

Решение на Европейския банков орган ЕВА/ДС/610

от 27 януари 2026 г.

относно механизма за утвърждаване на модела на предварителното допълнително обезпечение съгласно Регламента за европейската пазарна инфраструктура (РЕПИ) за стандартния модел на предварителното допълнително обезпечение (SIMM) на Международната асоциация за суапове и деривативи (ISDA)

Съветът на надзорниците,

като взе предвид Регламент (ЕС) № 1093/2010 на Европейския парламент и на Съвета от 24 ноември 2010 година за създаване на Европейски надзорен орган (Европейски банков орган), за изменение на Решение № 716/2009/ЕО и за отмяна на Решение 2009/78/ЕО на Комисията (¹) („Регламент за ЕБО“), и по-специално член 1, параграф 2, член 2, член 8, параграф 1, букви б) и й), член 8, параграф 1а, буква а), член 8, параграф 2, буква й), член 31, параграф 2, букви а), б) и е) и член 35 от него, и

като взе предвид Регламент (ЕС) № 648/2012 на Европейския парламент и на Съвета от 4 юли 2012 година относно извънборсовите деривати, централните контрагенти и регистрите на трансакции (²) (РЕПИ), и по-специално член 11, параграфи 3 и 12а,

като има предвид, че:

- (1) В член 11, параграфи 3 и 12а от РЕПИ се определя, че ЕБО отговаря за утвърждаването на проформа модели и на всяка промяна в тях. SIMM на ISDA е такъв проформа модел. За да бъде утвърден SIMM на ISDA, следва да бъдат допълнително уточнени всички аспекти на функцията по утвърждаване, които ЕБО трябва да изпълни в съответствие с РЕПИ, като същевременно следва, временно и без да се засяга член 89, параграф 11 от РЕПИ, да бъде създадена система за утвърждаване, докато централната база данни на ESMA, предвидена в член 17в от РЕПИ, започне да функционира.
- (2) Предвид ролята на ЕБО като централен валидатор, включително чрез извършваното от него непрекъснато наблюдение, следва да се търси възможно най-широко участие в системата за утвърждаване. В този контекст ЕБО, ЕЮРА, ESMA, финансовите и нефинансовите контрагенти, които използват SIMM на ISDA, съответните компетентни органи и Международната асоциация за суапове и деривативи (ISDA) следва да участват като ползватели на системата за утвърждаване, като взаимодействат ефективно помежду си за обмена на необходимата информация за всички аспекти на функцията по утвърждаване.

⁽¹⁾ ОВ L 331, 15.12.2010 г., стр. 12–47.

⁽²⁾ ОВ L 201, 27.7.2012 г., стр. 1.

- (3) Цялата информация, включена в системата за утвърждаване, следва да бъде обхваната от правната уредба на ЕС в областта на професионалната тайна, поверителността и защитата на личните данни, а достъпът до тази информация следва да се предоставя на ползвателите в съответствие с Регламента за ЕБО. Тъй като ЕБО се превръща във важен център за данни, за да се намалят тежестта и разходите за отчитането и да се повиши ефективността за всички ползватели, системата за утвърждаване следва да бъде интегрирана в Европейската централизирана инфраструктура за обмен на надзорни данни (EUCLID).
- (4) За да се подпомогне доброто функциониране на системата за утвърждаване, по отношение на заявленията за утвърждаване следва да се прилага процес на предварително присъединяване. За тази цел ЕБО следва да започне структуриран процес на присъединяване, за да събере цялата необходима информация за идентифициране на контрагентите, които използват SIMM на ISDA. Компетентните органи следва да предоставят на ЕБО имената и другите необходими данни на финансовите и нефинансовите контрагенти, които са подали заявление за лиценз за модел на първоначално допълнително обезпечение, основан на SIMM на ISDA, в съответствие с член 11, параграф 3, трета алинея от РЕПИ. Успоредно с това и в съответствие с член 11, параграф 12а, втора алинея от РЕПИ, ISDA следва да оказва съдействие на ЕБО, като предоставя информация за контрагентите, които използват SIMM на ISDA. За да се избегне дублиране и да се осигури точността на данните, ЕБО следва да координира процеса на присъединяване и може да разчита на потвърждения от компетентните органи, когато е целесъобразно.
- (5) Необходимо е да се гарантира, че компетентните органи и ISDA своевременно ще предоставят информация за новите контрагенти, които използват SIMM на ISDA, за да се улесни процесът на присъединяване, въз основа на който контрагентите ще изпълняват задължението си съгласно РЕПИ да подават заявление за утвърждаване на своя модел чрез системата за утвърждаване.
- (6) За да се премахне всякаква ненужна тежест и като се има предвид, че съгласно РЕПИ ISDA е длъжна да оказва ефективно съдействие на ЕБО за целите на утвърждаването, ISDA следва да отговаря за своевременното предоставяне на цялата необходима информация относно модела и всяка негова актуализация. За да може ЕБО да разбира в пълна степен модела и планираната му актуализация, тази информация следва да обхваща общите аспекти на модела — както тези, които са обхванати от актуализацията, така и тези, които не са обхванати от нея.
- (7) Присъединилите се финансови и нефинансови контрагенти, които използват SIMM на ISDA, следва да подадат до ЕБО заявление за утвърждаване, след като ЕБО потвърди, че ISDA е предоставила чрез системата за утвърждаване или чрез други средства, които ЕБО счита за подходящи, пълна информация и подкрепяща документация относно елементите и общите аспекти на SIMM на ISDA. Когато се подават такива заявления, следва да се счита, че се отнасят и са свързани с проформа модела на SIMM на ISDA, описан от ISDA като разработчик на модела в информацията и подкрепящата документация, предоставени на ЕБО. Такъв процес от два етапа, включващ първо представяне от ISDA на особеностите на модела и на всяка промяна в него, а след това подаване от контрагента на заявление за утвърждаване на неговия модел от ЕБО, следва да бъде следван в контекста на всяка последваща промяна на модела на SIMM на ISDA. За да се осигури максимална ефективност, когато заявление за утвърждаване е получено

след утвърждаването на действащия SIMM на ISDA, решението за утвърждаване следва да се генерира автоматично чрез системата.

- (8) ISDA следва да уведомява ЕБО за всяка актуализация на SIMM на ISDA, но ЕБО следва да запази гъвкавост да преценява кои от тези актуализации представляват промяна на модела, за която се изисква утвърждаване. Само при актуализации, които по преценка на ЕБО представляват промени в модела, следва да се задейства процеса на утвърждаване на SIMM на ISDA.
- (9) При първото утвърждаване на SIMM на ISDA следва да бъдат включени всички актуализации и промени на модела до датата на приемане на първоначалното решение за утвърждаване. Шестмесечният или тримесечният срок по РЕПИ, в рамките на който ЕБО е правно задължен да предостави или откаже утвърждаване, също следва да бъде посочен в настоящото решение и да започва да тече от първото заявление, получено от ЕБО чрез системата за утвърждаване.
- (10) Тъй като SIMM на ISDA се използва широко на световния пазар и за да се избегнат евентуални сътресения на пазара, ЕБО следва да пристъпи към утвърждаване веднага щом ISDA предостави цялата необходима информация за модела, доколкото това утвърждаване не се счита за явно неподходящо с оглед на пазарните условия или необходимостта да се гарантира финансовата стабилност, като в този случай утвърждаването следва да бъде отказано. За да се повиши сигурността на пазара и да се насърчи стабилността, утвърждаването на SIMM на ISDA не следва да бъде ограничено във времето и точно поради тази причина то следва да бъде придружено от проверка на непрекъснатата пригодност на SIMM на ISDA, която следва да бъде осигурена чрез непрекъснато наблюдение на модела от страна на ЕБО, както е посочено в член 11, параграф 12а, трета алинея от РЕПИ.
- (11) Утвърждаването на SIMM на ISDA посредством решение, което не е ограничено във времето, по същество налага това решение да може да бъде оттегляно напълно или частично, когато ЕБО счита, въз основа на непрекъснатото си наблюдение или на *ad hoc* основа, включително при извънредни ситуации, че оставането в сила на утвърждаването на SIMM на ISDA би било неподходящо с оглед на пазарните условия или на необходимостта да се гарантира финансова стабилност. Следва да се гарантира, че ЕБО ще оттегли утвърждаването на SIMM на ISDA, когато оставането му в сила се счита за неподходящо, независимо от това дали препоръките, направени от ЕБО по време на извършването от него непрекъснато наблюдение, са изпълнени от ISDA или от който и да било друг ползвател на системата за утвърждаване, към който може да бъдат отправени такива препоръки. Неоказването на съдействие от страна на ISDA също следва да доведе до оттегляне на утвърждаването на SIMM на ISDA, освен когато и доколкото от съображения, свързани с финансовата стабилност или целостта на пазара, е необходимо друго, тъй като такова неоказване на съдействие прави невъзможно непрекъснатото наблюдение на пригодността на SIMM на ISDA, което се изисква съгласно РЕПИ.
- (12) Като се има предвид, че непрекъснатото наблюдение е от значение за утвърждаването на SIMM на ISDA, е необходимо да се уточни кои елементи следва да бъдат включени като минимум в това наблюдение, извършвано от ЕБО. За да се осигури прозрачност, ЕБО следва да включва в годишния си доклад, посочен в РЕПИ, основните си констатации от това наблюдение.

- (13) Финансовите или нефинансовите контрагенти имат право да бъдат изслушани само когато ЕБО възнамерява да не утвърди SIMM на ISDA или да оттегли частично или напълно утвърждаването.
- (14) Необходимо е да се гарантира, че всички ползватели на системата за утвърждаване оказват ефикасно и ефективно съдействие на ЕБО, за да може той да изпълнява функцията си по утвърждаване. В този контекст контрагентите следва да информират ЕБО, ако са престанали да са в съответствие със SIMM на ISDA в действащата му утвърдена версия, а компетентните органи и контрагентите следва да предоставят на ЕБО всякаква информация, необходима за функцията по утвърждаване, на текуща или ad hoc основа.
- (15) За да се гарантира способността за реагиране във времето, като същевременно се спазват установените принципи за законно делегиране на задачи, постоянният комитет по регулиране и политика (SCRePol) следва да бъде оправомощен да утвърждава последващи промени, а Съветът на надзорниците следва да предоставя първоначалното утвърждаване на SIMM на ISDA и да взема решения относно всеки отказ за последващо утвърждаване или относно пълното или частично оттегляне на решение за утвърждаване. За да се повиши гъвкавостта, изпълнителният директор следва да бъде упълномощен да взема всички технически решения, необходими за функционирането на системата за утвърждаване и за изпълнението на функцията по утвърждаване. Съветът на надзорниците следва да бъде информиран за всички такива последващи утвърждавания от страна на SCRePol и за техническите решения на изпълнителния директор, като нищо не следва да го възпрепятства да отменя такива оправомощавания, когато е целесъобразно.
- (16) Преди да приеме настоящото решение, ЕБО проведе консултации с ЕИОПА, ESMA и ISDA, както и с компетентните органи, които участват в структурата за вътрешно управление на ЕБО.

РЕШИ:

Член 1 — Предмет и обхват

1. С настоящото решение се създава информационна система („система за утвърждаване на SIMM на ISDA“) като временен механизъм, докато започне да функционира базата данни на ESMA, предвидена в член 17в от РЕПИ.
2. ЕБО, ESMA, ЕИОПА, компетентните органи, посочени в член 2, параграф 13 от РЕПИ („компетентни органи“), и финансовите и нефинансовите контрагенти, посочени в член 11 от РЕПИ, които използват модела SIMM на ISDA („контрагенти“), както и ISDA, са ползвателите на системата за утвърждаване на SIMM на ISDA („ползватели“).
3. Информацията, включена в системата за утвърждаване на SIMM на ISDA, попада в обхвата на правната уредба на ЕС в областта на професионалната тайна, поверителността и защитата на личните данни, приложима за ЕБО. Достъпът е в съответствие с членове 70, 71 и 72 от Регламента за ЕБО.
4. Информацията, предоставена на ЕБО чрез системата за утвърждаване на SIMM на ISDA, се счита за информация, предоставена чрез Европейската централизирана инфраструктура

за обмен на данни (EUCLID), като се прилага Решение ЕВА/DC/2020/335 от 5.6.2020 г. относно EUCLID, с бъдещите му изменения или замени.

Член 2 — Присъединяване на контрагенти

1. Компетентните органи предоставят на ЕБО чрез системата за утвърждаване на SIMM на ISDA или чрез други средства, които ЕБО счита за подходящи, включената в приложение 1 информация за всички контрагенти, които използват модел на първоначалното допълнително обезпечение, основан на SIMM на ISDA, и които са длъжни да поискат лиценза, посочен в член 11, параграф 3, трета алинея от РЕПИ.
2. Компетентните органи предоставят без ненужно забавяне на ЕБО информацията, включена в приложение 1, за всеки контрагент, който подаде заявление за такъв лиценз след датата на влизане в сила на настоящото решение.
3. ISDA предоставя на ЕБО чрез системата за утвърждаване на SIMM на ISDA или чрез други средства, които ЕБО счита за подходящи, включената в приложение 2 информация за всички контрагенти, които използват SIMM на ISDA и са длъжни да поискат лиценза, посочен в член 11, параграф 3, трета алинея от РЕПИ.
4. След като получат уведомление от ЕБО, контрагентите трябва без ненужно забавяне да влязат в системата за утвърждаване, за да завършат процеса на присъединяване, в това число да определят лицата с права на достъп до системата за утвърждаване на SIMM на ISDA („оторизирани ползватели“) и да приемат условията по отношение на езика.
5. Контрагентите, които не са получили посоченото по-горе уведомление и имат задължението да подадат до ЕБО заявление за утвърждаване на своя модел в съответствие с член 11, параграф 3, трета алинея от РЕПИ, отнасят въпроса до ЕБО. Веднага след като получи искане от ЕБО съответният компетентен орган предоставя на ЕБО необходимата информация за присъединяването на съответния контрагент.

Член 3 — Предоставяне на информация и подкрепяща документация за SIMM на ISDA и за всяка негова актуализация

1. В съответствие с член 11, параграф 12а, втора алинея от РЕПИ ISDA предоставя без ненужно забавяне на ЕБО чрез системата за утвърждаване на SIMM на ISDA или чрез други средства, които ЕБО счита за подходящи, всякаква информация и подкрепяща документация, включително информация за елементите и общите аспекти, калибрирането, проектирането и покритието на инструментите, класовете активи и рисковите фактори от значение за SIMM на ISDA и за всяка от неговите актуализации.
2. За първото утвърждаване на SIMM на ISDA, ISDA се стреми да предостави информацията, посочена в параграф 1:
 - (а) за SIMM на ISDA, който е в сила понастоящем, без ненужно забавяне след влизането в сила на настоящото решение;

- (б) за всяка планирана актуализация на SIMM на ISDA, който е в сила понастоящем — до 14 август 2026 г.
3. За утвърждаването на всяка последваща промяна в SIMM на ISDA, ISDA осигурява предоставянето на посочената в параграф 1 информация на ЕБО във всички случаи не по-късно от четиринадесет (14) седмици преди датата, на която започва да се прилага всяка актуализация.
 4. ISDA уведомява за всички актуализации на SIMM на ISDA и предоставя цялата необходима информация за тях. Когато актуализация, за която ISDA е уведомила, според ЕБО не представлява промяна, включително в случаите, посочени в параграф 6, вече предоставеното утвърждаване продължава да се прилага и процесът на утвърждаване не се задейства.
 5. Следните актуализации на SIMM на ISDA се считат за промени в модела:
 - (а) с актуализацията се променят структурните основи на SIMM на ISDA, в това число проектирането, обхващането на рисковете или допусканията, или значително се преразглежда третирането на зависимостите в SIMM на ISDA;
 - (б) актуализацията води до включване на нови класове активи или видове рискове в SIMM на ISDA или до премахване на класове активи или видове рискове, които са били обхванати в SIMM на ISDA.
 6. Актуализации, засягащи само параметрите на модела, произтичащи от вече съществуващата и утвърдена методология на SIMM на ISDA, включително актуализациите на рисковите тегла и корелациите, или отнасящи се до разяснения, прецизиране и корекции на документацията или до технически подобрения, не се считат за промени в SIMM на ISDA.

Член 4 — Подаване на заявления за утвърждаване

1. ЕБО предоставя на присъединените контрагенти чрез системата за утвърждаване на SIMM на ISDA или чрез други средства, считани за подходящи, потвърждение, че пълната информация и документация за SIMM на ISDA са предоставени от ISDA в съответствие с член 3.
2. След получаване на посоченото в предходния параграф потвърждение присъединените контрагенти подават без ненужно забавяне чрез системата за утвърждаване на SIMM на ISDA или чрез други средства, които ЕБО счита за подходящи, заявление за утвърждаване на техния модел, като също така декларират, че той е в пълно съответствие с проформа модела на SIMM на ISDA, описан от ISDA в информацията и подкрепящата документация, представени в съответствие с член 3.
3. Последващи заявления за промяна в SIMM на ISDA се подават автоматично от системата за утвърждаване на SIMM на ISDA за всички присъединени контрагенти, които не са декларирали в съответствие с член 6, параграф 5, че са престанали да са в съответствие със SIMM на ISDA или че вече не са длъжни да подават заявления за утвърждаване и лиценз в съответствие с РЕПИ.

4. Когато заявление за утвърждаване на SIMM на ISDA бъде получено от ЕБО след утвърждаването на SIMM на ISDA, по това заявление се предоставя утвърждаване автоматично чрез системата за утвърждаване. Това утвърждаване се отнася до SIMM на ISDA, както е утвърдена.

Член 5 — Утвърждаване и отказ за утвърждаване на SIMM на ISDA

1. Когато ISDA е спазила член 3, ЕБО утвърждава SIMM на ISDA или всяка промяна в него, освен когато според ЕБО утвърждаването на SIMM на ISDA или на която и да било промяна в него е явно неподходящо с оглед на пазарните условия или необходимостта да се гарантира финансовата стабилност.
2. При първото утвърждаване на SIMM на ISDA се обхващат всички актуализации и промени в модела до датата, на която влиза в сила решението за утвърждаване, и решението за това утвърждаване се взема в съответствие с параграф 1 в срок от шест месеца от първото заявление, получено от ЕБО в съответствие с член 4.
3. Решението за утвърждаване на всяка промяна в SIMM на ISDA се взема в съответствие с параграф 1 в срок от три месеца от първото заявление, получено от ЕБО в съответствие с член 4. С всяко последващо решение за утвърждаване на SIMM на ISDA след промяна в него се отменят и заменят предишните решения за утвърждаване.
4. Утвърждаването или отказът за утвърждаване на SIMM на ISDA или на промяна в него се адресират до всички контрагенти, които са подали заявление в съответствие с член 4.
5. Утвърждаването на SIMM на ISDA не е ограничено във времето и се оттегля в съответствие с член 6.

Член 6 — Оттегляне на утвърждаването на SIMM на ISDA

1. Когато наблюдението по член 7 показва, че, според ЕБО, оставането в сила на утвърждаването на SIMM на ISDA е неподходящо с оглед на пазарните условия или необходимостта да се гарантира финансовата стабилност, това утвърждаване се оттегля напълно или частично от ЕБО.
2. Дори когато параграф 1 не се прилага, ЕБО оттегля утвърждаването на SIMM на ISDA, когато ISDA не оказва съдействие по начина, определен в настоящото решение, включително когато не предоставя изискваната информация, освен когато такава оттегляне би застрашило целостта на пазара или финансовата стабилност.
3. ЕБО оттегля решението за утвърждаване в съответствие с параграфи 1 или 2 независимо от това дали препоръките, посочени в член 7, параграф 4, са били изпълнени от техните адресати.
4. Решенията за оттегляне се адресират до всички контрагенти, чиито модели са утвърдени в съответствие с настоящото решение.
5. Утвърждаването на SIMM на ISDA се оттегля автоматично чрез системата за утвърждаване на SIMM на ISDA за всеки контрагент, който декларира в съответствие с член 10,

параграф 2, че е престанал да е в съответствие със SIMM на ISDA, утвърден от ЕБО, или че вече не е длъжен да подава заявление за утвърждаване и лиценз в съответствие с РЕПИ.

Член 7 — Наблюдение

1. ЕБО наблюдава непрекъснато целесъобразността на утвърдения SIMM на ISDA и анализира всички докладвани или възникващи по друг начин проблеми. Той включва основните си констатации в годишния доклад, посочен в член 11, параграф 12а, трета алинея от РЕПИ.
2. Извършваното от ЕБО наблюдение по параграф 1 включва най-малко следните елементи:
 - (а) съответствието на SIMM на ISDA с критериите по отношение на общите изисквания, рисковия маржин период, калибрирането на параметъра, диверсификацията, хеджирането и компенсиранията на риска според базовия актив или изискванията към качеството съгласно Делегиран регламент (ЕС) 2016/2251 на Комисията от 4 октомври 2016 година за допълване на Регламент (ЕС) № 648/2012 на Европейския парламент и на Съвета относно извънборсовите деривати, централните контрагенти и регистрите на трансакции по отношение на регулаторните технически стандарти за техники за намаляване на риска за договори за извънборсови деривати, за които не е извършен клиринг чрез централен контрагент ⁽³⁾;
 - (б) оценка на покритието и целесъобразността на рисковите фактори, включително с оглед на развитието на пазара и кризисните обстоятелства;
 - (в) оценка на калибрирането на модела;
 - (г) оценка на цялостните резултати от модела въз основа на резултатите от бектестване;
 - (д) други елементи, представени на вниманието на ЕБО от EIOPA, ESMA, компетентните органи или ISDA.
3. Извършваното от ЕБО наблюдение по настоящия член не пречи на ЕБО на *ad hoc* основа, включително в извънредни ситуации или при неблагоприятни пазарни тенденции, да извършва нова оценка на това дали утвърждаването на SIMM на ISDA продължава да е подходящо.
4. В годишния доклад, посочен в член 11, параграф 12а, трета алинея от РЕПИ, ЕБО може да отправя препоръки във връзка с всички проблеми, на които ISDA или който и да е ползвател на системата за утвърждаване трябва да обърне внимание. Тези препоръки могат да се отнасят до рискове, фактори, които не са адекватно отразени в утвърдената SIMM на ISDA, до приложното поле, до покритието на инструментите и класовете активи, до калибрирането или до всяка друга методология въз основа на SIMM на ISDA, както е утвърдена от ЕБО, или въз основа на всяка предвидена промяна в нея.

Член 8 — Право на изслушане

1. Когато ЕБО възнамерява да не утвърди SIMM на ISDA или да оттегли частично или напълно утвърждаването поради нецелесъобразност на SIMM на ISDA, контрагентите, които са

⁽³⁾ ОВ L 340, 15.12.2016 г., стр. 9–46

подали заявление за утвърждаване в съответствие с член 4 или чиито модели са утвърдени съгласно настоящото решение, се уведомяват за намерението на ЕБО и им се предоставя срок от двадесет [20] работни дни, в който могат да изразят становището си.

2. Уведомяването и изразяването на становища, посочени в предходния параграф, се извършват чрез системата за утвърждаване на SIMM на ISDA или чрез други средства, които ЕБО счита за подходящи.

Член 9 — Прозрачност

1. Всички ползватели се уведомяват за всяко решение за предоставяне или отказване на утвърждаване, както и всяко решение за частично или пълно оттегляне на утвърждаване, чрез системата за утвърждаване на SIMM на ISDA.
2. Във всяко решение за отказ и във всяко решение за частично или пълно оттегляне на утвърждаването се посочват мотивите, на които то се основава, и контрагентите се информират за средствата за правна защита, предвидени в Регламента за ЕБО.
3. Всяко решение за предоставяне или отказване на утвърждаване и всяко решение за частично или пълно оттегляне на утвърждаване, както и всяко становище, представено във връзка с упражняването на правото на изслушване, се публикуват на уебсайта на ЕБО без ненужно забавяне, освен ако ЕБО счита, че такова публикуване противоречи на законния интерес на тези финансови институции или на защитата на техните търговски тайни, или би могло сериозно да застраши правилното функциониране и целостта на финансовите пазари или стабилността на цялата финансова система на Съюза или на част от нея.

Член 10 — Предоставяне на информация и изисквания за оказване на съдействие

1. Компетентните органи:
 - (а) гарантират, че системата за утвърждаване на SIMM на ISDA съдържа точна и актуална информация за контрагентите, които са подали заявление за лиценз в съответствие с член 11, параграф 3, трета алинея от РЕПИ, за всеки модел на първоначално допълнително обезпечение, основан на SIMM на ISDA; и
 - (б) предоставят на ЕБО чрез системата за утвърждаване на SIMM на ISDA или чрез други средства, които ЕБО счита за подходящи, информацията, събрана от тях по време на първоначалния и текущия процес на лицензиране на SIMM на ISDA на ниво субект или на промените в него.
2. Контрагентите уведомяват без ненужно забавяне ЕБО чрез системата за утвърждаване на SIMM на ISDA, когато престанат да са в съответствие със SIMM на ISDA, който е утвърден в момента, или когато вече не са длъжни да подават заявления за утвърждаване и лиценз в съответствие с РЕПИ.
3. Ползвателите предоставят на ЕБО чрез системата за утвърждаване или чрез други средства, които ЕБО счита за подходящи, информацията, необходима за ефективното извършване на утвърждаването и оценката на непрекъснатата пригодност на SIMM на ISDA, в това число, без ограничение, информацията, посочена в приложението.

4. Ползвателите предоставят на ЕБО чрез системата за утвърждаване или чрез други средства, които ЕБО счита за подходящи, всякаква допълнителна информация и данни, които ЕБО счете за необходими за изпълнението на функцията си по утвърждаване.
5. Информацията, посочена в предходния параграф, включва например информация и данни за използването, резултатите, калибрирането или прилагането на SIMM на ISDA, информация и данни за размера на допълнителните обезпечения, изчислен чрез стандартизирана мрежа или модели на първоначални допълнителни обезпечения, качествена информация относно изричния избор да не се използват модели на първоначални допълнителни обезпечения, статистически данни относно извършени равнения и спорове, подробности относно най-важните спорове, както и статистически данни и данни за добавките, прилагани в допълнение към първоначалното допълнително обезпечение.
6. В допълнение към предоставянето на информация и данни, както е посочено в предходните параграфи, ползвателите следва без ненужно забавяне да оказват съдействие на ЕБО, за да му позволят да изпълнява функцията си по утвърждаване, и да предоставят на ЕБО, чрез системата за утвърждаване или чрез други средства, които ЕБО счита за подходящи, всяка поискана от ЕБО информация.

Член 11 — Вземане на решения

1. Първото решение за утвърждаване на SIMM на ISDA, решението за отказване на утвърждаването и решението за пълно или частично оттегляне на утвърждаването се вземат, в съответствие с членове 5 и 6, от Съвета на надзорниците.
2. Всяко последващо решение за утвърждаване на промяна в SIMM на ISDA, в съответствие с член 5, параграф 1, се взема от постоянния комитет по регулиране и политика (SCRePol). Съветът на надзорниците се информира надлежно за тези решения. SCRePol се стреми към постигане на консенсус при приемането на решение за утвърждаване на промяна в SIMM на ISDA. При липса на консенсус решението се приема с обикновено мнозинство от членовете на SCRePol, назначени от член с право на глас в Съвета на надзорниците. Гласовете „въздържал се“ или липсата на изразени становища се считат за подкрепа на решението. Когато SCRePol определи, че утвърждаването на промяна в SIMM на ISDA трябва да бъде отказано, той изпраща предложението си до Съвета на надзорниците за вземане на окончателно решение.
3. Изпълнителният директор е оправомощен да взема следните решения, като надлежно информира Съвета на надзорниците за тях:
 - (а) да иска допълнителна информация или да поиска конкретно съдействие от всеки ползвател по конкретен въпрос, свързан с прилагането на настоящото решение; и
 - (б) да определя обхвата, съдържанието, формата, честотата, референтните дати, правилата в областта на ИТ, правилата за утвърждаване и инструкциите за информацията и данните, включени в системата за утвърждаване на SIMM на ISDA, да определя целта на обработването на лични данни и правото на достъп до системата за утвърждаване на SIMM на ISDA и да установява всякакви други оперативни правила или технически спецификации („технически спецификации на системата за утвърждаване на SIMM на ISDA“), необходими за прилагането на настоящото решение.

Член 12 — Заключителни разпоредби

Настоящото решение влиза в сила на 1 март 2026 г.

Съставено в Париж,

José Manuel Campa
Председател

За Съвета на надзорниците

ПРИЛОЖЕНИЕ 1

Посочената по-долу информация се предоставя за всеки правен субект (т.е. контрагент по смисъла на РЕПИ), установен в ЕИП, по отношение на който се прилага изискването за размяна на първоначално допълнително обезпечение в съответствие с Делегиран регламент (ЕС) 2016/2251 на Комисията ⁽⁴⁾ („Съвместни регулаторни технически стандарти на ЕНО относно извънборсовите деривати, за които не е извършен клиринг“) и който е лицензиран ползвател на SIMM на ISDA — самостоятелно или като част от група (т.е. от ЕИП или извън ЕИП).

Идентификационни данни

- наименование на правния субект;
- идентификационен код на правния субект (ИКПС);
- естество на субекта (например нефинансов контрагент, кредитна институция, инвестиционен посредник, предприятие за колективно инвестиране в прехвърлими ценни книжа (ПКИПЦК), алтернативен инвестиционен фонд (АИФ), застрахователно дружество);
- държава, в която е установен субектът;
- компетентен орган, отговарящ за лицензирането на модела на първоначалното допълнително обезпечение на субекта;

Информация за обема на първоначалното допълнително обезпечение

- оценка на съвкупността (т.е. етапи 1—6), към която субектът понастоящем принадлежи в съответствие с член 36 от съвместните регулаторни технически стандарти на ЕНО относно извънборсовите деривати, за които не е извършен клиринг (напр. обща средна условна стойност > 3 000 млрд. евро, 8 млрд. евро < обща средна условна стойност <= 50 млрд. евро);
- посочване дали субектът има средномесечна непогасена условна стойност на извънборсовите деривати, за които не е извършен централизиран клиринг, от най-малко 750 млрд. евро на равнище група, както е посочено в член 11, параграф 15, първа алинея, буква аа) от РЕПИ (Да/Не);

⁽⁴⁾ ОВ L 340, 15.12.2016 г., стр. 9–46

Информация за контакт и информация за ИТ

- адрес на функционална електронна поща на екипа, който отговаря за лицензирането на модела на първоначалното допълнително обезпечение в субекта;
- домейни за електронна поща, използвани от субекта;
- Информация за контакт с лице за контакт 1.
Лице за контакт 1 отговаря за управлението на достъпа на контрагента до системата за утвърждаване на ЕБО за утвърждаването на SIMM на ISDA. Това лице за контакт може също така да изпълнява ролята на подател на данни за утвърждаването на модела на първоначалното допълнително обезпечение:
 - име и фамилия
 - роля в институцията
 - адрес на електронна поща и телефонен номер.
- Информация за контакт с лица за контакт 2 и 3.
Лица за контакт 2 и 3 изпълняват ролята на податели на данни за утвърждаването на модела на първоначалното допълнително обезпечение:
 - име и фамилия
 - роля в институцията
 - адрес на електронна поща и телефонен номер.

Информация за групата, към която принадлежи субектът

Когато субектът е част от група от ЕИП, т.е. е пряко или непряко дъщерно предприятие на друг субект, намиращ се в ЕИП, за най-високопоставения субект от групата, намиращ се в ЕИП („крайно дружество майка от ЕИП“), се посочва следното:

- наименование на крайното дружество майка от ЕИП;
- ИКПС на крайното дружество майка от ЕИП;
- държава, в която е установено крайното дружество майка от ЕИП;
- естество на крайното дружество майка от ЕИП (например нефинансов контрагент, кредитна институция, инвестиционен посредник, предприятие за колективно инвестиране в прехвърлими ценни книжа (ПКИПЦК), алтернативен инвестиционен фонд (АИФ), застрахователно дружество).

В допълнение, когато правните субекти са част от група извън ЕИП (т.е. крайното дружество майка на групата се намира извън ЕИП), за най-високопоставения субект от групата, намиращ се извън ЕИП („крайно дружество майка извън ЕИП“), се посочва следното:

- наименование на крайното дружество майка извън ЕИП;
- ИКПС на крайното дружество майка извън ЕИП;
- държава, в която е установено крайното дружество майка извън ЕИП;
- естество на крайното дружество майка извън ЕИП (например нефинансов контрагент, кредитна институция, инвестиционен посредник, предприятие за колективно инвестиране в прехвърлими ценни книжа (ПКИПЦК), алтернативен инвестиционен фонд (АИФ), застрахователно дружество).

Компетентните органи предоставят информацията във формата и в съответствие с указанията, определени от ЕБО.

ПРИЛОЖЕНИЕ 2

Посочената по-долу информация се предоставя за всеки правен субект (т.е. контрагент по смисъла на РЕПИ), установен в ЕИП, по отношение на който се прилага изискването за размяна на първоначално допълнително обезпечение в съответствие с Делегиран регламент (ЕС) 2016/2251 на Комисията ⁽⁵⁾ („Съвместни регулаторни технически стандарти на ЕНО относно извънборсовите деривати, за които не е извършен клиринг“) и който е станал лицензиран ползвател на SIMM на ISDA — самостоятелно или като част от група (т.е. от ЕИП или извън ЕИП).

Идентификационни данни

- наименование на правния субект на индивидуално равнище;
- държава, в която е установен субектът;
- идентификационен код на правния субект (ИКПС).

⁽⁵⁾ ОВ L 340, 15.12.2016 г., стр. 9–46