KOMISIJAS DELEĢĒTĀ REGULA (ES) 2020/1303

(2020. gada 14. jūlijs),

ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 648/2012 papildina attiecībā uz kritērijiem, kas EVTI būtu jāņem vērā, lai noteiktu, vai centrālais darījumu partneris, kas veic uzņēmējdarbību trešā valstī, ir sistēmiski nozīmīgs vai tāds, kas, iespējams, kļūs sistēmiski nozīmīgs Savienības vai vienas vai vairāku tās dalībvalstu finanšu stabilitātei

(Dokuments attiecas uz EEZ)

EIROPAS KOMISIJA,

ņemot vērā Līgumu par Eiropas Savienības darbību,

ņemot vērā Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 648/2012 (2012. gada 4. jūlijs) par ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, centrālajiem darījumu partneriem un darījumu reģistriem ([1]) un jo īpaši tās 25. panta 2.a punkta otro daļu,

tā kā:

(1) Novērtējot sistēmiskā riska pakāpi, ko trešās valsts *CCP* rada Savienības vai vienas vai vairāku tās dalībvalstu finanšu stabilitātei, EVTI būtu jāņem vērā virkne objektīvu kvantitatīvu un kvalitatīvu apsvērumu, kas pamatotu tās lēmumu atzīt trešās valsts *CCP* par 1. līmeņa vai 2. līmeņa *CCP*. Tai būtu arī jāņem vērā visi nosacījumi, saskaņā ar kuriem Komisija varētu būt pieņēmusi lēmumu par līdzvērtību. Jo īpaši, novērtējot trešās valsts *CCP* riska profilu, EVTI ir jāņem vērā objektīvi un pārredzami kvantitatīvi darbības rādītāji attiecībā uz darbībām, kas novērtējuma laikā veiktas attiecībā uz tīrvērtes procesa dalībniekiem, kuri veic uzņēmējdarbību Savienībā, vai kas denominētas Savienības valūtās. Lai gan EVTI ir holistiski jāņem vērā *CCP* veiktās darbības, to novērtējumā būtu jāatspoguļo risks, ko konkrēts *CCP* varētu radīt Savienības finanšu stabilitātei.

(2) Precizējot kritērijus, kas EVTI jāņem vērā, nosakot trešās valsts *CCP* līmeni, būtu jāpievērš uzmanība to darījumu veidam, kuriem *CCP* veic tīrvērti, tostarp to sarežģītībai, riska profilam un vidējam termiņam, kā arī attiecīgo tirgu pārredzamībai un likviditātei un pakāpei, kādā *CCP* tīrvērtes darbības ir denominētas euro vai citās Savienības valūtās. Šajā sakarā īpašas iezīmes attiecībā uz noteiktiem trešo valstu regulētos tirgos sarakstos iekļautiem un izpildītiem lauksaimniecības atvasināto instrumentu līgumiem, kas saistīti ar tirgiem, kuri lielākoties apkalpo iekšzemes nefinanšu darījumu partnerus minētajā trešā valstī, kas savus komercriskus pārvalda ar minēto līgumu starpniecību, var radīt nenozīmīgu risku tīrvērtes dalībniekiem un tirdzniecības vietām Savienībā, jo tām ir maza sistēmiska savstarpējā saistība ar pārējo finanšu sistēmu.

(3) Valstis, kurās *CCP* darbojas, tā sniegto pakalpojumu apjoms, finanšu instrumentu, kuriem tas veic tīrvērti, īpašības, kā arī apjomi, kuriem veic tīrvērti, ir objektīvi *CCP* darījumdarbības sarežģītības rādītāji. Tāpēc, ņemot vērā Regulas (ES) Nr. 648/2012 25. panta 2.a punkta a) apakšpunktā noteikto kritēriju, EVTI būtu jāņem vērā *CCP* īpašumtiesības, darījumdarbība un korporatīvā struktūra, kā arī *CCP* piedāvāto tīrvērtes pakalpojumu klāsts, veids un sarežģītība un tas, cik lielā mērā šie pakalpojumi ir nozīmīgi tīrvērtes dalībniekiem un klientiem ("tīrvērtes procesa dalībnieki"), kuri veic uzņēmējdarbību Savienībā. Lai gan *CCP* sistēmiskā nozīme būtu jānovērtē holistiskā veidā, EVTI būtu īpaši jāņem vērā tās *CCP* darījumdarbības īpatsvars, kas tiek veikta Savienības valūtās, kā arī tās*CCP* darījumdarbības īpatsvars, ko veic tīrvērtes procesa dalībnieki, kuri veic uzņēmējdarbību Savienībā. Lai *CCP*, visticamāk, būtu sistēmiski nozīmīgs Savienībai, ir svarīgi, ka EVTI novērtē tās grupas struktūru un īpašumtiesības, kurai *CCP* varētu piederēt, lai noteiktu, vai Savienības intereses ir apdraudētas. Turklāt būtu jānovērtē arī šāda *CCP* apkalpoto tirgu dziļums, likviditāte un pārredzamība, lai EVTI varētu labāk izprast risku tīrvērtes dalībniekiem, kuri veic uzņēmējdarbību Savienībā, rīkojot saistību neizpildes pārvaldības izsoli.

(4) *CCP* kapitāls un tīrvērtes procesa dalībnieku piešķirtie finanšu resursi, kā arī to sniegtā nodrošinājuma veids un būtība ir nozīmīgi elementi, kas jāņem vērā, novērtējot *CCP* spēju izturēt jebkādu negatīvu attīstību. Tāpēc, ņemot vērā Regulas (ES) Nr. 648/2012 25. panta 2.a punkta b) apakšpunktā noteikto kritēriju, EVTI vajadzētu būt pārskatam par *CCP* pieejamajiem finanšu resursiem saistību neizpildes gadījumā vai tādā gadījumā, kas nav saistīts ar saistību neizpildi. EVTI būtu arī jāņem vērā, vai šie resursi ir nodrošināti, nenodrošināti, piešķirti, nepiešķirti, finansēti vai nefinansēti, kā arī līdzekļi, ko *CCP* izmanto, lai nodrošinātu juridisko noteiktību un uzticēšanos attiecībā uz norēķiniem par maksājumiem, ko tas veic, un nodrošinājumu, ar kuru tam ir jārīkojas. Visbeidzot, EVTI būtu jāņem vērā atveseļošanas un noregulējuma režīma pastāvēšana, būtība un ietekme attiecībā uz *CCP*tajā

([1]) OV L 201, 27.7.2012., 1. lpp.

jurisdikcijā, kurā *CCP* iesniedz atzīšanas pieteikumu. Šādi atveseļošanas un noregulējuma režīmi būtu jāizvērtē, ņemot vērā starptautiski pieņemtas norādes un galvenos raksturlielumus. Aplūkojot norēķinu un likviditātes risku, EVTI būtu jāpievērš īpaša uzmanība tiem *CCP*, kuri, iespējams, kļūs sistēmiski, izvērtējot, cik droši šie *CCP* piekļūst likviditātei, kā arī likviditātes spriedzi Savienības valūtās. Lai gan maksājumu un norēķinu drošību varētu pastiprināt, izmantojot sadalītās virsgrāmatas tehnoloģiju vai citas jaunākās tehnoloģijas, EVTI būtu jāpievērš uzmanība papildu riskam, ko tā var radīt *CCP*, jo īpaši kiberriskam.

(5) *CCP* izvirzīto nosacījumu būtība, lai tīrvērtes procesa dalībnieki varētu piekļūt tā pakalpojumiem, un savstarpējā saikne starp šiem tīrvērtes procesa dalībniekiem ietekmē veidu, kādā nelabvēlīgs notikums var atstāt ietekmi uz *CCP* attiecībā uz šiem dalībniekiem. Tāpēc, ņemot vērā Regulas (ES) Nr. 648/2012 25. panta 2.a punkta c) apakšpunktā noteikto kritēriju, EVTI būtu pēc iespējas jānosaka *CCP* tīrvērtes procesa dalībnieku identitāte, jo īpaši, ja *CCP* sniedz pakalpojumus tīrvērtes procesa dalībniekiem, kuri veic uzņēmējdarbību Savienībā. EVTI būtu arī jānosaka tīrvērtes procesa dalībnieku vai *CCP* tīrvērtes procesa dalībnieku grupu attiecīgā tirgus daļa vai attiecīgā nozīme. Ciktāl tas nepieciešams, lai novērtētu ietekmi uz tīrvērtes dalībnieku struktūru, EVTI būtu jāizvērtē nosacījumi un iespējas, saskaņā ar kurām *CCP* nodrošina piekļuvi tā tīrvērtes pakalpojumiem. Attiecībā uz *CCP*, kam, iespējams, būs sistēmiska nozīme Savienībai, EVTI būtu jānovērtē, vai juridiskās un prudenciālās prasības, ko *CCP* izvirza saviem tīrvērtes dalībniekiem, ir pietiekami stingras.

(6) *CCP* darbības traucējumu gadījumā tīrvērtes procesa dalībniekiem var būt tieši vai netieši jāpaļaujas uz to, ka citi *CCP* sniegs līdzīgus vai identiskus pakalpojumus. Lai novērtētu tā *CCP* relatīvo nozīmi, kurš iesniedz atzīšanas pieteikumu, EVTI, ņemot vērā Regulas (ES) Nr. 648/2012 25. panta 2.a punkta d) apakšpunktā noteikto kritēriju, būtu jānosaka, vai tīrvērtes procesa dalībnieki var aizstāt dažus vai visus minētā *CCP* sniegtos tīrvērtes pakalpojumus ar citu *CCP* sniegtajiem pakalpojumiem, jo īpaši, ja minētie alternatīvie *CCP* ir saņēmuši atļauju vai ir atzīti Savienībā. Ja tīrvērtes dalībnieki un klienti, kuri veic uzņēmējdarbību Savienībā, var veikt tikai tādu konkrētu produktu tīrvērti, uz kuriem attiecas tīrvērtes pienākums, vienā trešās valsts *CCP*, EVTI īpaša uzmanība būtu jāpievērš šā *CCP* sistēmiskajai nozīmei.

(7) *CCP* var būt daudzējādā ziņā saistīti ar citām finanšu infrastruktūrām, piemēram, citiem *CCP* vai centrālajiem vērtspapīru depozitārijiem. Šo saikņu pārtraukšana var negatīvi ietekmēt *CCP* raitu darbību. Tāpēc, ņemot vērā Regulas (ES) Nr. 648/2012 25. panta 2.a punkta e) apakšpunktā noteikto kritēriju, EVTI būtu jānovērtē, cik lielā mērā *CCP* ir saistīts ar citām finanšu tirgus infrastruktūrām vai finanšu iestādēm tādā veidā, kas varētu ietekmēt Savienības vai vienas vai vairāku tās dalībvalstu finanšu stabilitāti. To darot, EVTI būtu jāpievērš īpaša uzmanība šīm saiknēm un savstarpējai atkarībai ar vienībām, kas atrodas Savienībā. Visbeidzot, EVTI būtu jānosaka un jānovērtē *CCP* ārpakalpojumu raksturs un risks, ko šādi mehānismi varētu radīt *CCP* gadījumā, ja tie jebkādā veidā tiktu pārtraukti vai traucēti.

(8) Ja, kā noteikts, izmantojot objektīvus kvantitatīvus rādītājus, tīrvērtes dalībnieku un klientu, kuri veic uzņēmējdarbību Savienībā, riska darījumi ar *CCP* ir nozīmīgi, EVTI būtu jānovērtē papildu elementi katram kritērijam. Jo vairāk *CCP* atbilst šiem rādītājiem, jo lielāka ir iespēja, ka EVTI secinās, ka *CCP* ir sistēmiski nozīmīgs Savienības vai vienas vai vairāku tās dalībvalstu finanšu stabilitātei.

(9) Šai deleģētajai regulai būtu jāstājas spēkā steidzamības kārtā, lai nodrošinātu visātrāko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) 2019/2099 ([2]) ieviešanu praksē,

IR PIEŅĒMUSI ŠO REGULU.

1. pants

CCP darījumdarbības veids, apjoms un sarežģītība

1. Ņemot vērā Regulas (ES) Nr. 648/2012 25. panta 2.a punkta a) apakšpunktā noteikto kritēriju, EVTI novērtē šādus elementus:

a) valstis, kurās *CCP* sniedz vai plāno sniegt pakalpojumus;

([2]) Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) 2019/2099 (2019. gada 23. oktobris), ar kuru attiecībā uz *CCP* atļauju piešķiršanā iesaistītajām procedūrām un iestādēm un trešo valstu *CCP* atzīšanas prasībām groza Regulu (ES) Nr. 648/2012 (OV L 322, 12.12.2019., 1. lpp.).

b) tas, cik lielā mērā *CCP* papildus tīrvērtes pakalpojumiem sniedz citus pakalpojumus;

c) to finanšu instrumentu veids, kuriem *CCP* veic vai veiks tīrvērti;

d) tas, vai uz finanšu instrumentiem, kuriem *CCP* veic vai veiks tīrvērti, attiecas tīrvērtes pienākums saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 4. pantu;

e) vidējās vērtības, kurām *CCP* veic tīrvērti viena gada laikā, šādos līmeņos:

i) *CCP* līmenī;

ii) katra tīrvērtes dalībnieka, kas ir vienība, kura veic uzņēmējdarbību Savienībā, vai vienība, kas ir daļa no grupas, uz kuru attiecas konsolidēta uzraudzība Savienībā, līmenī;

iii) kopumā to tīrvērtes dalībnieku līmenī, kuri veic uzņēmējdarbību ārpus Savienības vai kuri nav daļa no grupas, uz kuru attiecas konsolidēta uzraudzība Savienībā, ja tie veic tīrvērti klientu un netiešo klientu, kuri veic uzņēmējdarbību Savienībā, vārdā.

f) tas, vai *CCP* ir pabeidzis riska profila novērtējumu, pamatojoties uz starptautiski pieņemtiem standartiem vai citādi, izmantotā metodika un novērtējuma rezultāts.

2. 1. punkta e) apakšpunkta nolūkā EVTI atsevišķi novērtē šādas vērtības:

a) vērtspapīru darījumiem (tostarp vērtspapīru finansēšanas darījumiem saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) 2015/2365 ([3])) – atvērto pozīciju vai atvērtās ieguldījumu pozīcijas vērtība;

b) atvasināto instrumentu darījumiem, ko tirgo regulētā tirgū Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvas 2014/65/ES ([4]) nozīmē – atvērtās ieguldījumu pozīcijas vērtība vai apgrozījums;

c) ārpusbiržas atvasināto instrumentu darījumiem – bruto un neto nosacītā nenomaksātā summa.

Šīs vērtības novērtē pa valūtām un pa aktīvu klasēm.

3. Ja piemēro kādu no 6. pantā minētajiem rādītājiem, EVTI papildus šā panta 1. punktā uzskaitītajiem elementiem novērtē arī šādus elementus:

a) *CCP* īpašumtiesību struktūra;

b) ja *CCP* pieder pie tās pašas grupas kā cita finanšu tirgus infrastruktūra, piemēram, cits *CCP* vai centrālais vērtspapīru depozitārijs, – tās grupas korporatīvā struktūra, pie kuras *CCP* pieder;

c) tas, vai *CCP* sniedz tīrvērtes pakalpojumus klientiem vai netiešajiem klientiem, kas veic uzņēmējdarbību Savienībā, ar to tīrvērtes dalībnieku starpniecību, kas veic uzņēmējdarbību ārpus Savienības;

d) apkalpoto tirgu veids, dziļums un likviditāte un pieejamās informācijas līmenis par atbilstošiem cenu noteikšanas datiem tirgus dalībniekiem un visi vispārpieņemtie un uzticamie cenu noteikšanas avoti;

e) tas, vai tiek publiskotas kotētās cenas, pirmstirdzniecības pirkšanas un pārdošanas piedāvājumu cenas un tirdzniecības interešu dziļums;

f) tas, vai tiek publiskota tādu darījumu pēctirdzniecības cena, apjoms un laiks, kas izpildīti vai noslēgti *CCP* apkalpotajos tirgos un ārpus tiem.

([3]) Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) 2015/2365 (2015. gada 25. novembris) par vērtspapīru finansēšanas darījumu un atkalizmantošanas pārredzamību un ar ko groza Regulu (ES) Nr. 648/2012 (OV L 337, 23.12.2015., 1. lpp.).

([4]) Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīva 2014/65/ES (2014. gada 15. maijs) par finanšu instrumentu tirgiem un ar ko groza Direktīvu 2002/92/ES un Direktīvu 2011/61/ES (OV L 173, 12.6.2014., 349. lpp.).

2. pants

CCP grūtību vai darbības pārtraukšanas sekas

1. Ņemot vērā Regulas (ES) Nr. 648/2012 25. panta 2.a punkta b) apakšpunktā noteikto kritēriju, EVTI novērtē šādus elementus:

a) *CCP* kapitāls, tostarp nesadalītā peļņa un rezerves;

b) *CCP* pieņemtā un turētā nodrošinājuma veids un summa, piemērotie diskonti, attiecīgā diskontu metodika, valūtas, kurās nodrošinājums ir denominēts, un apmērs, kādā nodrošinājumu sniedz vienības, kas veic uzņēmējdarbību Savienībā vai kas ir daļa no grupas, uz kuru attiecas konsolidēta uzraudzība Savienībā;

c) maksimālā maržu summa, ko *CCP* iekasējis vienā dienā 365 dienu laikposmā pirms EVTI novērtējuma;

d) maksimālā maržu summa, ko vienā dienā 365 dienu laikposmā pirms EVTI novērtējuma *CCP* iekasē no katra tīrvērtes dalībnieka, kas ir vienība, kura veic uzņēmējdarbību Savienībā, vai vienība, kas ir daļa no grupas, uz kuru attiecas konsolidētā uzraudzība Savienībā, attiecīgā gadījumā pa aktīvu klasēm vai nošķirtiem saistību neizpildes fondiem;

e) attiecīgā gadījumā katram *CCP* saistību neizpildes fondam – maksimālās iemaksas fondā saistību neizpildes gadījumiem, ko *CCP* pieprasa un ko tas tur, vienā dienā 365 dienu laikposmā pirms EVTI novērtējuma;

f) attiecīgā gadījumā katram *CCP* saistību neizpildes fondam – maksimālās iemaksas fondā saistību neizpildes gadījumiem, ko vienā dienā 365 dienu laikposmā pirms EVTI novērtējuma *CCP* pieprasa un tur no katra tīrvērtes dalībnieka, kas ir vienība, kura veic uzņēmējdarbību Savienībā, vai vienība, kas ir daļa no grupas, uz kuru attiecas konsolidēta uzraudzība Savienībā;

g) aplēstās lielākās maksājumu saistības kopumā vienā dienā un katrā Savienības valūtā, ko izraisītu viena vai divu lielāko tīrvērtes dalībnieku (un to saistīto uzņēmumu) saistību neizpilde ārkārtējos, bet iespējamos tirgus apstākļos;

h) *CCP* labā piešķirto likvīdo finanšu resursu kopējā summa par katru Savienības valūtu atsevišķi pēc resursu veida, tostarp skaidras naudas noguldījumiem, piešķirtajiem vai nepiešķirtajiem resursiem;

i) kopējo likvīdo finanšu resursu summa, ko *CCP* ir piešķīrušas vienības, kas veic uzņēmējdarbību Savienībā vai kas ir daļa no grupas, uz kuru attiecas konsolidēta uzraudzība Savienībā.

2. Ja piemēro kādu no 6. pantā minētajiem rādītājiem, EVTI papildus šā panta 1. punktā uzskaitītajiem elementiem novērtē arī šādus elementus:

a) to likviditātes nodrošinātāju identitāte, kuri veic uzņēmējdarbību Savienībā vai kuri ir daļa no grupas, uz kuru attiecas konsolidēta uzraudzība Savienībā;

b) ienākošo un izejošo Savienības valūtas maksājumu vidējās un maksimālās kopējās dienas vērtības;

c) apmērs, kādā centrālās bankas nauda tiek izmantota norēķiniem un maksājumiem, un tas, vai citas struktūras tiek izmantotas norēķiniem vai maksājumiem;

d) tas, cik lielā mērā *CCP* norēķinu/maksājumu procesā izmanto tehnoloģijas, piemēram, sadalītās virsgrāmatas tehnoloģiju;

e) *CCP* atveseļošanas plāns;

f) *CCP* piemērojamais noregulējuma režīms;

g) tas, vai attiecīgajam *CCP* ir izveidota krīzes pārvarēšanas grupa.

3. pants

CCP tīrvērtes dalībnieku struktūra

1. Ņemot vērā Regulas (ES) Nr. 648/2012 25. panta 2.a punkta a) apakšpunktā noteikto kritēriju, EVTI novērtē šādus elementus:

a) tīrvērtes dalība un, ja informācija ir pieejama, to klientu vai netiešo klientu identitāte, kas veic uzņēmējdarbību Savienībā vai kas ietilpst grupā, uz kuru attiecas konsolidēta uzraudzība Savienībā, kuri izmanto *CCP* tīrvērtes pakalpojumus; un

b) dažādie pieejamie risinājumi, lai piekļūtu *CCP* tīrvērtes pakalpojumiem (tostarp dažādām dalībām un klientu tiešas piekļuves modeļiem), jebkādi nosacījumi piekļuves piešķiršanai, liegšanai vai izbeigšanai.

2. Ja piemēro kādu no 6. pantā minētajiem rādītājiem, EVTI papildus šā panta 1. punktā uzskaitītajiem elementiem īpaši novērtē visas juridiskās vai prudenciālās prasības, ko *CCP* noteicis tīrvērtes dalībniekiem attiecībā uz piekļuvi tā tīrvērtes pakalpojumiem.

4. pants

Alternatīvi tīrvērtes pakalpojumi, ko sniedz citi *CCP*

1. Ņemot vērā Regulas (ES) Nr. 648/2012 25. panta 2.a punkta d) apakšpunktā noteikto kritēriju, EVTI novērtē, vai tīrvērtes dalībnieki un klienti, kas veic uzņēmējdarbību Savienībā, var piekļūt dažiem vai visiem tīrvērtes pakalpojumiem, ko *CCP* sniedz ar citu *CCP* starpniecību, un vai šie *CCP* ir saņēmuši atļauju vai atzīti saskaņā ar minētās regulas 14. un 25. pantu.

2. Ja piemēro kādu no 6. pantā minētajiem rādītājiem, EVTI papildus šā panta 1. punktā uzskaitītajiem elementiem novērtē arī to, vai *CCP* sniegtie pakalpojumi attiecas uz atvasināto instrumentu klasi, uz kuru attiecas tīrvērtes pienākums saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 4. pantu.

5. pants

***CCP* attiecības, savstarpēja atkarība vai cita mijiedarbība**

1. Ņemot vērā Regulas (ES) Nr. 648/2012 25. panta 2.a punkta e) apakšpunktā noteikto kritēriju, EVTI novērtē to funkciju, pakalpojumu vai darbību tvērumu, kuras *CCP* ir uzticējis ārpakalpojumu sniedzējiem.

2. Ja piemēro kādu no 6. pantā minētajiem rādītājiem, EVTI papildus šā panta 1. punktā uzskaitītajiem elementiem izvērtē arī šādus elementus:

a) iespējamā ietekme uz Savienību vai vienu vai vairākām tās dalībvalstīm, ja ārpakalpojumā nodoto funkciju, pakalpojumu vai darbību sniedzējs nespēj izpildīt savus pienākumus saskaņā ar ārpakalpojumu mehānismiem;

b) tas, vai *CCP* apkalpo tirdzniecības vietas, kas veic uzņēmējdarbību Savienībā;

c) tas, vai *CCP* ir sadarbspējas mehānismi vai kompensējošas pozīcijas aprēķināšanas līgumi ar *CCP*, kas veic uzņēmējdarbību Savienībā, vai saiknes ar citām finanšu tirgus infrastruktūrām, kas atrodas Savienībā, piemēram, centrālajiem vērtspapīru depozitārijiem vai maksājumu sistēmām vai dalība tajās.

6. pants

Rādītāji par tīrvērtes dalībnieku un klientu, kas veic uzņēmējdarbību Savienībā, minimālajiem riska darījumiem ar *CCP*

1. Rādītāji 1. līdz 5. panta nolūkā ir šādi:

a) maksimālā atvērtā ieguldījumu pozīcija vērtspapīru darījumos, tostarp vērtspapīru finansēšanas darījumos, vai biržā tirgotos atvasinātos instrumentos, kas denominēti Savienības valūtās, kam *CCP* veic tīrvērti viena gada laikā pirms novērtējuma veikšanas vai kam paredzēts veikt tīrvērti viena gada laikā pēc novērtējuma veikšanas, ir vairāk nekā 1 000 miljardi EUR;

b) maksimālā to ārpusbiržas atvasināto instrumentu darījumu nenomaksātā nosacītā summa, kas denominēti Savienības valūtās un kuriem *CCP* veic tīrvērti viena gada laikā pirms novērtējuma veikšanas vai plāno veikt tīrvērti viena gada laikā pēc novērtējuma veikšanas, ir vairāk nekā 1 000 miljardi EUR;

c) vidējā apkopotā maržas prasība un iemaksas fondā saistību neizpildes gadījumiem attiecībā uz kontiem, kurus *CCP* tur tīrvērtes dalībnieki, kas ir vienības, kuras veic uzņēmējdarbību Savienībā, vai vienības, kas ir daļa no grupas, uz kuru attiecas konsolidēta uzraudzība Savienībā, un ko *CCP* aprēķina uz neto pamata tīrvērtes dalībnieka konta līmenī divu gadu laikā pirms novērtējuma veikšanas, ir vairāk nekā 25 miljardi EUR;

d) aplēstās lielākās maksājumu saistības, ko uzņēmušās vienības, kuras veic uzņēmējdarbību Savienībā, vai vienības, kas ir daļa no grupas, uz kuru attiecas konsolidētā uzraudzība Savienībā, un kas aprēķinātas viena gada laikā pirms novērtējuma, kas izrietētu no vismaz divu lielāko tīrvērtes dalībnieku un saistīto uzņēmumu saistību neizpildes ārkārtējos, bet iespējamos tirgus apstākļos, ir vairāk nekā 3 miljardi EUR.

Šā punkta d) apakšpunkta nolūkā maksājumu saistībās summē saistības visās Savienības valūtās, kas vajadzības gadījumā konvertētas EUR.

2. EVTI, pamatojoties uz 1. līdz 5. pantā noteiktajiem kritērijiem, var noteikt to, ka trešās valsts *CCP* ir 2. līmeņa *CCP* tikai tādā gadījumā, ja ir izpildīts vismaz viens no 1. punktā minētajiem rādītājiem.

7. pants

Stāšanās spēkā

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

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

Briselē, 2020. gada 14. jūlijā

Komisijas vārdā –
priekšsēdētāja
Ursula VON DER LEYEN