KOMISIJAS DELEĢĒTĀ REGULA (ES) 2021/1349

(2021. gada 6. maijs),

ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) 2016/1011 papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem, kuros precizēti kritēriji kompetento iestāžu atbilstības novērtējumam attiecībā uz kritiski svarīga etalona obligāto pārvaldību

(Dokuments attiecas uz EEZ)

EIROPAS KOMISIJA,

ņemot vērā Līgumu par Eiropas Savienības darbību,

ņemot vērā Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) 2016/1011 (2016. gada 8. jūnijs) par indeksiem, ko izmanto kā etalonus finanšu instrumentos un finanšu līgumos vai ieguldījumu fondu darbības rezultātu mērīšanai, un ar kuru groza Direktīvu 2008/48/EK, Direktīvu 2014/17/ES un Regulu (ES) Nr. 596/2014 ([1]), un jo īpaši tās 21. panta 5. punktu,

tā kā:

(1) Kompetento iestāžu novērtējums, kas minēts Regulas (ES) 2016/1011 21. panta 2. punkta b) apakšpunktā, attiecas vai nu uz to, kā kritiski svarīgs etalons ir jānodod jaunam administratoram, vai arī uz to, kā paredzēts pārtraukt minētā etalona izstrādi. Tāpēc ir lietderīgi precizēt divus kritēriju kopumus, kas kompetentajām iestādēm jāņem vērā atkarībā no tā, kuru scenāriju tās izvērtē.

(2) Ja kritiski svarīgs etalons ir jānodod jaunam administratoram, šim jaunajam administratoram būtu jāspēj nodrošināt kritiski svarīga etalona izstrādes nepārtrauktību tādā veidā, lai uzraudzītās vienības varētu turpināt to izmantot bez pārtraukuma un saskaņā ar Regulu (ES) 2016/1011. Tāpēc ir jāprecizē kritēriji, kas kompetentajai iestādei būtu jāņem vērā, novērtējot, vai jaunais administrators var nodrošināt šādu nepārtrauktību.

(3) Kritiski svarīga etalona uzraudzība būtu jānodrošina visā minētā etalona nodošanas laikā jaunam administratoram. Pastāv lielāks risks, ka šāda etalona uzraudzība varētu tikt pārtraukta, ja jaunais administrators atrodas citā dalībvalstī, nevis tajā, kurā atrodas kompetentā iestāde, kas veic novērtējumu par to, kā kritiski svarīgais etalons ir jānodod jaunajam administratoram. Attiecīgajām kompetentajām iestādēm būtu jāsadarbojas, lai nodrošinātu, ka kompetentā iestāde, kura veic novērtējumu, saņem visu informāciju, kas vajadzīga, lai noteiktu, vai etalona uzraudzības turpināšana tiks nodrošināta visā šādas nodošanas laikā, tostarp analīzi, kurā galvenā uzmanība pievērsta jaunā administratora atrašanās vietai un tā atļaujas piešķiršanas statusam.

(4) Izvērtējot, kā kritiski svarīgs etalons ir jānodod jaunam administratoram, kompetentajai iestādei būtu jāizanalizē no operacionālā viedokļa, kā kritiski svarīgā etalona izstrāde no pašreizējā administratora tiks nodota jaunajam administratoram. Attiecīgajai kompetentajai iestādei jo īpaši būtu jāapsver etalona nepārtraukta publiska pieejamība, ievades datu pieejamība, etalona aprēķināšanas metodika un jebkāda nepieciešamā sadarbība ar visiem datu sniedzējiem, lietotājiem un citām ieinteresētajām personām.

(5) Kompetentajai iestādei, kas novērtē, kā paredzēts pārtraukt kritiski svarīga etalona izstrādi, būtu jāpārliecinās, ka etalona izstrādi var pārtraukt sakārtotā veidā, cita starpā ņemot vērā procedūru etalona izstrādes pārtraukšanai, ko tās administrators noteicis saskaņā ar Regulas (ES) 2016/1011 28. panta 1. punktu. Tādēļ ir jāprecizē kritēriji, kas kompetentajai iestādei būtu jāņem vērā, lai noteiktu, vai tas tā ir.

([1]) OV L 171, 29.6.2016., 1. lpp.

(6) Kompetentajai iestādei, kas novērtē, kā paredzēts pārtraukt kritiski svarīga etalona izstrādi, būtu arī jāņem vērā rakstiskie plāni par etalona izstrādes pārtraukšanu, kas minēti Regulas (ES) 2016/1011 28. panta 2. punktā. Šie dažādu kritiski svarīga etalona lietotāju rakstiskie plāni ne vienmēr ir saskaņoti, un tie var nebūt konsekventi, ja tos piemēro vienlaikus. Tāpēc ir svarīgi, lai kompetentās iestādes ņemtu vērā, cik lielā mērā šie rakstiskie plāni ir saderīgi starp dažādiem etalona lietotājiem, tostarp attiecībā uz etalona izstrādes pārtraukšanas izraisītājnotikumiem, kas paredzēti minētajos rakstiskajos plānos, un kā šos rakstiskos plānus var izmantot, lai nodrošinātu kritiski svarīgā etalona pārtraukšanu sakārtotā veidā.

(7) Šī regula ir balstīta uz regulatīvo tehnisko standartu projektu, ko Komisijai iesniegusi Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestāde (EVTI).

(8) EVTI ir veikusi atklātas sabiedriskās apspriešanas par regulatīvo tehnisko standartu projektu, kas ir šīs regulas pamatā, izanalizējusi potenciālās saistītās izmaksas un ieguvumus un lūgusi ieteikumu no Vērtspapīru un tirgu nozares ieinteresēto personu grupas, kura izveidota saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 1095/2010 ([2]) 37. pantu,

(9) Lai nodrošinātu atbilstību 5. panta piemērošanas datumam Eiropas Parlamenta un Padomes Regulā (ES) 2019/2175 ([3]), ar kuru Regulā (ES) 2016/1011, tika ieviests minētās regulas 21. panta 5. punkts, šī regula būtu jāpiemēro no 2022. gada 1. janvāra,

IR PIEŅĒMUSI ŠO REGULU.

1. pants

Kritēriji, ar kuriem novērtē nodošanu jaunam administratoram

Kompetentās iestādes, novērtējot, kā kritiski svarīgs etalons ir jānodod jaunam administratoram, ņem vērā visus turpmāk minētos kritērijus:

a) to, vai jaunais administrators, kas ierosināts pašreizējā administratora iesniegtajā novērtējumā saskaņā ar Regulas (ES) 2016/1011 21. panta 1. punkta b) apakšpunkta i) punktu:

   i) atrodas tajā pašā dalībvalstī, kurā atrodas pašreizējais administrators, vai citā dalībvalstī; un, ja tā, tad kompetentā iestāde vajadzības gadījumā sadarbojas ar jaunā administratora dalībvalsts kompetento iestādi, lai novērtētu, vai laikā, kad kritiski svarīgais etalons tiek nodots jaunajam administratoram, tiks nodrošināta tā uzraudzība;

   ii) ir uzraudzītā vienība, un, ja tā, par kādām darbībām tā tiek uzraudzīta, un vai pastāv faktisks vai potenciāls interešu konflikts ar šīs vienības pašreizējām darbībām;

   iii) ir etalona lietotājs, un, ja tā, vai interešu konflikti, kas var rasties, ir pienācīgi mazināti;

   iv) jau ir saņēmis atļauju darboties kā etalona administrators saskaņā ar Regulas (ES) 2016/1011 34. pantu;

([2]) 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.).

([3]) Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) 2019/2175 (2019. gada 18. decembris), ar kuru groza Regulu (ES) Nr. 1093/2010, ar ko izveido Eiropas Uzraudzības iestādi (Eiropas Banku iestādi), Regulu (ES) Nr. 1094/2010, ar ko izveido Eiropas Uzraudzības iestādi (Eiropas Apdrošināšanas un aroda pensiju iestādi), Regulu (ES) Nr. 1095/2010, ar ko izveido Eiropas Uzraudzības iestādi (Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestādi), Regulu (ES) Nr. 600/2014 par finanšu instrumentu tirgiem, Regulu (ES) 2016/1011 par indeksiem, ko izmanto kā etalonus finanšu instrumentos un finanšu līgumos vai ieguldījumu fondu darbības rezultātu mērīšanai, un Regulu (ES) 2015/847 par līdzekļu pārvedumiem pievienoto informāciju (OV L 334, 27.12.2019., 1. lpp.).

v) jau izstrādā etalonus, un, ja tā, vai tie ir kritiski svarīgi, nozīmīgi, maznozīmīgi, preču vai procentu likmju etaloni;

b) to, vai kritiski svarīga etalona pašreizējais administrators ir informējis datu sniedzējus, lietotājus un citas ieinteresētās personas vai rīkojis sabiedrisku apspriešanu par kritiski svarīgā etalona iespējamo nodošanu jaunajam administratoram;

c) veidu, kādā jaunais administrators plāno aprēķināt kritiski svarīgo etalonu, un to, vai minētais administrators plāno grozīt kādu no turpmāk minētajiem elementiem, kas saistīti ar kritiski svarīgo etalonu, un, ja tā, kā administrators nodrošinās minēto elementu atbilstību Regulai (ES) 2016/1011:

i) metodika, tostarp ievades datu kvalitāte, un tās pārskatīšana;

ii) ārkārtas situāciju politika etalona aprēķināšanai;

iii) procedūras kļūdu novēršanai ievades datos vai etalona atkārtotā noteikšanā;

iv) rīcības kodekss;

d) to, vai jaunajam administratoram būs pieejami tie paši ievades dati, kas ir pašreizējā administratora rīcībā, tostarp pašreizējā administratora rīcībā esošie vēsturiskie ievades dati;

e) to, vai jaunā administratora IT infrastruktūras ir pienācīgi pārbaudītas kritiski svarīgā etalona izstrādei;

f) ja kritiski svarīga etalona pamatā ir ievades dati, ko sniedzis datu sniedzēju panelis, – to, kā jaunais administrators plāno izpildīt Regulas (ES) 2016/1011 11. panta 1. punkta d) apakšpunktā noteikto prasību, un to, vai pašreizējie datu sniedzēji būs daļa no paneļa arī pēc tam, kad etalons būs nodots jaunajam administratoram;

g) veidu, kādā jaunais administrators plāno publicēt kritiski svarīgo etalonu, tostarp standarta ikdienas publicēšanas kārtību, publicēšanas biežumu, tīmekļa vietnes adresi un to, vai kritiski svarīgs etalons būs pieejams, veicot maksājumu, vai bez maksas;

h) to, vai pastāv detalizēts plāns nodošanas datumam, un, ja tā, vai minētajā plānā ir risināti visi iespējamie jautājumi, tostarp līgumiskie jautājumi, kas izriet no kritiski svarīgā etalona nodošanas jaunam administratoram;

i) ar nodošanu saistītos juridiskos riskus, tostarp līguma noteikumu izpildes neiespējamības risku;

j) jauna administratora izstrādātā kritiski svarīgā etalona grāmatvedības un nodokļu ietekmi;

k) nodošanas ietekmi uz finanšu tirgus infrastruktūrām, tostarp tīrvērtes iestādēm.

2. pants

Kritēriji, ar kuriem novērtē kritiski svarīga etalona izstrādes pārtraukšanu

1. Kompetentās iestādes, novērtējot, kā ir jāpārtrauc kritiski svarīga etalona izstrāde, ņem vērā visus turpmāk minētos kritērijus:

a) saskaņā ar Regulas (ES) 2016/1011 28. panta 1. punktu ieviestās procedūras efektivitāti un jo īpaši:

i) to, vai minētajā procedūrā ir precīzi definētas darbības, kas administratoram jāveic, lai sakārtotā veidā pārtrauktu kritiski svarīgā etalona izstrādi;

ii) to, vai, ņemot vērā konkrētā gadījuma apstākļus, minētās darbības būs pietiekamas, lai nodrošinātu kritiski svarīgā etalona izstrādes pārtraukšanu sakārtotā veidā, ņemot vērā arī šā punkta b) apakšpunktā minēto kritēriju;

iii) to, kad šī procedūra tika izstrādāta un kad tā pēdējo reizi tika atjaunināta;

b) rakstiskos plānus, kas minēti Regulas (ES) 2016/1011 28. panta 2. punktā, un jo īpaši:

i) to, vai minētajos rakstiskajos plānos ir izvirzīti piemēroti alternatīvi etaloni, uz kuriem var atsaukties, lai aizstātu kritiski svarīgo etalonu, un, ja tā, vai minētajos rakstiskajos plānos ir izvirzīti tie paši vai atšķirīgi alternatīvie etaloni;

ii) ja minētajos rakstiskajos plānos ir izvirzīts viens un tas pats alternatīvais etalons, – to, vai minētais etalons ir pieņemts dažādās aktīvu kategorijās;

iii) to, vai rakstiskajos plānos iekļautie kritiski svarīga etalona izstrādes pārtraukšanas izraisītājnotikumi ir tādi paši kā plānos, ko izstrādā uzraudzītās vienības, kuras izmanto šo kritiski svarīgo etalonu, ja to ir iespējams novērtēt;

c) to, vai šā punkta b) apakšpunkta i) punktā minēto alternatīvo etalonu administratoriem ir piešķirta atļauja;

d) ja iespējams, to, vai kritiski svarīga etalona izstrādes pārtraukšana negatīvi ietekmētu tirgus integritāti, finanšu stabilitāti, patērētājus, reālo ekonomiku vai mājsaimniecību un uzņēmumu finansēšanu ([4]);

e) to, vai kritiski svarīgā etalona izstrādes pārtraukšana izraisītu *force majeure* gadījumu;

f) tirgus vai ekonomiskās realitātes dinamiku, ko kritiski svarīgais etalons plāno izmērīt, un to, vai pastāv pietiekami kvalitatīvi un kvantitatīvi ievades dati, lai precīzi atspoguļotu minēto pamatā esošo tirgu vai ekonomisko realitāti;

g) to, vai administrators ir informējis kritiski svarīga etalona datu sniedzējus, minētā etalona lietotājus un citas ieinteresētās personas vai ir rīkojis sabiedrisku apspriešanu par kritiski svarīga etalona izstrādes iespējamo pārtraukšanu;

h) visus juridiskos riskus, kas saistīti ar kritiski svarīgā etalona izstrādes pārtraukšanu;

i) kritiski svarīgā etalona izstrādes pārtraukšanas ietekmi uz grāmatvedību un nodokļiem;

j) kritiski svarīgā etalona izstrādes pārtraukšanas ietekmi uz tirgus infrastruktūrām, tostarp tīrvērtes iestādēm.

Šā punkta c) apakšpunkta nolūkos, ja šā punkta b) apakšpunkta i) punktā minēto alternatīvo etalonu administratori nav saņēmuši atļauju, kompetentā iestāde novērtē atļaujas piešķiršanas nosacījumus saskaņā ar Regulas (ES) 2016/1011 34. pantu un novērtē, vai kritiski svarīga etalona obligātās pārvaldības periods ir nepieciešams, lai varētu piešķirt atļauju minēto alternatīvo etalonu administratoriem.

2. Papildus 1. punkta a) apakšpunktā minētajiem kritērijiem kompetentā iestāde var novērtēt, vai procedūra, ko administrators noteicis saskaņā ar Regulas (ES) 2016/1011 28. panta 1. punktu, ir piemērota, ņemot vērā turpmāk minētos elementus attiecībā uz finanšu instrumentiem, finanšu līgumiem vai ieguldījumu fondiem, kas atsaucas uz kritiski svarīgo etalonu:

a) to apjoms un vērtība;

b) finanšu instrumentu, finanšu līgumu un jebkuru citu dokumentu, kas noslēgti ieguldījumu fonda darbības rezultātu mērīšanai, izmantojot indeksu vai indeksu kombināciju, termiņš, ilgums, periods līdz beigu termiņam vai beigu datums, lai izsekotu šāda indeksa vai indeksu kombinācijas atdevi, noteiktu portfeļa aktīvu sadalījumu vai aprēķinātu darbības rezultātu maksas;

c) tas, vai kritiski svarīgais etalons arī turpmāk tiks izstrādāts izmantošanai pārejas vai noslēguma cenas nepaziņošanas periodā;

([4]) Komisijas Deleģētā regula (ES) 2018/64 (2017. gada 29. septembris), ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) 2016/1011 papildina attiecībā uz precizējumu par to, kā 20. panta 1. punkta c) apakšpunkta iii) punktā noteiktie kritēriji ir jāpiemēro, lai novērtētu, vai konkrēti notikumi radītu būtisku un negatīvu ietekmi uz tirgus integritāti, finanšu stabilitāti, patērētājiem, reālo ekonomiku vai mājsaimniecību un uzņēmumu finansēšanu vienā vai vairākās dalībvalstīs (OV L 12, 17.1.2018., 5. lpp.).

d) tas, vai Regulas (ES) 2016/1011 28. panta 1. punktā minētā procedūra paredz tādas kritiski svarīga etalona izmaiņas, kas var būt vajadzīgas, lai nodrošinātu, ka kritiski svarīgais etalons arī turpmāk ir uzticams un reprezentatīvs pamatā esošajam tirgum vai ekonomiskajai realitātei, ko tas plāno mērīt visā šā panta 2. punkta c) apakšpunktā minētajā laikposmā;

e) iespējamība, ka attiecībā uz jebkuru šādu finanšu instrumentu, finanšu līgumu vai citu dokumentu, kas noslēgts ieguldījumu fonda darbības rezultātu mērīšanai, izmantojot indeksu vai indeksu kombināciju, lai izsekotu šāda indeksa vai indeksu kombinācijas atdevi, noteiktu portfeļa aktīvu sadalījumu vai aprēķinātu darbības rezultātu maksu, pastāvētu noteikumu izpildes neiespējamība vai ka tā noteikumi tiktu pārkāpti, ja kritiski svarīgā etalona izstrāde tiktu pārtraukta.

3. pants

Stāšanās spēkā un piemērošana

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

To piemēro no 2022. gada 1. janvāra.

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

Briselē, 2021. gada 6. maijā

Komisijas vārdā –
Priekšsēdētāja
Ursula VON DER LEYEN