II

(Neleģislatīvi akti)

REGULAS

KOMISIJAS DELEĢĒTĀ REGULA (ES) 2023/840

(2022. gada 25. novembris),

ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) 2021/23 papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem, kuros precizē saskaņā ar minētās regulas 9. panta 14. punktu izmantojamo priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummas aprēķināšanas un uzturēšanas metodiku

(Dokuments attiecas uz EEZ)

EIROPAS KOMISIJA,

ņemot vērā Līgumu par Eiropas Savienības darbību,

ņemot vērā Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) 2021/23 (2020. gada 16. decembris) par centrālo darījumu partneru atveseļošanas un noregulējuma režīmu un ar ko groza Regulas (ES) Nr. 1095/2010, (ES) Nr. 648/2012, (ES) Nr. 600/2014, (ES) Nr. 806/2014 un (ES) 2015/2365 un Direktīvas 2002/47/EK, 2004/25/EK, 2007/36/EK, 2014/59/ES un (ES) 2017/1132 ([1]), un jo īpaši tās 9. panta 15. punkta ceturto daļu,

tā kā:

(1) Priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsumma, kas jāizmanto grūtībās nonākušiem *CCP*, būtu jānosaka, ņemot vērā katra *CCP* individuālās iezīmes.

(2) Tāpēc metodikai to priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummas aprēķināšanai, kas *CCP* jāizmanto pēc saistību neizpildes vai ar saistību neizpildi nesaistīta gadījuma, būtu jāļauj nošķirt *CCP* ar sarežģītu riska profilu, kuriem priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummai vajadzētu būt lielākai, un *CCP* ar mazāk sarežģītu riska profilu vai risku konservatīvāku pārvaldību, kuriem priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummai vajadzētu būt mazākai.

(3) Metodikā to priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummas aprēķināšanai, kas centrālajam darījumu partnerim jāizmanto pēc saistību neizpildes vai ar saistību neizpildi nesaistīta gadījuma, būtu jāietver pietiekami skaidri un objektīvi parametri, lai izvairītos no novērtēšanas grūtībām, un būtu jānodrošina konsekventa tās piemērošana visiem *CCP*. Minētajiem parametriem būtu arī jārada iespēja priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummu pielāgot *CCP* struktūrai un iekšējai organizācijai, tā darbību būtībai, tvērumam un sarežģītībai, kā arī tā akcionāru, vadības un tīrvērtes dalībnieku un minēto tīrvērtes dalībnieku klientu stimulu struktūrai. Katram parametram būtu jāpiešķir procentpunktos izteikta vērtība. Visu parametru summai būtu jānodrošina *CCP* uz risku balstītā kapitāla procentuālais līmenis, ko izmanto kā priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummu, kura centrālajiem darījumu partneriem jāizmanto pēc saistību neizpildes vai ar saistību neizpildi nesaistīta gadījuma.

([1]) OV L 22, 22.1.2021., 1. lpp.

(4) Lai ņemtu vērā *CCP* struktūru un iekšējo organizāciju, kā arī tā darbību būtību, tvērumu un sarežģītību, *CCP* būtu jānovērtē to aktīvu klašu būtība un sarežģītība, kam veic tīrvērti, tas, cik daudz un cik sarežģītas ir savstarpējās atkarības ar citām finanšu tirgus infrastruktūrām un finanšu iestādēm, tā iekšējās organizācijas efektivitāte, tā riska pārvaldības sistēmas stabilitāte un to būtisko korektīvo pasākumu skaits, kuri vēl nav veikti pēc *CCP* kompetentās iestādes konstatējumiem.

(5) Lai ņemtu vērā *CCP* akcionāru, vadības un tīrvērtes dalībnieku un minēto tīrvērtes dalībnieku klientu stimulu struktūru, *CCP* būtu jānovērtē riski, kas saistīti ar tā tiešajām vai netiešajām īpašumtiesībām un kapitāla struktūru, *CCP* augstākās vadības atalgojumā iekļautie finansiālie stimuli, kā arī tīrvērtes dalībnieku un klientu iesaistes pakāpe *CCP* riska pārvaldībā.

(6) *CCP* būtu regulāri jāpārskata priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsumma, lai nodrošinātu, ka minētā summa saglabājas pienācīgā līmenī, tajā skaitā pēc būtiskām izmaiņām *CCP* uz risku balstītajās kapitāla prasībās, kas aprēķinātas saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 648/2012 ([2]) 16. panta 2. punktu.

(7) Lai izvairītos no nevajadzīga sloga, nebūtu jāprasa, lai *CCP* veiktu aprēķinu, pamatojoties uz konkrētiem metodikas parametriem, ja tas nolemj brīvprātīgi piemērot priekšfinansēto īpašo pašu resursu maksimālo papildsummu 25 % apmērā.

(8) Svarīgi ir tas, lai saistību neizpildes scenārijā priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsumma tiktu piešķirta taisnīgi. Tāpēc *CCP*, kas ir izveidojuši vairāk nekā vienu saistību neizpildes fondu dažādām to finanšu instrumentu klasēm, kuriem tie veic tīrvērti, būtu jāpiešķir priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsumma katram saistību neizpildes fondam proporcionāli tā lielumam. Ar saistību neizpildi nesaistītā scenārijā zaudējumu segšanai vajadzētu būt pieejamai visai priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummai.

(9) Īpašo pašu resursu papildsummai, kas centrālajiem darījumu partneriem jāizmanto pēc saistību neizpildes vai ar saistību neizpildi nesaistīta gadījuma, būtu jāatspoguļo dažādu parametru relatīvā nozīme, kas atspoguļo *CCP* iekšējo organizāciju, tā darbību būtību, tvērumu un sarežģītību, kā arī tā ieinteresēto personu stimulu struktūru, lai pastiprinātu stimulus pienācīgai riska pārvaldībai. Tāpēc, neskarot minimālo un maksimālo procentuālo līmeni, kas jāpiemēro, lai noteiktu priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummu, procentuālās daļas aprēķināšanai, kas jāpiemēro, lai noteiktu priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummu, vajadzētu būt visu katram parametram piešķirto procentpunktu kumulatīvai summai. Procentuālajam līmenim, kas jāpiemēro katram parametram, vajadzētu būt attiecīgo kvantitatīvo rādītāju summai. *CCP* risku un sarežģītības novērtēšanā visbūtiskākajiem parametriem būtu jāpiešķir kvantitatīvo rādītāju plašs diapazons, savukārt parametriem, kas attiecas uz *CCP* konkrētu riska aspektu, būtu jāpiešķir šaurāks diapazons.

(10) Metodikai īpašo papildu priekšfinansēto pašu resursu uzturēšanai būtu jāļauj ietekmi, ko rada prasība pēc šādiem papildu resursiem, *CCP* mazināt, ļaujot tiem minētos papildu resursus ieguldīt aktīvos, kas nav tie aktīvi, kurus ņem vērā *CCP* ieguldījumu politikā, kas minēta Regulas (ES) Nr. 648/2012 47. panta 1. punktā, ar noteikumu, ka minētie *CCP* īsteno atbilstīgas procedūras atveseļošanas pasākumu piemērošanai, lai mazinātu risku, ka šādi aktīvi nav tūlīt pieejami.

(11) Ir jāmazina papildu priekšfinansēto īpašo pašu resursu ietekme uz *CCP*. Tāpēc *CCP* ieguldījumu iespējas papildu priekšfinansēto īpašo pašu resursu uzturēšanai būtu daļēji jāsaskaņo ar to aktīvu sarakstu, kuri ir atbilstīgi kā nodrošinājums, ko *CCP* pieņem no tīrvērtes dalībniekiem. Minētā pieeja joprojām garantētu, ka *CCP* ir atbilstoša sistēma un procedūras ar šiem aktīviem saistīto risku pārvaldībai un to likvidācijai spriedzes apstākļos. Tomēr dažiem aktīviem, kas ir atbilstīgi kā nodrošinājums, arī turpmāk vajadzētu būt izslēgtiem no atbilstīgo ieguldījumu saraksta, jo tos nevar uzskatīt par pietiekami likvīdiem vai tie pakļautu *CCP* pašu resursus pārmērīgam kredītriskam un tirgus riskam, un tāpēc tos nevar uzskatīt par piemērotiem *CCP* ieguldījumam.

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

(12) Ja to priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsumma, kas ieguldīti aktīvos, kuri nav minēti Regulas (ES) Nr. 648/2012 47. panta 1. punktā, nav tūlīt pieejama, *CCP* pēc saistību neizpildes vai ar saistību neizpildi nesaistīta gadījuma būtu par to jāinformē sava kompetentā iestāde un savi tīrvērtes dalībnieki. Šādā gadījumā *CCP* vajadzētu būt tiesībām segt nepieejamo priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummu, pieprasot finansiālas iemaksas no saviem saistības pildošajiem tīrvērtes dalībniekiem. Šādas iemaksas būtu jāsadala taisnīgi un samērīgi.

(13) *CCP* būtu jāatlīdzina saistības pildošiem tīrvērtes dalībniekiem finansiālā iemaksa, ko šie tīrvērtes dalībnieki veikuši, lai segtu nepieejamo priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummu. Lai ierobežotu *CCP* saistības pildošo tīrvērtes dalībnieku pakļautību riskam un lai nodrošinātu, ka tie spēj izturēt jebkādas turpmākas naudas iemaksas, šāda atlīdzināšana saprātīgā termiņā būtu jāveic naudā un tajā pašā valūtā, kurā finansiālā iemaksa tika veikta. Atlīdzināšana būtu jāveic tikai pēc tam, kad *CCP* ir izpildījuši savus pārējos maksājumu pienākumus. Ja atlīdzināšana netiek veikta saprātīgā termiņā, nolūkā stimulēt pienākošos summu atgūšanu būtu jāprasa *CCP* maksāt gada procentus par šīm summām.

(14) Nolūkā saglabāt Savienības *CCP* starptautisko konkurētspēju Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestāde (EVTI), izstrādājot regulatīvo tehnisko standartu projektu, analizēja trešo valstu *CCP* piemērojamos noteikumus un praksi, kā arī starptautiskās norises *CCP* atveseļošanā un noregulējumā. Pamatojoties uz minēto analīzi, EVTI secināja, ka metodikai, kas ierosināta priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummu aprēķināšanai attiecībā uz Savienības *CCP*, nevajadzētu negatīvi ietekmēt starptautiski aktīvo Savienības *CCP* konkurētspēju.

(15) Šī regula ir balstīta uz regulatīvo tehnisko standartu projektu, ko Komisijai iesniegusi EVTI.

(16) EVTI izstrādāja tehnisko standartu projektu sadarbībā ar Eiropas Banku iestādi un pēc apspriešanās ar Eiropas Centrālo banku sistēmu. Atbilstīgi Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 1095/2010 ([3]) 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 Vērtspapīru un tirgu nozares ieinteresēto personu grupas atzinumu,

IR PIEŅĒMUSI ŠO REGULU.

1. pants

CCP priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummas aprēķināšana un piešķiršana

1. *CCP* aprēķina Regulas (ES) 2021/23 9. panta 14. punktā minēto priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummu, reizinot uz risku balstītās kapitāla prasības, kas aprēķinātas saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 16. panta 2. punktu un Komisijas Deleģēto regulu (ES) Nr. 152/2013 ([4]), ar *CCP* priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummas procentuālo līmeni "P", kas noteikts saskaņā ar 2. pantu.

2. *CCP* pārskata saskaņā ar 1. punktu aprēķināto priekšfinansēto īpašo pašu resursu procentuālā līmeņa un papildsummas noteikšanu pēc jebkādām būtiskām izmaiņām uz risku balstītajās kapitāla prasībās, kas aprēķinātas saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 16. panta 2. punktu, un pārskatīšanu veic vismaz reizi gadā.

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

([4]) 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 (OV L 52, 23.2.2013., 37. lpp.).

3. Šīs regulas 2. pantā minētais procentuālais līmenis nav jānosaka *CCP*, kas nolemj brīvprātīgi piemērot maksimālo 25 % procentuālo līmeni, lai aprēķinātu Regulas (ES) 2021/23 9. panta 14. punktā minēto priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummu.

4. *CCP*, kas ir izveidojuši vairāk nekā vienu saistību neizpildes fondu dažādām to finanšu instrumentu klasēm, kuriem tie veic tīrvērti, piešķir saskaņā ar 1. punktu aprēķināto priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummu katram saistību neizpildes fondam proporcionāli katra saistību neizpildes fonda lielumam. *CCP* norāda piešķīrumu atsevišķi savās bilancēs. *CCP* izmanto papildsummas, kas saistību neizpildes fondam piešķirtas saistību neizpildes gadījumiem tirgus segmentos, uz kuriem attiecas saistību neizpildes fonds. Ar saistību neizpildi nesaistītā gadījumā *CCP* visu priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummu, kas aprēķināta saskaņā ar 1. punktu, piešķir zaudējumiem, kas radušies ar saistību neizpildi nesaistīta gadījuma rezultātā.

2. pants

CCP priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummas procentuālā līmeņa noteikšana

CCP aprēķina 1. panta 1. punktā minēto *CCP* priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummas procentuālo līmeni saskaņā ar pielikumā noteiktajām formulām.

3. pants

CCP priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummas uzturēšana

1. *CCP* nekavējoties rakstiski paziņo savai kompetentajai iestādei, ja priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsumma kļūst mazāka par prasīto papildsummu, kas aprēķināta saskaņā ar 1. panta 1. punktu, un gadījumos, ja minētā papildsumma samazinās vēlāk. Minētajā rakstiskajā paziņojumā sīki izklāsta atlikušo priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummu un informē kompetento iestādi par to, vai piecu darbdienu laikā pēc minētā paziņojuma ir gaidāms turpmāks minētās summas samazinājums. Rakstiskajā paziņojumā arī izklāsta, kāpēc priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsumma ir samazinājusies zem prasītās papildsummas, un ietver visaptverošu aprakstu par pasākumiem un grafiku minētās summas atjaunošanai.

2. *CCP* izmanto tikai priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummas atlikušo summu Regulas (ES) 2021/23 9. panta 14. punkta vajadzībām, ja vēlāk iestājas viena vai vairāku tīrvērtes dalībnieku saistību neizpilde vai ar saistību neizpildi nesaistīts gadījums, pirms attiecīgais *CCP* ir atjaunojis visu savu priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummu, kas aprēķināta saskaņā ar 1. panta 1. punktu.

3. *CCP* atjauno priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummu ne vēlāk kā 20 darbdienu laikā pēc pirmā rakstiskā paziņojuma, kas minēts 1. punktā.

4. Ja saskaņā ar 2. pantu noteiktais procentuālais līmenis pārsniedz 10 %, *CCP* var ieguldīt pieprasīto papildu priekšfinansēto īpašo pašu resursu pārsnieguma summu zeltā un finanšu instrumentos, ko uzskata par augsti likvīdu nodrošinājumu saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 46. panta 1. punktu, ar noteikumu, ka:

a) šādi aktīvi ir iekļauti *CCP* nodrošinājuma politikā;

b) šādi aktīvi nav bankas garantijas, atvasinātie instrumenti vai kapitāla vērtspapīri;

c) attiecīgie *CCP* ir ieviesuši šīs regulas 4. un 5. pantā izklāstītās procedūras.

4. pants

Atveseļošanas pasākumu piemērošanas procedūra, ja papildsumma nav tūlīt pieejama

1. *CCP* nekavējoties informē savu kompetento iestādi un savus tīrvērtes dalībniekus par to, ka pēc saistību neizpildes vai ar saistību neizpildi nesaistīta gadījuma saskaņā ar 1. pantu aprēķināto priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsumma nav tūlīt pieejama. Tie sniedz savai kompetentajai iestādei un saviem tīrvērtes dalībniekiem arī sīku aprakstu par nepieejamo priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummu un šādas nepieejamības iemeslu.

2. Ja pēc saistību neizpildes vai ar saistību neizpildi nesaistīta gadījuma *CCP* iekasē finanšu resursus no saistības pildošiem tīrvērtes dalībniekiem, summa ir vienāda ar nepieejamo priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummu, un attiecīgie *CCP* sadala minēto summu saistības pildošiem tīrvērtes dalībniekiem proporcionāli to iemaksām saistību neizpildes fondā.

5. pants

Kompensācijas procedūra saistības pildošiem tīrvērtes dalībniekiem, kuri ir veikuši finansiālu iemaksu, ja papildsumma nav tūlīt pieejama

1. *CCP* veic visus saprātīgos pasākumus, lai atlīdzinātu saistības pildošiem tīrvērtes dalībniekiem, kuri ir veikuši finansiālu iemaksu *CCP* saskaņā ar 4. panta 2. punktu. To dara, vēlākais 20 darbdienu laikā pēc paziņojuma par līdzekļu nepieejamību, kas minēta 4. panta 1. punktā, monetizējot aktīvus, kuri izmantoti, lai ieguldītu priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummu, kas aprēķināta saskaņā ar 1. panta 1. punktu.

2. Ievērojot 4. punktu, *CCP* atlīdzina saistības pildošajiem tīrvērtes dalībniekiem saprātīgā termiņā un turpina, līdz visas summas ir atgūtas.

3. Visu to summu atlīdzināšanu, kas pienākas saistības pildošiem tīrvērtes dalībniekiem, veic naudā tajā pašā valūtā, kurā saistības pildošais tīrvērtes dalībnieks ir veicis finansiālu iemaksu *CCP*.

4. *CCP* maksā saistības pildošiem tīrvērtes dalībniekiem pienākošās summas pēc tam, kad ir noticis viss turpmāk minētais:

a) ir segtas darbības izmaksas;

b) ir samaksātas visas pienākošās un maksājamās parādsaistības;

c) ir samaksāta visa atlīdzība, kas jāmaksā Komisijas Deleģētās regulas (ES) 2023/450 ([5]) 3. pantā noteiktajā termiņā.

5. *CCP* maksā gada procentus par pienākošām summām, ja pilnīgai atlīdzināšanai paiet vairāk nekā 120 darbdienas no dienas, kad veikts sākotnējais atveseļošanas pasākums, kuram pieprasīta saistības pildošo tīrvērtes dalībnieku finansiālā iemaksa. Procentu likmi nosaka kā kavējuma procentu likmi, ko aprēķina saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES, Euratom) 2018/1046 ([6]) 99. pantu.

([5]) Komisijas Deleģētā regula (ES) 2023/450 (2022. gada 25. novembris), ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) 2021/23 papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem, kuros precizē, kādā secībā *CCP* jāmaksā Regulas (ES) 2021/23 20. panta 1. punktā minētā atlīdzība, kāds ir maksimālais gadu skaits, kuru laikā minētajiem *CCP* jāizmanto daļa no gada peļņas šādiem maksājumiem tādu instrumentu turētājiem, kuros ir atzītas tiesības uz to peļņu nākotnē, un kāda ir minētās peļņas maksimālā daļa, kas jāizmanto minētajiem maksājumiem (OVL 67, 3.3.2023, 5. Lpp.).

([6]) Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES, Euratom) 2018/1046 (2018. gada 18. jūlijs) par finanšu noteikumiem, ko piemēro Savienības vispārējam budžetam, ar kuru groza Regulas (ES) Nr. 1296/2013, (ES) Nr. 1301/2013, (ES) Nr. 1303/2013, (ES) Nr. 1304/2013, (ES) Nr. 1309/2013, (ES) Nr. 1316/2013, (ES) Nr. 223/2014, (ES) Nr. 283/2014 un Lēmumu Nr. 541/2014/ES un atceļ Regulu (ES, Euratom) Nr. 966/2012 (OV L 193, 30.7.2018., 1. lpp.).

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, 2022. gada 25. novembrī

Komisijas vārdā –
priekšsēdētāja
Ursula VON DER LEYEN

PIELIKUMS

1. **Vispārīgie norādījumi**

1. panta 1. punktā minēto *CCP* priekšfinansēto īpašo pašu resursu papildsummas procentuālo līmeni *CCP* aprēķina saskaņā ar šādu formulu:

$$P = \max(10\%; (\min(25\%; \sum_{i=1}^{5} A_i + \sum_{i=1}^{3} B_i)),$$

kur:

"*A*" = parametri A_1 līdz A_5, kurus *CCP* aprēķina saskaņā ar šā pielikuma 2. līdz 6. iedaļu;

"*B*" = parametri B_1 līdz B_3, kurus *CCP* aprēķina saskaņā ar šā pielikuma 7. līdz 9. iedaļu.

Parametri A_1 līdz A_5 atspoguļo *CCP* struktūru, iekšējo organizāciju, kā arī to darbību būtību, tvērumu un sarežģītību, un parametri B_1 līdz B_3 atspoguļo *CCP* akcionāru, vadības un tīrvērtes dalībnieku, tajā skaitā minēto tīrvērtes dalībnieku klientu, stimulu struktūru.

Galīgo procentuālo līmeni (*P*) noapaļo līdz tuvākajam veselajam skaitlim.

2. **To aktīvu klašu būtība un sarežģītība, kurām veic tīrvērti**

Parametrs A_1 norāda to aktīvu klašu būtību un sarežģītību, kurām veic tīrvērti. Parametrs A_1 ir diapazonā no 1 % līdz 7 %. Parametru A_1 aprēķina saskaņā ar šādu formulu:

$$A_1 = I_{assets} + I_{FX} + I_{settl}$$

kur:

I_{assets} atspoguļo dažādu aktīvu klašu skaitu, kurām *CCP* veic tīrvērti. I_{assets}vērtību aprēķina saskaņā ar šādu formulu:

$$I_{assets} = 0,01 \times \min(5, N_{assets}),$$

kur N_{assets} = dažādu aktīvu klašu skaits, kurām *CCP* veic tīrvērti;

I_{FX} atspoguļo valūtu skaitu, kurām *CCP* veic tīrvērti. I_{FX} vērtība ir 1 %, ja *CCP* veic tīrvērti vairāk nekā vienā valūtā izteiktiem aktīviem vai piedāvā norēķinus vairāk nekā vienā valūtā, un 0 % citos gadījumos;

I_{settl} atspoguļo atvasināto instrumentu norēķinu režīmu. I_{settl} vērtība ir 1 %, ja *CCP* piedāvā fiziskus norēķinus par atvasināto instrumentu līgumiem, un 0 % citos gadījumos.

3. ***CCP* attiecības un savstarpējās atkarības ar citām finanšu tirgus infrastruktūrām un citām finanšu iestādēm**

Parametrs A_2 norāda *CCP* attiecības un savstarpējās atkarības ar citām finanšu tirgus infrastruktūrām un citām finanšu iestādēm. Parametrs A_2 ir diapazonā no 0 % līdz 2 %. Parametru A_2 aprēķina saskaņā ar šādu formulu:

$$A_2 = I_{FMI} + I_{CMs}$$

kur:

I_{FMI} atspoguļo savstarpējo atkarību skaitu. I_{FMI} vērtība ir 1 %, ja *CCP* ir vairāk nekā piecas savstarpējas atkarības ar tirdzniecības vietām, maksājumu sistēmām un norēķinu sistēmām, un 0 % citos gadījumos;

I_{CMs} atspoguļo *CCP* tīrvērtes dalībnieku koncentrāciju. I_{CMs} vērtība ir 1 %, ja *CCP* pieci lielākie tīrvērtes dalībnieki veido vairāk nekā 40 % no *CCP* kopējiem priekšfinansētajiem resursiem, kas apkopoti attiecībā uz visiem pakalpojumiem un saistību neizpildes fondiem, un 0 % citos gadījumos. *CCP* nosaka piecu lielāko tīrvērtes dalībnieku resursu daļu, pamatojoties uz gada vidējo rādītāju.

4. ***CCP* iekšējā organizācija**

Parametrs A_3 norāda *CCP* iekšējās organizācijas efektivitāti. A_3 vērtība ir diapazonā no 0 % līdz 5 %. Parametru A_3 aprēķina saskaņā ar šādu formulu:

$$A_3 = I_{RiskCo} + I_{reporting} + I_{Riskstaff}$$

kur:

I_{Riskco} atspoguļo mijiedarbību starp valdi un riska komiteju, kas izveidota saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 28. pantu. I_{RiskCo} vērtība ir 2 %, ja *CCP* valde pēdējo trīs gadu laikā ir pieņēmusi vairāk nekā trīs lēmumus, kuros nav ievērots riska komitejas ieteikums vai ieteiktā nostāja, un 0 % citos gadījumos;

$I_{reporting}$ atspoguļo modeļa validācijas ziņošanas līmeni. $I_{reporting}$ vērtība ir 0 %, ja modeļa validācija nav strukturāli atkarīga no modeļa izstrādes, un 1 % citos gadījumos;

$I_{Riskstaff}$ atspoguļo riska pārvaldības funkcijai piesaistīto darbinieku īpatsvaru. $I_{Riskstaff}$ vērtība ir diapazonā no 0 % līdz 2 %, un to aprēķina saskaņā ar šādu formulu:

$$I_{Riskstaff} = \max\left(0; 0,02\times\left(1 - \left({}^{1}\!\!\diagup\!\!{}_{0,2}\right)\times P_{risk}\right)\right),$$

kur P_{risk} = riska pārvaldības pilnslodzes ekvivalentu īpatsvars kopējos *CCP* pilnslodzes ekvivalentos, tajā skaitā ārpakalpojumā nodotās funkcijas. $I_{Riskstaff}$ vērtība ir 2 %, ja P_{risk} ir vienāda ar 0 %, un 0 %, ja P_{risk} ir vienāda ar 20 %.

5. ***CCP* riska pārvaldības sistēmas noturība**

Parametrs A_4 norāda *CCP* riska pārvaldības stabilitāti. A_4 vērtība ir diapazonā no 0 % līdz 8 %. Parametru A_4 aprēķina saskaņā ar šādu formulu:

$$A_4 = I_{BT} + I_{incident} + I_{payments}$$

kur:

I_{BT} atspoguļo *CCP* maržu pietiekamību, kas novērtēta tā atpakaļejošās pārbaudēs. I_{BT} vērtība ir diapazonā no 0 % līdz 4 %, un to aprēķina saskaņā ar šādu formulu:

$$I_{BT} = 0,04\times P_{BT}\ ,$$

kur P_{BT} = *CCP* tīrvērtes kontu procentuālā daļa, ko aprēķina kā kritērijam atbilstošo tīrvērtes kontu skaitu attiecībā pret *CCP* tīrvērtes kontu kopējo skaitu, attiecībā uz kuriem maržu atpakaļejošo pārbaužu rezultāti par pēdējiem 12 mēnešiem ir zemāki par ETIR minimālo prasību, kā noteikts Komisijas Deleģētās regulas (ES) Nr. 153/2013 ([1]) 24. pantā. I_{BT} vērtība ir 4 %, ja P_{BT} ir 100 %;

$I_{incident}$ atspoguļo *CCP* darbības stabilitāti, pamatojoties uz tirdzniecības incidentu skaitu. $I_{incident}$ vērtība ir diapazonā no 0 % līdz 2 %, un to aprēķina saskaņā ar šādu formulu:

$$I_{incident} = 0,02\times\min\left(1; {}^{N_{days}}\!\!\diagup\!\!{}_{10}\right),$$

kur N_{days} = dienu skaits, kurās *CCP* pēdējo 12 mēnešu laikā nav spējis apstrādāt jaunus darījumus divas stundas vai ilgāk. $I_{incident}$ vērtība ir 2 %, ja N_{days} = 10 dienas;

([1]) 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 (OV L 052, 23.2.2013., 41. lpp.).

$I_{payments}$ atspoguļo *CCP* darbības stabilitāti, pamatojoties uz maksājumu incidentu skaitu. $I_{payments}$ vērtība ir diapazonā no 0 % līdz 2 %, un to aprēķina saskaņā ar šādu formulu:

$$I_{payments} = 0,02 \times \min\left(1; {}^{N_{days}}\!/_{10}\right),$$

kur N_{days} = dienu skaits, kurās *CCP* pēdējo 12 mēnešu laikā nav spējis apstrādāt vai saņemt maksājumus divas stundas vai ilgāk. $I_{payments}$ vērtība ir 2 %, ja N_{days} = 10 dienas.

6. **Vēl neveikti korektīvie pasākumi pēc *CCP* kompetentās iestādes konstatējumiem**

A_5 parametrs norāda vēl neveiktu būtisku korektīvo pasākumu skaitu pēc *CCP* kompetentās iestādes konstatējumiem. A_5 vērtība ir diapazonā no 0 % līdz 2 %. A_5 vērtību aprēķina saskaņā ar šādu formulu:

$$A_5 = I_{reco}$$

kur:

I_{reco} atspoguļo vēl neveiktos pasākumus prudenciālajos jautājumos. I_{reco} vērtība ir 2 %, ja *CCP* pēc kompetentās iestādes konstatējumiem, attiecībā uz kuriem *CCP* ir pārsniedzis termiņu, ko kompetentā iestāde noteikusi korektīvajā plānā, ir vismaz viens vēl neveikts būtisks korektīvais pasākums, un 0 % citos gadījumos;

Šajā formulā korektīvu pasākumu uzskata par būtisku, ja *CCP* vai attiecīgā kompetentā iestāde ir piešķīrusi šim korektīvajam pasākumam augstāko prioritāti, pamatojoties vai nu uz *CCP* iekšējo būtiskuma matricu, vai uz pašas kompetentās iestādes klasifikāciju.

7. ***CCP* īpašumtiesības, kapitāla struktūra un rentabilitāte**

Parametrs B_1 norāda *CCP* īpašumtiesības un kapitāla struktūru. B_1 vērtība ir diapazonā no 0 % līdz 4 %. B_1 vērtību aprēķina saskaņā ar šādu formulu:

$$B_1 = I_{majority} + I_{support}$$

kur:

$I_{majority}$ atspoguļo *CCP* mātesuzņēmuma būtību. $I_{majority}$ vērtība ir 2 %, ja centrālajam darījumu partnerim ir mātesuzņēmums, kas nav publiski piederošas grupas, bez reitinga vai ar reitingu zem ieguldījumu kategorijas, un 0 % citādos gadījumos. Reitings ir atļauju saņēmušas kredītreitingu aģentūras sniegtais vienības sliktākais reitings;

$I_{support}$ atspoguļo atbalstu, ko sniedz *CCP* mātesuzņēmums. $I_{support}$ vērtība ir 0 %, ja *CCP* saņem līgumā noteiktu būtisku finansiālu atbalstu no tā mātesuzņēmuma saistību neizpildes vai ar saistību neizpildi nesaistītā gadījumā, ieskaitot piešķirtās kredītlīnijas vai apdrošināšanas līgumus, un 2 % citos gadījumos.

8. **Augstākās vadības atalgojums**

Parametrs B_2 norāda apmēru, kādā augstākās vadības atalgojumu līgumiski var ietekmēt pēc saistību neizpildes vai ar saistību neizpildi nesaistīta gadījuma. B_2 vērtība ir diapazonā no 0 % līdz 2 %. B_2 vērtību aprēķina saskaņā ar šādu formulu:

$$B_2 = I_{\%amount} + I_{\%staff}$$

kur:

$I_{\%amount}$ atspoguļo augstākās vadības kopējā mainīgā atalgojuma daļu, uz ko attiecas atgūšanas klauzulas. $I_{\%amount}$ vērtība ir diapazonā no 0 % līdz 1 %, un to aprēķina saskaņā ar šādu formulu:

$$I_{\%amount} = \max\left(0; 0,01 \times (1 - 2P_{amount})\right),$$

kur P_{amount} = *CCP* augstākās vadības kopējā mainīgā gada atalgojuma procentuālā daļa, uz ko attiecas atgūšanas klauzulas saistību neizpildes vai ar saistību neizpildi nesaistītā gadījumā. $I_{\%amount}$ vērtība ir 1 %, ja P_{amount} ir 0 %;

$I_{\%staff}$ atspoguļo to augstākās vadības darbinieku procentuālo daļu, uz ko attiecas atgūšanas klauzulas saistību neizpildes vai ar saistību neizpildi nesaistītu zaudējumu gadījumā. $I_{\%staff}$ vērtība ir diapazonā no 0 % līdz 1 %, un to aprēķina saskaņā ar šādu formulu:

$$I_{\%staff} = \max\left(0; 0,01 \times \left((1 - P_{\%staff})\right)\right),$$

kur $P_{\%staff}$ = *CCP* augstākās vadības procentuālā daļa, kas izteikta procentos no gada vidējā augstākās vadības pilnslodzes ekvivalenta, uz kuru attiecas mainīgā atalgojuma atgūšanas klauzula.

9. **Tīrvērtes dalībnieku un klientu iesaiste *CCP* riska pārvaldībā**

Parametrs B_3 norāda tīrvērtes dalībnieku un klientu iesaisti *CCP* riska pārvaldībā. B_3 vērtība ir diapazonā no 0 % līdz 2 %. B_3 vērtību aprēķina saskaņā ar šādu formulu:

$$B_3 = I_{investment} + I_{incentives}$$

kur:

$I_{investment}$ atspoguļo tīrvērtes dalībnieku un klientu iesaisti ieguldījumu lēmumu pieņemšanas procesā. $I_{investment}$ vērtība ir 0 %, ja tīrvērtes dalībnieki ir iesaistīti ieguldījumu lēmumu pieņemšanā un uzņemas daļu no iespējamiem zaudējumiem, un 1 % citos gadījumos. Lai noteiktu $I_{investment}$ rādītāja vērtību, *CCP* uzskata, ka tīrvērtes dalībnieki ir iesaistīti ieguldījumu lēmumu pieņemšanā, ja ar tiem apspriežas vai nu *CCP* ieguldījumu politikas apstiprināšanas procesā, vai par katru atsevišķu ieguldījuma lēmumu;

$I_{incentives}$ atspoguļo tīrvērtes dalībnieku stimulus saistību neizpildes pārvaldības procesā. $I_{incentives}$ vērtība ir 0 %, ja tīrvērtes dalībniekiem ir stimuli piedalīties saistību neizpildes pārvaldības procesā, un 1 % citos gadījumos.