

Brüssel, 29. november 2016
(OR. en)

Institutsioonidevaheline
dokument:
2016/0365 (COD)

14835/16
ADD 1

EF 360
ECOFIN 1116
CODEC 1735

ETTEPANEK

Saatja:	Euroopa Komisjoni peasekretär, allkirjastanud Jordi AYET PUIGARNAU, direktor
Kättesaamise kuupäev:	29. november 2016
Saaja:	Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, Euroopa Liidu Nõukogu peasekretär
Komisjoni dok nr:	COM(2016) 856 final ANNEX 1
Teema:	LISA järgmise dokumendi juurde: Ettepanek: EUROOPA PARLAMENDI JA NÕUKOGU MÄÄRUS kesksete vastaspoolte finantsseisundi taastamise ja kriisilahenduse raamistiku kohta ning millega muudetakse määruseid (EL) nr 1095/2010, (EL) nr 648/2012 ja (EL) 2015/2365

Käesolevaga edastatakse delegatsioonidele dokument COM(2016) 856 final ANNEX 1.

Lisatud: COM(2016) 856 final ANNEX 1

Brüssel, 28.11.2016
COM(2016) 856 final

ANNEX 1

LISA

järgmise dokumendi juurde:

Ettepanek: EUROOPA PARLAMENDI JA NÕUKOGU MÄÄRUS

**kesksete vastaspoolte finantsseisundi taastamise ja kriisilahenduse raamistiku kohta
ning millega muudetakse määruseid (EL) nr 1095/2010, (EL) nr 648/2012 ja (EL)
2015/2365**

{SWD(2016) 368 final}
{SWD(2016) 369 final}

LISA

A JAGU

FINANTSSEISUNDI TAASTAMISE KAVADELE ESITATAVAD NÕUDED

1. Finantsseisundi taastamise kavas:

- (1) ei eeldata juurdepääsu erakorralisele riiklikule finantstoetusele ega selle saamist;
- (2) võetakse arvesse kõigi tõenäoliselt kavast mõjutatud sidusrühmade huvisid;
- (3) veendutakse, et kliirivate liikmete riskipositsioonid keskses vastaspooles ei ole piiramatud.

Keskne vastaspool töötab välja sobilikud mehhanismid selleks, et kaasata kõnealuse kava koostamisse seotud finantsturutaristud ja sidusrühmad, kes juhul, kui finantsseisundi taastamise kava rakendatakse, kannaksid kahju või kulusid või panustaksid likviidsuse puudujääkide katmisesse.

2. Finantsseisundi taastamise kava sisaldab järgmist teavet:

- (1) ülevaade kava põhielementidest ja kokkuvõte üldisest taastumissuutlikkusest;
- (2) ülevaade keskses vastaspooles pärast kõige viimase finantsseisundi taastamise kava esitamist toimunud olulistest muutustest;
- (3) kommunikatsiooni- ja avalikustamise kava, milles antakse ülevaade sellest, kuidas keskne vastaspool kavatseb toime tulla võimalike negatiivsete tureaktsioonidega;
- (4) ammendav valik kapitali, kahjude jaotamise ja likviidsusega seonduvaid meetmeid, mis on vajalikud keskse vastaspoole elujõulisuse ja finantsseisundi säilitamiseks või taastamiseks, sealhulgas selleks, et tema portfelli uuesti sobitada ning taastada kapital ja eelrahastatud vahendid, mis on kesksele vastaspoolele vajalikud tema igapäevase tegevuse ja kriitiliste teenuste osutamise jätkamiseks kooskõlas komisjoni delegeeritud määruse (EL) nr 152/2013 artikli 1 lõikega 2 ja komisjoni delegeeritud määruse (EL) nr 153/2013 artikli 32 lõigetega 2 ja 3;
- (5) asjakohased tingimused ja kord finantsseisundi taastamise meetmete õigeaegse rakendamise tagamiseks, samuti lai valik võimalusi finantsseisundi taastamiseks, sealhulgas kava iga olulise aspekti elluviimise prognoositav ajakava;
- (6) üksikasjalik kirjeldus igasuguse olulise takistuse kohta, mis võib kriisilahenduse kava tõhusat ja õigeaegset rakendamist pärssida, sealhulgas kaalutlused seoses mõjuga kliirivatele liikmetele ja nende klientidele, sealhulgas juhul, kui kliirivad liikmed võiksid tõenäoliselt võtta meetmeid kooskõlas omaenese finantsseisundi taastamise kavadega vastavalt direktiivi

2014/59/EL artiklitele 5 ja 7, ning ülejäänud konsolideerimisgrupile, kui see on asjakohane;

- (7) kriitiliste funktsioonide loetelu;
- (8) keskse vastaspoole põhiäriinide, funktsioonide ja varade väärtuse ning turustatavuse määramise protsessi üksikasjalik kirjeldus;
- (9) üksikasjalik kirjeldus selle kohta, kuidas finantsseisundi taastamise kava on integreeritud keskse vastaspoole juhtimisstruktuuriga, mil viisil see moodustab osa keskse vastaspoole tegevuseeskirjadest (mille kohta on olemas nõusolek kliirivatelt liikmetelt), samuti finantsseisundi taastamise kava heakskiitmisele kehtivate põhimõtete ja menetluste ning organisatsioonis töötavate inimeste määramise kohta, kellele tehakse ülesandeks kava koostamine ja elluviimine;
- (10) kokkulepped ja meetmed, millega motiveeritakse makseviivituses mitteolevaid kliirivaid liikmeid tegema konkureerivaid pakkumisi makseviivituses liikmete positsioonide oksjonitel;
- (11) kord ja meetmed, millega tagatakse, et kesksel vastaspoolel on piisav juurdepääs hädaolukorra rahastamisallikatele, sealhulgas võimalikele likviidsusallikatele, olemasoleva tagatise hinnang ning hinnang selle kohta, kuivõrd on võimalik kanda likviidsus- või muid vahendeid üle ühelt äriiinilt teisele, et tagada keskse vastaspoole suutlikkus jätkata oma tegevust ja täita oma kohustused nende sissenõutavaks muutumisel;
- (12) kord ja meetmed seoses järgnevaga:
 - (a) riski vähendamine;
 - (b) lepingute, õiguste, varade ja kohustiste restruktureerimine;
 - (c) äriiinide restruktureerimine;
 - (d) vajadus säilitada pidev juurdepääs finantsturutaristutele;
 - (e) vajadus säilitada keskse vastaspoole tegevusprotsesside, sealhulgas taristu ja IT-teenuste pidev toimimine;
 - (f) ettevalmistavad kokkulepped, et soodustada vara või äriiinide võõrandamist ajavahemiku jooksul, mis on piisav majandusliku usaldusväärsuse taastamiseks;
 - (g) muud juhtimismeetmed või -strateegiad majandusliku usaldusväärsuse taastamiseks ning nende meetmete või strateegiate prognoositav finantsmõju;
 - (h) ettevalmistavad meetmed, mille keskne vastaspool on võtnud või kavatses võtta, et soodustada finantsseisundi taastamise kava rakendamist, sealhulgas meetmed, mis on vajalikud keskse vastaspoole õigeaegseks rekapiitalseerimiseks, tema portfelli uuesti sobitamiseks ja eelrahastatud vahendite taastamiseks, ning kava piiriülest jõustamist;

- (i) näitajate raamistik, milles on kindlaks määratud, millal võib võtta kavas osutatud asjakohaseid meetmeid;
- (j) kui see on asjakohane, analüüs selle kohta, kuidas ja millal võib keskne vastaspool taotleda kavas käsitletavate tingimuste korral võimalust kasutada keskpanga vahendeid, ja loetelu keskpanga tingimuste kohaselt eeldatavalt tagatiseks kvalifitseeruvast varast;
- (k) võttes arvesse määruse (EL) 648/2012 artikli 49 lõike 1 sätteid, valik äärmuslikke stressistsenaariume, mis lähtuvad keskse vastaspoole eripäradest, sealhulgas kogu süsteemi hõlmavad sündmused, stressiolukord, mis on eriomane juriidilisele isikule ja konsolideerimisgrupile, kuhu ta kuulub, ning stressiolukord, mis on omane keskse vastaspoole üksikutele kliirivatele liikmetele või seotud finansturutaristule, kui see on asjakohane;
- (l) võttes arvesse määruse (EL) 648/2012 artikli 34 ja artikli 49 lõike 1 sätteid, selliste olukordade stsenaariumid, mille põhjuseks on ühe või mitme tema liikme stress või makseviivitus või siis muud tegurid, sealhulgas kahju johtuvalt keskse vastaspoole investeerimistegevusest või muudest talitlusprobleemidest (sealhulgas tõsine väline oht keskse vastaspoole tegevusele tulenevalt välistest tõrgetest, šokkidest või küberkuritegevusest);

B JAGU

TEAVE, MILLE ESITAMIST KRIISILAHENDUSASUTUSED VÕIVAD KESKSETELT VASTASPOOLTEL NÕUDA KRIISILAHENDUSE KAVA KOOSTAMISEKS JA HALDAMISEKS

Kriisilahendusasutused võivad kesketelt vastaspooltelt nõuda kriisilahenduse kava koostamiseks ja haldamiseks vähemalt järgmise teabe esitamist:

- (1) keskse vastaspoole organisatsioonilise struktuuri üksikasjalik kirjeldus, sealhulgas kõigi juriidiliste isikute loetelu;
- (2) iga juriidilise isiku hääleõiguslike ja mittehääleõiguslike õiguste otseste omanike andmed ning osakaal;
- (3) iga juriidilise isiku asukoht, asutamise jurisdiktsioon, tegevusloa jurisdiktsioon ning tippjuhtkonna liikmed;
- (4) keskse vastaspoole kriitiliste funktsioonide ja põhiäriilinide kaardistus, sealhulgas bilansiandmed selliste funktsioonide ja äriilinide kohta, viitega igale juriidilisele isikule;
- (5) keskse vastaspoole osade ja kõigi tema juriidiliste isikute äritegevuse üksikasjalik kirjeldus, tuues eraldi välja vähemalt teenuste liigid ja vastavad kliiringumahu summad, alustamise tagatise, variatsioonitagatise vood ja tagatisfondid, samuti kõik nende äriilinidega seotud hindamisõigused või muud finantsseisundi taastamise õigused;

- (6) keskse vastaspoole ja tema juriidiliste isikute kapital ja nende poolt emiteeritud võlainstrumendid;
- (7) loetelu isikutest, kellelt keskne vastaspool on saanud tagatist ja millisel kujul (omandiõiguse üleminek või koormatis) ning kellele ta on pantinud tagatise ja millisel kujul, tagatise valdaja nimi ning mõlemal juhul jurisdiktsioon, kus tagatis asub;
- (8) keskse vastaspoole ja selle juriidiliste isikute bilansiväliste riskipositsioonide kirjeldus, sealhulgas keskse vastaspoole kriitiliste funktsioonide ja põhiäriliinide kaardistus;
- (9) olulised keskse vastaspoole riskimaandustehingud, sealhulgas nende jaotus juriidiliste isikute lõikes;
- (10) keskse vastaspoole iga kliiriva liikme riskipositsioon ja olulisus, samuti analüüs suuremate kliirivate liikmete maksejõuetuse mõju kohta kesksele vastaspoolele;
- (11) kõik kauplemissüsteemid, mille kaudu keskne vastaspool sooritab arvuliselt või tehingute väärtuselt olulisel hulgal tehinguid, sealhulgas nende jaotus keskse vastaspoole juriidiliste isikute, kriitiliste funktsioonide ja põhiäriliinide vahel;
- (12) kõik makse-, kliiring- ja arveldussüsteemid, milles keskne vastaspool on otseselt või kaudselt liige, sealhulgas nende jaotus keskse vastaspoole juriidiliste isikute, kriitiliste funktsioonide ja põhiäriliinide vahel;
- (13) keskses vastaspooles kasutatavate põhiliste juhtimisinfosüsteemide loetelu ja üksikasjalik kirjeldus, sealhulgas riskijuhtimise, raamatupidamise ning finants- ja regulatiivaruandluse infosüsteemid, sealhulgas nende jaotus keskse vastaspoole juriidiliste isikute, kriitiliste funktsioonide ja põhiäriliinide vahel;
- (14) punktis 13 nimetatud infosüsteemide, nendega seotud teenustaseme kokkulepete ning tarkvara ja süsteemide või litsentside omanike loetelu, sealhulgas nende jaotus juriidiliste isikute, kriitiliste funktsioonide ja põhiäriliinide vahel;
- (15) juriidiliste isikute loetelu ja kaardistus ning erinevate juriidiliste isikute vaheliste vastastikuste seoste ja vastastikuse sõltuvuse kirjeldus, sealhulgas:
 - ühised või ühiselt kasutatavad töötajad, töövahendid ja süsteemid;
 - kapitali-, rahastamis- või likviidsuskokkulepped;
 - olemasolevad või tingimuslikud krediidiriskipositsioonid;
 - ristgarantii lepingud, risttagatiskokkulepped, samaaegse makseviivituse tingimused ning sidusüksuste vahelise tasaarvestuse kokkulepped (*netting*);
 - riskide ülekandmised ja kompensatsioonitehingud; teenustaseme kokkulepped;
- (16) iga juriidilise isiku pädev ja kriisilahendusasutus, kui see erineb määruse (EL) nr 648/2012 artiklis 22 ja käesoleva määruse artiklis 3 osutatust;

- (17) keskse vastaspoole kriisilahenduse kava koostamiseks vajaliku teabe esitamise eest vastutav juhatuse liige ning – juhul kui need on erinevad inimesed –, erinevate juriidiliste isikute, kriitiliste funktsioonide ja põhiäriliinide eest vastutavad isikud;
- (18) ülevaade keskses vastaspooles kehtivatest reeglitest, millega tagatakse, et kriisilahendusasutusel on kriisilahenduse korral olemas kogu vajalik teave, mida on tarvis kriisilahenduse vahendite ja õiguste rakendamiseks, nagu kriisilahendusasutus on kindlaks teinud;
- (19) kõik keskse vastaspoole ja selle juriidiliste isikute poolt kolmandate isikutega sõlmitud lepingud, mis võidakse lõpetada, kui ametiasutused võtavad vastu otsuse rakendada kriisilahenduse vahendit, ning analüüs, kas lepingu lõpetamise tagajärjed võivad mõjutada kriisilahenduse vahendi rakendamist;
- (20) kriisilahenduse toetamiseks võimalike likviidsusallikate kirjeldus;
- (21) teave vara koormatise, likviidse vara, bilansiväliste tegevuste, riskimaandusstrateegiate ja kirjendamistavade kohta.

C JAGU

KÜSIMUSED, MIDA KRIISILAHENDUSASUTUS PEAB KESKSE VASTASPOOLE KRIISILAHENDUSKÕLBLIKKUSE HINDAMISEL KAALUMA

Keskse vastaspoole kriisilahenduskõlblikkuse hindamisel võtab kriisilahendusasutus arvesse järgmist:

- (1) ulatust, mil määral kesksel vastaspoolel on võimalik paigutada põhiariliinid ja kriitilised funktsioonid ümber teistesse juriidilistesse isikutesse;
- (2) ulatust, mil määral õiguslikud ja organisatsioonilised struktuurid on viidud kooskõlla põhiariliinide ja kriitiliste funktsioonidega;
- (3) ulatust, mil määral on olemas kehtivad kokkulepped oluliste töötajate, taristu, rahastuse, likviidsuse ja kapitaliga varustamiseks, et toetada põhiariliine ja kriitilisi funktsioone ning säilitada nende toimimine;
- (4) ulatust, mil määral keskse vastaspoole teenuslepingud on keskse vastaspoole kriisilahenduse korral täielikult täitmisele pööratavad;
- (5) ulatust, mil määral keskse vastaspoole juhtimisstruktuur on asjakohane keskse vastaspoole teenuslepingutega seonduvate sise-eeskirjade järgimise haldamiseks ja tagamiseks;
- (6) ulatust, mil määral keskses vastaspooles on olemas kord, mille alusel kanda kriitiliste funktsioonide või põhiariliinide eraldamise korral teenuslepingute alusel pakutavad teenused üle kolmandatele isikutele;
- (7) ulatust, mil määral on olemas kehtivad hädaolukorra lahendamise plaanid ja meetmed, et tagada pidev juurdepääs makse- ja arveldussüsteemidele;
- (8) juhtimisinfosüsteemide asjakohasust selleks, et tagada, et kriisilahendusasutused saavad koguda täpset ja kõikehõlmavat teavet põhiariliinide ja kriitiliste funktsioonide kohta, nii et need aitaksid kaasa otsuste kiirele vastuvõtmisele;
- (9) juhtimisinfosüsteemide suutlikkust pakkuda igal ajal keskse vastaspoole tulemuslikuks kriisilahenduseks vajalikku teavet isegi kiiresti muutuvates tingimustes;
- (10) ulatust, mil määral keskne vastaspool on testinud oma juhtimisinfosüsteeme kriisilahendusasutuse poolt välja töötatud raskustesse sattumise stsenaariumide korral;
- (11) ulatust, mil määral keskne vastaspool suudab tagada oma juhtimisinfosüsteemide katkematu toimimise nii kahjustatud keskses vastaspooles kui ka uues keskses vastaspooles, juhul kui kriitilised funktsioonid ja põhiariliinid teistest funktsioonidest ja äriiinidest eraldatakse;

- (12) juhul kui keskne vastaspool kasutab konsolideerimisgrupisiseid garantiisid, siis ulatust, mil määral neid garantiisid antakse turutingimustel ning kuivõrd usaldusväärsed on nende garantiidega seotud riskijuhtimissüsteemid;
- (13) juhul kui keskne vastaspool tegeleb kompensatsioonitehingute sõlmimisega, siis ulatust, mil määral neid tehinguid sõlmitakse turutingimustel ning kuivõrd usaldusväärsed on nende tehingutega seotud riskijuhtimissüsteemid;
- (14) ulatust, mil määral konsolideerimisgrupiseste garantiide andmine või kompensatsioonitehingute sõlmimine suurendab konsolideerimisgrupisest negatiivse mõju ülekandumist;
- (15) ulatust, mil määral keskse vastaspoole õiguslik struktuur takistab kriisilahenduse vahendite rakendamist – tingitult juriidiliste isikute arvust, konsolideerimisgrupi struktuuri keerukusest või raskustest äriliinide ja konsolideerimisgrupi ettevõtjate kokkuviiimisel;
- (16) ulatust, mil määral keskse vastaspoole kriisilahendusel võiks olla negatiivne ülekanduv mõju tema konsolideerimisgrupi muule osale, kui see on asjakohane;
- (17) teenustaseme kokkulepete olemasolu ja usaldusväärsust;
- (18) seda, kas kolmanda riigi asutustel on vajalikud kriisilahenduse vahendid, et toetada liidu kriisilahendusasutuste kriisilahenduse meetmeid, ning liidu ja kolmanda riigi asutuste vahelise kooskõlastatud tegevuse ulatust;
- (19) kriisilahenduse vahendite kasutamise võimalikkust viisil, mis vastab kriisilahenduse eesmärkidele, võttes arvesse kasutada olevaid vahendeid ning keskse vastaspoole struktuuri;
- (20) kõiki erinõudeid, mis on vajalikud uute omandiõiguse instrumentide emiteerimiseks vastavalt artikli 33 lõikele 1;
- (21) kokkuleppeid ja viise, mille abil saaks kriisilahendust tõkestada kesksete vastaspoolte puhul, millel on eri jurisdiktsioonides asutatud kliirivad liikmed või sõlmitud tagatiskokkulepped;
- (22) kriisilahenduse vahendite usaldusväärsust kasutamist viisil, mis vastab kriisilahenduse eesmärkidele, võttes arvesse võimalikku mõju kliirivatele liikmetele, muudele vastaspooltele ja töötajatele ning võimalikke meetmeid, mida võivad võtta kolmanda riigi asutused;
- (23) ulatust, mil määral keskse vastaspoole kriisilahenduse mõju finantssüsteemile ja finantsturu usaldusele saab adekvaatselt hinnata;
- (24) ulatust, mil määral keskse vastaspoole kriisilahendusel on märkimisväärne otsene või kaudne ebasoodne mõju finantssüsteemile, turu usaldusele või majandusele;
- (25) ulatust, mil määral kriisilahenduse vahendite ja õiguste rakendamise abil saaks piirata negatiivse mõju ülekandumist teistele kesksetele vastaspooltele või finantsturgudele;

- (26) ulatust, mil määral keskse vastaspoole kriisilahendusel võiks olla oluline mõju makse- ja arveldussüsteemide toimimisele.