Europos Sąjungos Taryba

Briuselis, 2026 m. lapkričio 23 d.
(OR. en)

16245/26
ADD 1

EF 306
ECOFIN 1515
DELACT 180
ECB

PRIDEDAMAS PRANEŠIMAS

nuo:	Europos Komisijos generalinės sekretorės, kurios vardu pasirašo direktorė Martine DEPREZ
kam:	Europos Sąjungos Tarybos generalinei sekretorei Thérèse BLANCHET
Komisijos dok. Nr.:	C(2026) 7883 annex
Dalykas:	PRIEDAS prie KOMISIJOS DELEGUOTOJO REGLAMENTO (ES) .../... kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 648/2012 papildomas techniniais reguliavimo standartais, kuriais nustatomi pagrindinių sandorio šalių garantinių įmokų skaidrumo ir garantinių įmokų modeliavimo priemonės reikalavimai, taip pat tarpuskaitos paslaugų teikėjų garantinių įmokų skaidrumo ir garantinių įmokų modeliavimo reikalavimai

Delegacijoms pridedamas dokumentas C(2026) 7883 annex.

Pridedama: C(2026) 7883 annex

EUROPOS
KOMISIJA

Briuselis, 2026 11 10
C(2026) 7883 final

ANNEX

PRIEDAS

prie

KOMISIJOS DELEGUOTOJO REGLAMENTO (ES) .../...

kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 648/2012 papildomas techniniais reguliavimo standartais, kuriais nustatomi pagrindinių sandorio šalių garantinių įmokų skaidrumo ir garantinių įmokų modeliavimo priemonės reikalavimai, taip pat tarpuskaitos paslaugų teikėjų garantinių įmokų skaidrumo ir garantinių įmokų modeliavimo reikalavimai

PRIEDAS

PSŠ garantinių įmokų modeliavimo priemonei naudojamiems nepalankiausių rinkos sąlygų scenarijams taikomi reikalavimai

5 straipsnio 1 dalies pirmos pastraipos b punkte nurodyti PSŠ modeliavimo priemonės scenarijai atitinka visus šiuos reikalavimus:

(a) jie parengiami taip, kad gali daryti poveikį pradinės garantinės įmokos modeliams tokiu būdu:

i) jie lemia pradinės garantinės įmokos sumų pokyčius pasikeitus rinkos sąlygoms;

ii) jie apima tinkamus nepalankiausių sąlygų laikotarpius, darančius poveikį rinkos kintamumui, ir rizikos veiksnių, įtrauktų į pradinės garantinės įmokos modelius, koreliacijas;

iii) į juos įtrauktas priemonių, kurių tarpuskaitą atlieka PSŠ, kainų lygių, naudojamų kaip įvesties duomenys pradinėms garantinėms įmokoms apskaičiuoti, pokytis;

iv) jie gali apimti poveikį kitai rizikai ir garantinės įmokos komponentams, pavyzdžiui, dėl padidėjusių likvidavimo išlaidų arba sumažėjusio portfelio padengimo garantinėmis įmokomis;

(b) konkrečiai praeities scenarijai apima pagrindinius praeityje įvykusius nepalankiausių sąlygų įvykius, darančius didžiausią poveikį tarpuskaitos narių portfeliams ir aktualiausius turto klasėms, kurių tarpuskaitą atlieka PSŠ;

(c) konkrečiai hipotetiniai scenarijai parengiami taip, kad būtų orientuoti į tarpuskaitos narių likvidumo poreikius.