



Briselē, 28.11.2016.
COM(2016) 856 final

ANNEX 1

PIELIKUMS

priekšlikumam

EIROPAS PARLAMENTA UN PADOMES REGULAI

**par centrālo darījumu partneru atveseļošanas un noregulējuma režīmu un ar ko groza
Regulas (ES) Nr. 1095/2010, (ES) Nr. 648/2012 un (ES) 2015/2365**

{ SWD(2016) 368 final }

{ SWD(2016) 369 final }

PIELIKUMS

A IEDAĻA

PRASĪBAS ATTIECĪBĀ UZ ATVESEĻOŠANAS PLĀNIEM

1. Atveseļošanas plānā:

- (1) neparedz piekļuvi ārkārtas finansiālajam atbalstam no publiskā sektora līdzekļiem vai tā saņemšanu;
- (2) ņem vērā visu to ieinteresēto personu intereses, kurus, visticamāk, šis plāns skars;
- (3) nodrošina, ka tīrvērtes dalībnieku riska pozīcijas attiecībā uz *CCP* nav neierobežotas.

CCP izstrādā atbilstīgus mehānismus, lai iesaistītu saistītās FTI un ieinteresētās personas, kas uzņemtos zaudējumus, segtu izmaksas vai veiktu iemaksas, lai segtu likviditātes trūkumus gadījumā, ja minētā plāna sagatavošanas procesā tiktu īstenots atveseļošanas plāns.

2. Atveseļošanas plānā ietilpst šāda informācija:

- (1) kopsavilkums par plāna galvenajiem elementiem un kopsavilkums par kopējo atveseļošanas spēju;
- (2) apkopojums par būtiskām izmaiņām, kas skārušas *CCP* kopš pēdējā iesniegtā atveseļošanas plāna;
- (3) saziņas un izziņošanas plāns ar īsu izklāstu par to, kā *CCP* plāno tikt galā ar potenciāli negatīvām tirgus reakcijām;
- (4) vairākas kapitāla, zaudējumu sadales un likviditātes darbības, kas nepieciešamas, lai saglabātu vai atjaunotu *CCP* dzīvotspēju un finansiālo stāvokli, tostarp lai atjaunotu tā savietoto portfeli un papildinātu priekšfinansēto finanšu līdzekļu apjomu, kas ir nepieciešami, lai *CCP* saglabātu tā dzīvotspēju tā, ka tas var turpināt savu darbību, un lai turpinātu sniegt tā kritiski svarīgās funkcijas saskaņā ar Komisijas Deleģētās regulas (ES) Nr. 152/2013 1. panta 2. punktu un Komisijas Deleģētās regulas (ES) Nr. 153/2013 32. panta 2. punktu un 33. panta 2. punktu;
- (5) atbilstoši nosacījumi un procedūras, lai nodrošinātu atveseļošanas darbību savlaicīgu īstenošanu, kā arī plašu iespējamo atveseļošanas variantu klāstu, tostarp visu būtisko plāna aspektu izpildes paredzamo termiņu;
- (6) sīks apraksts par būtiskiem šķēršļiem plāna efektīvai un savlaicīgai izpildei, tostarp apsverot ietekmi uz tīrvērtes dalībniekiem un klientiem, tai skaitā gadījumos, kad tīrvērtes dalībnieki, visticamāk, veiks pasākumus saskaņā ar to atveseļošanas plāniem, kā minēts Direktīvas 2014/59/ES 5. un 7. pantā, un vajadzības gadījumā uz pārējo grupu;
- (7) kritiski svarīgo funkciju identifikācija;
- (8) detalizēts apraksts par vērtības un tirgspējas noteikšanas procedūrām attiecībā uz *CCP* galvenajiem darījumdarbības virzieniem, darbībām un aktīviem;
- (9) detalizēts apraksts par to, kā atveseļošanas plānošana ir integrēta *CCP* korporatīvās pārvaldības struktūrā un kā tā ir ietverta *CCP* darbības noteikumos, kuriem tīrvērtes dalībnieki ir piekrituši, kā arī politika un

procedūras, kas reglamentē atvēršanas plāna apstiprināšanu, un to organizācijas personu identificēšana, kuras atbild par plāna sagatavošanu un ieviešanu;

- (10) mehānismi un pasākumi, kas mudina saistības pildošos tīrvērtes dalībniekus konkurētspējīgi piedalīties saistības nepildošo dalībnieku pozīciju izsolēs;
- (11) sagatavošanas darbi un pasākumi, kas nodrošina *CCP* atbilstošu piekļuvi ārkārtas gadījumiem paredzēto līdzekļu avotiem, tostarp potenciālajiem likviditātes avotiem, pieejamā nodrošinājuma novērtējums un novērtējums par līdzekļu vai likviditātes pārvešanas iespējām starp darījumdarbības virzieniem, lai nodrošinātu, ka *CCP* var turpināt tā darbības un pildīt tā saistības paredzētajā termiņā;
- (12) mehānismi un pasākumi:
 - (a) riska mazināšanai;
 - (b) līgumu, tiesību, aktīvu un saistību pārstrukturēšanai;
 - (c) darījumdarbības virzienu pārstrukturēšanai;
 - (d) kas nepieciešami, lai saglabātu nepārtrauktu piekļuvi finanšu tirgu infrastruktūrām;
 - (e) kas nepieciešami, lai saglabātu *CCP* darbības procesu, tostarp infrastruktūras un IT pakalpojumu, nepārtrauktu funkcionēšanu;
 - (f) sagatavošanas darbi, kas sekmē aktīvu vai darījumdarbības virzienu pārdošanu finanšu stabilitātes atjaunošanai piemērotā termiņā;
 - (g) citas vadības darbības vai stratēģijas, lai atjaunotu finanšu stabilitāti, un šādu darbību vai stratēģiju paredzamā finansiālā ietekme;
 - (h) *CCP* veiktie vai plānotie sagatavošanas pasākumi, kas sekmē atvēršanas plāna īstenošanu, tostarp *CCP* savlaicīgai rekapitalizācijai nepieciešamie pasākumi, atjaunojot tā savietoto portfeli un papildinot priekšfinansēto finanšu līdzekļu apjomu, kā arī tā izpildāmību pārrobežu mērogā;
 - (i) rādītāju sistēma, kurā nosaka brīžus, kuros var būt veicamas plānā minētās atbilstīgās darbības;
 - (j) attiecīgā gadījumā analīze par to, kā un kad *CCP* plānā aprakstītajos apstākļos var pieteikties centrālās bankas mehānismu izmantošanai, un identificē tos aktīvus, attiecībā uz kuriem tiek sagaidīts, kā tie saskaņā ar centrālās bankas mehānisma noteikumiem tiks kvalificēti kā nodrošinājums;
 - (k) ņemot vērā Regulas (ES) Nr. 648/2012 49. panta 1. punkta noteikumus, dažādi ārkārtēji spriedzes scenāriji, kas saistīti ar *CCP* konkrētajiem apstākļiem, tostarp sistēmas mēroga notikumi un spriedze, kas ir specifiska juridiskajai personai un grupai, pie kuras tā pieder, un spriedze, kura ir specifiska atsevišķiem *CCP* tīrvērtes dalībniekiem vai attiecīgā gadījumā – saistītai FTI;
 - (l) ņemot vērā Regulas (ES) Nr. 648/2012 34. panta un 49. panta 1. punkta noteikumus, scenāriji, kurus izraisa gan viena vai vairāku tā dalībnieku spriedze vai saistību neizpilde, gan citi iemesli, tostarp zaudējumi, kas

radušies *CCP* ieguldījumu darbību dēļ vai darbības problēmu rezultātā (tostarp būtisks ārējs *CCP* darbības apdraudējums saistībā ar ārēju traucējumu, satricinājumu vai ar kiberjomu saistītu incidentu).

B IEDAĻA

INFORMĀCIJA, KO NOREGULĒJUMA IESTĀDES VAR PIEPRASĪT, LAI *CCP* SNIEDZ NOREGULĒJUMA PLĀNU SAGATAVOŠANAS UN UZTURĒŠANAS VAJADZĪBĀM

Lai sagatavotu un uzturētu noregulējuma plānus, noregulējuma iestādes var pieprasīt, lai iestādes sniedz vismaz šādu informāciju:

- (1) *CCP* organizatoriskās struktūras detalizēts apraksts, kā arī visu juridisko personu saraksts;
- (2) tiešo īpašnieku un katras juridiskās personas balsstiesību un tiesību bez balsu procentuālā daudzuma identifikācija;
- (3) par katru juridisko personu – atrašanās vieta, korporācijas jurisdikcija, licencēšana un galvenā vadība;
- (4) *CCP* kritiski svarīgo darbību un galveno darījumdarbības virzienu pārskats, tostarp šādu darbību un darījumdarbības virzienu bilances detalizēta informācija attiecībā uz katru juridisko personu;
- (5) detalizēts apraksts par *CCP* un visu tā juridisko personu darījumdarbību elementiem, kas ir vismaz sadalīti pēc pakalpojumu veida un pēc apjoma, kādā ir veikta tīrvērte, atvērto pozīciju, sākotnējās maržas, mainīgās maržas plūsmu un fondu saistības neizpildes gadījumiem apjoma un jebkādam saistītām novērtējuma tiesībām vai citām atvēršanas darbībām, kas attiecas uz šādām darbības jomām;
- (6) sīka informācija par *CCP* un tā juridisko personu emitētajiem kapitāla un parāda instrumentiem;
- (7) to personu identifikācija, no kurām *CCP* ir saņēmis nodrošinājumu, un kādā veidā tas ir noticis (īpašumtiesību nodošana vai nodrošinājuma tiesības), un kurām tas ir iekļājis nodrošinājumu, un kādā veidā tas ir noticis, un kura persona tur nodrošinājumu, un abos gadījumos – tā jurisdikcija, kurā atrodas nodrošinājums;
- (8) *CCP* un tā juridisko personu ārpusbilances riska darījumu apraksts, tostarp attiecināšana uz tā kritiski svarīgajām darbībām un pamatdarbības virzieniem;
- (9) būtiski *CCP* riska ierobežošanas darījumi ar attiecinājumu uz juridiskām personām;
- (10) relatīvo riska darījumu identificēšana un *CCP* tīrvērtes dalībnieku nozīmīgums, kā arī analīze par būtiskāko tīrvērtes dalībnieku grūtību ietekmi uz *CCP*;
- (11) katra sistēma, kurā *CCP* veic ievērojamu skaitu tirdzniecības darījumu vai ievērojamas vērtības tirdzniecības darījumus, tostarp pārskats attiecībā uz *CCP* juridiskajām personām, kritiski svarīgajām darbībām un galvenajiem darījumdarbības virzieniem;
- (12) katra maksājumu, tīrvērtes vai norēķinu sistēma, kurā *CCP* tieši vai netieši ir loceklis, tostarp attiecinājums uz *CCP* juridiskajām personām, kritiski svarīgajām darbībām un galvenajiem darījumdarbības virzieniem;

- (13) detalizēts inventāra apraksts un galveno informācijas sistēmu apraksts, tostarp attiecībā uz riska pārvaldību, uzskaiti un finanšu un regulatīvo pārskatu, ko izmanto *CCP*, tostarp attiecinājums uz *CCP* juridiskajām personām, kritiski svarīgajām darbībām un galvenajiem darījumdarbības virzieniem;
- (14) šā pielikuma (13) punktā identificēto sistēmu īpašnieku, ar tām saistīto pakalpojumu līmeņa līgumu un visas programmatūras un sistēmu vai licenču identifikācija, tostarp attiecinājums uz to juridiskajām personām, kritiski svarīgajām darbībām un galvenajiem darījumdarbības virzieniem;
- (15) juridisko personu un dažādu juridisko personu savstarpējās saistības un savstarpējās saistības identifikācija un pārskats, piemēram:
- kopīgs vai vienots personāls, iekārtas un sistēmas,
 - kapitāla, finansēšanas vai likviditātes mehānismi,
 - esošie vai iespējamie kredītriska darījumi,
 - šķērsgarantiju līgumi, šķērsnodrošinājuma mehānismi, vairāku saistību neizpildes nosacījumi, savstarpēji saistīti savstarpējā ieskaita līgumi,
 - risku pārvešana un kompensējošās tirdzniecības režīmi; pakalpojumu līmeņa līgumi;
- (16) kompetentā un noregulējuma iestāde attiecībā uz katru juridisko personu, ja tā atšķiras no iestādēm, kas izraudzītas saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 22. pantu un šīs regulas 3. pantu;
- (17) valdes loceklis, kas atbild par *CCP* noregulējuma plāna sagatavošanai nepieciešamās informācijas nodrošināšanu, kā arī tā atbildīgā persona (ja atšķiras), kas atbild par dažādām juridiskajām personām, kritiski svarīgajām darbībām un galvenajiem darījumdarbības virzieniem;
- (18) to mehānismu apraksts, ko *CCP* jau ieviesis, lai nodrošinātu, ka noregulējuma gadījumā noregulējuma iestādei ir visa noregulējuma instrumentu un pilnvaru piemērošanai nepieciešamā informācija, kā to noteikusi noregulējuma iestāde;
- (19) visi līgumi, ko *CCP* un to juridiskās personas ir noslēgušas ar trešām personām un kuru izbeigšanu var ierosināt ar iestāžu lēmumu piemērot noregulējuma instrumentu un ar lēmumu par to, vai izbeigšanas sekas var ietekmēt noregulējuma instrumenta piemērošanu;
- (20) apraksts par iespējamiem likviditātes avotiem noregulējuma atbalstam;
- (21) informācija par aktīvu apgrūtinājumiem, likvīdiem aktīviem, ārpusbilances darbībām, riska ierobežošanas stratēģiju un iegrāmatošanas praksi.

C IEDAĻA
JAUTĀJUMI, KAS NOREGULĒJUMA IESTĀDEI JĀIZSKATA,
NOVĒRTĒJOT CCP VAI GRUPAS NOREGULĒJAMĪBU

Novērtējot *CCP* noregulējamību, noregulējuma iestāde ņem vērā šādus elementus:

- (1) to, cik lielā mērā *CCP* spēj izveidot pārskatu par juridisko personu galvenajiem darījumdarbības virzieniem vai kritiski svarīgajām darbībām;
- (2) to, cik lielā mērā juridiskās un korporatīvās struktūras ir pielāgotas galvenajiem darījumdarbības virzieniem un kritiski svarīgajām darbībām;
- (3) to, cik lielā mērā ir ieviesti mehānismi, kas nodrošina nepieciešamo personālu, infrastruktūru, finansējumu, likviditāti un kapitālu galveno darījumdarbības virzienu un kritiski svarīgo darbību atbalstam un uzturēšanai;
- (4) to, cik lielā mērā *CCP* uzturētie pakalpojumu līgumi ir pilnībā izpildāmi *CCP* noregulējuma gadījumā;
- (5) to, cik lielā mērā *CCP* pārvaldes struktūra ir piemērota vadīšanai un atbildības nodrošināšanai ar *CCP* iekšējo politiku attiecībā uz tā pakalpojumu līmeņa līgumiem;
- (6) to, cik lielā mērā *CCP* ir izveidota procedūra, lai kritiski svarīgo funkciju vai galveno darījumdarbības virzienu nodalīšanas gadījumā nodotu trešām personām pakalpojumus, kas tiek sniegti saskaņā ar pakalpojumu līmeņa līgumiem;
- (7) to, cik lielā mērā ir pieņemti ārkārtas rīcības plāni un ieviesti pasākumi, lai nodrošinātu nepārtrauktu piekļuvi maksājumu un norēķinu sistēmām;
- (8) vadības informācijas sistēmu piemērotību, lai nodrošinātu, ka noregulējuma iestādes var iegūt precīzu un pilnīgu informāciju par galvenajiem darījumdarbības virzieniem un kritiski svarīgajām darbībām ar mērķi nodrošināt ātrāku lēmumu pieņemšanu;
- (9) vadības informācijas sistēmu spēju vienmēr sniegt informāciju, kas ir būtiska *CCP* efektīvam noregulējumam, arī strauji mainīgos apstākļos;
- (10) to, cik lielā mērā *CCP* ir pārbaudījis savas vadības informācijas sistēmas noregulējuma iestādes definētajos spriedzes scenārijos;
- (11) to, cik lielā mērā *CCP* var nodrošināt savu vadības informācijas sistēmu nepārtrauktu darbību gan attiecībā uz skarto *CCP*, gan attiecībā uz jauno *CCP* gadījumā, ja kritiski svarīgās darbības un galvenie darījumdarbības virzieni tiek atdalīti no pārējām darbībām un darījumdarbības virzieniem;
- (12) ja *CCP* gūst labumu no grupas iekšējām garantijām vai ir tām pakļauts – to, cik lielā mērā šīs garantijas tiek sniegtas attiecīgajos tirgus apstākļos un cik uzticamas ir riska vadības sistēmas attiecībā uz šīm garantijām;
- (13) ja *CCP* iesaistās kompensējošos darījumos – to, cik lielā mērā šie darījumi tiek veikti attiecīgajos tirgus apstākļos un cik uzticamas ir riska vadības sistēmas, kas attiecas uz šiem darījumiem;
- (14) to, cik lielā mērā grupas iekšējo garantiju vai kompensējošo darījumu izmantošana palielina kaitīgo ietekmi visā grupā;

- (15) to, cik lielā mērā *CCP* juridiskā struktūra kavē noregulējuma instrumentu piemērošanu saistībā ar juridisko personu skaitu, grupas struktūras sarežģītību vai grūtībām pielāgot darījumdarbības virzienus grupas vienībām;
- (16) attiecīgā gadījumā – to, ciktāl *CCP* noregulējums varētu negatīvi ietekmēt citu tā grupas daļu;
- (17) pakalpojumu līmeņa līgumu esamību un pamatīgumu;
- (18) to, vai trešo valstu iestādēm ir noregulējuma instrumenti, kas vajadzīgi, lai atbalstītu Savienības noregulējuma iestāžu noregulējuma darbības, un cik plaša ir saskaņota rīcība starp Savienības un trešo valstu iestādēm;
- (19) iespējas noregulējuma instrumentus izmantot tādā veidā, kas atbilst noregulējuma mērķiem, ņemot vērā pieejamos instrumentus un *CCP* struktūru;
- (20) jebkādas konkrētas prasības, kas vajadzīgas, lai emitētu jaunus īpašumtiesību instrumentus, kā minēts 33. panta 1. punktā;
- (21) noteikumus un līdzekļus, kas varētu apgrūtināt noregulējumu attiecībā uz *CCP*, kuru tīrvērtes dalībnieki vai nodrošinājuma līgumi ir atšķirīgās jurisdikcijās;
- (22) to, cik uzticama ir noregulējuma instrumentu izmantošana tādā veidā, kas atbilst noregulējuma mērķiem, ņemot vērā iespējamo ietekmi uz tīrvērtes dalībniekiem, citiem darījumu partneriem un darbiniekiem un iespējamajām darbībām, kuras var veikt trešo valstu iestādes;
- (23) to, cik lielā mērā *CCP* noregulējuma ietekmi uz finanšu sistēmu un uzticēšanos finanšu tirgum var pienācīgi novērtēt;
- (24) to, cik lielā mērā *CCP* noregulējums varētu ievērojami tieši vai netieši negatīvi ietekmēt finanšu sistēmu, uzticēšanos tirgum vai ekonomiku;
- (25) to, cik lielā mērā kaitīgo ietekmi uz citiem *CCP* vai finanšu tirgiem varētu ierobežot, piemērojot noregulējuma instrumentus un pilnvaras;
- (26) to, cik lielā mērā *CCP* noregulējumam varētu būt nozīmīga ietekme uz maksājumu un norēķinu sistēmu darbību.