KOMISIJOS DELEGUOTASIS REGLAMENTAS (ES) 2021/1351

2021 m. gegužės 6 d.

kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) 2016/1011 papildomas techniniais reguliavimo standartais, kuriais patikslinami sistemų ir kontrolės priemonių, kuriomis nustatomas bet koks elgesys, kuris gali būti susijęs su manipuliavimu lyginamuoju indeksu ar bandymu juo manipuliuoti, ir apie jį pranešama, ypatumai

(Tekstas svarbus EEE)

EUROPOS KOMISIJA,

atsižvelgdama į Sutartį dėl Europos Sąjungos veikimo,

atsižvelgdama į 2016 m. birželio 8 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (ES) 2016/1011 dėl indeksų, kurie kaip lyginamieji indeksai naudojami finansinėse priemonėse ir finansinėse sutartyse arba siekiant įvertinti investicinių fondų veiklos rezultatus, kuriuo iš dalies keičiami direktyvos 2008/48/EB ir 2014/17/ES bei Reglamentas (ES) Nr. 596/2014 ([1]), ypač į jo 14 straipsnio 4 dalį,

kadangi:

(1) turėtų būti užtikrinta, kad manipuliavimo lyginamaisiais indeksais arba bandymo jais manipuliuoti aptikimas būtų veiksmingas ir tinkamas. Todėl būtina, kad lyginamųjų indeksų administratoriaus sistemos ir kontrolės priemonės būtų proporcingos teikiamo lyginamojo indekso pobūdžiui, sudėtingumui ir manipuliavimo juo rizikai ir kad manipuliavimo rizika būtų vertinama remiantis objektyviu vertinimu, kurį atliekant atsižvelgiama į tokios rizikos kilmę, pobūdį, specifiškumą ir dydį;

(2) siekiant užtikrinti, kad bet kokio elgesio, kuris gali būti susijęs su manipuliavimu lyginamuoju indeksu arba bandymu juo manipuliuoti, aptikimas būtų veiksmingas, būtina numatyti tinkamas automatines pradinių duomenų stebėjimo sistemas. Tačiau vien tik automatinių sistemų nepakanka siekiant veiksmingai aptikti manipuliavimo veiksmus. Todėl automatines sistemas turėtų papildyti žmogaus atliekama tinkamo lygio analizė, kurią turi atlikti tinkamai parengti darbuotojai;

(3) siekiant užtikrinti, kad kompetentingos institucijos galėtų veiksmingai įvertinti priemones, kurių imamasi netinkamam elgesiui nustatyti ir apie jį pranešti, administratoriai kompetentingos institucijos prašymu turėtų jai pateikti informaciją apie atitinkamo lyginamojo indekso pobūdį, sudėtingumą ir manipuliavimo juo riziką ir pagrįsti pasirinkto automatizavimo ir žmogaus atliekamos analizės lygio tinkamumą;

(4) lyginamųjų indeksų administratoriaus darbuotojams, atsakingiems už administratoriaus sistemų ir kontrolės priemonių valdymą, turėtų būti rengiami tinkami mokymai, kad jie gebėtų analizuoti, ar konkretūs pradiniai duomenys yra įtartini, ar ne. Per tokius mokymus turėtų būti užtikrinama, kad tie darbuotojai žinotų tinkamo pradinių duomenų pateikimo ypatybes ir pradinių duomenų neatitikimus, kuriuos gali lemti manipuliavimas arba bandymas manipuliuoti. Veiksmingi mokymai turėtų būti pritaikyti prie teikiamo lyginamojo indekso pobūdžio, sudėtingumo ir manipuliavimo juo rizikos;

(5) administratoriai gali nuspręsti perduoti tretiesiems asmenims su sistemomis ir kontrolės priemonėmis susijusias užduotis. Užduotis tretiesiems asmenims perduoti turėtų būti galima tik tais atvejais, kai dėl jų perdavimo iš esmės nepablogėtų administratoriaus taikoma lyginamojo indekso teikimo kontrolė arba atitinkamos kompetentingos institucijos gebėjimas vykdyti lyginamojo indekso priežiūrą, be to, tokiam perdavimui visais atvejais būtų taikomi Reglamento (ES) 2016/1011 10 straipsnio reikalavimai;

(6) šis reglamentas grindžiamas Europos vertybinių popierių ir rinkų institucijos (ESMA) Komisijai pateiktais techninių reguliavimo standartų projektais;

([1]) OL L 171, 2016 6 29, p. 1.

(7) ESMA surengė atviras viešas konsultacijas dėl techninių reguliavimo standartų projektų, kuriais grindžiamas šis reglamentas, išanalizavo galimas su jais susijusias sąnaudas ir naudą ir paprašė, kad pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 1095/2010 ([2]) 37 straipsnį įsteigta Vertybinių popierių ir rinkų suinteresuotųjų subjektų grupė pateiktų savo rekomendaciją;

(8) siekiant šio reglamento taikymo pradžią suderinti su Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) 2019/2175 ([3]) 5 straipsnio, kuriuo į Reglamentą (ES) 2016/1011 įtraukta 14 straipsnio 4 dalis, taikymo data, šis reglamentas turėtų būti taikomas nuo 2022 m. sausio 1 d.,

PRIĖMĖ ŠĮ REGLAMENTĄ:

1 straipsnis

Tinkamos sistemos ir veiksmingos kontrolės priemonės

1. Reglamento (ES) 2016/1011 14 straipsnio 1 dalyje nurodytos tinkamos sistemos ir veiksmingos kontrolės priemonės yra:

a) tinkamos ir proporcingos atitinkamo lyginamojo indekso pobūdžiui, sudėtingumui ir manipuliavimo juo rizikai;

b) reguliariai, bent vieną kartą per metus peržiūrimos ir prireikus atnaujinamos, kad būtų užtikrinta, kad tos sistemos ir kontrolės priemonės ir toliau atitiktų a punktą;

c) aiškiai ir suprantamai įformintos raštu, įskaitant visus tų sistemų ir kontrolės priemonių pakeitimus ar atnaujinimus.

Taikant pirmos pastraipos a punktą, administratorius reguliariai, bent vieną kartą per metus įvertina manipuliavimo teikiamu lyginamuoju indeksu riziką, atsižvelgdamas į šiuos elementus:

a) numatomas operacijas, reikalingas lyginamajam indeksui pateikti;

b) galimą manipuliavimo rizikos kilmę, pobūdį, specifiškumą ir dydį;

c) priemones, numatytas manipuliavimo rizikai mažinti, įskaitant apsaugos priemones, saugumo priemones ir vidaus procedūras.

2. Reglamento (ES) 2016/1011 14 straipsnio 1 dalyje nurodytos tinkamos sistemos ir veiksmingos kontrolės priemonės apima visus toliau nurodytus elementus tiek, kiek jie atitinka teikiamo lyginamojo indekso pobūdį, sudėtingumą ir manipuliavimo juo riziką:

a) programinę įrangą, kuri leidžia atlikti atidėtą automatinį nuskaitymą, peržiūrėti ir analizuoti pradinius duomenis;

b) žmogaus atliekamą analizę veiksmams, kurie gali būti susiję su manipuliavimu lyginamuoju indeksu arba bandymu juo manipuliuoti, aptikti ir nustatyti.

3. Kompetentingos institucijos prašymu administratorius jai pateikia 1 dalies pirmos pastraipos a, b ir c punktuose nurodytą informaciją ir pagrindžia pasirinkto automatizavimo ir žmogaus atliekamos analizės lygio tinkamumą, kaip nurodyta 2 dalyje.

([2]) 2010 m. lapkričio 24 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 1095/2010, kuriuo įsteigiama Europos priežiūros institucija (Europos vertybinių popierių ir rinkų institucija) ir iš dalies keičiamas Sprendimas Nr. 716/2009/EB bei panaikinamas Komisijos sprendimas 2009/77/EB (OL L 331, 2010 12 15, p. 84).

([3]) 2019 m. gruodžio 18 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) 2019/2175, kuriuo iš dalies keičiamas Reglamentas (ES) Nr. 1093/2010, kuriuo įsteigiama Europos priežiūros institucija (Europos bankininkystės institucija), Reglamentas (ES) Nr. 1094/2010, kuriuo įsteigiama Europos priežiūros institucija (Europos draudimo ir profesinių pensijų institucija), Reglamentas (ES) Nr. 1095/2010, kuriuo įsteigiama Europos priežiūros institucija (Europos vertybinių popierių ir rinkų institucija), Reglamentas (ES) Nr. 600/2014 dėl finansinių priemonių rinkų, Reglamentas (ES) 2016/1011 dėl indeksų, kurie kaip lyginamieji indeksai naudojami finansinėse priemonėse ir finansinėse sutartyse arba siekiant įvertinti investicinių fondų veiklos rezultatus, ir Reglamentas (ES) 2015/847 dėl informacijos, teikiamos pervedant lėšas (OL L 334, 2019 12 27, p. 1).

2 straipsnis

Mokymai

1. Reglamento (ES) 2016/1011 14 straipsnio 1 dalyje nurodytas tinkamas sistemas ir veiksmingas kontrolės priemones valdo administratoriaus darbuotojai, kurie yra tinkamai ir reguliariai mokomi:

a) aptikti ir nustatyti bet kokius įtartinus pradinius duomenis, kurie galėjo atsirasti dėl manipuliavimo lyginamaisiais indeksais arba bandymo jais manipuliuoti;

b) nedelsiant pranešti apie tokius nustatytus faktus pagal savo vidaus pavaldumo struktūrą.

2. Nustatydamas šio straipsnio 1 dalyje nurodytų mokymų turinį, administratorius atsižvelgia į teikiamo lyginamojo indekso pobūdį, sudėtingumą ir manipuliavimo juo riziką, kaip nurodyta 1 straipsnio 1 dalies a punkte.

3 straipsnis

Pradinių duomenų teisingumo politika

Reglamento (ES) 2016/1011 14 straipsnio 1 dalyje nurodytos tinkamos sistemos ir veiksmingos kontrolės priemonės yra įrašomos į pradinių duomenų teisingumo politiką nurodant:

a) manipuliavimo lyginamaisiais indeksais riziką;

b) bendrą tinkamų sistemų ir veiksmingų kontrolės priemonių aprašymą, įskaitant jų atitiktį 1 straipsnyje nustatytiems reikalavimams;

c) bendrą administratoriaus darbuotojų, dalyvaujančių valdant tinkamas sistemas ir veiksmingas kontrolės priemones, kaip nurodyta 2 straipsnyje, mokymų aprašymą;

d) asmenų, atsakingų už tinkamas sistemas ir veiksmingas kontrolės priemones, vardus, pavardes ir kontaktinius duomenis.

4 straipsnis

Įsigaliojimas ir taikymas

Šis reglamentas įsigalioja dvidešimtą dieną po jo paskelbimo *Europos Sąjungos oficialiajame leidinyje*.

Jis taikomas nuo 2022 m. sausio 1 d.

Šis reglamentas privalomas visas ir tiesiogiai taikomas visose valstybėse narėse.

Priimta Briuselyje 2021 m. gegužės 6 d.

Komisijos vardu
Pirmininkė
Ursula VON DER LEYEN