru kapitāla prasībām.

(5) Direktīvā 2006/48/EK un Eiropas Parlamenta un Padomes 2006. gada 14. jūnija Direktīvā 2006/49/EK par ieguldījumu sabiedrību un kredītiestāžu kapitāla pietiekamību ⁽⁵⁾ ir paredzēts attiecīgais sliekšnis, lai noteiktu kapitāla prasības nolūkā segt kredītrisku, darījuma partnera kredītrisku un tirgus risku, ko nesedz speciālie finanšu resursi, jo tie ir līdzīgi riskiem, ar kuriem saskaras kredītiestādes vai ieguldījumu sabiedrības.

⁽¹⁾ Oficiālajā Vēstnesī vēl nav publicēts.

⁽²⁾ OV L 201, 27.7.2012., 1. lpp.

⁽³⁾ OV L 243, 11.9.2002., 1. lpp.

⁽⁴⁾ OV L 177, 30.6.2006., 1. lpp.

⁽⁵⁾ OV L 177, 30.6.2006., 201. lpp.

- (6) CCP rīcībā nav jābūt kapitālam tirdzniecības riska darījumu segšanai un iemaksām fondā saistību neizpildes gadījumiem, kas izriet no sadarbības mehānisma, ja ir atbilstība Regulas (ES) Nr. 648/2012 52. un 53. panta prasībām. Tomēr, ja šīs prasības nav izpildītas, CCP savstarpējās saiknes var tos pakļaut papildu riskam, ja to izvietotais nodrošinājums nav pilnīgi aizsargāts un ja nav nodrošināts tā bankrota attālinājums vai ja iemaksas fondā saistību neizpildes gadījumiem ir apdraudētas gadījumā, kad centrālā darījuma partnera, kas saņem nodrošinājumu, tūrvērtes dalībnieks nepilda saistības. Tādēļ tādos gadījumos iemaksām fondā saistību neizpildes gadījumiem un tirdzniecības riska darījumiem ar citiem CCP būtu jāpiemēro kapitāla prasības. Lai izvairītos no ietekmes izplatīšanās, prasībām attiecībā uz iemaksām fondā saistību neizpildes gadījumiem ar citiem CCP kopumā vajadzētu būt konservatīvākām nekā kapitāla prasībām saistībā ar kredītiestāžu riska darījumiem ar CCP. CCP paša resursus, ko izmanto iemaksām cita CCP fondā saistību neizpildes gadījumiem, nevajadzētu ņemt vērā Regulas (ES) Nr. 648/2012 16. panta 2. punktā minētajiem mērķiem, jo šie resursi netiek ieguldīti saskaņā ar tās ieguldījumu politiku. Tos arī nevajadzētu uzskaitīt divreiz, aprēķinot riska darījumu riska svērtās vērtības, kas izriet no šīm iemaksām.
- (7) Laiks, kas vajadzīgs, lai organizēti izbeigtu darbības, ir stingri atkarīgs no konkrētā CCP sniegtajiem tūrvērtes pakalpojumiem un no tirgus vides, kurā tas darbojas, jo īpaši gadījumā, kad cits CCP var pārņemt tā pakalpojumus. Tādēļ darbību izbeigšanai vajadzīgo mēnešu skaita pamatā vajadzētu būt CCP paša aplēsēm, kuras ir jāapstiprina kompetentajai iestādei. Šis laikposms ir jānosaka ne mazāk kā sešus mēnešus ilgs, lai nodrošinātu kapitāla prasību konsultatīvu līmeni.
- (8) Uzņēmējdarbības risks attiecas uz risku, ko CCP uzņemas savas efektivitātes un vispārējo uzņēmējdarbības nosacījumu iespējamo izmaiņu dēļ, kuras, iespējams, kaitēs tā finanšu stāvoklim, jo samazināsies tā ieņēmumi vai palielināsies tā izdevumi, kas novedīs pie zaudējumiem, kas ir jānodrošina ar kapitālu. Tā kā uzņēmējdarbības riska līmenis ir lielā mērā atkarīgs no katra CCP konkrētās situācijas un to var izraisīt dažādi faktori, piemēram, neefektīvas procedūras, negatīva tirgus vide, neefektīva reaģēšana uz tehnoloģiju progresu vai uzņēmējdarbības stratēģijas jomu vāja īstenošana, kapitāla prasības pamatā vajadzētu būt CCP paša aplēsēm, kuras ir jāapstiprina kompetentajai iestādei. Ir jānosaka minimums, lai nodrošinātu kapitāla prasību konsultatīvu līmeni.
- (9) Eiropas Banku iestāde (turpmāk – EBI), pirms tā iesniedza tehnisko standartu projektu, kas ir pamatā šai regulai, cieši sadarbojās ar Eiropas Centrālo banku sistēmu (turpmāk – ECB) un apspriedās ar Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestādi (turpmāk – EVTI). EBI arī organizēja atklātu

sabiedrisko apspriešanu par regulatīvu tehnisko standartu projektu, analizēja iespējamās saistītās izmaksas un ieguvumus un pieprasīja Banku nozares ieinteresēto personu grupas, kas izveidota saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 1093/2010 ⁽¹⁾ 37. pantu, atzinumu.

- (10) Šīs regulas pamatā ir regulatīvu tehnisko standartu projekts, ko Eiropas Komisijai iesniegusi Eiropas Uzraudzības iestāde (Eiropas Banku iestāde),

IR PIENĒMUSI ŠO REGULU.

1. pants

Kapitāla prasības

1. CCP rīcībā ir kapitāls, ieskaitot nesadalīto peļņu un rezerves, kas vienmēr ir lielāks par vai vienāds ar šādu vērtību summu:

- a) CCP kapitāla prasības savu darbību izbeigšanai vai pārstrukturēšanai, ko aprēķina saskaņā ar 2. pantu;
- b) CCP kapitāla prasības operacionālā un juridiskā riska segšanai, ko aprēķina saskaņā ar 3. pantu;
- c) CCP kapitāla prasības kredītriska, darījuma partnera kredītriska un tirgus riska segšanai, ko aprēķina saskaņā ar 4. pantu;
- d) CCP kapitāla prasības uzņēmējdarbības riska segšanai, ko aprēķina saskaņā ar 5. pantu.

2. CCP ir ieviesis procedūras, lai noteiktu visus risku avotus, kas var ietekmēt tā notiekošās funkcijas, un ņem vērā iespējamās negatīvas ietekmes varbūtējo iedarbību uz saviem ieņēmumiem vai izdevumiem, kā arī savu kapitāla līmeni.

3. Ja CCP rīcībā esošā kapitāla apmērs saskaņā ar 1. punktu ir mazāks par 110 % no kapitāla prasībām vai mazāks par 110 % no 7,5 miljoniem euro (paziņošanas sliekšnis), CCP nekavējoties informē kompetento iestādi un turpina tai sniegt atjauninātu informāciju vismaz reizi nedēļā, līdz CCP rīcībā esošā kapitāla apmērs sasniedz līmeni virs paziņošanas sliekšņa.

4. Šo informāciju sniedz rakstiski, ietverot šādus elementus:

- a) iemeslus, kādēļ CCP kapitāla līmenis ir zemāks par paziņošanas sliekšni, un CCP finansiālās situācijas īstermiņa perspektīvas aprakstu;

⁽¹⁾ OV L 331, 15.12.2010., 12. lpp.

b) vispusīgu aprakstu par pasākumiem, ko CCP paredzējis īstenot, lai nodrošinātu pastāvīgu atbilstību kapitāla prasībām.

2. pants

Kapitāla prasības darbību izbeigšanai vai pārstrukturēšanai

1. CCP savus gada bruto darbības izdevumus dala ar divpadsmit, lai noteiktu savus mēneša bruto darbības izdevumus, un iegūto skaitli reizina ar laikposmu, kas vajadzīgs tā darbību izbeigšanai vai pārstrukturēšanai, kā noteikts saskaņā ar 2. punktu. Šā aprēķina rezultāts ir kapitāls, kas vajadzīgs, lai nodrošinātu CCP darbību organizētu izbeigšanu vai pārstrukturēšanu.

2. Lai noteiktu 1. punktā minēto laikposmu CCP darbību izbeigšanai vai pārstrukturēšanai, CCP iesniedz kompetentajai iestādei apstiprināšanai saskaņā ar šīs kompetentās iestādes pilnvarām atbilstīgi Regulas (ES) Nr. 648/2012 III sadaļai savas aplēses par atbilstīgo laikposmu, lai izbeigtu vai pārstrukturētu savas darbības. Noteiktais laikposms ir pietiekams, lai nodrošinātu (arī saspringtos tirgus apstākļos) CCP darbību organizētu izbeigšanu vai pārstrukturēšanu, operāciju reorganizāciju, tīrvērtes portfeļa likvidāciju vai tīrvērtes darbību nodošanu citam CCP. Aplēsēs ņem vērā CCP pozīciju likviditāti, lielumu, termiņstrukturū un iespējamās pārrobežu ierobežojumus, kā arī produktu veidus, kam veic tīrvērti. CCP darbību izbeigšanas vai pārstrukturēšanas laikposmam, ko izmanto kapitāla prasības aprēķināšanai, jābūt vismaz sešiem mēnešiem.

3. CCP atjaunina savas darbību izbeigšanai vai pārstrukturēšanai atbilstīgā laikposma aplēses vienmēr, kad ir radušās būtiskas izmaiņas pieņēmumos, kas ir pamatā šīm aplēsēm, un iesniedz šīs atjauninātās aplēses kompetentajai iestādei apstiprināšanai.

4. Šajā pantā darbības izdevumus aplūko saskaņā ar starptautiskajiem finanšu pārskatu standartiem (turpmāk – IFRS), kas pieņemti atbilstīgi Regulai (EK) Nr. 1606/2002, vai saskaņā ar Padomes Direktīvām 78/660/EEK⁽¹⁾, 83/349/EEK⁽²⁾ un 86/635/EEK⁽³⁾, vai pēc vajadzības saskaņā ar trešās valsts vispārēji pieņemtiem grāmatvedības principiem, kurus atzīst par līdzvērtīgiem IFRS atbilstīgi Komisijas Regulai (EK) Nr. 1569/2007⁽⁴⁾, vai trešās valsts grāmatvedības standartiem, ko drīkst izmantot saskaņā ar minētās regulas 4. pantu. CCP izmanto savu jaunāko revidēto informāciju no saviem gada finanšu pārskatiem.

3. pants

Kapitāla prasības attiecībā uz operacionālo un juridisko risku

1. CCP aprēķina savas kapitāla prasības attiecībā uz 1. pantā minēto operacionālo – tostarp juridisko – risku, izmantojot vai

⁽¹⁾ OV L 222, 14.8.1978., 11. lpp.

⁽²⁾ OV L 193, 18.7.1983., 1. lpp.

⁽³⁾ OV L 372, 31.12.1986., 1. lpp.

⁽⁴⁾ OV L 340, 22.12.2007., 66 lpp.

nu pamatrādītāju pieeju, vai uzlaboto rādītāju pieejas, kā noteikts Direktīvā 2006/48/EK, piemērojot 2.–7. punktā paredzētos ierobežojumus.

2. CCP drīkst izmantot pamatrādītāju pieeju, lai aprēķinātu savas kapitāla prasības attiecībā uz operacionālo risku, saskaņā ar Direktīvas 2006/48/EK 103. pantu.

3. CCP ievieš labi dokumentētu operacionālā riska novērtēšanas un pārvaldības sistēmu, kurā skaidri norādītas atbildības jomas šajā sistēmā. CCP nosaka savus operacionālos riskus un izseko attiecīgos operacionālā riska datus, tostarp datus par būtiskiem zaudējumiem. Šai sistēmai veic regulāras pārbaudes, ko īsteno neatkarīga persona, kurai ir vajadzīgās zināšanas, lai veiktu šādu pārbaudi.

4. CCP operacionālā riska novērtēšanas sistēma ir cieši integrēta CCP riska pārvaldības procesos. Tās rezultāti ir CCP operacionālā riska profila uzraudzības un kontroles procesa neatņemama sastāvdaļa.

5. CCP ievieš augstākās vadības ziņošanas sistēmu, kas nodrošina operacionālā riska ziņojumus CCP attiecīgajām struktūrām. CCP ievieš procedūras piemērotu darbību veikšanai atbilstīgi vadības ziņojumos sniegtajai informācijai.

6. CCP var arī iesniegt pieteikumu savai kompetentajai iestādei, lai saņemtu atļauju izmantot uzlaboto rādītāju pieejas. Kompetentā iestāde var CCP piešķirt atļauju izmantot uzlaboto rādītāju pieejas, pamatojoties uz tā operacionālā riska aprēķina sistēmām saskaņā ar Direktīvas 2006/48/EK 105. pantu.

7. CCP, kas izmanto uzlaboto rādītāju pieejas, kā noteikts 6. punktā, lai aprēķinātu savas kapitāla prasības attiecībā uz operacionālo risku, rīcībā ir kapitāls, kurš vienmēr ir lielāks par vai vienāds ar 80 % no kapitāla, kas vajadzīgs, izmantojot pamatrādītāju pieeju saskaņā ar 2. punktu.

4. pants

Kapitāla prasības attiecībā uz kredītrisku, darījuma partnera kredītrisku un tirgus risku, ko nesiedz jau Regulas (ES) Nr. 648/2012 41.–44. pantā minētie speciālie finanšu resursi

1. CCP aprēķina savas 1. pantā minētās kapitāla prasības kā summu, ko veido 8 % no šā CCP riska darījumu riska svērtajām vērtībām attiecībā uz kredītrisku un darījuma partnera kredītrisku un šā CCP kapitāla prasībām attiecībā uz tirgus risku, kuru aprēķina saskaņā ar Direktīvu 2006/48/EK un Direktīvu 2006/49/EK, piemērojot 2.–5. punktā noteiktos ierobežojumus.

2. Lai aprēķinātu kapitāla prasības attiecībā uz tirgus risku, ko nesedz jau Regulas (ES) Nr. 648/2012 41.–44. pantā minētie speciālie finanšu resursi, CCP izmanto Direktīvas 2006/49/EK I–IV pielikumā noteiktās metodes.

3. Lai aprēķinātu riska darījumu riska svērtās vērtības attiecībā uz kredītrisku, ko nesedz jau Regulas (ES) Nr. 648/2012 41.–44. pantā minētie speciālie finanšu resursi, CCP izmanto standartizēto pieeju attiecībā uz kredītrisku, kura noteikta Direktīvas 2006/48/EK 78.–83. pantā.

4. Lai aprēķinātu riska darījumu riska svērtās vērtības attiecībā uz darījuma partnera kredītrisku, ko nesedz jau Regulas (ES) Nr. 648/2012 41.–44. pantā minētie speciālie finanšu resursi, CCP izmanto metodi, kura paredz novērtēšanu pēc tirgus vērtības un kura noteikta Direktīvas 2006/48/EK III pielikuma 3. daļā, un finanšu nodrošinājuma paplašināto metodi, veicot uzraudzības iestāžu noteikto svārstīguma korekciju, kas paredzēta Direktīvas 2006/48/EK VIII pielikuma 3. daļā.

5. Ja nav atbilstības visiem Regulas (ES) Nr. 648/2012 52. un 53. pantā minētajiem nosacījumiem un ja CCP neizmanto pašu resursus, CCP piemēro riska svērumu 1 250 % apmērā savam

riskam, kas izriet no cita CCP iemaksām fondā saistību neizpildes gadījumiem, un riska svērumu 2 % apmērā savam riskam, kurš izriet no tirdzniecības riska darījumiem ar citu CCP.

5. pants

Kapitāla prasības attiecībā uz uzņēmējdarbības risku

1. CCP iesniedz kompetentajai iestādei apstiprināšanai saskaņā ar šīs kompetentās iestādes pilnvarām atbilstīgi Regulas (ES) Nr. 648/2012 III sadaļai savas aplēses par kapitālu, kas vajadzīgs, lai segtu zaudējumus, kurus rada uzņēmējdarbības risks, pamatojoties uz saprātīgi prognozējamiem negatīviem scenārijiem, kas attiecas uz tā uzņēmējdarbības modeli.

2. Kapitāla prasības attiecībā uz uzņēmējdarbības risku ir vienādas ar apstiprinātajām aplēsēm, un tām jābūt vismaz 25 % apmērā no tā gada bruto darbības izdevumiem. Šajā pantā bruto darbības izdevumus aplūko saskaņā ar 2. panta 4. punktu.

6. pants

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, 2012. gada 19. decembrī

Komisijas vārdā –
priekšsēdētājs
José Manuel BARROSO

KOMISIJAS DELEĢĒTĀ REGULA (ES) Nr. 153/2013**(2012. gada 19. decembris),****ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 648/2012 attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par prasībām centrālajiem darījumu partneriem****(Dokuments attiecas uz EEZ)**

EIROPAS KOMISIJA,

ņemot vērā Līgumu par Eiropas Savienības darbību,

ņemot vērā Eiropas Centrālās bankas atzinumu ⁽¹⁾,

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 ⁽²⁾ un jo īpaši tās 25. panta 8. punktu, 26. panta 9. punktu, 29. panta 4. punktu, 34. panta 3. punktu, 41. panta 5. punktu, 42. panta 5. punktu, 44. panta 2. punktu, 45. panta 5. punktu, 46. panta 3. punktu, 47. panta 8. punktu un 49. panta 4. punktu,

tā kā:

(1) Šīs regulas noteikumi ir savstarpēji cieši saistīti, jo tie attiecas uz organizatoriskajām prasībām, tostarp par datu uzskaiti un darbības nepārtrauktību, un uz prudenciālas uzraudzības prasībām, tostarp saistībā ar maržām, saistību neizpildes fondu, likviditātes riska kontroli, secību saistību neizpildes gadījumā, nodrošinājumu, ieguldījumu politiku, modeļu pārskatīšanu, stresa testiem un atpakaļejošām pārbaudēm. Lai nodrošinātu saskaņotību starp šiem noteikumiem, kuriem vajadzētu stāties spēkā vienlaicīgi, un sekmētu to, ka personām, uz kurām attiecas šie pienākumi, ir iespējams to visaptverošs pārskats un viegla pieeja tiem, ir vēlams visus Regulas (ES) Nr. 648/2012 III un IV sadaļā paredzētos tehniskos standartus iekļaut vienā regulā.

(2) Ņemot vērā finanšu tirgu globālo raksturu, šajā regulā būtu jāņem vērā Maksājumu un norēķinu sistēmu komitejas un Starptautiskās Vērtspapīru komisiju organizācijas izdotie finanšu tirgus infrastruktūru principi (CPSS-IOSCO principi), kas kalpo par globālu kritēriju regulatīvajās prasībās centrālajiem darījumu partneriem.

(3) Lai nodrošinātu, ka centrālie darījumu partneri ir droši un stabili jebkādos tirgus apstākļos, ir svarīgi, lai tie pieņemtu piesardzīgas riska pārvaldības procedūras, kas pienācīgi aptvertu visus riskus, kam centrālie darījumu partneri ir vai var būt pakļauti. Šajā sakarā centrālo darījumu partneru faktiski piemērotajiem riska pārvaldības

standartiem vajadzētu būt stingrākiem nekā šajā regulā noteiktajiem standartiem, ja to uzskata par vajadzīgu riska pārvaldības nolūkos.

(4) Lai skaidri identificētu ierobežotu skaitu jēdzienu, kuri izriet no Regulas (ES) Nr. 648/2012, kā arī noteiktu tehniskos terminus, kas vajadzīgi šā tehniskā standarta izstrādei, būtu jādefinē vairāki termini.

(5) Ir svarīgi nodrošināt, lai atzīti trešās valsts centrālie darījumu partneri neradītu šķēršļus pienācīgai Savienības tirgu darbībai. Tādēļ ir būtiski nodrošināt, lai atzīti centrālie darījumu partneri nevarētu piemērot mazāk stingras riska pārvaldības prasības salīdzinājumā ar Savienības standartiem, kā rezultāts varētu būt regulējuma arbitrāža. Informācijai, kas jāsniedz EVTI saistībā ar trešās valsts centrālā darījumu partnera atzīšanu, vajadzētu dot EVTI iespēju novērtēt, vai attiecīgais centrālais darījumu partneris pilnībā atbilst prudenciālas uzraudzības prasībām, ko piemēro attiecīgajā trešā valstī. Turklāt Komisijas veiktajai līdzvērtības noteikšanai būtu jānodrošina, ka trešās valsts normatīvie akti ir līdzvērtīgi visiem Regulas (ES) Nr. 648/2012 IV sadaļas un šīs regulas noteikumiem.

(6) Lai nodrošinātu pienācīgu ieguldītāju aizsardzības līmeni trešo valstu centrālo darījumu partneru atzīšanā, Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestāde (EVTI) papildus obligātajai informācijai var pieprasīt vēl citu informāciju, lai varētu novērtēt, vai ir izpildīti Regulā (ES) Nr. 648/2012 paredzētie nosacījumi.

(7) Pastāvīga vērtēšana, vai trešās valsts centrālais darījumu partneris pilnībā atbilst prudenciālas uzraudzības prasībām, ir attiecīgās trešās valsts kompetentās iestādes pienākums. Informācijai, kas trešo valstu centrālajiem darījumu partneriem kā pieteikuma iesniedzējiem ir jāsniedz EVTI, nevajadzētu atkārtot trešās valsts kompetentās iestādes veikto novērtējumu, bet gan apliecināt, ka centrālajiem darījumu partneriem trešā valstī tiek piemērota efektīva uzraudzība un nodrošināta prasību izpilde, tādējādi garantējot augstu ieguldītāju aizsardzības līmeni.

(8) Lai EVTI varētu veikt pilnīgu novērtējumu, pieprasījuma iesniedzēja – trešās valsts centrālā darījumu partnera – sniegtā informācija būtu jāpapildina ar informāciju, kas vajadzīga, lai novērtētu, cik efektīva ir īstenotā uzraudzība, izpildes nodrošināšanas pilnvaras un trešās valsts kompetentās iestādes veiktās darbības. Šāda informācija būtu jāsniedz saskaņā ar Regulu (ES) Nr. 648/2012 izveidotā sadarbības režīma ietvaros. Šādam sadarbības režīmam būtu jānodrošina, ka EVTI tiek laikus informēta

⁽¹⁾ Oficiālajā Vēstnesī vēl nav publicēts.

⁽²⁾ OV L 201, 27.7.2012., 1. lpp.

par visiem uzraudzības vai izpildes nodrošināšanas pasākumiem pret centrālo darījumu partneri, kas iesniedzis pieprasījumu par atzīšanu, par jebkādam izmaiņām nosacījumos, ar kuriem attiecīgajam centrālajam darījumu partnerim piešķirta atļauja, un par jebkuru būtisku atjauninājumu sākotnējā informācijā, kuru centrālais darījumu partneris sniedzis saskaņā ar atzīšanas procedūru.

- (9) Regulas (ES) Nr. 648/2012 prasības attiecībā uz iekšējo riska ziņošanas kārtību ir jāprecizē sīkāk, lai ieviestu tādu riska pārvaldības sistēmu, kas aptver iekšējās riska pārvaldības procedūras struktūru, tiesības un pienākumus. Lai nodrošinātu, ka centrālais darījumu partneris darbojas stabila tiesiskā regulējuma ietvaros, pārvaldības sistēmā būtu jāņem vērā dažādi uzņēmējdarbības tiesību režīmi Eiropas Savienībā.
- (10) Lai nodrošinātu, ka centrālais darījumu partneris piemēro atbilstošas procedūras, tādējādi nodrošinot atbilstību šai regulai, Regulai (ES) Nr. 648/2012 un Komisijas Īstenošanas Regulai (ES) Nr. 1249/2012 ⁽¹⁾, būtu jāprecizē centrālā darījumu partnera atbilstības nodrošināšanas funkcijas uzdevumi un pienākumi.
- (11) Ir nepieciešams skaidri definēt valdes un augstākās vadības atbildību, kā arī precizēt minimālās prasības attiecībā uz valdes darbību, lai nodrošinātu, ka centrālā darījumu partnera organizatoriskā struktūra ļauj tam sniegt savus pakalpojumus un veikt savas darbības pastāvīgi un pienācīgā veidā. Ir jānosaka arī skaidra un precīza ziņojumu sniegšanas kārtība, lai nodrošinātu pārskatatbildību.
- (12) Lai nodrošinātu stabilu un pārdomātu centrālā darījumu partnera pārvaldību, ir svarīgi, lai tā atalgojuma politika mazinātu stimulus uzņemties pārmērīgi riskantas darbības. Lai atalgojuma politika sniegtu vēlamos rezultātus, valdei tā būtu atbilstīgi jāuzrauga un jāpārskata un jāizveido īpaša komiteja, kas pienācīgi pārraudzītu atalgojuma politikas īstenošanu.
- (13) Lai nodrošinātu, ka centrālajam darījumu partnerim ir pietiekami cilvēkresursi visu saistību izpildei, ka tie ir atbildīgi par savu darbību izpildi un ka kompetentajām iestādēm ir kontaktpunkti to uzraudzītajos centrālajos darījumu partneros, centrālajiem darījumu partneriem vajadzētu būt vismaz galvenā risku pārvaldītāja amatam, galvenā atbilstības nodrošināšanas inspektora amatam un galvenā tehnoloģiju pārvaldītāja amatam.
- (14) Centrālajiem darījumu partneriem vajadzētu pienācīgi novērtēt un uzraudzīt to, cik lielā mērā dažādu struktūru valdes sastāvā esošiem valdes locekļiem ir interešu konflikti centrālā darījumu partnera grupas ietvaros vai ārpus tās. Valdes locekļus nevajadzētu kavēt būt dažādu struktūru valdes sastāvā, ja vien tas nerada interešu konfliktu.
- (15) Lai nodrošinātu efektīvu revīzijas funkciju, centrālajam darījumu partnerim vajadzētu noteikt tā iekšējo revidentu pienākumus un ziņošanas kārtību, nodrošinot, ka jautājumi tiek savlaicīgi iesniegti izskatīšanai valdē un kompetentajām iestādēm. Izveidojot un uzturot iekšējās revīzijas funkciju, vajadzētu skaidri definēt tās uzdevumus, neatkarību un objektivitāti, darbības jomu un atbildību, pilnvaras, pārskatatbildību un darbības standartus.
- (16) Lai attiecīgā kompetentā iestāde varētu efektīvi veikt savus pienākumus, tai būtu jānodrošina pieeja visai informācijai, kas vajadzīga, lai noteiktu, vai centrālais darījumu partneris atbilst atļaujas piešķiršanas nosacījumiem. Centrālajam darījumu partnerim šādu informāciju vajadzētu darīt pieejamu bez nepamatotas kavēšanās.
- (17) Centrālo darījumu partneru veiktajai datu uzskaitēi būtu jāļauj iegūt pilnīgu informāciju par centrālo darījumu partneru kredītriska darījumu apjomu ar tīrvērtes dalībniekiem un jādod iespēja uzraudzīt implicēto sistēmisko risku. Tai arī būtu jāļauj kompetentām iestādēm, EVTI un attiecīgajiem ECBS locekļiem adekvāti rekonstruēt tīrvērtes procesu, lai novērtētu atbilstību regulatīvajām prasībām, tostarp ziņošanas prasībām. Turklāt reģistrētie dati ir noderīgi arī centrālajiem darījumu partneriem, pildot normatīvās prasības un pienākumus pret tīrvērtes dalībniekiem, kā arī strīda gadījumos.
- (18) Dati, kurus centrālie darījumu partneri sniedz darījumu reģistriem, būtu jāreģistrē, lai sniegtu kompetentajām iestādēm iespēju pārbaudīt, vai centrālie darījumu partneri pilda ziņošanas pienākumu, kas noteikts Regulā (ES) Nr. 648/2012, un iespēju viegli piekļūt informācijai gadījumos, kad tā nav atrodamā darījumu reģistros.
- (19) Nosakot datu uzskaites prasības attiecībā uz tirdzniecību, būtu jāizmanto tāda pati koncepcija, kā nosakot ziņošanas pienākumu Regulas (ES) Nr. 648/2012 9. pantā, lai nodrošinātu centrālo darījumu partneru pienācīgu ziņojumu sniegšanu.
- (20) Lai nodrošinātu darbības nepārtrauktību traucējumu laikā, centrālā darījumu partnera rezerves datu apstrādes vietai vajadzētu atrasties pietiekami tālu un pietiekami ģeogrāfiski atšķirīgā vietā no galvenās vietas, lai to nevarētu ietekmēt tas pats negadījums, kas izraisījis galvenās datu apstrādes vietas nepieejamību. Būtu jāizstrādā scenāriji, lai analizētu krīzes notikumu ietekmi uz būtiskajiem pakalpojumiem, tostarp scenāriji, kuros paredzēta sistēmu nepieejamība dabas katastrofas rezultātā. Šīs analīzes būtu regulāri jāpārskata.
- (21) Centrālie darījumu partneri ir sistēmiski nozīmīgas finanšu tirgus infrastruktūras, un tiem būtu jāatjauno būtiskās funkcijas divu stundu laikā, ideālā gadījumā dublēšanas sistēmām būtu jāuzsāk datu apstrāde tūlīt pēc starpgadījuma. Centrālajiem darījumu partneriem būtu arī jānodrošina ļoti liela iespējamība, ka dati nepazudīs.

⁽¹⁾ OV L 352, 21.12.2012., 32. lpp.

- (22) Ir svarīgi, lai tūrvērtes dalībnieka saistību neizpilde neizraisītu ievērojamus zaudējumus citiem tirgus dalībniekiem. Tādēļ centrālajiem darījumu partneriem, izmantojot saistību nepildītāja iemaksātās maržas, ir jāspēj segt vismaz attiecīgu proporcionālo daļu no iespējamajiem zaudējumiem, kas centrālajam darījumu partnerim varētu rasties slēgšanas (*close out*) procesa laikā. Noteikumos attiecībā uz dažādām finanšu instrumentu kategorijām būtu jābūt noteiktai minimālajai procentuālajai daļai, kādai jābūt nosegtai ar maržām. Turklāt centrālajiem darījumu partneriem būtu jāievēro principi, saskaņā ar kuriem to maržu līmeņi tiek pienācīgi pielāgoti katra finanšu instrumenta vai vērtspapīru portfeļa, kam tie veic tūrvērti, īpašībām.
- (23) Centrālajiem darījumu partneriem nevajadzētu augstas konkurences apstākļu rezultātā samazināt savas maržas līdz tādām līmenim, kas apdraud to drošumu. Šā iemesla dēļ maržas aprēķināšanā būtu jāievēro īpašas prasības attiecībā uz tās galvenajiem komponentiem. Šajā ziņā maržas aprēķināšanā būtu jāņem vērā viss tirgus apstākļu spektrs, tostarp stresa periodi.
- (24) Būtu jāievieš noteikumi, kuros noteikta atbilstīga procentuālā daļa un laikposmi likvidācijas periodam un vēsturiskā svārstīguma aprēķināšanai. Tomēr, lai nodrošinātu, ka centrālie darījumu partneri pienācīgi pārvalda risku, ar kuru tie saskaras, būtu vēlams nenorādīt konkrētu pieeju, kas centrālajam darījumu partnerim būtu jāpiemēro, aprēķinot vajadzīgās maržas no šiem parametriem. To pašu iemeslu dēļ centrālajiem darījumu partneriem nevajadzētu liegt piemērot dažādas uzticamas metodoloģiskās pieejas, lai noteiktu maržas finanšu instrumentu portfelim. Tiem būtu jāļauj izmantot metodes, kas balstītas uz korelācijām starp finanšu instrumenta vai finanšu instrumentu kopuma, kam tie veic tūrvērti, cenu risku, kā arī jebkuras citas piemērotas metodes, kas balstītas uz līdzvērtīgām statistiskajām atkarībām.
- (25) Lai noteiktu laika periodu, kurā centrālais darījumu partneris ir pakļauts tirgus riskam, kas saistīts ar saistību nepildītāja pozīcijas pārvaldību, centrālajam darījumu partnerim būtu jāņem vērā attiecīgās finanšu instrumentu vai vērtspapīru portfeļa, kam veic tūrvērti, īpašības, piemēram, to likviditātes līmenis un pozīcijas lielums vai tās koncentrācija. Centrālajiem darījumu partneriem būtu piesardzīgi jāizvērtē, cik ilgs laiks, sākot no pēdējās maržu iekasēšanas, ir vajadzīgs, lai pilnībā slēgtu saistību nepildītāja pozīciju, pozīcijas lielums un tās koncentrācija.
- (26) Lai novērstu finanšu nestabilitātes palielināšanos, centrālajiem darījumu partneriem vajadzētu, cik vien tas ir praktiski iespējams, pieņemt tālredzīgas maržas aprēķināšanas metodoloģijas, kas ierobežo prociklisku izmaiņu iespējamību maržas prasībās, vienlaikus nemazinot centrālā darījumu partnera izturētspēju.
- (27) Augstāks uzticamības intervāls attiecībā uz ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem principā ir pamatots, jo šo produktu cenu informācija ir mazāk uzticama un par tiem ir pieejams mazāk vēsturisko datu riska pakļautības aplēsēm. Centrālie darījumu partneri varētu veikt tūrvērti ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, kurus neskar minētā parādība un kuriem ir tādas pašas riska iezīmes kā biržas sarakstā iekļautiem atvasinātajiem instrumentiem, un tiem būtu jāspēj veikt šo produktu tūrvērti konsekventā veidā neatkarīgi no darījuma vai līguma noslēgšanas metodes.
- (28) Atbilstīga definīcija ārkārtējiem, taču iespējamajiem tirgus apstākļiem ir būtiska sastāvdaļa centrālā darījumu partnera riska pārvaldībā. Lai centrālā darījumu partnera riska pārvaldības sistēma būtu vienmēr aktuāla, ārkārtējus, taču iespējamus tirgus apstākļus nevajadzētu uzskatīt par statistisku jēdzienu, bet drīzāk par apstākļiem, kas laika gaitā mainās un atšķiras dažādos tirgos. Viens un tas pats scenārijs, kas ir ārkārtējs, taču iespējams vienam centrālajam darījumu partnerim, var būt bez lielas nozīmes citam centrālajam darījumu partnerim. Centrālajam darījumu partnerim būtu jāizveido stabils iekšējās politikas regulējums tādu tirgu noteikšanai, kuros tam ir riska darījumi, un jāizmanto kopējs minimālo standartu kopums ārkārtēju, taču iespējamu tirgus apstākļu definēšanai katrā identificētajā tirgū. Tam būtu objektīvi jāapsver iespēja, ka saspringta situācija var rasties vienlaicīgi vairākos tirgos.
- (29) Lai nodrošinātu, ka tiek veikti pienācīgi un stabili pārvaldības pasākumi, centrālā darījumu partnera izmantotā sistēma ārkārtēju, taču iespējamu tirgus apstākļu identificēšanai būtu jāapspriež riska komitejā un tai būtu jāsaņem valdes apstiprinājums. Tā būtu jāpārskata vismaz reizi gadā, riska komitejai apspriežot rezultātus un tad darot tos zināmus valdei. Pārskatīšanai būtu jānodrošina, ka izmaiņas centrālā darījumu partnera riska darījumu apmērā un koncentrācijā, kā arī notikumi tirgū, kurā tas darbojas, tiek atspoguļoti ārkārtēju, taču iespējamu tirgus apstākļu definīcijā. Šī pārskatīšana tomēr nedrīkstētu aizstāt centrālā darījumu partnera pastāvīgu vērtējuma veikšanu par tā saistību neizpildes fonda atbilstību, ņemot vērā mainīgos tirgus apstākļus.
- (30) Lai nodrošinātu sava likviditātes riska efektīvu pārvaldību, centrālajiem darījumu partneriem būtu jāpiemēro prasība izveidot likviditātes riska pārvaldības sistēmu. Šai sistēmai būtu jābūt atkarīgai no tā saistību veida un jāattiecas uz instrumentiem, kas centrālajam darījumu partnerim ir pieejami, lai novērtētu likviditātes risku, ar ko tas saskaras, noteiktu iespējamās likviditātes problēmas un nodrošinātu likvido resursu pietiekamību.
- (31) Novērtējot likvido resursu pietiekamību, centrālajam darījumu partnerim būtu jāpiemēro prasība ņemt vērā tā turēto resursu apjomu un likviditāti, kā arī šo aktīvu iespējamo koncentrācijas risku. Ir svarīgi, lai centrālie darījumu partneri būtu spējīgi identificēt visu galveno veidu likviditātes koncentrāciju savos resursos un rezultātā centrālā darījumu partnera likviditātes resursi vajadzības gadījumā būtu pieejami nekavējoties. Centrālajiem darījumu partneriem būtu jāņem vērā arī papildu riski, kas rodas saistībā ar daudzpusējām attiecībām, savstarpējām atkarībām un koncentrācijām.

- (32) Tā kā likviditātes resursiem ir jābūt viegli pieejamiem, lai segtu tās pašas dienas darījumus vai pat diennakts darījumus, centrālais darījumu partneris var izmantot naudu kredīspējīgās komercbankās, piešķirtās kredītlīnijas, repo, ļoti viegli pārdodamu nodrošinājumu un ieguldījumus, kas ir viegli pieejami un pārvēršami naudā saskaņā ar iepriekš noliktiem un ļoti uzticamiem finansēšanas noteikumiem pat saspringtu tirgus apstākļu gadījumā. Par daļu no likvidiem finanšu resursiem saskaņā ar iepriekšēju vienošanos šāda nauda un nodrošinājums būtu jāuzskata tikai noteiktos apstākļos.
- (33) Lai nodrošinātu centrālajam darījumu partnerim vajadzīgo stimulu noteikt piesardzīgas prasības un uzturēt šo summu pienācīgā līmenī, vienlaikus izvairoties no regulējuma arbitrāžas, ir svarīgi ieviest vienotu metodoloģiju, kā aprēķināt un uzturēt konkrētu īpašu pašu resursu summu, kura centrālajam darījumu partnerim būtu jā saglabā izmantošanai saistību neizpildes gadījumā. Ir svarīgi, lai tie resursi, kas paredzēti saistību neizpildes rezultātā radušos zaudējumu segšanai, tiktu uzturēti papildus prasītajam minimālajam kapitālam un tiem būtu skaidri atšķirīga funkcija no minimālā kapitāla, kas paredzēts citu risku segšanai, kuriem centrālais darījumu partneris varētu tikt pakļauts.
- (34) Ir svarīgi, lai centrālie darījumu partneri piemērotu vienotu metodoloģiju pašu resursu aprēķināšanai, kuri paredzēti izmantošanai saistību neizpildes gadījumā, – tādējādi centrālajiem darījumu partneriem tiktu nodrošināti līdzvērtīgi darbības nosacījumi. Ja metodoloģija nebūtu pietiekami skaidri noteikta, ļaujot centrālajiem darījumu partneriem rīkoties pēc saviem ieskatiem, tad rezultāti starp centrālajiem darījumu partneriem stipri atšķirtos, tādējādi veicinot regulatīvās arbitrāžas rašanos. Tāpēc ir svarīgi, lai metodoloģija neparedzētu centrālajiem darījumu partneriem rīcības brīvību. Šim nolūkam būtu lietderīgi piemērot vienkāršu procentu likmi, kas balstīta uz skaidri identificējamu lielumu, un skaidru metodoloģiju, lai nodrošinātu, ka centrālie darījumu partneri saskaņotā veidā aprēķina saistību neizpildes gadījumā izmantojamo pašu resursu lielumu.
- (35) Būtu jāparedz minimālo kritēriju kopums, lai nodrošinātu, ka pieņemams nodrošinājums ir ar augstu likviditāti un var tikt pārvērsts skaidrā naudā ātri un ar minimālu ietekmi uz cenu. Šiem kritērijiem vajadzētu attiekties uz nodrošinājuma emitentu, nodrošinājuma tirgus likviditāti un to, vai tā vērtība korelē ar tā dalībnieka kredīspēju, kurš sniedz nodrošinājumu, lai nosegtu iespējamo korelācijas risku. Centrālajam darījumu partnerim vajadzētu būt iespējai nepieciešamības gadījumā piemērot papildu kritērijus, lai sasniegtu vēlamo stabilitāti.
- (36) Centrālajiem darījumu partneriem būtu jāpieņem vienīgi ļoti likvids nodrošinājums, ar kuru saistīts minimāls kredītrisks un tirgus risks. Lai nodrošinātu, ka centrālā darījumu partnera turētais nodrošinājums saglabā augstu likviditāti jebkuros apstākļos, centrālajiem darījumu partneriem ir jāizveido pārredzama un paredzama politika un procedūras, lai vērtētu un pastāvīgi uzraudzītu to aktīvu likviditāti, kuri tiek pieņemti kā nodrošinājums, un piemērotu atbilstīgas vērtēšanas metodoloģijas. Tādēļ centrālajiem darījumu partneriem vajadzētu piemērot arī koncentrācijas ierobežojumus, kuru mērķis ir uzturēt pietiekamu nodrošinājuma dažādību, lai nodrošinātu, ka to iespējams īsā laikā pienācīgi likvidēt, nekādiem būtiskiem tirgus riskiem neietekmējot tā vērtību. Nosakot savu politiku par atbilstīgu nodrošinājumu un koncentrācijas ierobežojumiem, tiem būtu jāņem vērā šāda nodrošinājuma globālā pieejamība, ņemot vērā savas politikas iespējamo makroekonomisko ietekmi.
- (37) Lai izvairītos no korelācijas riska, tīrvērtes dalībniekiem principā nevajadzētu atļaut izmantot kā nodrošinājumu pašiem savus vērtspapīrus vai vērtspapīrus, ko emitējusi kāda struktūra tās pašas grupas ietvaros. Tomēr centrālajam darījumu partnerim vajadzētu būt iespējai atļaut tīrvērtes dalībniekiem kā nodrošinājumu sniegt segtās obligācijas, kuras neskartu emitenta maksātnespēja. Pamatā esošajam nodrošinājumam tomēr vajadzētu būt pienācīgi nošķirtam no emitenta un atbilst minimālajiem kritērijiem, kuri izvirzīti pieņemamam nodrošinājumam. Tīrvērtes dalībniekam nevajadzētu emitēt finanšu instrumentus ar primāro mērķi, ka cits tīrvērtes dalībnieks tos izmantos kā nodrošinājumu.
- (38) Lai garantētu centrālo darījumu partneru drošumu, centrālajam darījumu partnerim komercbankas garantija būtu jāatzīst kā nodrošinājums tikai pēc garantijas emitenta un garantijas tiesiskā, līgumiskā un darbības pamata rūpīgas izvērtēšanas. Būtu jāizvairās no centrālo darījumu partneru nenodrošinātiem riska darījumiem ar komercbankām. Tādēļ komercbanku garantijas drīkst pieņemt tikai tad, ja tas notiek saskaņā ar stingriem nosacījumiem. Šie nosacījumi lielākoties ir spēkā tādos tirgos, kam raksturīga augsta komercbanku koncentrācija, kuras ir gatavas sniegt kredītu nefinanšu tīrvērtes dalībniekiem. Tāpēc šādos gadījumos būtu jāpieļauj augstāks koncentrācijas ierobežojums.
- (39) Lai ierobežotu savu tirgus risku, centrālajam darījumu partnerim būtu jāpieņem prasība novērtēt savu nodrošinājumu vismaz reizi dienā. Tam būtu jāpieņemo pārdomāti atskaitījumi, kas atspoguļo nodrošinājuma vērtības potenciālo pieaugumu laikposmā no pēdējās pārvērtēšanas līdz tam brīdim, kad nodrošinājumu var pamatoti uzskatīt par likvidētu saspringtos tirgus apstākļos. Nosakot nodrošinājuma līmeni, būtu jāņem vērā arī iespējamā pakļautība korelācijas riskam.
- (40) Atskaitījumu izmantošanai būtu jādod centrālajam darījumu partnerim iespēja izvairīties no lielām un neparedzētām korekcijām prasītā nodrošinājuma summā, tādējādi pēc iespējas izvairoties no procikliskas ietekmes.
- (41) Lai izvairītos no iespējamās nelabvēlīgas ietekmes uz cenu gadījumā, ja nodrošinājums tiek īsā laikā likvidēts, centrālajam darījumu partnerim nevajadzētu koncentrēt nodrošinājumu uz ierobežotu skaitu emitentu vai ierobežotu skaitu aktīvu. Šā iemesla dēļ koncentrētas nodrošinājuma pozīcijas nevajadzētu uzskatīt par ļoti likvidām.

- (42) Likviditātes risks, kredītrisks un tirgus risks būtu jāizsver finanšu instrumentu portfeļa līmenī, kā arī atsevišķa finanšu instrumenta līmenī. Koncentrēts finanšu instrumentu portfelis var būtiskā mērā negatīvi ietekmēt nodrošinājuma vai finanšu instrumentu likviditāti, kuros centrālais darījumu partneris var ieguldīt savus finanšu resursus, jo pārdot lielas pozīcijas saspringtos tirgus apstākļos nav iespējams, nepazeminot tirgus cenu. Tā paša iemesla dēļ nodrošinājums, ko uztur centrālais darījumu partneris, būtu pastāvīgi jāuzrauga un jāvērtē, lai nodrošinātu, ka tas joprojām ir likvids.
- (43) Enerģijas atvasināto instrumentu tirgi ir īpaši spēcīgi savstarpēji saistīti ar tūlītējo preču darījuma līgumu tirgiem, un šajos atvasināto instrumentu tirgos lielu proporcionālo daļu veido nefinanšu tīrvērtes dalībnieki. Šajos tirgos būtisks skaits tirgus dalībnieku ir arī attiecīgās preces ražotāji. Pieeja pietiekamam nodrošinājumam, kas pilnībā segtu komercbanku garantijas, šiem nefinanšu tīrvērtes dalībniekiem varētu likt atbrīvoties no būtiskas savu esošo pozīciju daļas vai varētu kavēt tos turpināt veikt savu pozīciju tīrvērti kā centrālā darījumu partnera tiešiem tīrvērtes dalībniekiem. Šis process varētu radīt tirgus traucējumus enerģijas tirgos likviditātes un tirgus dalībnieku dažādības ziņā. Tāpēc tā piemērošanu vajadzētu atlikt saskaņā ar pārdomāti izstrādātu grafiku.
- (44) Lai nodrošinātu Regulā (ES) Nr. 648/2012 noteiktā regulējuma konsekventu piemērošanu, visām nozarēm piemērojamo noteikumu galīgajā formā būtu jāparedz līdzīgas prasības. Enerģētikas uzņēmumi patlaban darbojas saskaņā ar labi iedibinātu sistēmu, un tiem būs nepieciešams laiks, lai pielāgotos jaunajām prasībām, kas noteiktas, lai novērstu kaitīgu ietekmi uz reālo ekonomiku. Tādēļ šādu veidu tirgiem ir vēlams noteikt tādu piemērošanas datumu, kas ļautu veikt adekvātu pāreju no esošās tirgus prakses, pārmērīgi neietekmējot tirgus struktūru un likviditāti.
- (45) Centrālā darījumu partnera ieguldījumu politikā visaugstākā prioritāte būtu jāpiešķir kapitāla saglabāšanas principiem un likviditātes maksimizācijai. Ieguldījumu politikai būtu arī jānodrošina, ka nerodas interešu konflikti ar centrālā darījumu partnera komerciālajām interesēm.
- (46) Lai nodrošinātu konsekvenci starptautiskā mērogā, nosakot kritērijus, kādiem būtu jāatbilst finanšu instrumentiem, lai tos uzskatītu par centrālajam darījumu partnerim attaisnojamiem ieguldījumiem, būtu jāņem vērā 16. princips CPSS-IOSCO principos. Konkrēti, būtu jānosaka prasība, ka centrālajam darījumu partnerim jāpiemēro ierobežojoši standarti attiecībā uz finanšu instrumenta emitentu, iespēju nodot finanšu instrumentu un kredītrisku, tirgus risku, svārstīgumu un ārvalstu valūtas maiņas kursa risku, kas apdraud finanšu instrumentu. Centrālajam darījumu partnerim būtu jānodrošina, ka tas negatīvi neietekmē pasākumus, kas veikti, lai ierobežotu tā ieguldījumus apdraudošos riskus, pārmērīgi pakļaujot sevi riskam saistībā ar jebkādu atsevišķu finanšu instrumentu, finanšu instrumentu veidu, atsevišķu emitentu, emitentu veidu vai atsevišķu turētājbanku.
- (47) Izmantojot atvasinātos instrumentus, centrālais darījumu partneris pakļauj sevi papildu kredītriskam un tirgus riskam, un tāpēc ir nepieciešams noteikt ierobežojošu nosacījumu kopumu, ar kādiem centrālais darījumu partneris drīkst ieguldīt savus finanšu resursus atvasinātajos instrumentos. Ņemot vērā to, ka centrālā darījumu partnera mērķim vajadzētu būt neitrālai pozīcijai attiecībā uz tirgus risku, vienīgie riski, pret kuriem centrālajam darījumu partnerim būtu jānodrošinās, ir tie, kuri attiecas uz centrālā darījumu partnera pieņemto nodrošinājumu, vai riski, kas rodas tīrvērtes dalībnieka saistību neizpildes gadījumā. Riskus attiecībā uz nodrošinājumu, ko pieņem centrālais darījumu partneris, var pietiekamā mērā pārvaldīt ar atskaitījumu palīdzību, un tādēļ centrālajam darījumu partnerim nav nepieciešams izmantot atvasinātos instrumentus. Atvasinātie instrumenti centrālajam darījumu partnerim būtu jāizmanto vienīgi likviditātes riska pārvaldīšanai, kurš saistīts ar riska darījumiem dažādās valūtās, un saistības nepildījuša tīrvērtes dalībnieka finanšu instrumentu portfeļa nodrošināšanas nolūkā, un tikai tad, ja centrālā darījumu partnera saistību neizpildes pārvaldības procedūras paredz šādu izmantojumu.
- (48) Lai garantētu centrālo darījumu partneru drošumu, tiem vajadzētu atļaut uzturēt naudas līdzekļus nenodrošinātos noguldījumos tikai minimālos apmēros. Nodrošinot savus naudas līdzekļus, centrālajiem darījumu partneriem vajadzētu pastāvīgi nodrošināt, ka tie vienmēr ir pietiekami aizsargāti pret likviditātes risku.
- (49) Ir nepieciešams noteikt stingras prasības attiecībā uz stresa testiem un atpakaļejošām pārbaudēm, lai nodrošinātu to, ka centrālo darījumu partneru modeļi, to metodoloģija un likviditātes riska pārvaldības sistēma darbojas pienācīgi, ņemot vērā visus riskus, kādiem centrālais darījumu partneris ir pakļauts, tā, lai centrālā darījumu partnera rīcībā vienmēr būtu pietiekami resursi šo risku segšanai.
- (50) Lai nodrošinātu centrālajiem darījumu partneriem noteikto prasību konsekventu piemērošanu, ir jānosaka sīki izstrādāti noteikumi attiecībā uz veicamo pārbaudžu veidiem, tostarp gan attiecībā uz stresa testiem, gan atpakaļejošām pārbaudēm. Lai gādātu par plašu nodrošinājuma un atvasināto instrumentu līgumu klāstu, kuriem tīrvērtē var tikt veikta nākotnē, ņemtu vērā atšķirības centrālā darījumu partnera uzņēmējdarbības un riska pārvaldības pieejās, darītu iespējamu rīkoties atbilstoši turpmākajai attīstībai un jauniem riskiem un pieļautu pietiekamu elastīgumu, ir nepieciešama uz kritērijiem balstīta pieeja.
- (51) Apstiprinot centrālo darījumu partneru modeļus, to metodoloģiju un likviditātes riska pārvaldības sistēmu, ir svarīgi iesaistīt piemērotu neatkarīgu personu, lai būtu iespējams noteikt un veikt vajadzīgos korektīvos pasākumus pirms īstenošanas un izvairīties no interešu konfliktiem. Neatkarīgajai personai vajadzētu būt pietiekamā mērā nesaistītai ar centrālā darījumu partnera darbībām, izstrādājot, īstenojot un vēlāk piemērojot pārskatāmo modeli vai politiku, un tai nedrīkstētu būt būtisks interešu konflikts. Šādiem nosacījumiem varētu atbilst vai nu iekšējā struktūra, kam ir atsevišķa ziņojumu sniegšanas kārtība, vai arī ārēja struktūra.

- (52) Dažādie centrālā darījumu partnera finanšu resursu aspekti, jo īpaši maržas segums, fonds saistību neizpildes gadījumiem un citi finanšu resursi, ir paredzēti dažādiem scenārijiem un mērķiem. Tāpēc ir nepieciešams noteikt īpašas prasības, lai ņemtu vērā šos mērķus un nodrošinātu konsekventu piemērošanu no visu centrālo darījumu partneru puses. Novērtējot nepieciešamo segumu, centrālajam darījumu partnerim nevajadzētu savstarpēji kompensēt jebkādu riska darījumus starp saistības neizpildījušiem tīrvērtes dalībniekiem, lai izvairītos no iespējamās šo riska darījumu ietekmes samazināšanas.
- (53) Dažādu veidu finanšu instrumentus, kuriem centrālais darījumu partneris var veikt tīrvērti, apdraud dažādi specifiski riski. Tāpēc centrālajam darījumu partnerim savos modeļos, metodoloģijā un likviditātes riska pārvaldības sistēmā vajadzētu piemērot prasību ņemt vērā visus riskus, kas saistīti ar tirgiem, kuriem tas nodrošina tīrvērtes pakalpojumus, lai nodrošinātu, ka tas ir pienācīgi novērtējis iespējamās nākotnes riska darījumus. Lai pienācīgi ņemtu vērā šos riskus, stresa testēšanas prasībās būtu jāiekļauj finanšu instrumentiem specifiski riski, kas saistīti ar dažādu veidu finanšu instrumentiem.
- (54) Lai centrālais darījumu partneris varētu nodrošināt, ka tā modelī sākotnējās maržas aprēķināšanai pienācīgi ņemti vērā tā iespējamie riska darījumi, papildus ikdienas atpakaļejošām maržas seguma pārbaudēm, kurās pārbauda pieprasītās maržas pietiekamību, tam vajadzētu veikt atpakaļejošas pārbaudes arī attiecībā uz modeļa parametriem un pieņēmumiem. Tas ir būtisks nosacījums, lai nodrošinātu, ka ar centrālo darījumu partneru modeļiem iespējams precīzi aprēķināt sākotnējo maržu.
- (55) Stingras prasības attiecībā uz maržas prasību jutīguma analīzi var iegūt lielāku nozīmi, ja tirgi ir nelikvidi vai svārstīgi, un tās vajadzētu izmantot, lai noteiktu būtisku modeļa parametru izmaiņu ietekmi. Jutīguma analīze ir efektīvs līdzeklis, lai atklātu slēptas nepilnības, ko nav iespējams atklāt atpakaļejošās pārbaudēs.
- (56) Ja stresa testi un atpakaļejošās pārbaudes netiek veiktas regulāri, tā rezultātā centrālā darījumu partnera finanšu un likvidie resursi var būt nepietiekami, lai segtu faktiskos riskus, kādiem tas ir pakļauts. Turklāt, ja tiks veiktas atbilstīgas pārbaudes, centrālā darījumu partnera modeļi, to metodoloģija un likviditātes riska pārvaldības sistēma spēs ātri piemēroties mainīgajiem tirgus apstākļiem un jauniem riskiem. Tāpēc centrālajiem darījumu partneriem būtu nekavējoties jāizmanto pārbaudžu rezultāti savu modeļu, metodoloģiju un likviditātes riska pārvaldības sistēmas pārskatīšanā.
- (57) Ekstremālu tirgus apstākļu modelēšana var palīdzēt centrālajam darījumu partnerim noteikt savu esošo modeļu, likviditātes riska pārvaldības sistēmas un finanšu un likvidu resursu robežas. Tomēr, modelējot dažādus tirgus un produktus, centrālajam darījumu partnerim ir jāspriež pašam. Reversie stresa testi būtu jāuzskata par lietderīgu pārvaldības rīku, lai gan ne par galveno, lai noteiktu atbilstīgu finanšu resursu līmeni.
- (58) Ir būtiski iesaistīt tīrvērtes dalībniekus, klientus un citas būtiskas ieinteresētās personas centrālā darījumu partnera saistību neizpildes gadījumā piemērojamo procedūru testēšanā, izmantojot situāciju simulācijas, lai nodrošinātu, ka tām ir izpratne un operatīvas iespējas veiksmīgi piedalīties saistību neizpildes situācijas pārvaldībā. Situāciju simulācijām vajadzētu imitēt saistību neizpildes scenāriju, lai nodemonstrētu tīrvērtes dalībnieku, klientu un citu attiecīgo ieinteresēto personu uzdevumus un pienākumus. Turklāt ir svarīgi, lai centrālajam darījumu partnerim būtu atbilstoši mehānismi, ar kuru palīdzību tas varētu pārliecināties, vai ir vajadzīgi korektīvi pasākumi, un atklāt jebkādas neskaidrības noteikumos un procedūrās vai rīcības brīvību, ko tās pieļauj. Centrālā darījumu partnera saistību neizpildes pārvaldības procedūru testēšana ir īpaši svarīga tad, ja tā ir balstīta uz saistības pildījušo tīrvērtes dalībnieku vai trešo personu palīdzību slēgšanas (*close-out*) procesā un ja saistību neizpildes gadījumā piemērojamās procedūras vēl nekad nav tikušas pārbaudītas faktiskā saistību neizpildes gadījumā.
- (59) Šī regula balstās uz regulatīvu tehnisko standartu projektu, ko Komisijai iesniedza Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestāde (EVTI).
- (60) Pirms iesniegt tehnisko standartu projektu, kas ir šīs regulas pamatā, EVTI attiecīgos gadījumos apspriedās ar Eiropas Banku iestādi (EBI), Eiropas Sistēmisko risku kolēģiju un Eiropas Centrālo banku sistēmas (ECBS) dalībniekiem. Saskaņā ar 10. pantu Eiropas Parlamenta un Padomes 2010. gada 24. novembra Regulā (ES) Nr. 1095/2010, ar ko izveido Eiropas Uzraudzības iestādi (Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestādi) ⁽¹⁾, EVTI rīkoja atklātas sabiedriskās apspriešanas par regulatīvo tehnisko standartu projektu, analizēja iespējamās saistītās izmaksas un ieguvumus un lūdza sniegt atzinumu Vērtspapīru un tirgu nozares ieinteresēto personu grupai, kas izveidota saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 1095/2010 37. pantu,

IR PIENĒMUSI ŠO REGULU.

I NODAĻA

VISPĀRĪGA INFORMĀCIJA

1. pants

Definīcijas

Šajā regulā izmanto šādas definīcijas:

- 1) "bāzes risks" ir risks, ko rada nepilnīgi korelējoša dinamika starp diviem vai vairākiem aktīviem vai līgumiem, kuriem centrālais darījumu partneris veic tīrvērti;

⁽¹⁾ OV L 331, 15.12.2010., 84. lpp.

- 2) "ticamības intervāls" ir riska darījumu procentuālais apjoms katram finanšu instrumentam, kam veikta tīrvērtē, konkrētā atskaites (*lookback*) periodā, kas centrālajam darījumu partnerim ir jāsedz noteikta likvidācijas perioda laikā;
- 3) "ienākums no īpašumtiesībām" ir labums, kas izriet no tiesām īpašumtiesībām uz fizisku preci, un to ietekmē gan tirgus apstākļi, gan tādi faktori kā fiziskas uzglabāšanas izmaksas;
- 4) "maržas" ir maržas, kā minēts Regulas (ES) Nr. 648/2012 41. pantā. Tās var būt arī sākotnējās maržas un mainīgās maržas;
- 5) "sākotnējās maržas" ir maržas, ko centrālais darījumu partneris iekasē, lai segtu iespējamās turpmākos riska darījumus ar tīrvērtes dalībniekiem, kas veikusi maržu iemaksu, un – attiecīgā gadījumā – ar sadarbībai centrālajiem darījumu partneriem, intervālā starp pēdējo maržas iekasēšanu un pozīciju likvidāciju pēc kāda tīrvērtes dalībnieka saistību neizpildes vai sadarbībai centrālā darījumu partnera saistību neizpildes;
- 6) "mainīgās maržas" ir maržas, kas iekasētas vai izmaksātas, ņemot vērā esošos no faktiskajām tirgus cenas izmaiņām izrietošos riska darījumus;
- 7) "pēkšņas saistību neizpildes risks" ir risks, ka partneris vai emitents pēkšņi neizpildīs saistības, pirms tirgum būs bijis laiks ņemt vērā tā paaugstināto saistību neizpildes risku;
- 8) "likvidācijas periods" ir laikposms, ko izmanto, lai aprēķinātu maržas, kas saskaņā ar centrālā darījumu partnera novērtējumu ir vajadzīgas, lai pārvaldītu savu riska darījumu apjomu ar dalībnieku, kas nepilda saistības, un kura laikā centrālais darījumu partneris ir pakļauts tirgus riskam, kas saistīts ar saistību nepildītāja pozīciju pārvaldību;
- 9) "atskaites periods" (*lookback period*) ir laikposms vēsturiskā svārstīguma aprēķināšanai;
- 10) "testēšanas izņēmums" ir testa rezultāts, kas liecina par to, ka centrālā darījumu partnera modelis vai likviditātes riska pārvaldības sistēma nav nodrošinājusi paredzēto seguma līmeni;
- 11) "korelācijas risks" ir risks, kas izriet no riska darījumiem ar partneri vai emitentu, ja šā partnera sniegtais vai emitenta emitētais nodrošinājums cieši korelē ar tā kredītrisku.

II NODAĻA

TREŠO VALSTU CENTRĀLO DARĪJUMU PARTNERU ATZĪŠANA

(Regulas (ES) Nr. 648/2012 25. pants)

2. pants

Informācija, kas jāsniedz EVTI centrālā darījumu partnera atzīšanai

Trešā valstī reģistrēta centrālā darījumu partnera iesniegtajā pieteikumā par atzīšanu ir iekļauta vismaz šāda informācija:

- a) juridiskās personas pilns nosaukums;
- b) akcionāri vai dalībnieki, kuriem ir būtiska līdzdalība;
- c) to dalībvalstu saraksts, kurās tas plāno sniegt pakalpojumus;
- d) finanšu instrumentu kategorijas, kurām tiek veikta tīrvērtē;
- e) informācija, kas iekļaujama EVTI tīmekļa vietnē saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 88. panta 1. punkta e) apakšpunktu;
- f) ziņas par tā finanšu resursiem, formu, to uzturēšanas metodēm un to nodrošināšanas pasākumiem, tostarp saistību neizpildes pārvaldības procedūrām;
- g) ziņas par maržu un saistību neizpildes fonda aprēķināšanas metodoloģiju;
- h) saraksts ar atbilstīgiem nodrošinājumiem;
- i) vērtību, kurām centrālais darījumu partneris – pieteikuma iesniedzējs veicis tīrvērti, sadalījums (ja nepieciešams, potenciālais) pa tām Savienības dalībvalsts valūtām, kurās centrālais darījumu partneris veicis tīrvērti;
- j) gada laikā pirms pieteikuma iesniegšanas datuma veikto stresa testu un atpakaļejošu pārbažu rezultāti;
- k) tā noteikumi un iekšējās procedūras ar pierādījumiem par pilnīgu atbilstību attiecīgajā trešā valstī piemērojamajām prasībām;
- l) ziņas par jebkādu ārpuspakalpojumu piesaisti;
- m) ziņas par nošķiršanas pasākumiem un attiecīgo juridisko stabilitāti un izpildāmību;

- n) ziņas par centrālā darījumu partnera pieejas prasībām un nosacījumiem attiecībā uz dalības apturēšanu un izbeigšanu;
- o) ziņas par jebkuru vienošanos par sadarbību, tostarp trešās valsts kompetentajai iestādei sniegtā informācija, lai tā varētu novērtēt vienošanos.

III NODAĻA

ORGANIZATORISKĀS PRASĪBAS

(Regulas (ES) Nr. 648/2012 26. pants)

3. pants

Pārvaldības sistēma

1. Būtiskākie komponenti centrālā darījumu partnera pārvaldības sistēmā, kas nosaka tā organizatorisko struktūru, kā arī skaidri noteiktu un labi dokumentētu politiku, procedūras un procesus, saskaņā ar kuriem darbojas valde un augstākā vadība, ir šādi:

- a) valdes un jebkādu valdes komiteju sastāvs, uzdevumi un pienākumi;
- b) vadības uzdevumi un pienākumi;
- c) augstākās vadības struktūra;
- d) ziņošanas kārtība starp augstāko vadību un valdi;
- e) valdes locekļu un augstākās vadības iecelšanas kārtība;
- f) riska pārvaldības, atbilstības un iekšējās kontroles funkciju izstrāde;
- g) procesi, lai nodrošinātu pārskatatbildību pret ieinteresētajām personām.

2. Centrālajam darījumu partnerim ir pietiekams personāls, lai izpildītu visas saistības, kuras izriet no šīs regulas un Regulas (ES) Nr. 648/2012. Centrālajam darījumu partnerim nav kopīga personāla ar citām grupas struktūrām, izņemot saskaņā ar vienošanos par ārpakalpojumiem atbilstīgi Regulas (ES) Nr. 648/2012 35. pantam.

3. Centrālais darījumu partneris nosaka atbildības sadalījumu, kas ir skaidri, konsekventi un labi dokumentēti. Centrālais darījumu partneris nodrošina, ka galvenā risku pārvaldītāja, galvenā atbilstības nodrošināšanas inspektora un galvenā tehnoloģiju

pārvaldītāja funkcijas veic dažādas personas – centrālā darījumu partnera darbinieki, kam piešķirta ekskluzīva kompetence veikt šīs funkcijas.

4. Centrālais darījumu partneris, kas ir daļa no grupas, ņem vērā iespējamo grupas ietekmi uz tā pārvaldības sistēmu, tostarp to, vai tas ir pietiekamā mērā neatkarīgs, lai izpildītu savus regulatīvos pienākumus kā atsevišķa juridiskā persona un vai tā neatkarību varētu apdraudēt grupas struktūra vai jebkurš valdes loceklis, kas ir arī tās pašas grupas citas struktūras valdes loceklis. Jo īpaši šāds centrālais darījumu partneris paredz īpašas procedūras interešu konfliktu novēršanai un pārvaldībai, tostarp attiecībā uz ārpakalpojumu izmantošanu.

5. Ja centrālais darījumu partneris uztur divu līmeņu valdes sistēmu, tad pārvaldes uzdevumus un pienākumus, kā noteikts šajā regulā un Regulā (ES) Nr. 648/2012, attiecīgi sadala uzraudzības padomei un valdei.

6. Riska pārvaldības politika, procedūras, sistēmas un pārbaudes ir daļa no saskaņotas un atbilstīgas regulējuma sistēmas, kuru regulāri pārskata un atjaunina.

4. pants

Riska pārvaldības un iekšējās kontroles mehānismi

1. Centrālajam darījumu partnerim ir stabila sistēma visu būtisko risku, kuriem tas ir pakļauts vai varētu tikt pakļauts, visaptverošai pārvaldībai. Centrālais darījumu partneris izveido dokumentētu politiku, procedūras un sistēmas, lai atklātu, novērtētu, uzraudzītu un pārvaldītu šādus riskus. Izveidojot riska pārvaldības politiku, procedūras un sistēmas, centrālais darījumu partneris strukturē tās tādā veidā, lai nodrošinātu, ka tūrvērtes dalībnieki pienācīgi pārvalda un mazina riskus, kurus tie rada centrālajam darījumu partnerim.

2. Centrālais darījumu partneris veic integrētu un visaptverošu pārskatu par visiem attiecīgajiem riskiem. Tie ietver riskus, kurus centrālajam darījumu partnerim rada tā tūrvērtes dalībnieki un – ciktāl praktiski iespējams – klienti, riskus, kurus tas rada tūrvērtes dalībniekiem un – ciktāl praktiski iespējams – klientiem, kā arī riskus, kurus centrālajam darījumu partnerim rada citas struktūras, piemēram (bet ne tikai), sadarbībā ar centrālie darījumu partneri, vērtspapīru norēķinu un maksājumu sistēmas, norēķinu bankas, likviditātes nodrošinātāji, centrālie vērtspapīru depozitāriji, tirdzniecības vietas, ko apkalpo centrālais darījumu partneris, un citi būtiski svarīgi pakalpojumu sniedzēji, un riskus, kurus tas rada šādām struktūrām.

3. Centrālais darījumu partneris izstrādā atbilstīgus riska pārvaldības rīkus, lai spētu pārvaldīt visus būtiskos riskus un ziņot par tiem. Tas ietver sistēmas, tirgus vai citu savstarpēju atkarību noteikšanu un pārvaldību. Ja centrālais darījumu partneris sniedz ar tūrvērti saistītus pakalpojumus, kuru riska profils atšķiras no tā funkcijām un kas potenciāli varētu tam radīt vērā ņemamus papildu riskus, tad centrālais darījumu partneris pienācīgi pārvalda šos papildu riskus. Tas var nozīmēt arī centrālā darījumu partnera sniegto papildu pakalpojumu juridisku nošķiršanu no tā pamatfunkcijām.

4. Pārvaldības sistēma nodrošina to, ka centrālā darījumu partnera valde uzņemas galīgo atbildību un pārskatatbildību par centrālā darījumu partnera risku pārvaldību. Valde definē, nosaka un dokumentē atbilstīgu pieļaujamo riska līmeni un centrālā darījumu partnera spēju uzņemties risku. Valde un augstākā vadība nodrošina, ka centrālā darījumu partnera politika, procedūras un pārbaudes atbilst centrālā darījumu partnera pieļaujamajam riska līmenim un spējai uzņemties risku un nosaka to, kā centrālais darījumu partneris identificē riskus, ziņo par tiem, pārtrauc un pārvalda riskus.

5. Centrālais darījumu partneris izmanto stabilas informācijas un riska kontroles sistēmas, kas nodrošina centrālajam darījumu partnerim un – attiecīgā gadījumā – tā tīrvērtes dalībniekiem un, ja iespējams, klientiem iespējas savlaicīgi saņemt informāciju, un atbilstīgi piemēro riska pārvaldības politiku un procedūras. Šīs sistēmas nodrošina vismaz to, ka pakļautība kredītriskam un likviditātes riskam tiek pastāvīgi uzraudzīta centrālā darījumu partnera līmenī, kā arī tīrvērtes dalībnieku līmenī un, ciktāl praktiski iespējams, klientu līmenī.

6. Centrālais darījumu partneris nodrošina, ka riska pārvaldības funkcijai ir vajadzīgās pilnvaras, kompetence un pieeja visai būtiskajai informācijai un ka tā ir pietiekami neatkarīga no citām centrālā darījumu partnera funkcijām. Centrālā darījumu partnera galvenais risku pārvaldītājs īsteno riska pārvaldības sistēmu, tostarp valdes noteikto politiku un procedūras.

7. Centrālajam darījumu partnerim ir piemēroti iekšējās kontroles mehānismi, lai palīdzētu valdei uzraudzīt un novērtēt tā riska pārvaldības politikas, procedūru un sistēmu piemērotību un efektivitāti. Šādi mehānismi ietver stabilas administratīvās un grāmatvedības procedūras, stabilu atbilstības nodrošināšanas funkciju un neatkarīgu iekšējo revīziju un apstiprināšanas vai pārskatīšanas funkciju.

8. Centrālā darījumu partnera finanšu pārskatu sagatavo katru gadu, un tā revīziju veic obligātie revidenti vai revīzijas uzņēmumi Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvas 2006/43/EK ⁽¹⁾ izpratnē.

5. pants

Atbilstības politika un procedūras

1. Centrālais darījumu partneris ievieš, īsteno un uztur atbilstīgu politiku un procedūras, kas paredzētas, lai atklātu jebkādu risku, ka centrālais darījumu partneris un tā darbinieki varētu nepildīt centrālā darījumu partnera saistības saskaņā ar šo regulu, Regulu (ES) Nr. 648/2012 un Īstenošanas regulu (ES) Nr. 1249/2012, kā arī saistītos riskus, un ievieš atbilstīgus pasākumus un procedūras, lai pēc iespējas mazinātu šādu risku un lai kompetentās iestādes varētu efektīvi īstenot savas pilnvaras atbilstīgi minētajām regulām.

⁽¹⁾ OV L 157, 9.6.2006., 87. lpp.

2. Centrālais darījumu partneris nodrošina, ka tā noteikumi, procedūras un līgumiskas vienošanās ir skaidras un visaptverošas un nodrošina atbilstību šai regulai, Regulai (ES) Nr. 648/2012 un Īstenošanas regulai (ES) Nr. 1249/2012, kā arī visām citām piemērojamajām normatīvajām un uzraudzības prasībām.

Centrālā darījumu partnera noteikumus, procedūras un līgumiskās vienošanās reģistrē rakstveidā vai izmantojot citu pastāvīgu informācijas nesēju. Šie noteikumi, procedūras un līgumiskās vienošanās un jebkādi pievienotie materiāli ir precīzi, aktuāli un viegli pieejami kompetentajai iestādei, tīrvērtes dalībniekiem un attiecīgā gadījumā arī klientiem.

Centrālais darījumu partneris nosaka un analizē to, cik stabili ir centrālā darījumu partnera noteikumi, procedūras un līgumiskās vienošanās. Ja nepieciešams, šīs analīzes veikšanai tiek lūgti neatkarīgi juridiskie atzinumi. Centrālajam darījumu partnerim ir spēkā procedūra, saskaņā ar kuru ierosina un īsteno izmaiņas tā noteikumos un procedūrās un pirms jebkādu būtisku izmaiņu īstenošanas apspriežas ar visiem attiecīgajiem tīrvērtes dalībniekiem un iesniedz ierosinātās izmaiņas kompetentajai iestādei.

3. Izstrādājot savus noteikumus, procedūras un līgumiskas vienošanās, centrālais darījumu partneris ņem vērā attiecīgos regulējuma principus un nozares standartus, un tirgus protokolus un skaidri norāda, ciktāl šīs prakses ir ņemtas vērā dokumentācijā, kas regulē centrālā darījumu partnera, tā tīrvērtes dalībnieku un citu attiecīgo trešo personu tiesības un pienākumus.

4. Centrālais darījumu partneris nosaka un analizē jautājumus saistībā ar iespējamo tiesību normu kolīziju un izstrādā noteikumus un procedūras, lai mazinātu šādā gadījumā radušos juridisko risku. Ja nepieciešams, centrālais darījumu partneris šīs analīzes veikšanai lūdz neatkarīgus juridiskos atzinumus.

Centrālā darījumu partnera noteikumos un procedūrās skaidri norāda tos tiesību aktus, kurus ir paredzēts piemērot katram centrālā darījumu partnera darbību un operāciju aspektam.

6. pants

Atbilstības nodrošināšanas funkcija

1. Centrālais darījumu partneris izveido un uztur pastāvīgu un efektīvu atbilstības nodrošināšanas funkciju, kura ir neatkarīga no citām centrālā darījumu partnera funkcijām. Tas nodrošina, ka atbilstības nodrošināšanas funkcijai ir vajadzīgās pilnvaras, resursi, kompetence un pieeja visai būtiskajai informācijai.

Savas atbilstības nodrošināšanas funkcijas izveidē centrālais darījumu partneris ņem vērā savas uzņēmējdarbības specifiku, apjomu un sarežģītību, kā arī šīs uzņēmējdarbības gaitā sniegto pakalpojumu un veikto darbību specifiku un klāstu.

2. Galvenajam atbilstības nodrošināšanas inspektoram ir vismaz šādi pienākumi:

- a) uzraudzīt un pastāvīgi izvērtēt atbilstību un efektivitāti pasākumiem, kas tiek veikti atbilstīgi 5. panta 4. punktam, un darbībām, kas veiktas, lai novērstu jebkādas nepilnības centrālā darījumu partnera saistību pildīšanā;
- b) administrēt atbilstības nodrošināšanas politiku un procedūras, ko izveidojusi augstākā vadība un valde;
- c) sniegt padomus un palīdzēt par centrālā darījumu partnera pakalpojumu un darbību veikšanu atbildīgajām personām nodrošināt centrālā darījumu partnera saistību izpildi atbilstīgi šai regulai, Regulai (ES) Nr. 648/2012 un Īstenošanas regulai (ES) Nr. 1249/2012 un attiecīgos gadījumos citām regulējošām prasībām;
- d) regulāri ziņot valdei par to, kā centrālais darījumu partneris un tā darbinieki nodrošina atbilstību šai regulai, Regulai (ES) Nr. 648/2012 un Īstenošanas regulai (ES) Nr. 1249/2012;
- e) izveidot procedūras, lai efektīvi novērstu nepilnības atbilstības nodrošināšanā;
- f) nodrošināt, lai personas, kas iesaistītas atbilstības nodrošināšanas funkcijas veikšanā, nebūtu iesaistītas to pakalpojumu un darbību izpildē, kuras tās uzrauga, un ka šādu personu interešu konflikti tiek pienācīgi atklāti un novērsti.

7. pants

Organizatoriskā struktūra un ziņošanas kārtības nodalīšana

1. Centrālais darījumu partneris nosaka valdes, augstākās vadības un jebkādu valdes komiteju sastāvu, uzdevumus un atbildību. Šī kārtība tiek skaidri noteikta un labi dokumentēta. Valde izveido vismaz revīzijas komiteju un atalgojuma komiteju. Saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 28. pantu izveidotā riska komiteja ir valdes padomdevēja komiteja.

2. Valde uzņemas vismaz šādus pienākumus:

- a) noteikt centrālajam darījumu partnerim skaidrus mērķus un stratēģijas;
- b) efektīvi uzraudzīt augstāko vadību;
- c) izveidot piemērotu atalgojuma politiku;
- d) izveidot un pārraudzīt riska pārvaldības funkciju;
- e) pārraudzīt atbilstības nodrošināšanas funkciju un iekšējās kontroles funkciju;

f) pārraudzīt ārpalpojumu piesaisti;

g) pārraudzīt atbilstību visiem šīs regulas, Regulas (ES) Nr. 648/2012 un Īstenošanas regulas (ES) Nr. 1249/2012 noteikumiem un visām pārējām normatīvajām un uzraudzības prasībām;

h) nodrošināt pārskatatbildību pret akcionāriem vai īpašniekiem un darbiniekiem, tīrvērtes dalībniekiem un to klientiem un citām attiecīgām ieinteresētajām personām.

3. Augstākajai vadībai ir vismaz šādi pienākumi:

a) nodrošināt centrālā darījumu partnera darbību atbilstību tā mērķiem un stratēģijai, kā to noteikusi valde;

b) izstrādāt un ieviest atbilstības nodrošināšanas un iekšējās kontroles procedūras, kas veicina centrālā darījumu partnera mērķu sasniegšanu;

c) regulāri pārskatīt un testēt iekšējās kontroles procedūras;

d) nodrošināt, lai pietiekami resursi būtu atvēlēti riska pārvaldībai un atbilstības nodrošināšanai;

e) aktīvi iesaistīties riska kontroles procesā;

f) nodrošināt, lai tiktu pienācīgi novērsti riski, kas apdraud centrālo darījumu partneri saistībā ar tā veiktajām tīrvērtes darbībām un ar tīrvērti saistītām darbībām.

4. Ja valde deleģē uzdevumus komitejām vai apakškomitejām, tā turpina apstiprināt tādus lēmumus, kuri var būtiski ietekmēt centrālā darījumu partnera riska profilu.

5. Kārtība, saskaņā ar kuru darbojas valde un augstākā vadība, ietver procedūras, lai atklātu, novērstu un pārvaldītu valdes un augstākās vadības locekļu iespējamās interešu konfliktus.

6. Centrālajam darījumu partnerim ir skaidra un tieša ziņojumu sniegšanas kārtība starp tā valdi un augstāko vadību, lai nodrošinātu, ka augstākā vadība ir pārskatatbildīga par savu darbību. Riska pārvaldības, atbilstības nodrošināšanas un iekšējās revīzijas darbību ziņošanas kārtība ir skaidra un nodalīta no ziņošanas kārtības, kas attiecas uz citām centrālā darījumu partnera darbībām. Riska direktors ziņo valdei vai nu tieši, vai ar riska komitejas priekšsēdētāja starpniecību. Galvenais atbilstības nodrošināšanas inspektors un iekšējās revīzijas funkcija ziņojumus sniedz tieši valdei.

8. pants

Atalgojuma politika

1. Atalgojuma komiteja izstrādā un pilnveido atalgojuma politiku, pārbauda tās īstenošanu, ko veic augstākā līmeņa vadība, un regulāri pārskata tās funkcionēšanu praksē. Pašu politiku dokumentē un pārskata vismaz reizi gadā.

2. Atalgojuma politika ir izstrādāta tā, lai atalgojuma līmenis un struktūra atbilstu piesardzīgai riska pārvaldībai. Politikā ņem vērā potenciālos riskus, kā arī esošos riskus un riska ietekmi. Izmaksu grafiki tiek sastādīti, ņemot vērā risku periodus. Jo īpaši mainīga atalgojuma gadījumā atalgojuma politikā pienācīgi ņem vērā iespējamās neatbilstības starp darbības rezultātiem un riska periodiem un nodrošina, ka maksājumi vajadzības gadījumā tiek atlikti. Kopējās atalgojuma summas mainīgās un nemainīgās daļas ir līdzsvarotas, un tajās ir ņemta vērā riska korekcija.

3. Atalgojuma politika nodrošina, ka riska pārvaldības, atbilstības nodrošināšanas un iekšējās revīzijas funkcijas veikšanā iesaistītie darbinieki tiek atalgoti tādā veidā, kas nav saistīts ar centrālā darījumu partnera uzņēmējdarbības rezultātiem. Atalgojuma līmenis ir atbilstošs, ņemot vērā atbildības līmeni, kā arī salīdzinot ar atalgojuma līmeni uzņēmējdarbības jomās.

4. Atalgojuma politikai ik gadu veic neatkarīgu revīziju. Šo revīziju rezultātus dara pieejamus kompetentajai iestādei.

9. pants

Informācijas tehnoloģiju sistēmas

1. Centrālais darījumu partneris izstrādā savu informācijas tehnoloģiju sistēmu koncepciju un nodrošina, ka tās ir uzticamas un drošas, kā arī spējīgas apstrādāt informāciju, kas nepieciešama centrālajam darījumu partnerim tā darbību un operāciju drošai un efektīvai veikšanai.

Informācijas tehnoloģiju arhitektūra ir labi dokumentēta. Sistēmas ir atbilstīgas centrālā darījumu partnera darbības vajadzībām un to apdraudošajiem riskiem, noturīgas, tostarp saspringtos tirgus apstākļos, un elastīgas, lai nepieciešamības gadījumā spētu apstrādāt papildu informāciju. Centrālais darījumu partneris nodrošina procedūras un jaudas plānošanu, kā arī pietiekamu rezerves jaudu, lai sistēma varētu apstrādāt visus atlikušos darījumus pirms dienas beigām būtisku darbības traucējumu apstākļos. Centrālais darījumu partneris nodrošina procedūras jaunu tehnoloģiju ieviešanai, tostarp skaidrus plānus iepriekšējās situācijas atjaunošanai.

2. Lai nodrošinātu augsta līmeņa drošību informācijas apstrādē un savienojamību ar saviem tīrvērtes dalībniekiem un klientiem, kā arī ar saviem pakalpojumu sniedzējiem, centrālā darījumu partnera informācijas tehnoloģiju sistēmas ir balstītas uz starptautiski atzītiem tehniskajiem standartiem un nozares

paraugpraksi. Pēc būtisku izmaiņu veikšanas un pēc būtiskiem darbības traucējumiem centrālais darījumu partneris pirms pirmās izmantošanas savām sistēmām veic stingru testēšanu, simulējot stresa apstākļus. Šo testu izstrādē un veikšanā vajadzības gadījumā iesaista tīrvērtes dalībniekus un klientus, sadarbīgos centrālos darījumu partnerus un citas ieinteresētās personas.

3. Centrālais darījumu partneris uztur stabilu informācijas drošības sistēmu, kas pienācīgi pārvalda tā informācijas drošības risku. Šī sistēma ietver atbilstīgus mehānismus, politiku un procedūras, lai aizsargātu informāciju no neatļautas izpaušanas, nodrošinātu datu precizitāti un integritāti un garantētu centrālā darījumu partnera pakalpojumu pieejamību.

4. Informācijas drošības sistēmā ietilpst vismaz šādi elementi:

- a) pārbaudes par piekļuvi sistēmai;
- b) pietiekama aizsardzība pret ielausanos sistēmā un datu ļaunprātīgu izmantošanu;
- c) īpašas ierīces, lai saglabātu datu autentiskumu un integritāti, tostarp kriptogrāfijas tehnika;
- d) uzticami tīkli un procedūras precīzas un tūlītējas datu pārraides nodrošināšanai bez būtiskiem traucējumiem;
- e) revīzijas informācijas uzskaites dati.

5. Informācijas tehnoloģiju sistēmas un informācijas drošības sistēmu pārskata vismaz reizi gadā. Tām veic neatkarīgus revīzijas novērtējumus. Šo novērtējumu rezultātus paziņo valdei un dara pieejamus kompetentajai iestādei.

10. pants

Informācijas atklāšana

1. Centrālais darījumu partneris bez maksas dara publiski pieejamu šādu informāciju:

- a) informāciju par savu pārvaldības sistēmu, tostarp:
 - i) savu organizatorisko struktūru, kā arī galvenajiem mērķiem un stratēģijām;
 - ii) atalgojuma politikas pamatelementiem;
 - iii) būtiskāko finanšu informāciju, tostarp tā jaunākos revīdētos finanšu pārskatus;
- b) informāciju par saviem noteikumiem, tostarp šādu informāciju:
 - i) saistību neizpildes pārvaldības procedūras, procedūras un papildinošus dokumentus;

- ii) būtisku informāciju par darbības nepārtrauktību;
- iii) informāciju par centrālā darījumu partnera riska pārvaldības sistēmām, metodēm un rezultātiem atbilstīgi XII nodaļai;
- iv) visu būtisko informāciju par to struktūru un darbībām, kā arī par tīrvērtes dalībnieku un klientu tiesībām un pienākumiem, kas vajadzīgi, lai tiem būtu iespējams skaidri noteikt un pilnībā izprast riskus un izmaksas, kas saistīti ar centrālā darījumu partnera pakalpojumu izmantošanu;
- v) centrālā darījumu partnera konkrētā brīža tīrvērtes pakalpojumus, tostarp sīku informāciju par katru pakalpojumu;
- vi) centrālā darījumu partnera riska pārvaldības sistēmas, metodes un rezultātus, tostarp informāciju par finanšu resursiem, ieguldījumu politiku, cenu datu avotiem un modeļiem, ko tas izmanto maržu aprēķināšanā;
- vii) tiesību aktus un noteikumus, kas reglamentē:
 - 1) pieeju centrālajam darījumu partnerim;
 - 2) līgumus, ko centrālais darījumu partneris noslēdzis ar tīrvērtes dalībniekiem un, ja iespējams, ar klientiem;
 - 3) līgumus, kurus centrālais darījumu partneris pieņem tīrvērtes veikšanai;
 - 4) jebkādas vienošanās par sadarbību;
 - 5) nodrošinājuma un saistību neizpildes fonda iemaksu izmantošanu, tostarp pozīciju un nodrošinājuma likvidāciju un to, cik lielā mērā nodrošinājums ir aizsargāts pret trešo pušu prasījumiem;

- c) informāciju par atbilstīgu nodrošinājumu un piemērojamiem atskaitījumiem;
- d) sarakstu ar visiem konkrētā brīža tīrvērtes dalībniekiem, tostarp tīrvērtes dalībniekiem piemērojamos kritērijus attiecībā uz dalības iegūšanu, apturēšanu un izbeigšanu.

Ja kompetentā iestāde piekrīt centrālajam darījumu partnerim, ka jebkāda šā punkta b) vai c) apakšpunktā minētā informācija var apdraudēt komercnoslēpumu vai centrālā darījumu partnera drošumu un stabilitāti, centrālais darījumu partneris var nolemt atklāt šo informāciju tādā veidā, kas novērš vai mazina šos riskus, vai arī neizpaust šo informāciju.

2. Centrālais darījumu partneris bez maksas atklāj sabiedrībai informāciju par visām būtiskajām izmaiņām tā pārvaldības

sistēmā, mērķos, stratēģijās un galvenajos politikas virzienos, kā arī tā piemērojamajos noteikumos un procedūrās.

3. Informācija, ko centrālais darījumu partneris atklāj sabiedrībai, ir pieejama tā tīmekļa vietnē. Informācija ir pieejama vismaz vienā no valodām, ko ierasts lietot starptautisko finanšu jomā.

11. pants

Iekšējā revīzija

1. Centrālais darījumu partneris izveido un uztur iekšējās revīzijas funkciju, kas ir nošķirta un neatkarīga no pārējām centrālā darījumu partnera funkcijām un darbībām un kurai ir šādi uzdevumi:

- a) izveidot, īstenot un uzturēt revīzijas plānu, lai pārbaudītu un novērtētu centrālā darījumu partnera sistēmu, iekšējās kontroles mehānismu un pārvaldības sistēmas atbilstību un efektivitāti;
- b) sniegt ieteikumus, pamatojoties uz tā darba rezultātiem, kas veikts saskaņā ar a) apakšpunktu;
- c) pārbaudīt šo ieteikumu izpildi;
- d) ziņot valdei par iekšējās revīzijas jautājumiem.

2. Iekšējās revīzijas funkcijai ir vajadzīgās pilnvaras, resursi, kompetence un pieeja visiem savu funkciju veikšanai svarīgajiem dokumentiem. Tā ir pietiekami neatkarīga no vadības un ziņojumus sniedz tieši valdei.

3. Iekšējā revīzija novērtē centrālā darījumu partnera riska pārvaldības procesu un kontroles mehānismu efektivitāti tādā veidā, kas ir proporcionāls dažādu uzņēmējdarbības virzienus apdraudošajiem riskiem un neatkarīgs no izvērtētajām uzņēmējdarbības jomām. Iekšējās revīzijas funkcijai ir pieejama vajadzīgā informācija, lai pārskatītu visas centrālā darījumu partnera darbības un operācijas, procesus un sistēmas, tostarp izmantotos ārpalpojumus.

4. Iekšējās revīzijas novērtējumi ir balstīti uz visaptverošu revīzijas plānu, kuru pārskata un paziņo kompetentajai iestādei vismaz reizi gadā. Centrālais darījumu partneris nodrošina to, ka, pamatojoties uz konkrētu notikumu, var nekavējoties veikt īpašas revīzijas. Revīzijas plānošanu un pārskatīšanu apstiprina valde.

5. Centrālā darījumu partnera tīrvērtes operācijām, riska pārvaldības procedūrām, iekšējās kontroles mehānismiem un kontiem veic neatkarīgu revīziju. Neatkarīgas revīzijas veic vismaz reizi gadā.

IV NODAĻA

UZSKAITES DATI

(Regulas (ES) Nr. 648/2012 29. pants)

12. pants

Vispārīgas prasības

1. Centrālais darījumu partneris reģistrētos datus glabā uz pastāvīga informācijas nesēja tā, lai informāciju varētu sniegt kompetentajām iestādēm, EVTI un attiecīgajām Eiropas Centrālo banku sistēmas (ECBS) dalībniecēm tādā formā un veidā, ka būtu izpildīti šādi nosacījumi:

- a) katru centrālā darījumu partnera veiktās apstrādes posmu ir iespējams rekonstruēt;
- b) ir iespējams reģistrēt, izsekot un izgūt datu oriģinālo saturu un jebkādos labojumus vai citus grozījumus;
- c) tiek veikti pasākumi, lai novērstu neatļautus grozījumus uzskaites datos;
- d) tiek veikti atbilstīgi pasākumi, lai nodrošinātu uzskaites datu drošību un konfidencialitāti;
- e) datu uzskaites sistēmā ir iekļauts mehānisms kļūdu konstatēšanai un labošanai;
- f) uzskaites sistēmā ir nodrošināta uzskaites datu savlaicīga atjaunošana sistēmas kļūmes gadījumā.

2. Ja dati vai informācija ir jaunāki par sešiem mēnešiem, tos sniedz 1. punktā minētajām iestādēm pēc iespējas ātrāk un vēlākais līdz brīdim, kad beidzas nākamā darbdiena pēc tam, kad ticis saņemts pieprasījums no attiecīgās iestādes.

3. Ja dati vai informācija ir vecāki par sešiem mēnešiem, tos sniedz 1. punktā minētajām iestādēm pēc iespējas ātrāk un ne vēlāk kā piecu darbdienu laikā pēc tam, kad ticis saņemts pieprasījums no attiecīgās iestādes.

4. Ja centrālā darījumu partnera apstrādātie dati satur personas datus, tad centrālais darījumu partneris ņem vērā savus pienākumus saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvu 95/46/EK ⁽¹⁾ un Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (EK) Nr. 45/2001 ⁽²⁾.

5. Ja centrālais darījumu partneris uztur datu reģistrus ārpus Savienības, tas nodrošina, ka kompetentajai iestādei, EVTI un attiecīgajām ECBS dalībniecēm ir iespējams piekļūt reģistriem tādā pašā mērā un tādos pašos laikposmos kā tad, ja tie tiktu uzturēti Savienībā.

6. Katrs centrālais darījumu partneris norāda attiecīgās personas, kas var attiecīgo datu sniegšanai 2. un 3. punktā noteiktajos termiņos izskaidrot tā datu saturu kompetentajām iestādēm.

7. Kompetentajai iestādei jābūt iespējām pārbaudīt visus datu reģistrus, kas centrālajam darījumu partnerim jāuztur saskaņā ar šo regulu. Centrālais darījumu partneris kompetentajai iestādei pēc pieprasījuma nodrošina saskaņā ar 13. un 14. pantu vajadzīgo datu tiešu piegādi.

13. pants

Darījumu uzskaites dati

1. Centrālais darījumu partneris veic uzskaiti par visiem darījumiem saskaņā ar visiem līgumiem, kam tas veic tīrvērti, un nodrošina, ka tā uzskaites datos ir iekļauta visa informācija, kas vajadzīga, lai veiktu visaptverošu un precīzu tīrvērtes procesa rekonstrukciju attiecībā uz katru līgumu, un ka katrs ieraksts par katru darījumu ir unikāli identificējams un meklējams vismaz pēc visiem datu laukiem, kas attiecas uz centrālo darījumu partneri, sadarbbspējīgu centrālo darījumu partneri, tīrvērtes dalībnieku, klientu, ja tas ir zināms centrālajam darījumu partnerim, un finanšu instrumentu.

2. Attiecībā uz katru darījumu, kas saņemts tīrvērtē, centrālais darījumu partneris tūlīt pēc attiecīgās informācijas saņemšanas izdara un atjaunina ierakstu ar šādu informāciju:

- a) cena, procentu likme vai likmju starpība un daudzums;
- b) tīrvērtes veikšanas iespējas, norādot, vai darījums centrālajam darījumu partnerim ir bijis pirkšanas vai pārdošanas darījums;
- c) finanšu instrumenta identifikācija;
- d) tīrvērtes dalībnieka identifikācija;
- e) līguma noslēgšanas vietas identifikācija;
- f) datums un laiks, kad centrālais darījumu partneris ir iesaistījies;
- g) līguma izbeigšanas diena un laiks;
- h) norēķina noteikumi un modalitāte;
- i) norēķina vai iepirkšanas darījuma diena un laiks un, ciktāl piemērojama, šāda informācija:
 - i) diena un laiks, kad līgums sākotnēji noslēgts;
 - ii) līguma sākotnējie noteikumi un līgumslēdzējas puses;

⁽¹⁾ OV L 281, 23.11.1995., 31. lpp.

⁽²⁾ OV L 8, 12.1.2001., 1. lpp.

- iii) ja piemērojams – sadarbībā centrālā darījumu partnera, kas veic darījuma viena posma tīrvērti, identifikācija;
- iv) klienta, tostarp jebkuru netiešo klientu, ja tie zināmi centrālajam darījumu partnerim, identitāte un, ja notiek nosūtīšana tīrvērtē pēc darījuma izpildes, – tās personas identifikācija, kura ir nodevusi līgumu.

14. pants

Pozīciju uzskaites dati

1. Centrālais darījumu partneris saglabā uzskaites datus par katram tīrvērtes dalībniekam piederošām pozīcijām. Par katru saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 39. pantu uzturēto kontu tiek veikta atsevišķa datu uzskaitē, un centrālais darījumu partneris nodrošina, ka tā uzskaites datus ir iekļauta visa informācija, kas vajadzīga, lai veiktu visaptverošu un precīzu pozīcijas pamatā esošo darījumu rekonstrukciju, un ka katrs ieraksts ir identificējams un meklējams vismaz pēc visiem datu laukiem, kas attiecas uz centrālo darījumu partneri, sadarbībā centrālo darījumu partneri, tīrvērtes dalībnieku, klientu, ja tas ir zināms centrālajam darījumu partnerim, un finanšu instrumentu.

2. Katras darbdienas beigās centrālais darījumu partneris izdara ierakstu saistībā ar katru pozīciju, iekļaujot turpmāk minētos datus tiktāl, cik tie ir saistīti ar attiecīgo pozīciju:

- a) dati par tīrvērtes dalībnieku, klientu, ja tas ir zināms centrālajam darījumu partnerim, un – attiecīgā gadījumā – par jebkuru sadarbībā centrālo darījumu partneri, kurš uztur šādu pozīciju;
 - b) pozīcijas zīme;
 - c) pozīcijas vērtības aprēķināšana ik dienu ar datiem par cenām, pēc kurām tiek vērtēti līgumi, un jebkāda cita būtiska informācija.
3. Centrālais darījumu partneris veic un regulāri atjaunina uzskaites datus par tā pieprasīto maržu summām, iemaksām saistību neizpildes fondā un citiem Regulas (ES) Nr. 648/2012 43. pantā minētajiem finanšu resursiem un attiecībā uz katru atsevišķu tīrvērtes dalībnieku un klientu, ja centrālajam darījumu partnerim tas ir zināms, – uzskaites datus par attiecīgo summu, ko faktiski iemaksājis tīrvērtes dalībnieks dienas beigās, un izmaiņām šajā summā, kas var rasties dienas laikā.

15. pants

Uzņēmējdarbības uzskaites dati

1. Centrālais darījumu partneris uztur atbilstošu un sakārtotu datu uzskaiti par darbībām, kas saistītas ar tā uzņēmējdarbību un iekšējo organizāciju.

2. Datu uzskaiti, kas minēta 1. punktā, veic katru reizi, kad notiek būtiskas izmaiņas attiecīgajos dokumentos, un tā ietver vismaz:

- a) valdes un attiecīgo komiteju, tīrvērtes nodaļas, riska pārvaldības nodaļas un visu citu attiecīgo vienību vai nodaļu struktūrshēmu;
- b) datus par tiešiem vai netiešiem akcionāriem vai dalībniekiem (fiziskām vai juridiskām personām), kuriem ir būtiska līdzdalība, un par šīs līdzdalības apjomu;
- c) dokumentus, kas apliecina saskaņā ar III nodaļu un 29. pantu prasīto politiku, procedūras un procesus;
- d) valdes sanāksmju protokolus un, attiecīgā gadījumā, valdes apakškomiteju un augstākās vadības komiteju sanāksmju protokolus;
- e) riska komitejas sanāksmju protokolus;
- f) apspriežu ar tīrvērtes dalībniekiem un klientiem protokolus, ja tādi ir;
- g) iekšējās un ārējās revīzijas ziņojumus, riska pārvaldības ziņojumus, atbilstības ziņojumus un konsultējošo uzņēmumu ziņojumus, tostarp vadības reakciju;
- h) darbības nepārtrauktības politiku un negadījuma seku novēršanas plānu, kas prasīti 17. pantā;
- i) likviditātes plānu un dienas likviditātes ziņojumus, kas prasīti 32. pantā;
- j) datus par visiem aktīviem un saistībām, un kapitāla kontiem, kas paredzēti Regulas (ES) Nr. 648/2012 16. pantā;
- k) saņemtās sūdzības, informāciju par sūdzības iesniedzēju, adresi un konta numuru; sūdzības saņemšanas datumu; visu sūdzībā nosaukto personu identitāti; aprakstu par sūdzības būtību; rīcību, reaģējot uz sūdzību, un datumu, kad sūdzībā norādītās problēmas tikušas atrisinātas;
- l) datus par jebkādiem pārtraukumiem vai traucējumiem pakalpojumu sniegšanā, tostarp sīki izstrādātu ziņojumu par šo notikumu laiku, ietekmi un veiktajiem ietekmes mazināšanas pasākumiem;
- m) veikto atpakaļejošo pārbaužu un stresa testu rezultātu protokolus;
- n) saraksti ar kompetentajām iestādēm, EVTI un attiecīgajām ECBS dalībniecēm;
- o) juridiskos atzinumus, kas saņemti saskaņā ar III nodaļas noteikumiem;
- p) attiecīgos gadījumos – dokumentāciju attiecībā uz vienošanos par sadarbību ar citiem centrālajiem darījumu partneriem;
- q) informāciju saskaņā ar 10. panta 1. punkta b) apakšpunkta vii) punktu un 1. punkta d) apakšpunktu;
- r) attiecīgos dokumentus, kuros aprakstīta virzība saistībā ar jaunām uzņēmējdarbības iniciatīvām.

16. pants

Ieraksti par datiem, kas paziņoti darījumu reģistram

Centrālais darījumu partneris identificē un saglabā visu informāciju un datus, kuri ir jāziņo saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 9. pantu, kā arī ierakstu par datumu un laiku, kad darījums ir paziņots.

V NODAĻA

DARBĪBAS NEPĀRTRAUKTĪBA

(Regulas (ES) Nr. 648/2012 34. pants)

17. pants

Stratēģija un politika

1. Centrālajam darījumu partnerim ir darbības nepārtrauktības politika un negadījuma seku novēršanas plāns, kurus apstiprinājusi valde. Darbības nepārtrauktības politikai un negadījuma seku novēršanas plānam veic neatkarīgas pārskatīšanas, par kurām ziņo valdei.

2. Darbības nepārtrauktības politikā identificē visas būtiskās darbības funkcijas un saistītās sistēmas un iekļauj centrālā darījumu partnera stratēģiju, politiku un mērķus, lai nodrošinātu šo funkciju un sistēmu nepārtrauktību.

3. Darbības nepārtrauktības politikā ņem vērā ārējās saiknes un savstarpējas atkarības finanšu infrastruktūras iekšienē, tostarp tirdzniecības vietas, kurās centrālais darījumu partneris veic tīrvērti, vērtspapīru norēķinu un maksājumu sistēmas un kredītiestādes, kuras izmanto centrālais darījumu partneris vai saistīts centrālais darījumu partneris. Tajā ņem vērā arī būtiskās funkcijas vai pakalpojumus, kurus kā ārpakalpojumus veikuši trešās puses pakalpojumu sniedzēji.

4. Darbības nepārtrauktības politika un negadījuma seku novēršanas plāns ietver skaidri definētus un dokumentētus pasākumus, kas veicami darbības nepārtrauktību apdraudošā ārkārtas situācijā, negadījuma vai krīzes apstākļos un kuru mērķis ir nodrošināt būtisko funkciju minimālo pakalpojuma līmeni.

5. Negadījuma seku novēršanas plānā identificē un iekļauj būtisko funkciju atjaunošanas punkta mērķus un atjaunošanas laika mērķus un nosaka vispiemērotāko atjaunošanas stratēģiju katrai no šīm funkcijām. Šādi pasākumi ir izstrādāti tā, lai nodrošinātu, ka ārkārtas situācijā būtiskās funkcijas tiek pabeigtas laikus un ka tiek nodrošināts tāds pakalpojumu līmenis, kāds paredzēts saskaņā ar vienošanos.

6. Centrālā darījumu partnera darbības nepārtrauktības politikā nosaka maksimāli pieļaujamo laiku, kurā būtiskās funkcijas un sistēmas drīkst būt neizmantojamas. Maksimālais centrālā darījumu partnera būtisko funkciju atjaunošanas laiks, kas jāiekļauj darbības nepārtrauktības politikā, nedrīkst pārsniegt divas stundas. Dienas noslēgumā veicamās procedūras un maksājumus jebkurā gadījumā pabeidz prasītajā laikā un dienā.

7. Centrālais darījumu partneris, nosakot atjaunošanās laiku katrai funkcijai, ņem vērā potenciālo vispārējo ietekmi uz tirgus efektivitāti.

18. pants

Uzņēmējdarbības ietekmes analīze

1. Centrālais darījumu partneris veic uzņēmējdarbības ietekmes analīzi, kas ir izstrādāta tā, lai noteiktu, kuras darbības funkcijas ir būtiskas centrālā darījumu partnera pakalpojumu sniegšanas nodrošināšanai. Daļa no analīzes ir šo funkciju būtiskums citām iestādēm un finanšu infrastruktūrai.

2. Centrālais darījumu partneris izmanto uz scenāriju balstītu riska analīzi, kuras mērķis ir noteikt, kā dažādi scenāriji ietekmē riskus, kas apdraud tā būtiskās darbības funkcijas.

3. Novērtējot riskus, centrālais darījumu partneris ņem vērā atkarību no ārējiem pakalpojumu sniedzējiem, tostarp komūnālo pakalpojumu uzņēmumu pakalpojumiem. Centrālais darījumu partneris veic pasākumus, lai pārvaldītu šādas atkarības, izmantojot piemērotus līgumu un organizatoriskos noteikumus.

4. Uzņēmējdarbības ietekmes analīzi un scenārija analīzi regulāri atjaunina; tās pārskata vismaz reizi gadā un pēc negadījuma vai būtiskām organizatoriskām pārmaiņām. Analīzē ņem vērā visus būtiskos notikumus, tostarp tirgus un tehnoloģiju attīstību.

19. pants

Negadījuma seku novēršana

1. Centrālais darījumu partneris veic pasākumus, lai nodrošinātu tā būtisko funkciju nepārtrauktību, par pamatu ņemot negadījumu scenārijus. Šiem pasākumiem ir jāattiecas vismaz uz pietiekamu cilvēkresursu pieejamību, būtisko funkciju maksimālo zaudlaiku un kļūmjpārlēci un funkciju atjaunošanu rezerves vietnē.

2. Centrālais darījumu partneris uztur rezerves datu apstrādes vietni, kas spēj nodrošināt visu centrālā darījumu partnera būtisko funkciju nepārtrauktību identiski kā galvenajā vietnē. Rezerves vietnei ir tāds ģeogrāfiskā riska profils, kas ir atšķirīgs no galvenās vietnes ģeogrāfiskā riska profila.

3. Centrālais darījumu partneris uztur vai tam ir tūlītēja pieeja rezerves uzņēmējdarbības vietai, lai personālam būtu iespējams vismaz nodrošināt pakalpojumu nepārtrauktību gadījumā, ja galvenā uzņēmējdarbības vieta nav pieejama.

4. Centrālais darījumu partneris ņem vērā vajadzību pēc papildu datu apstrādes vietnes, jo īpaši tad, ja galvenās un rezerves vietnes riska profilu dažādība nenodrošina pietiekamu pārliecību, ka centrālā darījumu partnera darbības nepārtrauktības mērķi tiks sasniegti jebkura scenārija gadījumā.

20. pants

Testēšana un uzraudzība

1. Centrālais darījumu partneris testē un uzrauga savu darbības nepārtrauktības politiku un negadījuma seku novēršanas plānu ar regulāriem intervāliem un pēc būtiskiem pārveidojumiem vai izmaiņām sistēmās vai saistītās funkcijās, lai nodrošinātu, ka darbības nepārtrauktības politika sasniedz izvirzītos mērķus, tostarp mērķi par funkciju atjaunošanu ne ilgāk kā divu stundu laikā. Testi tiek plānoti un dokumentēti.

2. Darbības nepārtrauktības politikas un negadījuma seku novēršanas plāna testēšana atbilst šādiem nosacījumiem:

- a) tajā ir paredzēti liela mēroga katastrofu scenāriji un pārslēgšanās starp galveno un rezerves vietni;
- b) tajā ir paredzēta iespēja iesaistīt tūrvērtes dalībniekus, ārējos pakalpojumu sniedzējus un attiecīgās iestādes finanšu infrastruktūrā, ar ko darbības nepārtrauktības politikā tikusi identificēta savstarpēja atkarība.

21. pants

Uzturēšana

1. Centrālais darījumu partneris regulāri pārskata un atjaunina savu darbības nepārtrauktības politiku, lai iekļautu tajā visas būtiskās funkcijas un tām vispiemērotāko atjaunošanas stratēģiju.

2. Centrālais darījumu partneris regulāri pārskata un atjaunina savu negadījuma seku novēršanas plānu, lai iekļautu tajā vispiemērotāko atjaunošanas stratēģiju visām būtiskajām funkcijām.

3. Darbības nepārtrauktības politikas un negadījuma seku novēršanas plāna atjauninājumos ņem vērā testu rezultātus, neatkarīgu pārskatītāju ieteikumus un citu pārskatītāju un kompetento iestāžu ieteikumus. Centrālie darījumu partneri pārskata savu darbības nepārtrauktības politiku un negadījuma seku novēršanas plānu pēc katra būtiska darbības traucējuma, lai noskaidrotu cēloņus un noteiktu, kādi uzlabojumi nepieciešami centrālā darījumu partnera darbībās, darbības nepārtrauktības politikā un negadījuma seku novēršanas plānā.

22. pants

Krīzes pārvarēšana

1. Centrālajam darījumu partnerim ir krīzes pārvarēšanas funkcija, kas darbojas ārkārtas gadījumā. Krīzes pārvarēšanas procedūra ir skaidri noteikta un dokumentēta rakstiski. Valde uzrauga krīzes pārvarēšanas funkciju un regulāri saņem un pārskata ziņojumus par to.

2. Krīzes pārvarēšanas funkcija ietver labi strukturētas un skaidras procedūras, lai pārvaldītu iekšējo un ārējo saziņu krīzes situācijā.

3. Pēc krīzes gadījuma centrālais darījumu partneris veic pārskatu par saviem krīzes pārvarēšanas pasākumiem. Pārskatīšanā attiecīgā gadījumā izmanto arī tūrvērtes dalībnieku un citu ārēju ieinteresēto personu ieguldījumu.

23. pants

Saziņa

1. Centrālajam darījumu partnerim ir saziņas plāns, kurā dokumentēts tas, kādā veidā augstākā vadība, valde un attiecīgās ārējās ieinteresētās personas, tostarp kompetentās iestādes, tūrvērtes dalībnieki, klienti, norēķinu iestādes, vērtspapīru norēķinu un maksājumu sistēmas un tirdzniecības vietas, tiks pietiekami informētas krīzes laikā.

2. Par scenārija analīzi, riska analīzi, pārskatīšanu un uzraudzības un testu rezultātiem ziņo valdei.

VI NODAĻA

MARŽAS

(Regulas (ES) Nr. 648/2012 41. pants)

24. pants

Procentu likme

1. Centrālais darījumu partneris aprēķina sākotnējās maržas, lai segtu riska darījumus, kas izriet no tirgus svārstībām, par katru finanšu instrumentu, kas ir nodrošināts uz produktu bāzes, 25. pantā noteiktajam laikposmam un pieņemot pozīcijas likvidēšanas laikposmu, kā noteikts 26. pantā. Aprēķinot sākotnējās maržas, centrālais darījumu partneris ievēro vismaz šādu ticamības intervālus:

- a) attiecībā uz ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem – 99,5 %;
- b) attiecībā uz finanšu instrumentiem, kas nav ārpusbiržas atvasinātie instrumenti, – 99 %.

2. Lai noteiktu adekvātu ticamības intervālu attiecībā uz katru finanšu instrumentu kategoriju, kam tas veic tūrvērti, centrālais darījumu partneris papildus ņem vērā vismaz vēl šādus faktorus:

- a) finanšu instrumentu kategorijas cenu nenoteiktību sarežģītību un apmēru, kas var ierobežot sākotnējās un mainīgās maržas aprēķināšanas apstiprināšanu;
- b) finanšu instrumentu kategorijas riska iezīmes, kas var ietvert (bet neaprobežojas ar) svārstīgumu, ilgumu, likviditāti, nelineārajām cenu iezīmēm, pēkšņas saistību neizpildes risku un korelācijas risku;
- c) cik lielā mērā citas riska kontroles nepietiekami ierobežo kredītriska darījumus;
- d) finanšu instrumentu kategorijai piemītošo sviras efektu, tostarp – vai finanšu instrumentu kategorijai raksturīgs izteikts svārstīgums, liela koncentrētība starp dažiem tirgus dalībniekiem vai arī tos varētu būt grūti izbeigt.

3. Centrālais darījumu partneris informē kompetento iestādi un tā tūrvērtē dalībniekus par kritērijiem, kas ņemti vērā, lai noteiktu procentu likmes maržu aprēķināšanai par katru finanšu instrumentu kategoriju.

4. Ja centrālais darījumu partneris veic tūrvērti ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, kuriem ir tādas pašas riska iezīmes kā regulētos tirgos vai līdzvērtīgā trešās valsts tirgū izpildītiem atvasināto instrumentu līgumiem, pamatojoties uz 2. punktā izklāstīto riska faktoru novērtējumu, centrālais darījumu partneris attiecībā uz šiem līgumiem var izmantot alternatīvu ticamības intervālu – vismaz 99 % –, ja riski, kas saistīti ar ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem, kam tas veic tūrvērti, tiek pienācīgi mazināti, izmantojot šādu ticamības intervālu, un ja ir ievēroti 2. punktā minētie nosacījumi.

25. pants

Laikposms vēsturiskā svārstīguma aprēķināšanai

1. Centrālais darījumu partneris nodrošina, ka saskaņā ar tā modeļu metodoloģiju un apstiprināšanas procedūru, kas izveidota saskaņā ar XII nodaļas noteikumiem, sākotnējās maržas nosedz vismaz 24. pantā noteikto ticamības intervālu un attiecībā uz 26. pantā noteikto likvidācijas periodu nosedz pakļautību riskiem, kas izriet no vēsturiskā svārstīguma, kurš aprēķināts, pamatojoties uz datiem, kas aptver vismaz pēdējos 12 mēnešus.

Centrālais darījumu partneris nodrošina, ka vēsturiskā svārstīguma aprēķināšanai izmantotie dati aptver visu tirgus apstākļu spektru, tostarp stresa periodus.

2. Centrālais darījumu partneris vēsturiskā svārstīguma aprēķināšanai var izmantot jebkuru citu laikposmu, ja šāda laikposma izmantošanas rezultātā maržas prasības ir vismaz tikpat augstas kā tās, kas iegūtas, izmantojot 1. punktā noteikto laikposmu.

3. Maržas parametri attiecībā uz finanšu instrumentiem, kuriem nav vēsturiskā novērošanas perioda, tiek balstīti uz konservatīviem pieņēmumiem. Centrālais darījumu partneris nekavējoties pielāgo pieprasīto maržu aprēķināšanu, pamatojoties uz analīzi par jauno finanšu instrumentu cenu vēsturi.

26. pants

Likvidācijas perioda laikposmi

1. Centrālais darījumu partneris nosaka likvidācijas perioda laikposmus, ņemot vērā finanšu instrumenta, kuram veic tūrvērti, specifiku, tirgu, kurā to tirgo, un periodu maržu aprēķināšanai un iekasēšanai. Šie likvidācijas periodi ir vismaz šādi:

- a) piecas darbdienas ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem;
- b) divas darbdienas finanšu instrumentiem, kas nav ārpusbiržas atvasinātie instrumenti.

2. Jebkurā gadījumā, lai noteiktu atbilstīgu likvidācijas periodu, centrālais darījumu partneris novērtē un summē vismaz šādus laikposmus:

- a) iespējami ilgāko periodu, kāds var paiet no pēdējās maržu iekasēšanas līdz brīdim, kad centrālais darījumu partneris paziņo par saistību neizpildi vai aktivizē saistību neizpildes pārvaldības procedūru;
- b) paredzamo laikposmu, kas nepieciešams, lai izstrādātu un īstenotu stratēģiju tūrvērtē dalībnieka saistību neizpildes pārvaldībai, ņemot vērā katras finanšu instrumentu kategorijas īpatnības, tostarp to likviditātes līmeni un pozīciju koncentrāciju, un tirgus, kurus centrālais darījumu partneris izmantos, lai izbeigtu tūrvērtē dalībnieka pozīciju vai pilnībā ierobežotu tās risku;

- c) attiecīgā gadījumā – laikposmu, kas vajadzīgs, lai segtu darījuma partnera risku, kam pakļauts centrālais darījumu partneris.

3. Izvērtējot 2. punktā noteiktos laikposmus, centrālais darījumu partneris ņem vērā vismaz 24. panta 2. punktā norādītos faktorus un laika periodu vēsturiskā svārstīguma aprēķināšanai, kā noteikts 25. pantā.

4. Ja centrālais darījumu partneris veic tūrvērti ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, kuriem ir tādas pašas riska iezīmes kā regulētā tirgū vai līdzvērtīgā trešās valsts tirgū izpildītiem atvasinātajiem instrumentiem, tas var likvidācijas periodam izmantot laikposmu, kas atšķiras no 1. punktā noteiktā, ja var pārliecināt kompetento iestādi, ka:

- a) šāds laikposms būtu piemērotāks nekā 1. punktā norādītais, ņemot vērā īpašās iezīmes, kādas ir attiecīgajiem ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem;
- b) šāds laikposms ir vismaz divas darbdienas.

27. pants

Maržas noteikšana finanšu instrumentu portfelim

1. Centrālais darījumu partneris var atļaut kompensēšanu vai samazinājumus attiecībā uz prasīto maržu visiem finanšu instrumentiem, kam tas veic tūrvērti, ja viena finanšu instrumenta vai finanšu instrumentu kopuma cenu risks būtiski un ticami korelē ar citu finanšu instrumentu cenu risku vai, pamatojoties uz līdzvērtīgu statistisko atkarības parametru, uzrāda šādu atkarību.

2. Centrālais darījumu partneris dokumentē savu pieeju attiecībā uz maržas noteikšanu finanšu instrumentu portfelim, un tam ir vismaz jānodrošina, ka korelācija vai līdzvērtīgs statistiskais atkarības parametrs attiecībā uz diviem vai vairākiem finanšu instrumentiem, kam tiek veikta tūrvērtē, ir uzticams saskaņā ar 25. pantu aprēķinātajā atskaites periodā un pierāda savu noturīgumu vēsturisku vai hipotētisku stresa scenāriju laikā. Centrālais darījumu partneris pierāda, ka pastāv cenu saistības ekonomisks pamatojums.

3. Visus finanšu instrumentus, kuriem tiek piemērota maržas noteikšana finanšu instrumentu portfelim, nosedz no viena saistību neizpildes fonda. Piemērojot atkāpi, ja centrālais darījumu partneris var iepriekš pierādīt savai kompetentajai iestādei un tā tīrvērtes dalībniekiem, kā potenciālie zaudējumi tiktu sadalīti starp dažādiem saistību neizpildes fondiem, un ja tā reglamentā ir iekļauts nepieciešamo noteikumu kopums, maržas noteikšanu finanšu instrumentu portfelim var piemērot no dažādiem saistību neizpildes fondiem segtiem finanšu instrumentiem.

4. Ja maržas noteikšana finanšu instrumentu portfelim aptver vairākus instrumentus, tad maržas samazinājumi nepārsniedz 80 % no starpības starp katram produktam individuāli aprēķināto maržu summu un maržu, kas aprēķināta, pamatojoties uz kombinētu aplēsi par visa portfeļa pakļautību riskiem. Ja centrālais darījumu partneris maržas samazinājuma rezultātā netiek pakļauts nekādam potenciālam riskam, tas var piemērot samazinājumu līdz 100 % apmērā no šīs starpības.

5. Maržas samazināšanu saistībā ar finanšu instrumentu portfeli pakļauj stabilai stresa testēšanas programmai saskaņā ar XII nodaļu.

28. pants

Procikliskums

1. Centrālais darījumu partneris nodrošina, ka tā politika attiecībā uz ticamības intervāla, likvidācijas perioda un atskaites perioda izvēli un pārskatīšanu nodrošina tālredzīgas, stabilas un piesardzīgas maržas prasības, kas ierobežo procikliskumu tādā mērā, ka centrālā darījumu partnera stabilitāte un finansiālā drošība netiek nelabvēlīgi ietekmēta. Tas ietver iespējamu izvairīšanos no traucējumiem vai vērienīgām izmaiņām maržas prasībās un pārredzamu un paredzamu procedūru izveidi maržas prasību pielāgošanai, reaģējot uz mainīgajiem tirgus apstākļiem. To darot, centrālais darījumu partneris izmanto vismaz vienu no šādiem risinājumiem:

- a) piemēro maržu rezervi, kas atbilst vismaz 25 % no aprēķinātajām maržām un periodos, kad ievērojami pieaug aprēķinātās maržas prasības, drīkst tikt uz laiku pilnībā izmantota;
- b) piešķir vismaz 25 % svērumu stresa apstākļos veiktiem novērojumiem atskaites periodā, kas aprēķināti saskaņā ar 26. pantu;
- c) nodrošina, ka tā prasības attiecībā uz maržām nav zemākas par tām, kas tiktu aprēķinātas, izmantojot svārstīguma aplēsi 10 gadus ilgām vēsturiskajam atskaites periodam.

2. Pārskatot maržas modeļa parametrus, lai labāk atspoguļotu esošos tirgus apstākļus, centrālais darījumu partneris ņem vērā šādas pārskatīšanas potenciālo prociklisko ietekmi.

VII NODAĻA

FONDS SAISTĪBU NEIZPILDES GADĪJUMIEM

(Regulas (ES) Nr. 648/2012 42. pants)

29. pants

Regulējums un pārvaldība

1. Lai noteiktu saistību neizpildes fonda minimālo lielumu un citu finanšu resursu summu, kas nepieciešami, lai atbilstu Regulas (ES) Nr. 648/2012 42. un 43. panta prasībām, ņemot vērā ar grupu saistītas atkarības, centrālais darījumu partneris ievieš iekšējās politikas regulējumu, lai noteiktu tādu ārkārtēju, taču iespējamu tirgus apstākļu veidus, kas varētu pakļaut to lielākam riskam.

2. Regulējumā ietilpst paziņojums, kurā izklāstīts, kā centrālais darījumu partneris definē ārkārtējus, taču iespējamus tirgus apstākļus. To pilnībā dokumentē un saglabā saskaņā ar 12. pantu.

3. Regulējumu apspriež risku komiteja un apstiprina valde. Regulējuma stabilitāti un tā spēju atspoguļot tirgus svārstības pārskata vismaz reizi gadā. Pārskatīšanas rezultātus apspriež riska komiteja un ziņo valdei.

30. pants

Ārkārtēju, taču iespējamu tirgus apstākļu identificēšana

1. Regulējumā, kas aprakstīts 29. pantā, tiek atspoguļots centrālā darījumu partnera riska profils, attiecīgos gadījumos ņemot vērā pārrobežu un starpvalūtu riska darījumus. Tajā identificē visus tirgus riskus, kuriem centrālais darījumu partneris būtu pakļauts pēc viena vai vairāku tā tīrvērtes dalībnieku saistību neizpildes, tostarp nelabvēlīgas tirgus cenu svārstības instrumentiem, kuriem veikta tīrvērtē, šo instrumentu samazinātas tirgus likviditātes un nodrošinājuma likvidācijas vērtības samazinājuma riskus. Regulējumā ņem vērā arī papildu riskus centrālajam darījumam partnerim, kas izriet no saistības nepildījušā tīrvērtes dalībnieka grupā ietilpstošu struktūru vienlaicīgas bankrotēšanas.

2. Regulējumā atsevišķi identificē visus tirgus, kuros centrālais darījumu partneris ir pakļauts riskam kāda tīrvērtes dalībnieka saistību neizpildes scenārija gadījumā. Katram identificētajam tirgum centrālais darījumu partneris nosaka to, kas ir ārkārtēji, taču iespējami apstākļi, pamatojoties vismaz uz šādiem faktoriem:

- a) dažādiem vēsturiskajiem scenārijiem, tostarp ārkārtēju tirgus svārstību periodos, kas novērotas pēdējos 30 gados vai laikposmos, par kuriem ir pieejami uzticami dati, un kas būtu pakļāvuši centrālo darījumu partneri vislielākajam finansiālajam riskam. Ja centrālais darījumu partneris nolēm, ka lielu cenu svārstību vēsturiskā perioda atkārtšanās nav ticama, tas pamato kompetentajai iestādei tā nieikļaušanu regulējumā;

b) dažādiem iespējamajiem nākotnes scenārijiem, kas balstīti uz konsekventiem pieņēmumiem par tirgus svārstībām un cenu korelāciju dažādos tirgos un dažādiem finanšu instrumentiem, pamatojoties uz kvantitatīviem un kvalitatīviem vērtējumiem par iespējamajiem tirgus apstākļiem.

3. Regulējumā kvantitatīvi un kvalitatīvi ņem vērā arī to, cik lielā mērā ārkārtējas cenu svārstības varētu notikt vairākos identificētajos tirgos vienlaicīgi. Regulējumā ņem vērā to, ka vēsturiskās cenu korelācijas ārkārtējos, taču iespējamajos tirgos apstākļos var vairs neeksistēt.

31. pants

Ārkārtēju, taču iespējamu tirgus apstākļu pārskatīšana

Centrālais darījumu partneris regulāri pārskata 30. pantā aprakstītās procedūras, ņemot vērā visus būtiskos tirgus notikumus un tīrvērtes dalībnieku riska darījumu mērogu un koncentrāciju. Vēsturisko un hipotētisko scenāriju kopumu, ko centrālais darījumu partneris izmanto, lai noteiktu ārkārtējus, taču iespējamus tirgus apstākļus, centrālais darījumu partneris, apspriežoties ar riska komiteju, izskata vismaz reizi gadā un vēl biežāk gadījumā, ja tirgus norises vai būtiskas izmaiņas līgumu kopumā, kuriem centrālais darījumu partneris veic tīrvērti, ietekmē scenāriju pamatā esošos pieņēmumus un tādējādi var būt vajadzīgas korekcijas scenārijos. Par būtiskām izmaiņām regulējumā ziņo valdei.

VIII NODAĻA

LIKVIDITĀTES RISKA PĀRBAUDES

(Regulas (ES) Nr. 648/2012 44. pants)

32. pants

Likviditātes riska novērtējums

1. Centrālais darījumu partneris izveido stabilu likviditātes riska pārvaldības sistēmu, kas ietver efektīvus darbības un analīzes instrumentus, lai regulāri un savlaicīgi identificētu, novērtētu un uzraudzītu tā norēķinus un finansējuma plūsmas, tostarp tā dienas likviditātes resursu izmantošanu. Centrālie darījumu partneri regulāri izvērtē savas likviditātes pārvaldības sistēmas koncepciju un darbību, ņemot vērā arī stresa testu rezultātus.

2. Centrālā darījumu partnera likviditātes riska pārvaldības sistēma ir pietiekami stabila, lai nodrošinātu to, ka centrālais darījumu partneris spēj izpildīt maksājumu un norēķinu saistības visās attiecīgajās valūtās, kad pienācis to termiņš, tostarp attiecīgā gadījumā dienas laikā. Centrālā darījumu partnera likviditātes riska pārvaldības sistēmā ietilpst arī novērtējums par tā turpmākajām likviditātes vajadzībām ļoti dažādos iespējamajos stresa scenārijos. Pie stresa scenārijiem pieder tīrvērtes dalībnieku saistību neizpilde saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 44. pantu no saistību neizpildes dienas līdz likvidācijas perioda beigām un likviditātes risks, ko rada centrālā darījumu partnera ieguldījumu politika un procedūras ārkārtējos, taču iespējamajos tirgus apstākļos.

3. Likviditātes riska pārvaldības sistēma ietver likviditātes plānu, ko dokumentē un uztur atbilstīgi 12. pantam. Likviditātes plāna minimālajā saturā ietilpst centrālā darījumu partnera procedūras attiecībā uz:

- tā likviditātes vajadzību dažādos tirgus scenārijos pārvaldību un uzraudzību vismaz reizi dienā;
- pietiekamu likvido finanšu resursu uzturēšanu, lai apmierinātu tā likviditātes vajadzības, un nodalīšanu starp dažādiem likvido resursu veidiem pēc to izmantojuma;
- centrālajam darījumu partnerim pieejamo likvido aktīvu un tā likviditātes vajadzību noteikšanu un novērtēšanu reizi dienā;
- likviditātes riska avotu noteikšanu;
- laikposmu novērtēšanu, kādos būtu jābūt pieejamiem centrālā darījumu partnera likvidajiem finanšu resursiem;
- iespējamo likviditātes vajadzību ņemšanu vērā, kuras izriet no tīrvērtes dalībnieku spējas nodrošināt naudas līdzekļu maiņu pret bezskaidras naudas nodrošinājumu;
- procedūrām likviditātes deficīta gadījumā;
- jebkuru tādu likvido finanšu resursu papildināšanu, kurus tas var izmantot stresa apstākļu gadījumos.

Centrālā darījumu partnera valde apstiprina plānu pēc apspriešanās ar risku komiteju.

4. Centrālais darījumu partneris novērtē likviditātes risku, ar kuru tas saskaras, tostarp attiecībā uz situācijām, kad centrālais darījumu partneris vai tā tīrvērtes dalībnieki tīrvērtes vai norēķinu procesa ietvaros nespēj nokārtot savas maksājumu saistības termiņā, un tajā ņem vērā arī centrālā darījumu partnera ieguldījumu darbības. Riska pārvaldības sistēmā ņem vērā arī likviditātes vajadzības, kas izriet no centrālā darījumu partnera attiecībām ar jebkuru struktūru, attiecībā pret kuru centrālais darījumu partneris ir pakļauts likviditātes riskam, tostarp:

- norēķinu bankām;
- maksājumu sistēmām;
- vērtspapīru norēķinu sistēmām;
- korespondentbankām, kurās ir nostro konti;
- turētājbankām;
- likviditātes nodrošinātājiem;
- sadarbspējīgiem centrālajiem darījumu partneriem;
- pakalpojumu sniedzējiem.

5. Centrālais darījumu partneris ņem vērā visas savstarpējās atkarības starp ar 4. punktā minētajām struktūrām un daudzveidīgās attiecības, kādas 4. punktā minētai struktūrai var būt ar centrālo darījumu partneri tā likviditātes riska pārvaldības sistēmā.

6. Centrālais darījumu partneris ievieš ikdienas ziņojumu par vajadzībām un resursiem atbilstīgi 3. punkta a), b) un c) apakšpunktam un ceturkšņa ziņojumu par savu likviditātes plānu saskaņā ar 3. punkta d) līdz h) apakšpunktu. Ziņojumus dokumentē un saglabā atbilstīgi IV nodaļas noteikumiem.

33. pants

Pieeja likviditātes resursiem

1. Centrālais darījumu partneris katrā attiecīgajā valūtā uztur likvidos resursus, kuri ir samērīgi ar tā likviditātes prasībām, kas noteiktas saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 44. pantu un šīs regulas 32. pantu. Šie likvidie resursi nepārsniedz:

- a) centrālajā emisijas bankā deponētās naudas daudzumu;
 - b) naudas daudzumu, kas deponēts darbības atļauju saņēmušā kredītiestādē atbilstīgi 47. pantam;
 - c) piešķirto kredītlīniju vai līdzvērtīgu vienošanos ar saistības izpildījušiem tīrvērtes dalībniekiem summu;
 - d) noslēgto pārdošanas ar atpirkšanu līgumu summu;
 - e) ļoti viegli pārdodamus finanšu instrumentus, kuris atbilst 45. un 46. panta prasībām un par kuriem centrālais darījumu partneris var pierādīt, ka tie ir viegli pieejami un pārvēršami naudā tajā pašā dienā, izmantojot iepriekš nolīgtu un augstā mērā uzticamu finansēšanas mehānismu, tostarp saspringtos tirgus apstākļos.
2. Centrālais darījumu partneris ņem vērā valūtas, kurās denominētas tā saistības, un stresa apstākļu iespējamo ietekmi uz tā spēju piekļūt ārvalstu valūtas tirgiem tādā veidā, kas būtu saderīgs ar ārvalstu valūtas vērtspapīru norēķinu cikliem un vērtspapīru norēķinu sistēmām.
3. Tīrvērtes dalībnieku pret tīrvērtes dalībniekiem sniegto nodrošinājumu piešķirtās kredītlīnijas netiek uzskaitītas dubulti kā likvidie līdzekļi. Centrālais darījumu partneris veic pasākumus, lai uzraudzītu un kontrolētu likviditātes riska darījumu koncentrāciju ar atsevišķiem likviditātes nodrošinātājiem.
4. Centrālais darījumu partneris veic pienācīgas stingras pārbaudes, lai pārliecinātos, ka tā likviditātes nodrošinātājiem ir pietiekamas iespējas izpildīt likviditātes vienošanās noteikumus.
5. Centrālais darījumu partneris regulāri testē savas procedūras saistībā ar pieeju resursiem atbilstīgi iepriekš noliktiem

finansēšanas mehānismiem. Tas var ietvert testa summu izgūšanu no komerciālajām kredītlīnijām, lai pārbaudītu resursu pieejamības ātrumu un procedūru uzticamību.

6. Centrālajam darījumu partnerim tā likviditātes plānā ir sīki izstrādātas procedūras, kā izmantot savus likvidos finanšu resursus, lai pildītu maksājumu saistības likviditātes deficīta laikā. Likviditātes procedūrās skaidri norāda, kad būtu jāizmanto konkrēti resursi. Procedūrās apraksta arī to, kā piekļūt skaidras naudas depozītiem vai skaidras naudas noguldījumiem uz vienu nakti, kā izpildīt tās pašas dienas tirgus darījumus, vai to, kā izmantot iepriekš nolīgtas likviditātes kredītlīnijas. Šīs procedūras regulāri testē. Centrālais darījumu partneris izstrādā arī atbilstošu finansēšanas mehānisma atjaunošanas plānu pirms tā termiņa beigām.

34. pants

Koncentrācijas risks

1. Centrālais darījumu partneris cieši uzrauga un kontrolē sava likviditātes riska koncentrāciju, tostarp tā riska darījumus ar 32. panta 4. punktā minētajām struktūrām un tās pašas grupas struktūrām.
2. Centrālā darījumu partnera likviditātes riska pārvaldības sistēmā ietilpst ierobežojumu piemērošana attiecībā uz riska darījumiem un koncentrāciju.
3. Centrālais darījumu partneris nosaka procesus un procedūras, ko piemēro gadījumos, kad tiek pārkāpti koncentrācijas ierobežojumi.

IX NODAĻA

SECĪBA SAISTĪBU NEIZPILDES GADĪJUMĀ

(Regulas (ES) Nr. 648/2012 45. pants)

35. pants

Centrālā darījumu partnera pašu resursu, kuri izmantojami saistību neizpildes gadījumā, summas aprēķināšana

1. Centrālais darījumu partneris uztur un norāda atsevišķi savā bilancē pašu resursu summu, kas paredzēta izmantošanai Regulas (ES) Nr. 648/2012 45. panta 4. punktā norādītajiem mērķiem.
2. Minimālo summu, kas minēta 1. punktā, centrālais darījumu partneris aprēķina, reizinot ar 25 % minimālo kapitālu, ieskaitot nesadalīto peļņu un rezerves, ko uztur saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 16. pantu un Komisijas Deleģēto regulu (ES) Nr. 152/2013 ⁽¹⁾.

Centrālais darījumu partneris katru gadu pārskata šo minimālo summu.

⁽¹⁾ Skatīt šā Oficiālā Vēstneša 37. lpp.

3. Ja centrālais darījumu partneris ir izveidojis vairāk nekā vienu saistību neizpildes fondu dažādām finanšu instrumentu kategorijām, kam tas veic tīrvērti, visus īpaši izmantošanai paredzētos pašu resursus, kas aprēķināti saskaņā ar 1. punktu, iedala saistību neizpildes fondos proporcionāli katra saistību neizpildes fonda lielumam, un tie atsevišķi jānorāda tā bilanci un jāizmanto saistību neizpildes gadījumos, kas rodas dažādajos tirgus segmentos, uz kuriem attiecas saistību neizpildes fondi.

4. Nekādus resursus, izņemot kapitālu, tostarp nesadalīto peļņu un rezerves, kas minēts Regulas (ES) Nr. 648/2012 16. pantā, neizmanto 1. punkta prasību izpildei.

36. pants

Centrālā darījumu partnera pašu resursu, kas izmantojami saistību neizpildes gadījumā, summas uzturēšana

1. Centrālais darījumu partneris nekavējoties informē kompetento iestādi tad, ja uzturētā īpašo pašu resursu summa kļūst mazāka par summu, kas prasīta saskaņā ar 35. pantu, norāda prasības neizpildes iemeslu un rakstveidā sniedz visaptverošu aprakstu par pasākumiem un grafiku šīs summas atjaunošanai.

2. Ja, pirms centrālais darījumu partneris ir atjaunojis īpašos pašu resursus, atkal notiek viena vai vairāku tīrvērtes dalībnieku saistību neizpilde, tad Regulas (ES) Nr. 648/2012 45. panta nolūkā izmanto vienīgi no attiecīgajiem šim nolūkam paredzētajiem pašu resursiem atlikušo summu.

3. Centrālais darījumu partneris atjauno īpašos pašu resursus vismaz viena mēneša laikā no paziņojuma saskaņā ar 1. punktu.

X NODAĻA

NODROŠINĀJUMS

(Regulas (ES) Nr. 648/2012 46. pants)

37. pants

Vispārīgas prasības

Centrālais darījumu partneris ievieš un īsteno pārredzamu un paredzamu politiku un procedūras, pastāvīgi uzrauga kā nodrošinājumu pieņemto aktīvu likviditāti un vajadzības gadījumā veic ietekmes mazināšanas pasākumus.

Centrālais darījumu partneris vismaz reizi gadā pārskata savu atbilstīgo aktīvu politiku un procedūras. Šādu pārskatīšanu veic arī ikreiz, kad ir notikušas būtiskas izmaiņas, kas ietekmē centrālā darījumu partnera pakļautību riskiem.

38. pants

Naudas nodrošinājums

Piemērojot Regulas (ES) Nr. 648/2012 46. panta 1. punktu, ļoti likvidu nodrošinājumu naudā denominē vienā no šīm valūtām:

a) valūtā, par kuru centrālais darījumu partneris var pierādīt kompetentajai iestādei, ka tas spēj adekvāti pārvaldīt risku šajā valūtā;

b) valūtā, kurā centrālais darījumu partneris veic tīrvērtes darījumus, nodrošinājuma robežās, kurš ir vajadzīgs, lai segtu centrālā darījumu partnera riska darījumus šajā valūtā.

39. pants

Finanšu instrumenti

Piemērojot Regulas (ES) Nr. 648/2012 46. panta 1. punktu, finanšu instrumentus, bankas garantijas un zeltu, kas atbilst I pielikumā izklāstītajiem nosacījumiem, uzskata par nodrošinājumu ar augstu likviditāti.

40. pants

Nodrošinājuma vērtības noteikšana

1. Lai noteiktu vērtību ļoti likvidam nodrošinājumam, kā definēts 37. pantā, centrālais darījumu partneris ievieš un īsteno politiku un procedūras, lai aptuveni reālajā laikā uzraudzītu kredīta kvalitāti, tirgus likviditāti un cenu svārstības katram aktīvam, kas pieņemts kā nodrošinājums. Centrālais darījumu partneris regulāri un vismaz reizi gadā pārskata savas vērtēšanas politikas un procedūru atbilstību. Šādu pārskatīšanu veic arī ikreiz, kad ir notikušas būtiskas izmaiņas, kas ietekmē centrālā darījumu partnera pakļautību riskiem.

2. Centrālais darījumu partneris nosaka sava nodrošinājuma vērtību pēc tirgus cenām aptuveni reālajā laikā, un, ja tas nav iespējams, centrālajam darījumu partnerim jābūt iespējai pierādīt kompetentajām iestādēm, ka tas spēj pārvaldīt iespējamus riskus.

41. pants

Atskaitījumi

1. Centrālais darījumu partneris ievieš un īsteno politiku un procedūras, lai noteiktu pārdomātus atskaitījumus, kas piemērojami nodrošinājuma vērtībai.

2. Atskaitījumā ņem vērā to, ka saspringtos tirgus apstākļos var būt vajadzība likvidēt nodrošinājumu, un laiku, kas vajadzīgs tā likvidēšanai. Centrālais darījumu partneris pierāda kompetentajai iestādei, ka atskaitījumus aprēķina, izmantojot konservatīvu metodi, lai pēc iespējas ierobežotu prociklisku ietekmi. Katram nodrošinājuma aktīvam atskaitījumu nosaka, ņemot vērā attiecīgos kritērijus, tostarp:

a) aktīvu veidu un kredītriska līmeni saistībā ar finanšu instrumentu, pamatojoties uz centrālā darījumu partnera veiktu iekšēju novērtējumu. Veicot šādu novērtējumu, centrālais darījumu partneris izmanto definētu un objektīvu metodoloģiju, kas pilnībā nepaļaujas uz ārējiem atzinumiem un kurā ņemts vērā risks, kas saistīts ar emitenta galvenās uzņēmējdarbības vietas atrašanos konkrētā valstī;

- b) aktīvu termiņu;
- c) aktīvu vēsturisko un hipotētisko nākotnes cenu svārstīgumu saspringtos tirgus apstākļos;
- d) bāzes tirgus likviditāti, tostarp solītās/prasītās cenas starpības;
- e) ārvalstu valūtas risku, ja tāds ir;
- f) korelācijas risku.

3. Centrālais darījumu partneris regulāri uzrauga atskaitījumu atbilstīgumu. Centrālais darījumu partneris pārskata atskaitījumu politiku un procedūras vismaz reizi gadā un ikreiz, kad notiek būtiskas izmaiņas, kas ietekmē centrālā darījumu partnera pakļautību riskiem, bet pēc iespējas būtu jāizvairās no traucējošām vai vērīenīgām izmaiņām atskaitījumos, kuras varētu radīt procikliskumu. Atskaitījumu politikai un procedūrām veic neatkarīgu apstiprināšanu vismaz reizi gadā.

42. pants

Koncentrācijas ierobežojumi

1. Centrālais darījumu partneris ievieš un īsteno politiku un procedūras, lai nodrošinātu, ka nodrošinājums ir pietiekami diversificēts, lai to varētu likvidēt noteiktā turēšanas periodā, neradot būtisku ietekmi uz tirgu. Politikā un procedūrās nosaka riska mazināšanas pasākumus, kas jāveic, ja ir pārsniegti 2. punktā noteiktie koncentrācijas ierobežojumi.

2. Centrālais darījumu partneris nosaka koncentrācijas ierobežojumus:

- a) atsevišķu emitentu līmenī;
- b) emitentu veida līmenī;
- c) aktīvu veida līmenī;
- d) katra tīrvērtes dalībnieka līmenī;
- e) visu tīrvērtes dalībnieku līmenī.

3. Koncentrācijas ierobežojumus nosaka saskaņā ar konservatīvu metodi, ņemot vērā visus būtiskos kritērijus, tostarp:

- a) finanšu instrumentus, ko emitējuši ekonomikas nozares, darbības, ģeogrāfiskā reģiona ziņā viena veida emitenti;
- b) finanšu instrumenta vai emitenta kredītriska līmeni, pamatojoties uz centrālā darījumu partnera veiktu iekšēju novērtējumu. Veicot šādu novērtējumu, centrālais darījumu partneris izmanto definētu un objektīvu metodoloģiju, kas pilnībā nepaļaujas uz ārējiem atzinumiem un kurā ņemts vērā risks, kas saistīts ar emitenta galvenās uzņēmējdarbības vietas atrašanos konkrētā valstī;
- c) finanšu instrumentu likviditāti un cenu svārstīgumu.

4. Centrālais darījumu partneris nodrošina, ka ne vairāk kā 10 % no tā nodrošinājuma garantē viena kredītiestāde vai līdzvērtīga trešās valsts finanšu iestāde, vai struktūra, kas pieder tai pašai uzņēmumu grupai kā kredītiestāde vai trešās valsts finanšu iestāde. Ja nodrošinājums, ko centrālais darījumu partneris saņem komercbankas garantijas veidā, ir lielāks nekā 50 % no kopējā nodrošinājuma, šo ierobežojumu drīkst paaugstināt līdz 25 %.

5. Aprēķinot 2. punktā noteiktos ierobežojumus, centrālais darījumu partneris iekļauj visus centrālā darījumu partnera riska darījumus ar emitentu, tostarp kumulatīvo kredītlīniju summu, noguldījumu sertifikātus, termiņnoguldījumus, krājkontus, noguldījuma kontus, norēķinu kontus, naudas tirgus instrumentus un atpakaļpirkuma līgumus, ko izmanto centrālais darījumu partneris. Šie ierobežojumi neattiecas uz centrālā darījumu partnera turētu nodrošinājumu, kas pārsniedz minimālās prasības attiecībā uz maržām, saistību neizpildes fondu vai citiem finanšu resursiem.

6. Nosakot koncentrācijas ierobežojumu centrālā darījumu partnera riska darījumiem ar atsevišķu emitentu, centrālais darījumu partneris apkopo un uzskata par vienotu risku savus riska darījumus ar visiem finanšu instrumentiem, ko emitējis emitents vai grupas struktūra un ko nepārprotami garantē emitents vai grupas struktūra, un ar finanšu instrumentiem, ko emitējuši uzņēmumi, kuru vienīgais mērķis ir turēt īpašumā ražošanas līdzekļus, kas ir būtiski emitenta uzņēmējdarbībai.

7. Centrālais darījumu partneris regulāri uzrauga koncentrācijas ierobežojumu atbilstību tā politikai un procedūrām. Centrālais darījumu partneris pārskata savu koncentrācijas ierobežojumu politiku un procedūru vismaz reizi gadā un ikreiz, kad notiek būtiskas izmaiņas, kas ietekmē centrālā darījumu partnera pakļautību riskiem.

8. Centrālais darījumu partneris informē kompetento iestādi un tīrvērtes dalībniekus par piemērojamiem koncentrācijas ierobežojumiem un visām izmaiņām saistībā ar tiem.

9. Ja centrālais darījumu partneris būtiski pārkāpj tā politikā un procedūrās noteiktos koncentrācijas ierobežojumus, tas nekavējoties informē kompetento iestādi. Centrālais darījumu partneris novērš pārkāpumu, cik drīz vien iespējams.

XI NODAĻA

IEGULDĪJUMU POLITIKA

(Regulas (ES) Nr. 648/2012 47. pants)

43. pants

Finanšu instrumenti ar augstu likviditāti

Piemērojot Regulas (ES) Nr. 648/2012 47. panta 1. punktu, parāda instrumentus var uzskatīt par ļoti likvidiem un ar minimālu kredītrisku un tirgus risku, ja tie ir parāda instrumenti, kas atbilst visiem II pielikumā izklāstītajiem nosacījumiem.

44. pants

Augsta līmeņa drošības pasākumi finanšu instrumentu deponēšanai

1. Ja centrālais darījumu partneris, ne nododot īpašumtiesības, ne tiesības uz vērtspapīriem, nevar 45. pantā minētos finanšu instrumentus vai finanšu instrumentus, kas tam iemaksāti kā maržas, iemaksas saistību neizpildes fondā vai iemaksas citos finanšu resursos, deponēt pie vērtspapīru norēķinu sistēmas dalībnieka, kas nodrošina pilnīgu šo instrumentu aizsardzību, tad šādus finanšu instrumentus deponē kādā no šīm struktūrām:

- a) centrālajā bankā, kas nodrošina pilnīgu šo instrumentu aizsardzību un kas nepieciešamības gadījumā centrālajam darījumu partnerim piešķir tūlītēju pieeju finanšu instrumentam;
- b) kredītiestādē, kam piešķirta atļauja, kā definēts Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvā 2006/48/EK ⁽¹⁾, kura nodrošina šo instrumentu pilnīgu nošķiršanu un aizsardzību, nepieciešamības gadījumā centrālajam darījumu partnerim piešķir tūlītēju pieeju finanšu instrumentiem un par kuru centrālais darījumu partneris var pierādīt, ka tai ir zems kredītrisks, pamatojoties uz centrālā darījumu partnera veiktu iekšēju novērtējumu. Veicot šādu novērtējumu, centrālais darījumu partneris izmanto definētu un objektīvu metodoloģiju, kas pilnībā nepaļaujas uz ārējiem atzinumiem un kurā ņemts vērā risks, kas saistīts ar kredītiestādes galvenās uzņēmējdarbības vietas atrašanos konkrētā valstī;
- c) trešās valsts finanšu iestādē, uz kuru attiecas un kura ievēro prudenciālas uzraudzības noteikumus, ko attiecīgās kompetentās iestādes uzskata par vismaz tikpat stingriem kā Direktīvā 2006/48/EK paredzētos prudenciālas uzraudzības noteikumus, un kurai ir stabila grāmatvedības prakse, kontu turēšanas procedūras un iekšējā kontrole, un kura nodrošina šo instrumentu pilnīgu nošķiršanu un aizsardzību, nepieciešamības gadījumā piešķir centrālajam darījumu partnerim tūlītēju pieeju finanšu instrumentiem un par kuru centrālais darījumu partneris var pierādīt, ka tai ir zems kredītrisks, pamatojoties uz centrālā darījumu partnera veiktu iekšēju novērtējumu. Veicot šādu novērtējumu, centrālais darījumu partneris izmanto definētu un objektīvu metodoloģiju, kas pilnībā nepaļaujas uz ārējiem atzinumiem un kurā ņemts vērā risks, kas saistīts ar kredītiestādes galvenās uzņēmējdarbības vietas atrašanos konkrētā valstī.

2. Ja finanšu instrumenti tiek deponēti saskaņā ar 1. punkta b) vai c) apakšpunktu, to turējumu nodrošina saskaņā ar noteikumiem, kas novērš jebkādas zaudējumus centrālajam darījumu partnerim, kuri varētu rasties atļauju saņēmušās finanšu iestādes saistību neizpildes vai maksātnespējas gadījumā.

3. Augsta līmeņa drošības pasākumi finanšu instrumentu deponēšanai, kas iemaksāti kā maržas, iemaksas saistību neizpildes fondā vai iemaksas citos finanšu resursos, centrālajam

darījumu partnerim ļauj atkārtoti izmantot šos finanšu instrumentus tikai tad, ja ir spēkā Regulas (ES) Nr. 648/2012 39. panta 8. punktā paredzētie nosacījumi un ja atkārtotas izmantošanas mērķis ir pārvaldīt tūlītējas dalībnieka saistību neizpildes gadījumu vai īstenot vienošanos par sadarbību.

45. pants

Augsta līmeņa drošības pasākumi naudas līdzekļu uzturēšanai

1. Piemērojot Regulas (ES) Nr. 648/2012 47. panta 4. punktu, ja skaidra nauda tiek deponēta iestādē, kas nav centrālā banka, tad šāds depozīts atbilst visiem turpmāk minētajiem nosacījumiem:

a) depozīts ir vienā no šīm valūtām:

- i) valūtā, par kuras riskiem centrālais darījumu partneris ar augstu uzticamības pakāpi var pierādīt, ka tas spēj tos pārvaldīt;
- ii) valūtā, kurā centrālais darījumu partneris veic darījumu tūlītēji, attiecīgajā valūtā saņemtā nodrošinājuma robežās;

b) depozīts ir vienā no šādām struktūrām:

- i) kredītiestādē, kam piešķirta atļauja, kā definēts Direktīvā 2006/48/EK, par kuru centrālais darījumu partneris var pierādīt, ka tai ir zems kredītrisks, pamatojoties uz centrālā darījumu partnera veiktu iekšēju novērtējumu. Veicot šādu novērtējumu, centrālais darījumu partneris izmanto definētu un objektīvu metodoloģiju, kas pilnībā nepaļaujas uz ārējiem atzinumiem un kurā ņemts vērā risks, kas saistīts ar emitenta galvenās uzņēmējdarbības vietas atrašanos konkrētā valstī;
- ii) trešās valsts finanšu iestādē, uz kuru attiecas un kura ievēro prudenciālas uzraudzības noteikumus, ko attiecīgās kompetentās iestādes uzskata par vismaz tikpat stingriem kā tos, kas paredzēti Direktīvā 2006/48/EK, kurai ir stabila grāmatvedības prakse, kontu turēšanas procedūras un iekšējā kontrole, un par kuru centrālais darījumu partneris var pierādīt, ka tai ir zems kredītrisks, pamatojoties uz centrālā darījumu partnera veiktu iekšēju novērtējumu. Veicot šādu novērtējumu, centrālais darījumu partneris izmanto definētu un objektīvu metodoloģiju, kas pilnībā nepaļaujas uz ārējiem atzinumiem un kurā ņemts vērā risks, kas saistīts ar emitenta galvenās uzņēmējdarbības vietas atrašanos konkrētā valstī.

2. Ja skaidra nauda tiek uzturēta kā vienas nakts depozīts saskaņā ar 1. punktu, tad ne mazāk kā 95 % no šīs naudas, kuru aprēķina par vidējo laikposmu, kas ir viens kalendārais mēnesis, deponē saskaņā ar noteikumiem, kas garantē naudas nodrošinājumu ar ļoti likvidiem finanšu instrumentiem, kuri atbilst 45. panta prasībām, izņemot minētā panta 1. punkta c) apakšpunktā norādīto prasību.

⁽¹⁾ OV L 177, 30.6.2006., 1. lpp.

45. pants

Koncentrācijas ierobežojumi

1. Centrālais darījumu partneris ievieš un īsteno politiku un procedūras, lai nodrošinātu, ka finanšu instrumenti, kuros tiek ieguldīti tā finanšu resursi, ir pietiekami diversificēti.

2. Centrālais darījumu partneris nosaka koncentrācijas robežas un uzrauga tā finanšu resursu koncentrāciju:

- a) atsevišķu finanšu instrumentu līmenī;
 - b) finanšu instrumentu veidu līmenī;
 - c) atsevišķu emitentu līmenī;
 - d) emitentu veidu līmenī;
 - e) darījuma partneru līmenī, ar kuriem ir noslēgtas vienošanās atbilstīgi 44. panta 1. punkta b) un c) apakšpunktam vai 45. panta 2. punktam.
3. Attiecībā uz emitentu veidiem centrālais darījumu partneris ņem vērā šādus faktorus:
- a) ģeogrāfisko sadalījumu;
 - b) savstarpējās atkarības un daudzveidīgās attiecības, kas struktūrai var būt ar centrālo darījumu partneri;
 - c) kredītriska līmeni;
 - d) centrālā darījumu partnera riska darījumus saistībā ar produktiem, kuriem centrālais darījumu partneris veic tīrvērti.

4. Politikā un procedūrās ir noteikti riska mazināšanas pasākumi, kas jāpiemēro, ja ir pārsniegti koncentrācijas ierobežojumi.

5. Nosakot koncentrācijas ierobežojumus centrālā darījumu partnera riska darījumiem ar atsevišķiem emitentiem vai turētājbankām, centrālais darījumu partneris apkopo un uzskata par vienotu risku savus riska darījumus ar visiem finanšu instrumentiem, ko emitējis vai kurus nepārprotami garantējis emitents, un visiem finanšu resursiem, kas deponēti turētājbankā.

6. Centrālais darījumu partneris regulāri uzrauga koncentrācijas ierobežojumu atbilstību tā politikai un procedūrām. Turklāt centrālais darījumu partneris pārskata savu koncentrācijas ierobežojumu politiku un procedūru vismaz reizi gadā un ikreiz, kad notiek būtiskas izmaiņas, kas ietekmē centrālā darījumu partnera pakļautību riskiem.

7. Ja centrālais darījumu partneris pārkāpj tā politikā un procedūrās noteiktos koncentrācijas ierobežojumus, tas nekavējoties informē kompetento iestādi. Centrālais darījumu partneris novērš pārkāpumu, cik drīz vien iespējams.

46. pants

Bezskaidras naudas nodrošinājums

Ja nodrošinājums ir saņemts kā finanšu instruments saskaņā ar X nodaļas noteikumiem, piemēro tikai 44. un 45. pantu.

XII NODAĻA

PĀRSKATS PAR MODEĻIEM, STRESA TESTIEM UN ATPAKAĻEJOŠĀM PĀRBAUDĒM

(Regulas (ES) Nr. 648/2012 49. pants)

1. IEDAĻA

Modeļi un programmas

47. pants

Modeļu apstiprināšana

1. Centrālais darījumu partneris veic visaptverošu apstiprināšanu saviem modeļiem, to metodēm un likviditātes riska pārvaldības sistēmai, kuru izmanto, lai kvantitatīvi izteiktu, apkopotu un pārvaldītu tā riskus. Jebkādam būtiskām pārskatīšanām vai pielāgojumiem tā modeļos, to metodoloģijā un likviditātes riska pārvaldības sistēmā veic pienācīgu pārvaldību, tostarp konsultējoties ar riska komiteju, un pirms to piemērošanas tos apstiprina kvalificēta un neatkarīga persona.

2. Centrālā darījumu partnera apstiprināšanas procesu dokumentē un vismaz precizē politiku, ko izmanto, lai pārbaudītu centrālā darījumu partnera maržu, saistību neizpildes fonda un citu finanšu resursu aprēķināšanas metodes un likvīdo finanšu resursu aprēķināšanas sistēmu. Jebkādam šādas politikas būtiskām pārskatīšanām vai pielāgojumiem nodrošina pienācīgu pārvaldību, tostarp konsultējoties ar riska komiteju, un pirms to piemērošanas tās apstiprina kvalificēta un neatkarīga persona.

3. Visaptveroša apstiprināšana ietver vismaz šādas darbības:

- a) modeļu un regulējuma konceptuālās stabilitātes novērtējumu, aptverot arī to izstrādes dokumentāciju;
- b) notiekošās uzraudzības procedūru pārskatīšanu, tostarp procesu pārbaudes un salīdzinošo vērtēšanu;
- c) modeļu, to metodoloģijas un regulējuma izstrādē izmantoto parametru un pieņēmumu pārskatīšanu;
- d) atbilstības un piemērotības pārskatīšanu modeļiem, to metodoloģijai un regulējumam, kas pieņemti attiecībā uz līgumu veidu, kuriem tos piemēro;

e) savu stresa testēšanas scenāriju piemērotības pārskatīšanu atbilstīgi VII nodaļai un 52. pantam;

f) testēšanas rezultātu analīzi.

4. Centrālais darījumu partneris nosaka kritērijus, pēc kuriem izvērtē, vai tā modeļus, to metodoloģiju un likviditātes riska pārvaldības sistēmu var veiksmīgi apstiprināt. Viens no kritērijiem ir arī veiksmīgi testēšanas rezultāti.

5. Ja cenu dati nav viegli pieejami vai uzticami, centrālais darījumu partneris reaģē uz šādiem ierobežojumiem un vismaz izmanto konservatīvus pieņēmumus, kas balstīti uz novērotajiem korelējošiem vai saistītiem tirgiem un aktuālajām tirgus norisēm.

6. Ja cenu dati nav viegli pieejami vai uzticami, sistēmām un vērtēšanas modeļiem, ko izmanto šim nolūkam, nodrošina pienācīgu pārvaldību (tostarp – konsultējoties ar riska komiteju), apstiprināšanu un testēšanu. Centrālais darījumu partneris uzdod savus vērtēšanas modeļus attiecībā uz dažādiem tirgus scenārijiem apstiprināt kvalificētai un neatkarīgai personai, lai nodrošinātu, ka saskaņā ar tā modeļiem tiek precīzi aprēķinātas atbilstošas cenas, un vajadzības gadījumā koriģē sākotnējo maržu aprēķinu, lai tajā būtu ņemti vērā visi konstatētie modeļa riski.

7. Centrālais darījumu partneris regulāri sagatavo novērtējumu par sava maržu modeļa teorētiskajām un empīriskajām īpašībām attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem, kuriem tas veic tīrvērti.

48. pants

Testēšanas programmas

1. Centrālajam darījumu partnerim ir politika un procedūras, kurās sīki aprakstītas stresa testu un atpakaļejošo pārbaužu programmas, kuras tas piemēro, lai novērtētu, cik atbilstīgi, precīzi, uzticami un stabili ir tā modeļi un metodoloģija, ko izmanto, lai aprēķinātu tā riska kontroles mehānismus, tostarp maržas, iemaksas saistību neizpildes fondā un citus finanšu resursus dažādos tirgus apstākļos.

2. Centrālā darījumu partnera politikā un procedūrās ir sīki izklāstīta arī stresa testēšanas programma, ko tas izmanto, lai novērtētu likviditātes riska pārvaldības sistēmas atbilstīgumu, precizitāti, uzticamību un stabilitāti.

3. Politikā un procedūrās ir noteikta vismaz metodoloģija piemērotu testu izvēlei un izstrādei, tostarp portfeļa un tirgus datu atlasei, testu veikšanas regularitāte, specifiskās riska iezīmes finanšu instrumentiem, kam veic tīrvērti, testēšanas rezultātu un izņēmumu analīze un nepieciešamie attiecīgie korektīvie pasākumi.

4. Centrālais darījumu partneris visu testu veikšanā iekļauj visas klientu pozīcijas.

2. IEDAĻA

Atpakaļejošās pārbaudes

49. pants

Atpakaļejošo pārbaužu procedūra

1. Centrālais darījumu partneris novērtē savu maržu segumu, veicot faktiskos rezultātu *ex post* salīdzinājumus ar gaidītajiem rezultātiem, kuri tika iegūti, izmantojot maržas aprēķināšanas modeļus. Šādu analīzi ar atpakaļejošās pārbaudes palīdzību veic katru dienu, lai novērtētu, vai attiecībā uz maržu segumu ir radušies kādi testēšanas izņēmumi. Segumu novērtē aktuālajām pozīcijām finanšu instrumentos un attiecībā uz tīrvērtes dalībniekiem un ņem vērā finanšu instrumentu portfeļa maržas noteikšanas iespējamo ietekmi un, attiecīgā gadījumā, sadarbīgos centrālos darījumu partnerus.

2. Centrālais darījumu partneris savā atpakaļejošo pārbaužu programmā ņem vērā atbilstīgus vēsturiskos laikposmus, lai nodrošinātu, ka novērojumu laikposms ir pietiekams, lai mazinātu jebkādu nelabvēlīgu ietekmi uz statistisko nozīmīgumu.

3. Centrālais darījumu partneris savā atpakaļejošo pārbaužu programmā ņem vērā vismaz skaidrus statistiskos testus un darbības rezultātu kritērijus, ko centrālais darījumu partneris nosaka atpakaļejošo pārbaužu rezultātu novērtēšanai.

4. Lai saņemtu riska komitejas ieteikumus maržas modeļa pārskatīšanai, centrālais darījumu partneris regulāri ziņo riska komitejai par saviem atpakaļejošo pārbaužu rezultātiem un analīzi tādā veidā, ka netiek pārkāpti konfidencialitātes noteikumi.

5. Atpakaļejošo pārbaužu rezultātus un analīzes datus dara pieejamus visiem tīrvērtes dalībniekiem un – ja tie centrālajam darījumu partnerim ir zināmi – klientiem. Visiem pārējiem klientiem atpakaļejošo pārbaužu rezultātus un analīzes datus pēc pieprasījuma dara pieejamus attiecīgie tīrvērtes dalībnieki. Minēto informāciju apkopo tādā veidā, ka netiek pārkāpti konfidencialitātes noteikumi, un tīrvērtes dalībniekiem un klientiem ir pieeja detalizētiem atpakaļejošo pārbaužu rezultātiem un analīzes datiem tikai par savu finanšu instrumentu portfeli.

6. Centrālais darījumu partneris nosaka procedūras, lai konkretizētu darbības, ko tas varētu veikt, ņemot vērā atpakaļejošo pārbaužu analīzes rezultātus.

3. IEDAĻA

Jutīguma testēšana un analīze

50. pants

Jutīguma testēšanas un analīzes procedūra

1. Centrālais darījumu partneris veic jutīguma testus un analīzi, lai novērtētu sava maržu modeļa segumu dažādos tirgus apstākļos, izmantojot vēsturiskos datus par faktiskajiem saspringtajiem tirgus apstākļiem un hipotētiskos datus par iespējamajiem saspringtiem tirgus apstākļiem, kas tomēr nav īstenojušies.

2. Centrālais darījumu partneris izmanto plašu parametru un pieņēmumu spektru, lai aptvertu dažādus vēsturiskos un hipotētiskos apstākļus, tostarp vissvārstīgākos periodus, kādi pieredzēti tā apkalpotajos tirgos, un ekstrēmas izmaiņas korelācijās starp to līgumu cenām, kuriem centrālais darījumu partneris veic tīrvērti, lai saprastu, kā ārkārtīgi saspringti tirgus apstākļi un svarīgu modeļa parametru izmaiņas varētu ietekmēt maržu seguma līmeni.

3. Jūtīguma analīzi veic vairākiem faktiski eksistējošiem un reprezentatīviem tīrvērtes dalībnieku portfeliem. Reprezentatīvos portfeļus izvēlas, pamatojoties uz to jutīgumu pret būtiskiem riska faktoriem un korelācijām, kam pakļauts centrālais darījumu partneris. Šādi jutīguma testi un analīze ir izstrādāti tā, lai pārbaudītu sākotnējā maržu modeļa galvenos parametrus un pieņēmumus ar vairākiem ticamības intervāliem, lai noteiktu sistēmu jutīgumu pret kļūdām, kalibrējot šādus parametrus un pieņēmumus. Pienācīgu uzmanību pievērš riska faktoru termiņstrukturai un pieņemtajai korelācijai starp riska faktoriem.

4. Centrālais darījumu partneris izvērtē potenciālos zaudējumus tīrvērtes dalībnieka pozīcijās.

5. Centrālais darījumu partneris attiecīgā gadījumā ņem vērā parametrus, kas atspoguļo tādu tīrvērtes dalībnieku vienlaicīgu saistību neizpildi, kuri emitē finanšu instrumentus, kam centrālais darījumu partneris veic tīrvērti, vai atvasināto instrumentu, kam centrālais darījumu partneris veic tīrvērti, pamatā esošos instrumentus. Attiecīgā gadījumā ņem vērā arī ietekmi, ko rada tāda klienta saistību neizpilde, kurš emitē finanšu instrumentus, kam centrālais darījumu partneris veic tīrvērti, vai atvasināto instrumentu, kam centrālais darījumu partneris veic tīrvērti, pamatā esošos instrumentus.

6. Lai saņemtu riska komitejas ieteikumus maržu modeļa pārskatīšanai, centrālais darījumu partneris regulāri ziņo riska komitejai par saviem jutīguma pārbažu rezultātiem un analīzi tādā veidā, ka netiek pārkāpti konfidencialitātes noteikumi.

7. Centrālais darījumu partneris nosaka procedūras, lai konkretizētu darbības, ko tas varētu veikt, ņemot vērā jutīguma pārbažu analīzes rezultātus.

3. Centrālā darījumu partnera stresa testēšanas programmā ir noteikts, ka stresa testus veic, izmantojot noteiktus stresa testu scenārijus gan par pagātnē pieredzētiem, gan par hipotētiskiem ārkārtējiem, taču iespējamiem tirgus apstākļiem saskaņā ar VII nodaļu. Pagātnes apstākļus nepieciešamības gadījumā pārskata un pielāgo. Centrālais darījumu partneris ņem vērā arī citu veidu atbilstošus stresa testēšanas scenārijus, tostarp – bet ne tikai – tā norēķinu banku, korespondentbanku, kurās ir nostro konti, turētājbanku, likviditātes nodrošinātāju vai sadarbībasjūgu centrālo darījumu partneru tehniskas vai finansiālas problēmas.

4. Centrālajam darījumu partnerim ir iespējas pielāgot savus stresa testus, ātri iekļaujot jaunus vai potenciālus riskus.

5. Centrālais darījumu partneris ņem vērā iespējamus zaudējumus, kas var rasties tāda klienta (ja tas ir zināms), kurš veic tīrvērti ar vairākiem tīrvērtes dalībniekiem, saistību neizpildes gadījumā.

6. Centrālais darījumu partneris regulāri ziņo riska komitejai par saviem stresa testu rezultātiem un analīzi tādā veidā, ka netiek pārkāpti konfidencialitātes noteikumi, lai saņemtu riska komitejas ieteikumus tā modeļu, metodoloģiju un tā likviditātes riska pārvaldības sistēmas pārskatīšanai.

7. Stresa testu rezultātus un analīzes datus dara pieejamus visiem tīrvērtes dalībniekiem un – ja tie centrālajam darījumu partnerim ir zināmi – klientiem. Visiem pārējiem klientiem stresa testu rezultātus un analīzes datus pēc pieprasījuma dara pieejamus attiecīgie tīrvērtes dalībnieki. Minēto informāciju apkopo tādā veidā, ka netiek pārkāpti konfidencialitātes noteikumi, un tīrvērtes dalībniekiem un klientiem ir pieeja detalizētiem stresa testu rezultātiem un analīzes datiem tikai par savu finanšu instrumentu portfeli.

8. Centrālais darījumu partneris nosaka procedūras, lai konkretizētu darbības, ko tas varētu veikt, ņemot vērā stresa testu analīzes rezultātus.

52. pants

Stresa testos vērā ņemamie riska faktori

1. Centrālais darījumu partneris nosaka būtiskos riska faktorus, kas raksturīgi līgumiem, kuriem tas veic tīrvērti, un kas varētu radīt ietekmi uz tā zaudējumiem; tam ir atbilstoša metode šo riska faktoru mērīšanai. Centrālā darījumu partnera stresa testos attiecīgā gadījumā ņem vērā vismaz riska faktorus, kas noteikti attiecībā uz šādu veidu finanšu instrumentiem:

a) līgumiem, kas attiecas uz procentu likmēm, – riska faktorus, kas saistīti ar procentu likmēm katrai valūtai, kurā centrālais darījumu partneris veic tīrvērti finanšu instrumentiem. Ienesīguma līknes modeli sadala dažādos beigu termiņu segmentos, lai aptvertu likmju svārstīguma atšķirības visā līknē. Saisītāto riska faktoru skaits ir atkarīgs no procentu likmju līgumu, kuriem tīrvērti veic centrālais darījumu partneris, sarežģītības. Bāzes risku, ko rada nepilnīgi korelējoša dinamika starp valsts un citām fiksētā ienākuma procentu likmēm, aptver atsevišķi;

4. IEDAĻA

Stresa testi

51. pants

Stresa testēšanas procedūra

1. Centrālā darījumu partnera veiktajos stresa testos piemēro stresa parametrus, pieņēmumus un scenārijus modeļiem, ko izmanto, lai novērtētu riska darījumu apjomu un pārliecinātos, ka tā finanšu resursi ir pietiekami, lai segtu šos riska darījumus ārkārtējos, taču iespējamajos tirgus apstākļos.

2. Saskaņā ar centrālā darījumu partnera stresa testēšanas programmu dažādi stresa testi tam ir jāveic regulāri, ņemot vērā centrālā darījumu partnera produktu klāstu, visus tā modeļu un to metodoloģiju elementus un tā likviditātes riska pārvaldības sistēmu.

- b) līgumiem, kas attiecas uz maiņas kursu, – riska faktorus, kas saistīti ar katru ārvalstu valūtu, kurā centrālais darījumu partneris veic finanšu instrumentu tīrvērti, un valūtas maiņas kursu starp valūtu, kurā tiek pieprasītas maržas, un valūtu, kurā centrālais darījumu partneris veic finanšu instrumentu tīrvērti;
- c) līgumiem, kas saistīti ar kapitāla vērtspapīriem, – riska faktorus, kas saistīti ar atsevišķu kapitāla vērtspapīru emisiju svārstīgumu attiecībā uz katru tirgu, kurā centrālais darījumu partneris veic tīrvērti, un ar kopējā kapitāla vērtspapīru tirgus dažādu sektoru svārstīgumu. Konkrētam tirgum paredzētās modeļēšanas tehnikas sarežģītība un veids ir atbilstoši centrālā darījumu partnera riska darījumiem kopējā tirgū, kā arī tā atsevišķu kapitāla vērtspapīru emisiju koncentrācijai attiecīgajā tirgū;
- d) preču līgumiem – riska faktorus, kuros ņemtas vērā preču līgumu un atvasināto instrumentu, kuriem centrālais darījumu partneris veic tīrvērti, dažādās kategorijas un apakškategorijas, tostarp attiecīgā gadījumā ienākuma no īpašumtiesībām mainību starp preces atvasināto instrumentu pozīcijām un naudas pozīcijām precē;
- e) līgumiem, kas saistīti ar kredītu, – riska faktorus, kuros ņemts vērā pēkšņas saistību nepildīšanas risks, tostarp kumulatīvais risks, kas izriet no vairākām saistību neizpildēm, bāzes risks un atgūšanas likmes svārstības.
2. Savos stresa testos centrālais darījumu partneris pienācīgi ņem vērā arī vismaz:
- a) korelācijas, tostarp tās, kuras konstatētas starp noteiktajiem riska faktoriem un līdzīgiem līgumiem, kuriem centrālais darījumu partneris veic tīrvērti;
- b) faktorus, kas saistīti ar līguma, kam veic tīrvērti, implicēto un vēsturisko svārstīgumu;
- c) jebkuru jaunu līgumu, kuriem centrālais darījumu partneris veic tīrvērti, specifiskās īpašības;
- d) koncentrācijas risku, tostarp pret tīrvērtes dalībnieku un pret tīrvērtes dalībnieka grupas struktūrām;
- e) savstarpējās atkarības un daudzpusējās attiecības;
- f) saistītos riskus, tostarp ārvalstu valūtas risku;
- g) noteiktos ierobežojumus riska pakļautībai;
- h) korelācijas risku.

53. pants

Stresa testēšana kopējiem finanšu resursiem

1. Centrālā darījumu partnera stresa testēšanas programma nodrošina, ka tā maržas, saistību neizpildes fonda iemaksas un citi finanšu resursi visi kopā ir pietiekami, lai ārkārtējos, taču iespējamajos tirgus apstākļos nosegtu vismaz divu to tīrvērtes dalībnieku saistību neizpildi, ar kuriem tam ir vislielākie riska darījumi. Ar stresa testēšanas programmas palīdzību tiek izvērtēti arī iespējamie zaudējumi ārkārtējos, taču iespējamajos tirgus apstākļos, ja saistības nepilda tās pašas grupas struktūras, pie kuras pieder divi tie tīrvērtes dalībnieki, ar kuriem tam ir vislielākie riska darījumi.
2. Centrālā darījumu partnera stresa testēšanas programma nodrošina, ka tā maržas un saistību neizpildes fonds ir pietiekami, lai saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 42. pantu nosegtu vismaz tā tīrvērtes dalībnieka saistību neizpildi, ar kuru tam ir vislielākie riska darījumi, vai arī riska darījumu ziņā otrā un trešā lielākā tīrvērtes dalībnieka saistību neizpildi, ja to riska darījumu summa ir lielāka.
3. Centrālais darījumu partneris veic rūpīgu analīzi par potenciālajiem zaudējumiem, kādi tam varētu rasties, un izvērtē potenciālos zaudējumus tīrvērtes dalībnieka pozīcijās, tostarp risku, ka šādu pozīciju likvidācija varētu ietekmēt tirgu un centrālā darījumu partnera maržu seguma līmeni.
4. Centrālais darījumu partneris savos stresa testos attiecīgā gadījumā ņem vērā ietekmi, kāda būtu tāda tīrvērtes dalībnieka saistību neizpildei, kurš emitē finanšu instrumentus, kam centrālais darījumu partneris veic tīrvērti, vai atvasināto instrumentu, kam centrālais darījumu partneris veic tīrvērti, pamatā esošos instrumentus. Attiecīgā gadījumā ņem vērā arī ietekmi, ko rada tāda klienta saistību neizpilde, kurš emitē finanšu instrumentus, kam centrālais darījumu partneris veic tīrvērti, vai atvasināto instrumentu, kam centrālais darījumu partneris veic tīrvērti, pamatā esošos instrumentus.
5. Centrālais darījumu partneris savos stresa testos ņem vērā likvidācijas periodu, kā noteikts 26. pantā.

54. pants

Stresa testēšana attiecībā uz likvidajiem finanšu resursiem

1. Centrālā darījumu partnera stresa testēšanas programma attiecībā uz tā likvidajiem finanšu resursiem nodrošina, ka tie ir pietiekami saskaņā ar VIII nodaļā izklāstītajām prasībām.
2. Centrālajam darījumu partnerim ir skaidri un pārskatāmi noteikumi un procedūras, lai novērstu nepietiekamu likvido finanšu resursu situāciju, ja tādu atklāj stresa testi, un lai nodrošinātu maksājumu saistību izpildi.

Centrālajam darījumu partnerim ir arī skaidras procedūras savu stresa testu rezultātu un analīzes datu izmantošanai, lai novērtētu un pielāgotu savas likviditātes riska pārvaldības sistēmas un likviditātes nodrošinātāju atbilstību.

3. Stresa testēšanā attiecībā uz likvidajiem finanšu resursiem izmantotajos stresa testēšanas scenārijos ņem vērā centrālā darījumu partnera struktūru un darbību, un tie aptver visas struktūras, kas varētu tam radīt būtisku likviditātes risku. Šādos stresa testos ņem vērā arī jebkādas ciešas saiknes vai līdzīgus riska darījumus starp centrālā darījumu partnera tīrvērtes dalībniekiem, tostarp citām tās pašas grupas struktūrām, un novērtē vairāku saistību neizpildes gadījumu varbūtību un iespējamo domino efektu, ko tās varētu radīt starp tā tīrvērtes dalībniekiem.

5. IEDAĻA

Segums un testu rezultātu izmantošana

55. pants

Pietiekama seguma uzturēšana

1. Lai varētu nekavējoties pielāgot savu maržu prasību aprēķināšanu, pienācīgi ņemot vērā jaunus tirgus apstākļus, centrālais darījumu partneris ievieš un uztur procedūras, kas ļauj konstatēt izmaiņas tirgus apstākļos, tostarp svārstīguma palielināšanos vai likviditātes samazināšanos attiecībā uz finanšu instrumentiem, kuriem tas veic tīrvērti, lai varētu nekavējoties pielāgot savu maržu prasību aprēķināšanu, pienācīgi ņemot vērā jaunus tirgus apstākļus.

2. Centrālais darījumu partneris veic testus attiecībā uz atskaitījumiem, ko tas piemēro, lai nodrošinātu, ka novērotos ārkārtējos, taču iespējamajos tirgus apstākļos nodrošinājumu var likvidēt vismaz pēc tā samazinātās vērtības.

3. Ja centrālais darījumu partneris iekasē maržu portfela, nevis produktu līmenī, tas nepārtraukti pārskata un testē kompensēšanu starp produktiem. Centrālais darījumu partneris šādu kompensēšanu balsta uz piesardzīgu un ekonomiski nozīmīgu metodoloģiju, kurā ņemts vērā produktu cenu savstarpējās atkarības līmenis. Konkrēti, centrālais darījumu partneris testē to, kā mainās korelācijas faktiski konstatētos un hipotētiskos smagos tirgus apstākļos.

56. pants

Modeļu pārskatīšana, izmantojot testa rezultātus

1. Centrālajam darījumu partnerim ir skaidras procedūras, lai noteiktu papildu maržas summu, kāda tam var būt vajadzīga (tostarp tajā pašā dienā), un lai pārkalibrētu savu maržas modeli, ja atpakaļejošo pārbaužu rezultāti liecina par to, ka modelis nav darbojies tā, kā ticis gaidīts, un rezultātā ar modeļa palīdzību nav iespējams noteikt atbilstošu sākotnējās maržas summu, kas vajadzīga, lai panāktu vajadzīgo uzticamības līmeni. Ja centrālais darījumu partneris ir konstatējis, ka nepieciešama papildu marža, tas pieprasa papildu maržu nākamajā maržu pieprasījumā.

2. Centrālais darījumu partneris novērtē, kādi ir tā atpakaļejošo pārbaužu rezultātos konstatēto testēšanas izņēmumu

ienesli. Atkarībā no izņēmumu iemesla centrālais darījumu partneris nosaka, vai ir vajadzīgas būtiskas izmaiņas maržas modeli vai modeļos, kas nodrošina tā izejas datus, un vai ir vajadzīga esošo parametru pārkalibrēšana.

3. Centrālais darījumu partneris novērtē, kādi ir tā stresa testu rezultātos konstatēto testēšanas izņēmumu iemesli. Pamatoties uz izņēmumu iemesliem, centrālais darījumu partneris nosaka, vai ir vajadzīgas būtiskas izmaiņas tā modeļos, to metodoloģijās vai tā likviditātes riska pārvaldības sistēmā vai arī ir nepieciešams pārkalibrēt esošos parametrus vai pieņēmumus.

4. Ja testēšanas rezultāti liecina par maržu, saistību neizpildes fonda vai citu finanšu resursu nepietiekamu segumu, centrālais darījumu partneris, izmantojot nākamo maržu pieprasījumu, palielina savu finanšu resursu kopējo segumu līdz pieņemamam līmenim. Ja testēšanas rezultāti liecina par nepietiekamiem likvidajiem finanšu resursiem, centrālais darījumu partneris, cik ātri iespējams, palielina savus likvidos finanšu resursus līdz pieņemamam līmenim.

5. Centrālais darījumu partneris, pārskatot savus modeļus, to metodoloģijas un likviditātes riska pārvaldības sistēmu, uzrauga testēšanas izņēmumu atkārtošanās biežumu, lai pienācīgi un bez liekas kavēšanās noteiktu un risinātu problēmas.

6. IEDAĻA

Reversie stresa testi

57. pants

Reversie stresa testi

1. Centrālais darījumu partneris veic reversos stresa testus, kas izstrādāti tā, lai noteiktu, kādos tirgus apstākļos tā maržas, saistību neizpildes fonds un citi finanšu resursi var izrādīties nepietiekams riska darījumu segums un kādos tirgus apstākļos tā finanšu resursi var būt nepietiekami. Veicot šādus testus, centrālais darījumu partneris modeļē ārkārtējus tirgus apstākļus, kuri pārsniedz tos, kas tiek uzskatīti par iespējamiem tirgus apstākļiem, lai palīdzētu noteikt savu modeļu, savas likviditātes riska pārvaldības sistēmas, savu finanšu resursu un savu likvido finanšu resursu robežas.

2. Centrālais darījumu partneris izstrādā tādos reversos stresa testus, kas ir pielāgoti to tirgu un līgumu specifiskajiem riskiem, kuriem tas sniedz tīrvērtes pakalpojumus.

3. Centrālais darījumu partneris izmanto 1. punktā aprakstītos apstākļus un savu reverso stresa testu rezultātus un analīzes datus, lai palīdzētu identificēt ārkārtējus, taču iespējamus scenārijus saskaņā ar VII nodaļu.

4. Centrālais darījumu partneris regulāri paziņo riska komitejai savu reverso stresa testu rezultātus un analīzes datus tādā veidā, ka netiek pārkāpti konfidencialitātes noteikumi, un konsultējas ar riska komiteju par to pārskatīšanu.

7. IEDAĻA

Saistību neizpildes gadījumā piemērojamās procedūras

58. pants

Saistību neizpildes gadījumā piemērojamo procedūru testēšana

1. Centrālais darījumu partneris testē un pārskata savas saistību neizpildes gadījumā piemērojamās procedūras, lai nodrošinātu, ka tās ir gan praktiskas, gan efektīvas. Saistību neizpildes gadījumā piemērojamo procedūru testēšanas ietvaros centrālais darījumu partneris izmanto arī situāciju simulācijas.

2. Pēc savu saistību neizpildes gadījumā piemērojamo procedūru testēšanas centrālais darījumu partneris nosaka visas neskaidrības un attiecīgi pielāgo savas procedūras, lai tās mazinātu.

3. Centrālais darījumu partneris, izmantojot situāciju simulācijas, pārlicinās, ka visi tīrvērtes dalībnieki, attiecīgā gadījumā arī klienti un citas iesaistītās personas, tostarp sadarbībā iesaistītie centrālie darījumu partneri un visi saistīto pakalpojumu sniedzēji, ir pienācīgi informēti un zina, kādas procedūras ietilpst saistību neizpildes scenārijā.

8. IEDAĻA

Apstiprināšana un testēšanas biežums

59. pants

Biežums

1. Centrālais darījumu partneris vismaz reizi gadā veic savu modeļu un to metodoloģiju visaptverošu apstiprināšanu.

2. Centrālais darījumu partneris vismaz reizi gadā veic savas likviditātes riska pārvaldības sistēmas visaptverošu apstiprināšanu.

3. Centrālais darījumu partneris vismaz reizi gadā veic savu vērtēšanas modeļu pilnīgu apstiprināšanu.

4. Centrālais darījumu partneris vismaz reizi gadā pārskata 51. pantā noteiktās politikas atbilstību.

5. Centrālais darījumu partneris analizē un uzrauga savu modeļu darbības rezultātus un finanšu resursu segumu saistību neizpildes gadījumā, vismaz reizi dienā veicot maržu seguma atpakaļejošās pārbaudes un vismaz reizi dienā veicot stresa testu, kurā izmantoti standartizēti un iepriekš noteikti parametri un pieņēmumi.

6. Centrālais darījumu partneris analizē un uzrauga savu likviditātes riska pārvaldības sistēmu, vismaz reizi dienā veicot stresa testus attiecībā uz saviem likvidajiem finanšu resursiem.

7. Centrālais darījumu partneris vismaz reizi mēnesī veic testēšanas rezultātu detalizētu rūpīgu analīzi, lai nodrošinātu savu stresa testu scenāriju, modeļu un likviditātes riska pārvaldības sistēmas, izmantoto parametru un pieņēmumu pareizību.

Šādu analīzi saspringtos tirgus apstākļos veic biežāk, tostarp, ja finanšu instrumenti, kam tiek veikta tīrvērtē, vai apkalpotie tirgi kļūst ļoti svārstīgi, kļūst mazāk likvidi vai ja būtiski palielinās tā tīrvērtes dalībnieku pozīciju lielums vai koncentrācija, vai ja paredzams, ka centrālajam darījumu partnerim radīsies saspringti tirgus apstākļi.

8. Jūtīguma analīzi veic vismaz reizi mēnesī, izmantojot jutīguma testu rezultātus. Šo analīzi vajadzētu veikt biežāk, ja tirgi ir netipiski svārstīgi vai mazāk likvidi vai ja būtiski palielinās tā tīrvērtes dalībnieku pozīciju lielums vai koncentrācija.

9. Centrālais darījumu partneris vismaz reizi gadā testē kompensēšanu starp finanšu instrumentiem un to, kā mainās korelācijas faktiski konstatētos un hipotētiskos smagos tirgus apstākļos.

10. Centrālā darījumu partnera piemērotos atskaitījumus testē vismaz reizi mēnesī.

11. Centrālais darījumu partneris vismaz reizi ceturksnī veic reversos stresa testus.

12. Centrālais darījumu partneris vismaz reizi ceturksnī testē un pārskata savas saistību neizpildes gadījumā piemērojamās procedūras un vismaz reizi gadā veic situāciju simulācijas saskaņā ar 61. pantu. Centrālais darījumu partneris veic situāciju simulācijas arī pēc jebkādam būtiskām izmaiņām tā saistību neizpildes gadījumā piemērojamajās procedūrās.

9. IEDAĻA

Testu veikšanai izmantotie laiki

60. pants

Laikposmi

1. Laikposmi, ko izmanto stresa testiem, tiek noteikti atbilstīgi VII nodaļai un aptver hipotētiskus ārkārtējus, taču iespējamus tirgus apstākļus.

2. Atpakaļejošām pārbaudēm izmantotie vēsturiskie laikposmi ietver datus vismaz par iepriekšējo gadu vai par laikposmu, kādā centrālais darījumu partneris ir veicis tīrvērti, ja šis laikposms ir īsāks par gadu.

10. IEDAĻA

Informācijas publiskošana

61. pants

Publiskojamā informācija

1. Centrālais darījumu partneris publisko informāciju par vispārīgiem principiem, kas ir tā modeļu un to metodoloģiju pamatā, par veikto testu veidiem, iekļaujot testu rezultātu vispārīgu kopsavilkumu, un par visiem veiktajiem korektīvajiem pasākumiem.

2. Centrālais darījumu partneris dara sabiedrībai pieejamu informāciju par savu saistību neizpildes gadījumā piemērojamo procedūru galvenajiem aspektiem, tostarp:

- a) par apstākļiem, kādos drīkst veikt pasākumus;
- b) par to, kas drīkst veikt šādus pasākumus;
- c) par atļauto pasākumu apmēru, tostarp gan attiecībā uz paša centrālā darījumu partnera, gan klientu pozīcijām, līdzekļiem un aktīviem;
- d) par mehānismiem, kas attiecas uz centrālā darījumu partnera saistībām pret saistības pildījušajiem tīrvērtes dalībniekiem;

- e) par mehānismiem, kas attiecas uz saistības nepildījušā tīrvērtes dalībnieka saistībām pret saviem klientiem.

62. pants

Stāšanās spēkā un piemērošana

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

I pielikuma 2. iedaļas h) punktu attiecībā uz darījumiem ar atvasinātajiem instrumentiem, kā minēts Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 1227/2011 ⁽¹⁾ 2. panta 4. punkta b) un d) apakšpunktā, piemēro, kad ir pagājuši trīs gadi no šīs regulas stāšanās spēkā.

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

Briselē, 2012. gada 19. decembrī

Komisijas vārdā –
priekšsēdētājs
José Manuel BARROSO

⁽¹⁾ OV L 326, 8.12.2011., 1. lpp.

I PIELIKUMS

Finanšu instrumentiem, bankas garantijām un zeltam, ko uzskata par ļoti likvīdu nodrošinājumu, piemērojamie nosacījumi

1. IEDAĻA

Finanšu instrumenti

Piemērojot Regulas (ES) Nr. 648/2012 46. panta 1. punktu, ļoti likvīds nodrošinājums finanšu instrumentu veidā ir finanšu instrumenti, kas atbilst šīs regulas II pielikuma 1. punktā paredzētajiem nosacījumiem, vai pārvedami vērtspapīri un naudas tirgus instrumenti, kas atbilst visiem turpmāk minētajiem nosacījumiem:

- a) centrālais darījumu partneris var pierādīt kompetentajai iestādei, ka finanšu instrumentus ir emitējis emitents, kam ir zems kredītrisks, pamatojoties uz centrālā darījumu partnera veiktu atbilstīgu iekšēju novērtējumu. Veicot šādu novērtējumu, centrālais darījumu partneris izmanto definētu un objektīvu metodoloģiju, kas pilnībā nepaļaujas uz ārējiem atzinumiem un kurā ņemts vērā risks, kas saistīts ar emitenta galvenās uzņēmējdarbības vietas atrašanos konkrētā valstī;
- b) centrālais darījumu partneris var pierādīt kompetentajai iestādei, ka finanšu instrumentiem ir zems tirgus risks, pamatojoties uz centrālā darījumu partnera veiktu atbilstīgu iekšēju novērtējumu. Veicot šādu novērtējumu, centrālais darījumu partneris izmanto definētu un objektīvu metodoloģiju, kas pilnībā nepaļaujas uz ārējiem atzinumiem;
- c) tie ir denominēti vienā no šīm valūtām:
 - i) valūtā, par kuru centrālais darījumu partneris var pierādīt kompetentajām iestādēm, ka tas spēj pārvaldīt tās risku;
 - ii) valūtā, kurā centrālais darījumu partneris veic līgumu tīrvērti, –nodrošinājuma robežās, kurš ir vajadzīgs, lai segtu centrālā darījumu partnera riska darījumus šajā valūtā;
- d) tie ir brīvi pārvedami, un uz tiem neattiecas nekādi regulatīvi vai juridiski ierobežojumi vai trešo personu prasījumi, kas kavē likvidācijas veikšanu;
- e) tiem ir aktīvs tiešo pārdošanas vai atpirkuma līgumu tirgus, daudzveidīga pircēju un pārdevēju grupa, kuriem centrālajam darījumu partnerim (arī saspringtos apstākļos) ir uzticama piekļuve, ko tas var pierādīt;
- f) tiem ir uzticami cenu dati, kas tiek regulāri publicēti;
- g) tos nav emitējušas šādas struktūras:
 - i) tīrvērtes dalībnieks, kas sniedz nodrošinājumu, vai struktūra, kas pieder tai pašai grupai kā tīrvērtes dalībnieks, – izņemot segtās obligācijas un tikai tad, ja aktīvi, kas nodrošina attiecīgo obligāciju, ir atbilstoši nošķirti stabilā tiesiskajā regulējumā un atbilst šīs iedaļas prasībām;
 - ii) centrālais darījumu partneris vai struktūra, kas pieder tai pašai grupai kā centrālais darījumu partneris;
 - iii) struktūra, kuras uzņēmējdarbībā ietilpst centrālā darījumu partnera darbībai būtiski svarīgi pakalpojumi, ja vien šī struktūra nav kāda EEZ centrālā banka vai centrālā banka, kura emitē kādu valūtu, kurā centrālajam darījumu partnerim ir riska darījumi;
- h) tie nav nekā citādi pakļauti ievērojamam korelācijas riskam.

2. IEDAĻA

Bankas garantijas

1. Lai komercbankas garantiju, uz kuru attiecas ierobežojumi saskaņā ar vienošanos ar kompetento iestādi, varētu pieņemt kā nodrošinājumu atbilstīgi Regulas (ES) Nr. 648/2012 46. panta 1. punktam, tai jāatbilst šādiem nosacījumiem:

- a) tā ir izsniegta kā garantija kādam nefinanšu tīrvērtes dalībniekam;
- b) to ir izsniedzis emitents, par kuru centrālais darījumu partneris var pierādīt kompetentajai iestādei, ka tam ir zems kredītrisks, pamatojoties uz centrālā darījumu partnera veiktu iekšēju novērtējumu. Veicot šādu novērtējumu, centrālais darījumu partneris izmanto definētu un objektīvu metodoloģiju, kas pilnībā nepaļaujas uz ārējiem atzinumiem un kurā ņemts vērā risks, kas saistīts ar emitenta galvenās uzņēmējdarbības vietas atrašanos konkrētā valstī;

- c) tā ir denominēta vienā no šīm valūtām:
- i) valūtā, par kuru centrālais darījumu partneris var pierādīt kompetentajām iestādēm, ka tas spēj adekvāti pārvaldīt tās risku;
 - ii) valūtā, kurā centrālais darījumu partneris veic līgumu tīrvērti, –nodrošinājuma robežās, kurš ir vajadzīgs, lai segtu centrālā darījumu partnera riska darījumus šajā valūtā;
- d) tā ir neatsaucama un beznosacījumu, un emitents nevar atsaukties ne uz kādiem tiesību aktos vai līgumos paredzētiem izņēmumiem vai aizsardzību, lai iebilstu pret garantijas izmaksāšanu;
- e) pēc pieprasījuma to var nomaksāt saistības nepildījušā tīrvērtes dalībnieka finanšu instrumentu portfeļa likvidācijas laikā bez jebkādiem regulatīviem, juridiskiem vai operatīviem ierobežojumiem;
- f) to nav izsniegusi:
- i) struktūra, kas pieder tai pašai grupai kā nefinanšu tīrvērtes dalībnieks, uz kuru attiecas garantija;
 - ii) struktūra, kuras uzņēmējdarbībā ietilpst centrālā darījumu partnera darbībai būtiski svarīgi pakalpojumi, ja vien šī struktūra nav kāda EEZ centrālā banka vai centrālā banka, kura emitē kādu valūtu, kurā centrālajam darījumu partnerim ir riska darījumi;
- g) tā nav nekā citādi pakļauta ievērojamam korelācijas riskam;
- h) tā ir pienācīgi pamatots nodrošinājums, kas atbilst šādiem nosacījumiem:
- i) tas nav pakļauts korelācijas riskam, pamatojoties uz korelāciju ar galvotāja vai nefinanšu tīrvērtes dalībnieka kredītspēju, ja vien šis korelācijas risks nav ticis adekvāti samazināts ar atskaitījumiem no nodrošinājuma;
 - ii) centrālajam darījumu partnerim ir tūlītēja piekļuve tam, un tam ir noteikts bankrota attālinājums tīrvērtes dalībnieka un galvotāja vienlaicīgas saistību nepildīšanas gadījumā;
- i) galvotāja piemērotību ir apstiprinājusi centrālā darījumu partnera valde pēc pilnīga novērtējuma par emitentu un par galvotāja tiesisko regulējumu, līgumattiecībām un darbības regulējumu, lai panāktu augsta līmeņa pārliecību par garantijas efektivitāti, un par to ir paziņots kompetentajai iestādei.
2. Lai centrālās bankas izsniegta bankas garantija tiktu atzīta kā nodrošinājums saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 46. panta 1. punktu, tai jāatbilst šādiem nosacījumiem:
- a) to ir izsniegusi kāda EEZ centrālā banka vai centrālā banka, kura emitē kādu valūtu, kurā centrālajam darījumu partnerim ir riska darījumi;
- b) tā ir denominēta vienā no šīm valūtām:
- i) valūtā, par kuru centrālais darījumu partneris var pierādīt kompetentajām iestādēm, ka tas spēj adekvāti pārvaldīt tās risku;
 - ii) valūtā, kurā centrālais darījumu partneris veic tīrvērtes darījumus, – nodrošinājuma robežās, kurš ir vajadzīgs, lai segtu centrālā darījumu partnera pakļautību riskam šajā valūtā;
- c) tā ir neatsaucama un beznosacījumu, un centrālā bankā, kas to izsniegusi, nevar atsaukties ne uz kādiem tiesību aktos vai līgumos paredzētiem izņēmumiem vai aizsardzību, lai iebilstu pret garantijas izmaksu;
- d) to var nomaksāt saistības nepildījušā tīrvērtes dalībnieka finanšu instrumentu portfeļa likvidācijas laikā, un uz to neattiecas nekādi regulatīvi, juridiski vai operatīvi ierobežojumi vai trešo pušu prasījumi.

3. IEDAĻA

Zelts

Zelts, kas var tikt atzīts kā nodrošinājums saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 46. panta 1. punktu, ir tīra zelta atzīta labas piegādes standarta stieņos un atbilst šādiem nosacījumiem:

- a) tas ir tiešā centrālā darījumu partnera turējumā;

- b) tas ir deponēts kādā EEZ centrālajā bankā vai centrālajā bankā, kas emitē valūtu, kurā centrālajam darījumu partnerim ir riska darījumi, kura veic atbilstošus pasākumus, lai aizsargātu tīrvērtes dalībnieku vai klientu īpašumtiesības uz zeltu, un nepieciešamības gadījumā nodrošina centrālajam darījumu partnerim tūlītēju piekļuvi zeltam;
- c) tas ir deponēts atļauju saņēmušā kredītiestādē, kā definēts Direktīvā 2006/48/EK, kura veic atbilstošus pasākumus, lai aizsargātu tīrvērtes dalībnieku vai klientu īpašumtiesības uz zeltu, un nepieciešamības gadījumā nodrošina centrālajam darījumu partnerim tūlītēju piekļuvi zeltam un par kuru centrālais darījumu partneris var pierādīt kompetentajai iestādei, ka tai ir zems kredītrisks, pamatojoties uz centrālā darījumu partnera veiktu iekšēju novērtējumu. Veicot šādu novērtējumu, centrālais darījumu partneris izmanto definētu un objektīvu metodoloģiju, kas pilnībā nepaļaujas uz ārējiem atzinumiem un kurā ņemts vērā risks, kas saistīts ar emitenta galvenās uzņēmējdarbības vietas atrašanos konkrētā valstī;
- d) tas ir deponēts trešās valsts kredītiestādē, uz kuru attiecas un kura ievēro prudenciālas uzraudzības noteikumus, ko kompetentās iestādes uzskata par vismaz tikpat stingriem kā noteikumus, kas paredzēti Direktīvā 2006/48/EK, kurai ir stabila grāmatvedības prakse, kontu turēšanas procedūras un iekšējā kontrole, kura veic atbilstošus pasākumus, lai aizsargātu tīrvērtes dalībnieku vai klientu īpašumtiesības uz zeltu, un nepieciešamības gadījumā nodrošina centrālajam darījumu partnerim tūlītēju piekļuvi zeltam un par kuru centrālais darījumu partneris var pierādīt kompetentajai iestādei, ka tai ir zems kredītrisks, pamatojoties uz centrālā darījumu partnera veiktu iekšēju novērtējumu. Veicot šādu novērtējumu, centrālais darījumu partneris izmanto definētu un objektīvu metodoloģiju, kas pilnībā nepaļaujas uz ārējiem atzinumiem un kurā ņemts vērā risks, kas izriet no emitenta galvenās uzņēmējdarbības vietas atrašanās konkrētā valstī.
-

II PIELIKUMS

Ļoti likvidiem finanšu instrumentiem piemērojamie nosacījumi

1. Piemērojot Regulas (ES) Nr. 648/2012 47. panta 1. punktu, finanšu instrumentus var uzskatīt par finanšu instrumentiem ar augstu likviditātes pakāpi, minimālu kredītrisku un tirgus risku, ja tie atbilst visiem turpmāk minētajiem nosacījumiem:

- a) tos emitējusi vai nepārprotami garantējusi:
 - i) valdība;
 - ii) kāda centrālā banka;
 - iii) daudzpusēja attīstības banka, kā norādīts Direktīvas 2006/48/EK VI pielikuma 1. daļas 4.2. iedaļā;
 - iv) Eiropas finanšu stabilitātes instruments vai attiecīgā gadījumā Eiropas stabilitātes mehānisms;
- b) centrālais darījumu partneris var pierādīt, ka tiem ir zems kredītrisks un tirgus risks, pamatojoties uz centrālā darījumu partnera veiktu iekšēju novērtējumu. Veicot šādu novērtējumu, centrālais darījumu partneris izmanto definētu un objektīvu metodoloģiju, kas pilnībā nepaļaujas uz ārējiem atzinumiem un kurā ņemts vērā risks, kas saistīts ar emitenta galvenās uzņēmējdarbības vietas atrašanos konkrētā valstī;
- c) centrālā darījumu partnera portfeļa finanšu instrumentu atlikušais vidējais laiks līdz termiņam nepārsniedz divus gadus;
- d) tie ir denominēti vienā no šīm valūtām:
 - i) valūtā, par kuru centrālais darījumu partneris var pierādīt, ka tas spēj pārvaldīt tās riskus; vai
 - ii) valūtā, kurā centrālais darījumu partneris veic darījumu tīrvērti, – attiecīgajā valūtā saņemtā nodrošinājumu robežās;
- e) tie ir brīvi pārvedami, un uz tiem neattiecas nekādi regulatīvi ierobežojumi vai trešo personu prasījumi, kas kavē likvidācijas veikšanu;
- f) tiem ir aktīvs tiešo pārdošanas vai atpirkuma līgumu tirgus ar daudzveidīgu pircēju un pārdevēju grupu, kuriem centrālajam darījumu partnerim (arī saspringtos apstākļos) ir uzticama piekļuve;
- g) par šiem instrumentiem tiek regulāri publicēti uzticami cenu dati.

2. Piemērojot Regulas (ES) Nr. 648/2012 47. panta 1. punktu, arī atvasināto instrumentu līgumus var uzskatīt par finanšu ieguldījumiem ar augstu likviditātes pakāpi, minimālu kredītrisku un tirgus risku, ja tie ir noslēgti šādos nolūkos:

- a) ierobežot saistības nepildījušā tīrvērtes dalībnieka portfeļa riskus centrālā darījumu partnera saistību neizpildes pārvaldības procedūras ietvaros; vai
- b) ierobežot valūtas risku, kas izriet no tā likviditātes pārvaldības sistēmas, kura izstrādāta saskaņā ar VIII nodaļu.

Ja atvasināto instrumentu līgumus izmanto šādos apstākļos, tad izmanto tikai tādas atvasināto instrumentu līgumus, par kuriem tiek regulāri publicēti uzticami cenu dati, un tikai tādā laikposmā, kas vajadzīgs, lai samazinātu kredītrisku un tirgus risku, kam ir pakļauts centrālais darījumu partneris.

Centrālā darījumu partnera politiku attiecībā uz atvasināto instrumentu līgumu izmantošanu apstiprina valde pēc apspriešanās ar risku komiteju.

Abonementa cenas 2013. gadā (bez PVN, ieskaitot sūtīšanas izdevumus)

ES Oficiālais Vēstnesis, L un C sērija, tikai papīra formātā	22 oficiālajās ES valodās	EUR 1 300 gadā
ES Oficiālais Vēstnesis, L un C sērija, papīra formātā + DVD, ikgadējs	22 oficiālajās ES valodās	EUR 1 420 gadā
ES Oficiālais Vēstnesis, L sērija, tikai papīra formātā	22 oficiālajās ES valodās	EUR 910 gadā
ES Oficiālais Vēstnesis, L un C sērija, DVD, ikmēneša (apkopojošs)	22 oficiālajās ES valodās	EUR 100 gadā
ES Oficiālā Vēstneša pielikums (S sērija) – Publiskā iepirkuma līgumu konkursi, DVD, viens izdevums nedēļā	daudzvalodu: 23 oficiālajās ES valodās	EUR 200 gadā
ES Oficiālais Vēstnesis, C sērija – Konkursi	valodā(-ās) saskaņā ar konkursu(-iem)	EUR 50 gadā

Eiropas Savienības Oficiālā Vēstneša, kas iznāk oficiālajās Eiropas Savienības valodās, abonements ir pieejams 22 valodās. Tajā ir L sērija ("Tiesību akti") un C sērija ("Paziņojumi un informācija").

Katrai valodas versijai nepieciešams atsevišķs abonements.

Saskaņā ar Padomes Regulu (EK) Nr. 920/2005, kas publicēta 2005. gada 18. jūnijā *Oficiālajā Vēstnesī* L 156, Eiropas Savienības iestādes uz zināmu laiku nesaista pienākums visus tiesību aktus sagatavot īru valodā un tos publicēt šajā valodā. Tādēļ *Oficiālā Vēstneša* izdevumus īru valodā var iegādāties atsevišķi.

Oficiālā Vēstneša pielikumu (S sērija – "Publiskā iepirkuma līgumu konkursi") var abonēt 23 oficiālo valodu versijās vienā daudzvalodu DVD formātā.

Eiropas Savienības Oficiālā Vēstneša abonentiem ir tiesības saņemt dažādus *Oficiālā Vēstneša* pielikumus bez papildu samaksas. Abonentus informē par pielikumiem ar *Eiropas Savienības Oficiālajā Vēstnesī* iekļautiem paziņojumiem lasītājiem.

Pārdošana un abonementi

Dažādus maksas periodiskos izdevumus, tādus kā *Eiropas Savienības Oficiālais Vēstnesis*, var abonēt pie mūsu komerciālajiem izplatītājiem. To saraksts ir pieejams šādā tīmekļa vietnē:

http://publications.europa.eu/others/agents/index_lv.htm

EUR-Lex (<http://eur-lex.europa.eu>) piedāvā tiešu bezmaksas piekļuvi Eiropas Savienības tiesību aktiem. Šajā vietnē iespējams iepazīties ar *Eiropas Savienības Oficiālo Vēstnesi*, un tajā ir iekļauti arī līgumi, tiesību akti, tiesu prakse un sagatavošanā esošie tiesību akti.

Lai uzzinātu vairāk par Eiropas Savienību, skatīt: <http://europa.eu>



Eiropas Savienības Publikāciju birojs
2985 Luksemburga
LUKSEMBURGA

LV