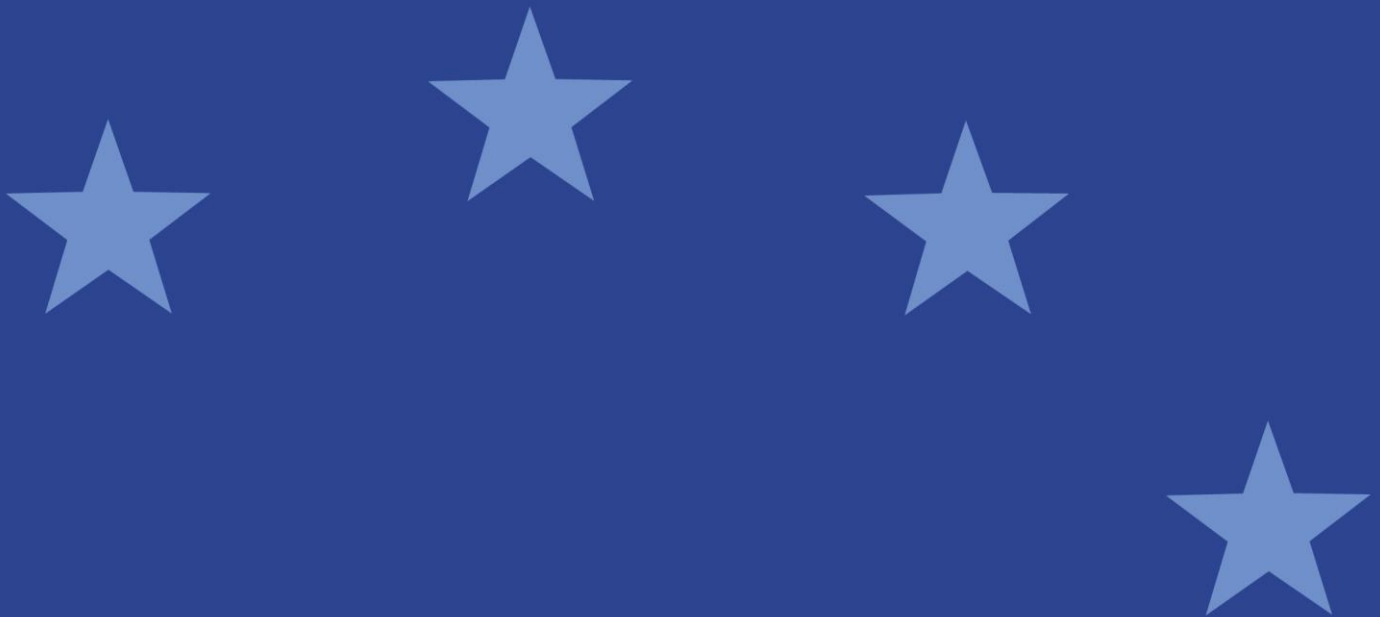




European Securities and
Markets Authority

Pamatnostādnes

par kopējām procedūrām un metodiku attiecībā uz *CCP* uzraudzības
pārbaudes un novērtējuma procesu saskaņā ar EMIR 21. pantu



Satura rādītājs

| | |
|---|----|
| 1. Darbības joma..... | 3 |
| 2. Normatīvās atsauces, saīsinājumi un definīcijas | 4 |
| 3. Mērķis..... | 5 |
| 4. Atbilstība un ziņošanas pienākumi | 6 |
| 5. Pamatnostādnes par kopējām procedūrām un metodiku attiecībā uz CCP uzraudzības pārbaudēm un novērtējuma procesu saskaņā ar EMIR 21. pantu..... | 7 |
| 5.1 Pārskatīšanas un novērtējuma darbības joma..... | 7 |
| 5.2 Pārskatīšanas un novērtējuma formāts un apjoms..... | 7 |
| 5.3 Pārskatīšanas un novērtējuma biežums | 8 |
| 5.4 Informācija — avoti un metodika | 8 |
| 5.5 Uzraudzības pārbaudes rezultāti — metodika | 9 |
| I pielikums: CCP prasību saraksts ar to attiecīgajiem EMIR noteikumiem un atbilstošajiem RTS noteikumiem | 10 |
| II pielikums: Metodika katram pantam un prasībai | 11 |

1. Darbības joma

Kam ir paredzētas šīs pamatnostādnes?

1. Šīs pamatnostādnes attiecas uz kompetentajām iestādēm, kas izraudzītas saskaņā ar EMIR 22. pantu un kas uzrauga CCP, kuri saņēmuši atļauju saskaņā ar EMIR 14. pantu.

Ko nosaka šīs pamatnostādnes?

2. Šīs pamatnostādnes attiecas uz kopējām procedūrām un metodēm uzraudzības pārbaudes un novērtējuma procesam saskaņā ar EMIR 21. pantu. Šīs pamatnostādnes neievieš jaunas prasības centrālajiem darījumu partneriem papildus tām, kas noteiktas EMIR vai attiecīgajos tehniskajos standartos.

Kad šīs pamatnostādnes stājas spēkā?

3. Šīs pamatnostādnes piemēro no 2022. gada 11. maija.

2. Normatīvās atsauces, saīsinājumi un definīcijas

Atsauces uz tiesību aktiem

| | |
|--------------|--|
| EMIR | Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) 648/2012 (2012. gada 4. jūlijs) par ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, centrālajiem darījumu partneriem un darījumu reģistriem ¹ |
| ESMA regula | 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 ² |
| RTS 153/2013 | Komisijas Deleģētā regula (ES) Nr. 153/2013 (2012. gada 19. decembris) par prasībām centrālajiem darījumu partneriem ³ |

Saīsinājumi

| | |
|------|--------------------------------------|
| EEZ | Eiropas Ekonomikas zona |
| EFUS | Eiropas Finanšu uzraudzības sistēma |
| EK | Eiropas Komisija |
| ES | Eiropas Savienība |
| ESMA | Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestāde |

Definīcijas

4. Ja vien nav norādīts citādi, šajā apspriežu dokumentā izmantotajiem terminiem ir tāda pat nozīme kā EMIR un RTS regulā 153/2013.
5. Papildus izmanto šādus terminus:

| | |
|-----------------|---|
| <i>Kolēģija</i> | kolēģija, kas izveidota saskaņā ar EMIR 18. pantu |
|-----------------|---|

¹ OV L 201, 27.7.2012., 1. lpp.

² OV L 331, 15.12.2010., 84. lpp.

³ OV L 52, 23.2.2013., 41. lpp.

3. Mērķis

6. Šo pamatnostādņu pamatā ir *ESMA* regulas 16. panta 1. punkts un EMIR 21. panta 6. punkts.
7. Šo pamatnostādņu mērķis ir izveidot konsekventu, efektīvu un konstruktīvu uzraudzības praksi EFUS un nodrošināt vienotu, vienveidīgu un konsekventu EMIR 21. panta piemērošanu.
8. Konkrēti, šo pamatnostādņu mērķis ir palīdzēt kompetentajām iestādēm piemērot EMIR noteikumus saistībā ar centrālo darījumu partneru pārskatīšanu un novērtēšanu, sīkāk precizējot kopīgās procedūras un metodes, lai nodrošinātu šo pārskatu un novērtējumu formāta, biežumu un dziļuma konsekveni.

4. Atbilstība un ziņošanas pienākumi

Pamatnostādņu statuss

9. Šīs pamatnostādnes tiks izdotas saskaņā ar *ESMA* regulas 16. pantu un ir adresētas kompetentajām iestādēm. Saskaņā ar *ESMA* regulas 16. panta 3. punktu kompetentajām iestādēm ir jādara viss iespējamais, lai nodrošinātu atbilstību šīm pamatnostādņēm.
10. Pamatnostādņēs izklāstīts *ESMA* viedoklis par attiecīgām uzraudzības praksēm EFUS jeb par to, kā ES tiesību akti būtu jāpiemēro konkrētā jomā. Tāpēc *ESMA* sagaida, ka visas kompetentās iestādes, kurām šīs pamatnostādnes ir paredzētas, tās ievēros. Kompetentajām iestādēm, uz kurām attiecas pamatnostādnes, tās būtu jāievēro, atbilstīgi iekļaujot tās savā uzraudzības praksē (piemēram, grozot tiesisko regulējumu vai uzraudzības procedūras).

Ziņošanas prasības

11. Saskaņā ar *ESMA* regulas 16. panta 3. punktu kompetentajām iestādēm ir jāinformē *ESMA* par to, vai tās i) ievēro, ii) neievēro, bet plāno ievērot šīs pamatnostādnes, vai iii) neievēro un neplāno ievērot šīs pamatnostādnes.
12. Neievērošanas gadījumā kompetentajām iestādēm arī divu mēnešu laikā no dienas, kad šīs pamatnostādnes publicētas *ESMA* tīmekļa vietnē visās ES oficiālajās valodās, jāpaziņo *ESMA* arī pamatnostādņu neievērošanas iemesli.
13. Paziņojumu veidne ir pieejama *ESMA* tīmekļa vietnē. Pēc veidnes aizpildīšanas to nosūta *ESMA*.

5. Pamatnostādnes par kopējām procedūrām un metodiku attiecībā uz CCP uzraudzības pārbaudēm un novērtējuma procesu saskaņā ar EMIR 21. pantu

5.1 Pārskatīšanas un novērtējuma darbības joma

14. Pārskatīšanas un novērtējuma darbības joma aptver visas prasības *CCP*, kas noteiktas EMIR un tās papildinošajās Regulatīvo tehnisko standartu regulās (RTS 152/2013 un 153/2013 — kopā *CCP* RTS). Novērtējamo risku tvērums ietver visus riskus, kas ir vai varētu attiekties uz *CCP*, tostarp, bet ne tikai, finanšu un operacionālos riskus.
15. Detalizēts *CCP* prasību saraksts ar to attiecīgajiem EMIR noteikumiem un *CCP* RTS atbilstošajiem papildinošajiem pantiem ir iekļauts pamatnostādņu I pielikumā. Tie ietver kapitāla prasības, organizatoriskās prasības, uzņēmējdarbības veikšanas prasības, prudenciālās prasības, prasības hipotētiskā kapitāla aprēķināšanai un ar to saistītās ziņošanas un sadarbības mehānisma prasības.

5.2 Pārskatīšanas un novērtējuma formāts un apjoms

16. Kompetentajām iestādēm būtu jāņem vērā visas I pielikumā iekļautās prasības jebkura *CCP* pārskatīšanai un novērtējumam.
17. Veicot jebkura *CCP* pamatpārskatīšanu, kompetentajām iestādēm būtu jāņem vērā visi elementi, kas iekļauti II pielikuma trešajā slejā “Pamatpārskatīšana”. Pamatpārskats būtu jāveic pat tad, ja kompetentās iestādes nav informētas par izmaiņām, ko *CCP* veicis pārskatīšanas periodā. Tikai tad, ja kompetentās iestādes sevi pozitīvi novērtē, ka pārskatīšanas periodā nav notikušas izmaiņas attiecībā uz konkrētām prasībām, pieņēmumiem un faktiem, kas ir to iepriekšējās analīzes pamatā, to attiecīgā pamatpārskatīšana var būt mazāk strukturēta.
18. Ja attiecībā uz konkrētu prasību *CCP* atbilst kādam no faktoriem, kas var pamatot II pielikuma ceturtajā slejā minēto paplašināto vai īpašo pārskatīšanu, kompetentajām iestādēm attiecībā uz šo prasību papildus pamatpārbaudei būtu jāveic II pielikuma piektajā slejā aprakstītā paplašinātā pārskatīšana.
19. Ja kompetentās iestādes veic *CCP* pārskatīšanu un novērtējumu attiecībā uz konkrētu prasību, būtu jāņem vērā visi attiecīgie ESMA pieņemtie 3. līmeņa akti (piemēram, pamatnostādnes, atzinumi, jautājumi un atbildes).

5.3 Pārskatīšanas un novērtējuma biežums

20. Kompetentajām iestādēm reizi gadā (t. i., katru gadu) būtu jāveic *CCP* uzraudzības pārbaudes un novērtējuma process.
21. Papildu *ad hoc* pārskatīšana
 1. Jebkādām būtiskām un neregulārām *CCP* operacionālā, tehniskā, finansiālā vai prudenciālā rakstura izmaiņām, kas nav minētas 7. pamatnostādnes 2. punktā, vajadzētu būt pamatam papildu *ad hoc* uzraudzības pārbaudes un novērtējuma procesam, iespējams, pēc šo būtisko izmaiņu īstenošanas, lai īpaši atspoguļotu sistēmu, procesu, procedūru un riska pārvaldības politikas izmaiņu ietekmi uz *CCP*.
 2. Šajā *ad hoc* pārskatīšanā nav iekļautas šādas būtiskas un vienreizējas izmaiņas:
 - *CCP* darbības un pakalpojumu paplašināšana (saskaņā ar EMIR 15. pantu);
 - ierosinātā *CCP* iegāde (saskaņā ar EMIR 32. pantu);
 - izmaiņas attiecībā uz ārpalpojumu izmantošanu nozīmīgām darbībām, kas saistītas ar *CCP* riska pārvaldību (saskaņā ar EMIR 35. pantu);
 - *CCP* modeļu un parametru pārskatīšana (saskaņā ar EMIR 49. pantu);
 - jauns sadarbības mehānisms ar *CCP* (saskaņā ar EMIR 54. pantu).
 3. Šajā *ad hoc* pārskatīšanā galvenā uzmanība būtu jāpievērš pašām izmaiņām un visām iespējamajām šo izmaiņu sekām uz *CCP* atbilstību visām I pielikumā uzskaitītajām prasībām.
 4. Ja tiek veikta šāda *ad hoc* pārskatīšana, kompetentajai iestādei būtu jāinformē kolēģija par šīs *ad hoc* pārskatīšanas rezultātiem. Šai kolēģijas informēšanai vajadzētu notikt pēc iespējas ātrāk pēc *ad hoc* pārskatīšanas, un to nevajadzētu atlikt, lai tā būtu daļa no ikgadējās pārskatīšanas procesa.

5.4 Informācija — avoti un metodika

22. Uzraudzības pārbaudēm nepieciešamā informācija būtu jāiegūst, izmantojot divus savstarpēji papildinošus kanālus:
 - informāciju, kas iegūta, kompetentajām iestādēm veicot nepārtrauktu pastāvīgu uzraudzību un pārraudzību, un
 - informāciju, ko kompetentās iestādes savākušas īpaši nolūkā veikt pārskatīšanu un novērtējumu.
23. Informācijā, kas iegūta, kompetentajām iestādēm nepārtraukti pastāvīgi uzraugot un pārraugot *CCP*, būtu jāietver vismaz šādi elementi:
 - jebkāda informācija par izmaiņām, ko *CCP* ieviesis kādā no tā iekšējiem noteikumiem, piemēram, procedūrām, politikas nostādnēm, kā visa publiski pieejamā informācija;

- visi dokumenti, pierādījumi, novērtējumi, apstiprinājumi un ziņojumi, ko iesniedzis CCP vai sagatavojusi kompetentā iestāde saistībā ar CCP pieteikumiem par darbības un pakalpojumu paplašināšanu (saskaņā ar EMIR 15. pantu) un būtisku izmaiņu apstiprināšanu CCP modeļos un parametros (saskaņā ar EMIR 49. pantu), kā arī visi jautājumi, kuri gada laikā varēja radīt pamatu īpašam kompetentās iestādes apstiprinājumam un kolēģijas atzinumam (piemēram, EMIR 30.–32., 35., 51. un 54. pants);
 - visa gada laikā kompetentās iestādes veikto dokumentu pārbažu un pārbažu uz vietas rezultāti.
24. Informācijai, ko kompetentās iestādes savākušas, īpaši lai veiktu CCP mehānismu, stratēģiju, procesu un mehānismu pārskatīšanu un novērtējumu, papildinot informāciju, kas savākta nepārtrauktās pastāvīgās uzraudzības un pārraudzības rezultātā, būtu jāietver vismaz šādi elementi:
- pārskatīts CCP pašnovērtējums;
 - atjaunināta informācija, ko sniedzis CCP, kas ietverta ESMA neformālajā riska novērtējuma ziņojuma veidnē, kurā būtu jāiekļauj analītisks pārskats par CCP riska modeļu darbības rezultātiem iepriekšējā gadā, tostarp par tā maržu modeļiem, stresa testu sistēmu, likviditātes riska kontroli, nodrošinājuma diskontiem;
 - detalizēti *ad hoc* sanāksmju un pārrunu protokoli ar CCP pārstāvi, kas organizētas, lai sagatavotu pārskatīšanas un attiecīgās kolēģijas sanāksmes;
 - CCP sagatavoti dokumenti iesniegšanai tā riska komitejai, kā arī riska komitejas atzinumus.

5.5 Uzraudzības pārbaudes rezultāti — metodika

25. Lai informētu kolēģiju, uzraudzības pārbaudes rezultāti būtu jāiesniedz kā ziņojums. Kolēģijas locekļu un ESMA labā šajā ziņojumā ne tikai vispirms būtu jāiekļauj to ievērojamo izmaiņu apkopojums, kas notikušas CCP visā pārskata periodā, bet arī jāsniedz atjaunināta, visaptveroša un konsolidēta novērtējuma versija, skaidri nošķirot to, kas ir mainījies pārskata periodā, un iepriekšējā gada novērtējums.

I pielikums: CCP prasību saraksts ar to attiecīgajiem EMIR noteikumiem un atbilstošajiem RTS noteikumiem

| Prasības | EMIR noteikumi | RTS 152/2013 un 153/2013 |
|--|------------------------|----------------------------|
| Kapitāla prasības | 16. pants | RTS 153/2013 1.–5. pants |
| Organizatoriskas prasības | | |
| Vispārīgi noteikumi par organizatoriskajām prasībām | 26. pants | RTS 153/2013 3.–11. pants |
| Augstākā vadība un valde | 27. pants | |
| Riska komiteja | 28. pants | |
| Dokumentācija | 29. pants | RTS 153/2013 12.–16. pants |
| Kompetento iestāžu informēšana | 31. panta 1. punkts | |
| Interesu konflikts | 33. pants | |
| Uzņēmējdarbības nepārtrauktība | 34. pants | RTS 153/2013 17.–23. pants |
| Ārpakalpojumi | 35. pants | |
| Uzņēmējdarbības ētikas normas [EMIR 2. nodaļa] | | |
| Vispārīgi noteikumi par uzņēmējdarbības ētikas normām | 36. pants | |
| Prasības dalībai | 37. pants | |
| Pārredzamība | 38. pants | |
| Nodalīšana un pārnēsamība | 39. pants | |
| Uzraudzības prasības [EMIR 3. nodaļa] | | |
| Riska pozīciju pārvaldība | 40. pants | |
| Maržu prasības | 41. pants | RTS 153/2013 24.–28. pants |
| Fonds saistību neizpildes gadījumā | 42. pants | RTS 153/2013 29.–31. pants |
| Citi finanšu resursi | 43. pants | |
| Likviditātes riska kontrole | 44. pants | RTS 153/2013 32.–34. pants |
| Secība saistību neizpildes gadījumā | 45. pants | RTS 153/2013 35.–36. pants |
| Nodrošinājuma prasības | 46. pants | RTS 153/2013 35.–36. pants |
| Ieguldījumu politika | 47. pants | RTS 153/2013 43.–46. pants |
| Procedūras saistību neizpildes gadījumā | 48. pants | |
| Pārskats par modeļiem, stresa testiem un atpakaļejošām pārbaudēm | 49. pants | RTS 153/2013 47.–61. pants |
| Norēķini | 50. pants | |
| Aprēķini un ziņošana Regulas (ES) Nr. 575/2013 par prudenčuālajām prasībām attiecībā uz kredītiestādēm un ieguldījumu brokeru sabiedrībām vajadzībām [EMIR 4. nodaļa] | | |
| KCCP aprēķināšana | 50.a pants | |
| Vispārēji noteikumi KCCP aprēķināšanai | 50.b pants | |
| Informācijas ziņošana | 50.c pants | |
| Specifisko posteņu, par ko ziņo CCP, aprēķināšana | 50.d pants | |
| Sadarbspējas mehānismi [EMIR V sadaļa] | | |
| Sadarbspējas mehānismi | 51. pants | |
| Riska pārvaldība | 52. pants | |
| Maržu noteikšana CCP vidū | 53. pants | |

II pielikums: Metodika katram pantam un prasībai

| Prasības | EMIR | Pamatpārskatīšana | Faktori, kas var būt par pamatu paplašinātai/konkrētai pārskatīšanai | Pamatpārskatīšana |
|--------------------------|---|--|--|-------------------|
| Kapitāla prasības | 16. pants RTS 152/2013 1.–5. pants | <ul style="list-style-type: none"> - CCP kapitāla prasību aprēķināšana metožu novērtējums, tostarp jebkādas izmaiņas attiecībā uz ievaddatiem/procesiem/scenārijiem, ko piemēro, lai aprēķinātu kapitāla prasības attiecībā uz: <ul style="list-style-type: none"> o darbības izbeigšanu vai pārstrukturēšanu, ietverot to, kā CCP nosaka pienācīgu laikposmu savu darbību izbeigšanai; o operacionālajiem un juridiskajiem riskiem; o kredītrisku, darījuma partnera kredītrisku, tirgus risku; o darījumdarbības risku, ietverot darījumdarbības iniciatīvu ietekmi pārskatīšanas periodā, un CCP apgrozījuma attīstību; - CCP rīcībā esošā kapitāla apjoma aprēķināšanas un uzraudzības procedūru novērtējums; | - nav attiecināms (n/a) | - n/a |

| | | | | |
|---|--|---|---|--|
| | | <ul style="list-style-type: none"> - Analītisks pārskats par CCP ieguldījumiem tā kapitālā, tostarp detalizēta informācija par kapitāla likvidācijai un piekļuvei vajadzīgo laiku; - Pierādījumi par CCP kapitāla prasībām un pozīciju pārskatīšanas periodā, tostarp: <ul style="list-style-type: none"> o kapitāla prasību apjoms dalījumā pa riska veidiem; o kapitāla summa, tostarp nesadalītā peļņa un rezerves, kas ir atbilstīgas kapitāla prasību segšanai; o pierādījumi, ka CCP pārskata periodā ir pastāvīgs un pieejams sākumkapitāls vismaz 7,5 miljonu EUR apmērā. | | |
| Organizatoriskās prasības [IV sadaļas 1. nodaļa] | | | | |
| Vispārīgi noteikumi | 26. pants RTS 153/2013 3.–11. pants | <ul style="list-style-type: none"> - Korporatīvās un organizatoriskās struktūras, pārvaldības mehānisma, riska pārvaldības un iekšējās kontroles mehānismu, tostarp atbilstības funkcijas, iekšējās revīzijas un informācijas tehnoloģiju struktūras, novērtējums. | <ul style="list-style-type: none"> - CCP pieder noteiktai grupai un tam ir kopīgas atsevišķas funkcijas, personāls vai sistēmas ar vienu vai vairākām grupas vienībām. | <ul style="list-style-type: none"> - Novērtējums par mijiedarbību ar citām grupas struktūrām (piemēram, personāla kopīgošana, norīkošana, ārpakalpojumi) un attiecīgie neatkarības aizsardzības pasākumi (piemēram, interešu konflikta politika, pakalpojumu līmeņa vienošanās, savlaicīga paziņošana par saistību izbeigšanu, pārejas noteikumi saistību izbeigšanas gadījumā utt.). |

| | | | | |
|---------------------------------|---|--|--|--|
| Augstākā vadība un valde | 27. pants | <ul style="list-style-type: none"> - Pierādījumi par <i>CCP</i> augstākās vadības un valdes locekļu pieredzi, kas nodrošinātu, ka viņiem ir pietiekami laba reputācija un pieredze, lai nodrošinātu stabilu un piesardzīgu <i>CCP</i> vadību; - Valdes locekļu neatkarības novērtējums; - Novērtējums attiecībā uz valdes sastāvu un visiem atjauninājumiem, kas ieviesti pārskatīšanas periodā, tostarp pierādījumi, ka vismaz viena trešdaļa un ne mazāk kā divi locekļi ir neatkarīgi, un sīkas ziņas par tīrvērtes dalībnieku klientu pārstāvību. | - n/a | - n/a |
| Riska komiteja | 28. pants | <ul style="list-style-type: none"> - Riska komitejas sastāva un lomas novērtējums, ietverot jebkādas izmaiņas pārskatīšanas periodā, kas saistītas ar: <ul style="list-style-type: none"> o tās locekļu pieredzi un kompetenci, kā arī priekšsēdētāja neatkarību; o darba uzdevumu un procedūru, saskaņā ar kuru notiek apspriedes ar riska komiteju par jebkādiem pasākumiem, kas var ietekmēt <i>CCP</i> riska pārvaldību; o sīkāku informāciju par klientu pārstāvību riska komitejā. | | |
| Dokumentācija | 29. pants RTS 153/2013 12.–16. pants | <ul style="list-style-type: none"> - Novērtējums par procedūrām/politiku, kas īstenota, lai uzturētu darījumus, pozīcijas un darījumdarbības reģistrus, ietverot jebkādas izmaiņas attiecībā uz to, kā centrālais darījumu partneris nodrošina pienācīgu | - <i>CCP</i> uztur dokumentāciju ārpus Savienības; | - ja <i>CCP</i> uztur dokumentāciju ārpus Savienības, pierādījumi par to, kā pilnīga piekļuve dokumentiem tiek nodrošināta NCA, <i>ESMA</i> un ECBS. |

| | | | | |
|---------------------------------------|----------------------------|---|--|---|
| | | informācijas noturību, pieejamību un detalizāciju. | | |
| Kompetento iestāžu informēšana | 31. panta 1. punkts | - NCA paziņošanas procedūru novērtējums par jebkādām izmaiņām tās vadībā un jebkāda cita informācija, kas vajadzīga, lai novērtētu atbilstību 27. panta 1. punktam vai 27. panta 2. punkta otrajai daļai. | - n/a | - n/a |
| Interesu konflikts | 33. pants | <ul style="list-style-type: none"> - Interesu konflikta pārvaldības politikas novērtējums uzņēmuma līmenī, tostarp jebkādas izmaiņas attiecībā uz: <ul style="list-style-type: none"> o politiku/procedūrām/instrumentiem, lai novērtētu un mazinātu visus iespējamus un faktiskos interešu konflikta riskus attiecībā uz vadītājiem, darbiniekiem vai jebkuru personu, kurai ir tieša vai netieša kontrole vai ciešas saiknes; o procedūrām, saskaņā ar kurām atklāj interešu konfliktu avotu vispārējo raksturu ar tīrvērtes dalībniekiem vai tīrvērtes dalībnieka klientiem; o procedūrām, lai novērstu CCP sistēmā glabātās informācijas ļaunprātīgu izmantošanu; - Novērtējums, ka atalgojuma politika arvien atbilst CCP darījumdarbības un riska stratēģijām, korporatīvajai kultūrai un vērtībām, CCP ilgtermiņa interesēm un | - Centrālais darījuma partneris ir mātes uzņēmums vai meitas uzņēmums; | <ul style="list-style-type: none"> - Novērtējums par procedūrām un politiku, lai novērstu, uzraudzītu un atklātu jebkādu interešu konfliktu, kas var rasties citu uzņēmumu, attiecībā pret kuriem CCP ir mātes uzņēmums vai meitas uzņēmums, struktūras un uzņēmējdarbības rezultātā; - Attiecībā uz pārskatīšanas periodu — ziņas par visiem jauniem interešu konfliktiem, kas grupas struktūras rezultātā varētu būt identificēti/mazināti. |

| | | | | |
|---------------------------------------|---|--|--|---|
| | | <p>pasākumiem, kas veikti, lai novērstu interešu konfliktu;</p> <ul style="list-style-type: none"> - Pierādījumi par labu korporatīvo kultūru, interešu konfliktu pārvaldību un trauksmes celšanas procesiem. - Šādu pasākumu efektivitātes novērtēšanas un biežas pārskatīšanas procedūru novērtējums. | | |
| Uzņēmējdarbības nepārtrauktība | 34. pants RTS 153/2013 17.–23. pants | <ul style="list-style-type: none"> - CCP darbības nepārtrauktības politikas un negadījumu seku novēršanas plāna galveno elementu novērtējums, tostarp: <ul style="list-style-type: none"> o sīki izstrādāta informācija par darbības nepārtrauktības politikas pārvaldības un apstiprināšanas procesu un neatkarīgās pārskatīšanas biežumu un ar to saistītajiem procesiem; o sīki izstrādāta informācija par kritiski svarīgajām uzņēmējdarbības funkcijām un sistēmām, uz kurām attiecas politika, to identificēšanai izmantotajiem kritērijiem un metodēm, kas izmantotas, lai nodrošinātu to nepārtrauktību; o atsauce uz savstarpējo saistību un atkarību no citām ārējām sistēmām un pakalpojumiem, tostarp uz to, kā centrālais darījumu partneris pārvalda iespējamo uzņēmējdarbības risku, kas var attiekties uz abiem. Analītisks | <ul style="list-style-type: none"> - Centrālais darījuma partneris ir mātes uzņēmums vai meitas uzņēmums. | <ul style="list-style-type: none"> - Grupas darbības nepārtrauktības un negadījuma seku novēršanas plāna politikas novērtējums, ja šāda politika var ietekmēt CCP. |

| | | | | |
|-----------------------------|-------------------------|---|---|--|
| <p>Ārpakalpojumi</p> | <p>35. pants</p> | <p>pārskats par CCP satricinājumu vispārējo ietekmi uz tā apkalpoto tirgu;</p> <ul style="list-style-type: none"> o sīki izstrādāta informācija par CCP procedūrām, lai nodrošinātu savlaicīgus un pienācīgus norēķinus vai klientu un tīrvērtes dalībnieku aktīvu un pozīciju pārvešanu tā atļaujas anulēšanas gadījumā. - Darbības nepārtrauktības un negadījuma seku novēršanas testēšanas pasākumu un rezultātu analītisks pārskats, ietverot biežumu un mehānismu, lai ņemtu vērā un īstenotu testā gūto pieredzi. - Krīzes funkcijas sastāva/procedūru novērtējums. - Komunikācijas plāna novērtējums, tostarp tas, kā krīzes laikā tiek informētas visas attiecīgās ieinteresētās personas. <p>- Visu ārpakalpojumu pasākumu apraksts, tostarp sīka informācija par ārpakalpojumā nodotajām funkcijām, pakalpojumu sniedzēju identifikācija, pakalpojumu līmenis, darbības rādītāji un saistību izbeigšanas nosacījumi;</p> <p>- Pušu atbildības, tiesību un pienākumu analītisks pārskats, tostarp pierādījumi par to, vai CCP joprojām ir pilnībā atbildīgs par visu savu pienākumu izpildi saskaņā ar</p> | <p>- CCP uztic ārpakalpojumu sniedzējiem nozīmīgākās darbības, kas saistītas ar riska pārvaldību;</p> | <p>- NCA veiktā novērtējuma kopsavilkums, kas pamatojis šādu ārpakalpojumu apstiprināšanu.</p> |
|-----------------------------|-------------------------|---|---|--|

| | | | | |
|--|------------------|--|-------|-------|
| | | EMIR un kā tas nodrošina, lai vienmēr tiek izpildīti visi 35. panta nosacījumi; | | |
| Uzņēmējdarbības ētikas normas [IV sadaļas 2. nodaļa] | | | | |
| Vispārīgi noteikumi par uzņēmējdarbības ētikas normām | 36. pants | - Pierādījumi, ka <i>CCP</i> ir pieejami, pārredzami un taisnīgi noteikumi sūdzību ātrai izskatīšanai. | - n/a | - n/a |
| Prasības dalībai | 37. pants | - Novērtējums par kritērijiem, kas jāizpilda, lai kļūtu par tīrvērtes dalībnieku, tostarp analītisks pārskats par to taisnīgumu, objektivitāti, saistību ar risku un proporcionalitāti attiecībā pret risku, ietverot tīrvērtes pakalpojumu sniegšanu klientiem. - Novērtējums par procesu un procedūrām, kas ieviestas, lai varētu pastāvīgi izvērtēt atbilstību minētajiem kritērijiem un veikt ikgadēju visaptverošu pārskatīšanu, kā arī pārvaldīt gadījumus, kad minētās prasības vairs netiek pildītas. | - n/a | - n/a |
| Pārredzamības prasības | 38. pants | - Pierādījumi par to, ka <i>CCP</i> atklāj attiecīgo informāciju (piemēram, tīmekļa vietne), tostarp: <ul style="list-style-type: none"> o publisko informāciju par cenām un maksām, atlaidēm un rabatēm, nosacījumiem šo atlaižu saņemšanai; | - n/a | - n/a |

| | | | | |
|----------------------------------|------------------|---|--|--|
| | | <ul style="list-style-type: none"> ○ atklāj informāciju tīrvērtes dalībniekiem un klientiem par riskiem, kas saistīti ar sniegtajiem pakalpojumiem; ○ atklāj informāciju tīrvērtes dalībniekiem un NCA par cenu, kas izmantota, lai aprēķinātu dienas beigu riska pozīcijas; ○ publisko informāciju par darījumu, kam veikta tīrvērtē, apjomu attiecībā uz katru aktīvu klasi, kurai veikta tīrvērtē; ○ publisko informāciju par dalībniekiem noteiktajām juridiskajām, operatīvajām un tehniskajām prasībām; <p>- CCP īstenoto procesu novērtējums, lai nodrošinātu tīmekļa vietņu pastāvīgu atjaunināšanu un precizitāti, kā arī jebkādos pierādījumus par atjauninājumiem pārskatīšanas periodā.</p> | | |
| Nodalīšana un pārnesamība | 39. pants | <p>- CCP noteikumu, procedūru un komercnoteikumu novērtējums, lai:</p> <ul style="list-style-type: none"> ○ atsevišķi identificētu un reģistrētu visus aktīvus un pozīcijas konkrētā tīrvērtes dalībnieka kontā no CCP aktīviem un no aktīviem un pozīcijām, citu tīrvērtes dalībnieku kontā; ○ nodrošina, ka visi konkrētā tīrvērtes dalībnieku klientu aktīvi un pozīcijas tiek turēti nošķirti no aktīviem un pozīcijām tīrvērtes dalībnieka iestādes kontā (pilnīga klientu nošķiršana); | <p>- CCP papildus iestādes kontiem, pilnīgas un individuālas klientu nošķiršanas kontiem piedāvā vēl citus nošķirtu kontu risinājumus.</p> | <p>- Novērtējums par tīrvērtes dalībniekiem pieejamo nošķirto kontu papildu veidiem, tostarp pierādījumi, ka šāds formāts nodrošina vismaz līdzvērtīgu nošķiršanu un aktīvu un pozīciju aizsardzību kā CCP pilnīgas un individuālas klientu nošķiršanas mehānismi.</p> |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | <ul style="list-style-type: none"> ○ nodrošina, ka CCP piedāvā pilnīgas un individuālas klientu nošķiršanas izvēli; ○ nodrošina, ka gadījumos, kad klients ir izvēlējis individuālu nošķiršanu, visi klienta aktīvi un pozīcijas tiek turēti atsevišķi no aktīviem un pozīcijām iestādes kontā un citu tīrvērtes dalībnieka klientu aktīviem un pozīcijām; - Apraksts un analītisks pārskats par mehānismu, kas paredzēts, lai publiskotu izmaksas un aizsardzības līmeņus katram piedāvātajam konta veidam; - Apraksts par CCP iespēju atkārtoti izmantot nodrošinājumu, ko tīrvērtes dalībnieki un to klienti iemaksā kā maržu vai iemaksu saistību neizpildes fondā; - Novērtējums par CCP mehānismiem, lai tīrvērtes dalībnieka saistību neizpildes gadījumā nodrošinātu: <ul style="list-style-type: none"> ○ iespēju pārnest pozīcijas un aktīvus, kas ir to klientu turējumā, kuri nav pildījuši saistības; ○ ja šāds mēģinājums neizdodas — šādu pozīciju likvidāciju un nodrošinājuma atdošanu klientiem. | | |
| <p>Uzraudzības prasības [EMIR IV sadaļas 3. nodaļa]</p> | | | | |

| | | | | |
|---|--|---|--|--|
| <p>Riska pozīciju pārvaldība</p> | <p>40. pants</p> | <ul style="list-style-type: none"> - Metodikas un procedūru analītisks pārskats, lai gandrīz reālā laikā novērtētu CCP likviditāti un kredītriskus ar tīrvērtes dalībniekiem, ietverot CCP izmantoto cenu avotu aprakstu un analītisku pārskatu. | <ul style="list-style-type: none"> - Riska darījumi ar sadarbspējīgu(-iem) CCP(-iem). | <ul style="list-style-type: none"> - Metodikas un procedūru analītisks pārskats, lai novērtētu CCP likviditāti un kredītriska darījumus ar sadarbspējīgu(-iem) CCP(-iem). |
| <p>Maržu prasības</p> | <p>41. pants RTS 153/2013 24.–28. pants</p> | <ul style="list-style-type: none"> - Sākotnējo maržu aprēķināšanas modeļa novērtējums un modeļa pamatparametru (ticamības intervāls, atskaites periods, likvidācijas periods) kalibrēšanai piemērotā metodika, tostarp tas, kā tas nodrošina, ka sākotnējās maržas nav mazākas par tām, kas tiktu aprēķinātas, piemērojot EMIR minimālās prasības; - Novērtējums par procedūrām sākotnējo maržu iekasēšanai, ietverot tekošās dienas maržas aprēķināšanas periodiskumu un tekošās dienas maržas pieprasījuma robežvērtībām; - Novērtējums par izvēlēto iespēju, lai ierobežotu procikliskumu, ietverot datus par to, kā modelis darbojas spriedzes periodos; - Kopsavilkums un analītisks pārskats par CCP maržu atpakaļejošās pārbaudes rezultātiem pārskatīšanas periodā. | <ul style="list-style-type: none"> - CCP veic tīrvērti vairākām aktīvu klasēm (ar dažādiem maržas modeļiem); - Ārpusbiržas atvasināto instrumentu pamatparametri (ticamības intervāls / likvidācijas periods) ir zemāki nekā standarts (kā atļauts saskaņā ar RTS 153/2013 24. panta 4. punktu un 26. panta 4. punktu); - CCP piemēro portfeļa maržu noteikšanu dažādiem instrumentiem, tostarp gadījumos, kad 80 % robežvērtība ir atcelta; - CCP aprēķina un maina maržas, izmantojot sadarbspējas saikni. | <ul style="list-style-type: none"> - Sīki izstrādāts novērtējums par maržu noteikšanas metodiku katrai aktīvu klasei / darījumdarbības virzienam; - Ja viens modelis aptver vairākus darījumdarbības virzienus — novērtējums par to, kā tiek ņemtas vērā katras aktīvu klases raksturīgās iezīmes; - Ja ārpusbiržas atvasināto instrumentu pamatparametri ir zemāki par standartu, pierādījumi, ka šādi parametri būtu piemērotāki, ņemot vērā attiecīgo ārpusbiržas atvasināto instrumentu specifiskās iezīmes; - Novērtējums par pieeju, ko piemēro portfeļa maržu noteikšanai dažādu instrumentu vidū, tostarp: - maržu samazinājuma būtiskuma analītisks pārskats; - novērtējums par korelācijas līmeni un ticamību (vai jebkuru citu statistisko atkarības parametru) finanšu instrumentu vidū; |

| | | | | |
|----------------------------------|---|--|--|---|
| | | | | - analītisks pārskats par metodiku un procedūrām, kas ieviestas, lai apmainītos ar maržām, izmantojot sadarbbspējīgu saikni. |
| Saistību neizpildes fonds | 42. pants RTS 153/2013 29.–31. pants | <ul style="list-style-type: none"> - Katra saistību neizpildes fonda lieluma noteikšanas metodikas novērtējums, tostarp tas, kā tiek noteiktas minimālās/maksimālās vērtības; - Saistību neizpildes fonda iemaksu piešķiršanas metodikas novērtējums un procedūras saistību neizpildes fonda iemaksu iekasēšanai, tostarp papildināšanai; - Analītisks pārskats par metodiku, kas izmantota, lai definētu ārkārtējus, bet ticamus scenārijus attiecībā uz saistību neizpildes fonda lielumu, tostarp jebkādas izmaiņas spriedzes scenāriju sarakstā pārskatīšanas periodā; - Novērtējums par saistību neizpildes fonda piemērotību ārkārtējos, bet iespējamajos tirgus apstākļos izturēt tā tīrvērtes dalībnieka saistību neizpildi, ar kuru tam ir lielākie riska darījumi, vai otrā un trešā lielākā tīrvērtes dalībnieka saistību neizpildi (1. vai 2.+ 3. segums). | - CCP ir vairāki darījumdarbības virzieni / saistību neizpildes fondi. | - Attiecībā uz katru saistību neizpildes fonda /darījumdarbības virzienu — detalizēts novērtējums par saistību neizpildes fonda lieluma noteikšanas metodiku, ietverot īpašus ārkārtējos, bet ticamus scenārijus. |
| Citi finanšu resursi | 43. pants | - Priekšfinansēto resursu pietiekamības novērtējums, lai ārkārtējos, bet ticamos tirgus apstākļos izturētu to divu tīrvērtes | n/a | n/a |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | dalībnieku saistību neizpildi, ar kuriem tam ir lielākie riska darījumi (2. segums). | | |
| Likviditātes riska kontrole | 44. pants RTS 153/2013 32.–34. pants | <ul style="list-style-type: none"> - Pieejamo likvīdo resursu novērtējums, iedalot pēc to veida (skaidra nauda, piešķirtās kredītlīnijas, piešķirtie repo darījumi, plaši tirgojami finanšu instrumenti) un ietverot likviditātes nodrošinātāju identitāti, pušu saistības, tiesības un pienākumus, saistību izbeigšanas nosacījumus utt. - CCP likviditātes riska darījumu analītisks pārskats, tostarp pārskatīšanas periodā — datumi/scenāriji / tīrvērtes dalībnieki, kas rada lielākos riska darījumus; - Riska pārvaldības sistēmas analītisks pārskats, tostarp tas, kā likviditātes vajadzības tiek segtas saskaņā ar dažādiem scenārijiem, kā arī jebkādas norādes pārkāpuma gadījumā un veikto pasākumu apraksts; - Likviditātes riska darījumu koncentrācijas riska kontroles un uzraudzības procedūras un metodikas novērtējums. | <ul style="list-style-type: none"> - CCP veic instrumentu tīrvērti vairākās valūtās; - CCP veic tīrvērti instrumentiem ar augstām likviditātes prasībām (piemēram, repo darījumiem). | <ul style="list-style-type: none"> - Apraksts un novērtējums par pasākumiem, kas ieviesti, lai būtu pieejama likviditāte dažādās valūtās; - Par katru valūtu — apraksts un novērtējums par modeļiem/procedūrām/procesiem, kas ieviesti likviditātes riska darījumu uzraudzībai. |
| Secība saistību neizpildes gadījumā | 45. pants RTS 153/2013 35.–36. pants | <ul style="list-style-type: none"> - CCP īpašo pašu resursu aprēķināšanas metodikas novērtējums; - CCP pašu resursu sastāva apraksts un analītisks pārskats un analītisks pārskats par to, kā tie tiek ieguldīti; | <ul style="list-style-type: none"> - Vairāki darījumdarbības virzieni / secība saistību neizpildes gadījumā; - CCP pašu resursu sadalījums atbilstoši | <ul style="list-style-type: none"> - Novērtējums par to, kā CCP nodrošina pašu resursu pienācīgu sadali atbilstoši secībai saistību neizpildes gadījumā. |

| | | | | |
|--------------------------------------|--|--|---|--|
| | | <ul style="list-style-type: none"> - Procedūru pašu resursu līmeņa uzraudzībai novērtējums un NCA informēšana pārkāpuma gadījumā; | <p>secībai saistību neizpildes gadījumā;</p> | |
| <p>Nodrošinājuma prasības</p> | <p>46. pants RTS 153/2013 37.–42. pants</p> | <ul style="list-style-type: none"> - <i>CCP</i> pieņemtā atbilstošā nodrošinājuma tvēruma novērtējums, tostarp sīka informācija par instrumentiem vai skaidru naudu Savienības valūtās un to, vai tiek piemēroti jebkādi ierobežojumi; - Turētā nodrošinājuma (dalījumā pa valūtām) sadalījums i) skaidrā naudā Savienības valūtās un valūtā, kas nav Savienības valūta, ii) valsts obligācijās, iii) ES uzņēmumu obligācijas un iv) cits vērtspapīros, kas emitēti Savienības valūtā; - Novērtējums par metodiku un kritērijiem, kas piemēroti, lai nodrošinātu, ka bezskaidras naudas nodrošinājumu var uzskatīt par augstas likviditātes nodrošinājumu saskaņā ar RTS 153/2013 I pielikumu; - Novērtējums par <i>CCP</i> piemērotajām riska mazināšanas metodēm attiecībā uz nodrošinājumu, tostarp: <ul style="list-style-type: none"> o metodika un procedūras, ko piemēro nodrošinājuma novērtēšanai tuvu reāllaikam; o diskontu kalibrēšanas metodika; | <ul style="list-style-type: none"> - <i>CCP</i> pieņem un tur skaidru naudu vairākās valūtās. - <i>CCP</i> pieņem un tur finanšu instrumentus vairākās valūtās. | <ul style="list-style-type: none"> - Attiecībā uz katru valūtu — novērtējums par to, kā <i>CCP</i> pārvalda valūtas risku, kas izriet no tā turējumā esošā nodrošinājuma, nošķirot skaidru naudu un finanšu instrumentus. |

| | | | | |
|----------------------|--|--|--|---|
| Ieguldījumu politika | 47. pants RTS 153/2013 43.– 46. pants | <ul style="list-style-type: none"> ○ koncentrācijas limitu noteikšanas metodika. | | |
| | | <ul style="list-style-type: none"> - CCP ieguldījumu politikas analītisks pārskats un jo īpaši ieguldītā nodrošinājuma sadalījums skaidras naudas un finanšu instrumentu formā pārskatīšanas periodā; - To finanšu instrumentu saraksts, kuros CCP ir veicis ieguldījumus pārskatīšanas periodā, un novērtējums par metodiku, kas izmantota, lai noteiktu, vai šādi instrumenti ir ar augstu likviditāti saskaņā ar RTS 153/2013 II pielikumu; - To finanšu iestāžu analītisks pārskats, kurās tiek noguldīti instrumenti, un metodika, kas izmantota, lai novērtētu kredītrisku, un pasākumus, lai novērstu zaudējumus, ko rada šo iestāžu saistību neizpilde vai maksātnespēja. - Novērtējums par metodēm, kas izmantotas, lai noteiktu koncentrācijas limitus, uzraudzītu CCP finanšu resursu koncentrāciju un mazinātu koncentrācijas risku. | <ul style="list-style-type: none"> - CCP tur ieguldījumus vairākās valūtās; - CCP ir ieviesis pasākumus finanšu instrumentu / skaidras naudas uzturēšanai ar trešo personu (ES kredītiestādi vai trešās valsts finanšu iestādi); | <ul style="list-style-type: none"> - Novērtējums par to, kā CCP pārvalda valūtas risku, kas izriet no tā <ul style="list-style-type: none"> ○ ieguldījumiem finanšu instrumentos; ○ noguldījumiem skaidrā naudā; - Ja aktīvi ir noguldīti pie trešās personas, analītisks pārskats par to, kā tīrvērtes dalībniekiem piederošie aktīvi ir identificējami atsevišķi no CCP un trešai personai piederošiem aktīviem. |
| Procedūras saistību | 48. pants | <ul style="list-style-type: none"> - Analītisks pārskats par CCP procedūru piemērotību un izpildāmību saistību neizpildes pārvaldībā, tostarp identificējot | <ul style="list-style-type: none"> - Vairāki darījumdarbības virzieni (instrumentu | <ul style="list-style-type: none"> - Attiecībā uz katru darījumdarbības virzienu — piemērojamās saistību neizpildes procedūras apraksts; |

| | | | | |
|--|--|--|---|--|
| <p>neizpildes gadījumā</p> | | <p>saistību neizpildi, informējot ieinteresētās personas, pārvedot klientu aktīvus un pozīcijas, likvidējot portfeļus.</p> <ul style="list-style-type: none"> - Apraksts un pierādījumi, ka tiek veikta regulāra testēšana un verifikācija, lai nodrošinātu procedūru izpildāmību (ugunsdzēsības mācības), un ka šādas pārskatīšanas rezultāti ir ņemti vērā; <ul style="list-style-type: none"> o pārskatīšanai attiecīgā gadījumā jāaptver visu pārskatīšanas periodā veikto testu rezultāti; | <p>likvidācija vairākos tirgos);</p> <ul style="list-style-type: none"> - CCP veic tīrvērti instrumentiem ar sarežģītām riska iezīmēm (piemēram, tādiem kā ārpusbiržas atvasināto instrumentu kredītriska mijmaiņas līgumi, IRS); - Koordinācija grupā saistību neizpildes pārvaldības saistībā; - Īpaša pakalpojumu slēgšanas procedūra attiecībā uz sadarbspējīgu saiti. | <ul style="list-style-type: none"> - Attiecīgā gadījumā — pierādījumi, ka CCP ir ieviesis un pārbaudījis procedūras, lai vienlaicīgi pārvaldītu saistību nepildītāja portfeļa likvidāciju vairākos tirgos; - Attiecīgā gadījumā — pierādījumi, ka CCP var paļauties uz nepieciešamajām iekšējām zināšanām vai ārējām konsultācijām, lai pārvaldītu un likvidētu sarežģītus produktus, tostarp stresa periodā; - Attiecīgā gadījumā — novērtējums par procedūrām, kas grupas līmenī ieviestas, lai pārvaldītu kopīga tīrvērtes dalībnieka saistību neizpildi; - Attiecīgā gadījumā — novērtējums par procedūrām, kas īstenošanas, lai pārvaldītu sadarbspējīgās saiknes pakalpojuma slēgšanu. |
| <p>Pārskats par modeļiem, stresa testiem un atpakaļejošām pārbaudēm</p> | <p>49. pants RTS 153/2013 47.–61. pants</p> | <ul style="list-style-type: none"> - Novērtējums par CCP atpakaļejošu pārbaudžu programmu, jutīguma testiem, stresa testu programmu un reversā stresa testu programmu, ietverot jebkādas izmaiņas politikā, ko piemēro, lai noteiktu: <ul style="list-style-type: none"> o atbilstošo testu laika periodu; o pārbaudžu biežumu; o vēsturiskos un hipotētiskos scenārijus, kas izmantoti stresa testā, jutīguma testā un reversā stresa testā; | <p>- n/a</p> | <p>- n/a</p> |

| | | | | |
|-----------------|------------------|--|--|---|
| | | <ul style="list-style-type: none"> ○ rezultātu novērtēšanai izmantotos kritērijus; ○ atkarībā no rezultātiem veicamās darbības un ziņošana riska komitejai; ○ rezultātu atklāšanas līmeni tīrvērtes dalībniekiem un klientiem. | | |
| Norēķini | 50. pants | <ul style="list-style-type: none"> - Apraksts par visiem darījumu norēķiniem; - Novērtējums par tīrvērtes dalībniekiem sniegtās informācijas pārredzamības līmeni attiecībā uz finanšu instrumentu piegādēm, tostarp par to, vai <i>CCP</i> ir pienākums veikt vai saņemt finanšu instrumentu piegādi; - Ja centrālajam darījumu partnerim nav pienākuma veikt piegādi vai uzņemties atbildību par tādu līgumu piegādi, kuriem veikta tīrvērtē, novērtējums, ka piegādes neizpildes risks ir skaidri noteikts <i>CCP</i> noteikumu kopumā, ietverot iespējamu kompensāciju dalībniekiem; - Ja <i>CCP</i> ir pienākums veikt vai saņemt fiziskas finanšu instrumentu piegādes: <ul style="list-style-type: none"> ○ izmanto tīrvērtes saistību neizpildes procedūru mehānismu novērtējumu; ○ attiecībā uz līgumiem, kuros neizmanto saistību neizpildes procedūras, — analītisks pārskats par to, kā <i>CCP</i> uzņemas un mazina galveno risku. | <ul style="list-style-type: none"> - <i>CCP</i> partneris nepaļaujas uz naudas bāzi, lai norēķinātos par saviem darījumiem. | <ul style="list-style-type: none"> - Attiecībā uz norēķinu kārtību, kurā neizmanto naudas bāzi, — alternatīvā risinājuma analītisks pārskats, tostarp sīkāka informācija par: <ul style="list-style-type: none"> ○ izmantoto komercbanku sarakstu; ○ plūsmām dalījumā pa valūtām un bankām; ○ analītisks pārskats par to, kā tiek uzraudzīts skaidras naudas norēķinu risks, un īstenotajiem riska mazināšanas pasākumiem. |

| Aprēķini un ziņošana Regulas (ES) Nr. 575/2013 par prudenācijām prasībām attiecībā uz kredītiestādēm un ieguldījumu brokeru sabiedrībām vajadzībām [EMIR4. nodaļa] | | | | |
|--|------------------------|--|-------|-------|
| Aprēķināšana un ziņošana Regulas(ES) Nr. 575/2013 vajadzībām | 50.a–50.d pants | <ul style="list-style-type: none"> - Novērtējums attiecībā uz procedūru un metodiku, kas saistīta ar to, kā CCP saskaņā ar prasībām aprēķina KCCP; - Pierādījumi, ka CCP pienācīgi ziņo informāciju saviem tīrvērtes dalībniekiem, kas ir iestādes, vai to kompetentajām iestādēm. | - n/a | - n/a |
| Sadarbspējas mehānismi [EMIR V sadaļa] | | | | |
| Sadarbspējas mehānismi | 51. pants | - Attiecīgā gadījumā — novērtējums par procedūrām nediskriminējošai piekļuvei datiem, kas CCP vajadzīgi, lai tas varētu pildīt savas funkcijas no savas tirdzniecības vietas. | - n/a | n/a |
| Riska pārvaldība | 52. pants | <ul style="list-style-type: none"> - Novērtējums par politiku, procedūrām un sistēmām, kas saistītas ar CCP sadarbības mehānismu, ietverot: <ul style="list-style-type: none"> o kredītriska un likviditātes riska pārvaldību; o savstarpējo atkarība un korelācijas saikni ar sadarbību; o nodrošinājuma pārvaldību, ietverot gadījumus, kad atļauta nodrošinājuma atkārtota izmantošana; o saistību neizpildes pārvaldību un procedūras sadarbības saiknes | - n/a | n/a |

| | | | | |
|---|-------------------------|--|--------------|------------|
| <p>Maržu noteikšana CCP vidū</p> | <p>53. pants</p> | <p>izbeigšanai viena vai otra CCP saistību neizpildes gadījumā;</p> <ul style="list-style-type: none"> - Ja sadarbspējīgo CCP izmantotie riska pārvaldības modeļi atšķiras — novērtējums par ieviestajām procedūrām, lai identificētu šīs atšķirības, novērtētu riskus un mazinātu tos. - To procedūru novērtējums, ar kurām kontos nodala CCP vārdā turētos aktīvus un pozīcijas, kas tiek turētas uz to CCP rēķina, ar kuriem tam ir izveidoti sadarbspējas mehānismi. | <p>- n/a</p> | <p>n/a</p> |
|---|-------------------------|--|--------------|------------|