

Rozhodnutí Evropského orgánu pro bankovníctví EBA/DC/610

ze dne 27. ledna 2026

o opatřeních pro zajištění funkce validace modelu počátečních marží podle nařízení EMIR v souvislosti s modelem ISDA SIMM

Rada orgánů dohledu

s ohledem na nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 1093/2010 ze dne 24. listopadu 2010 o zřízení Evropského orgánu dohledu (Evropského orgánu pro bankovníctví), o změně rozhodnutí č. 716/2009/ES a o zrušení rozhodnutí Komise 2009/78/ES¹ (dále jen „nařízení o orgánu EBA“), a zejména na čl. 1 odst. 2, článek 2, čl. 8 odst. 1 písm. b) a j), čl. 8 odst. 1a písm. a), čl. 8 odst. 2 písm. j), čl. 31 odst. 2 písm. a), b) a f) a článek 35 uvedeného nařízení, a

s ohledem na nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 648/2012 ze dne 4. července 2012 o OTC derivátech, ústředních protistranách a registrech obchodních údajů² (dále jen „nařízení EMIR“), a zejména na čl. 11 odst. 3 a 12a uvedeného nařízení,

vzhledem k těmto důvodům:

- (1) Nařízení EMIR v čl. 11 odst. 3 a 12a stanoví, že orgán EBA odpovídá za validaci pro forma modelů a jejich změn. Takovým pro forma modelem je model ISDA SIMM. Pro validaci modelu ISDA SIMM by měly být dále upřesněny všechny aspekty funkce validace, kterou má orgán EBA provádět v souladu s nařízením EMIR, přičemž systém validace by měl být zaveden přechodně, aniž je dotčen čl. 89 odst. 11 nařízení EMIR, dokud nebude funkční centrální databáze orgánu ESMA uvedená v článku 17c nařízení EMIR.
- (2) Vzhledem k úloze orgánu EBA jakožto ústředního orgánu pro validaci by průběžné sledování z jeho strany mělo usilovat o co nejširší účast v systému validace. V této souvislosti by se jako uživatelé systému validace měly zapojit orgány EBA, EIOPA a ESMA a finanční a nefinanční smluvní strany používající model ISDA SIMM, relevantní příslušné orgány i Mezinárodní asociace pro swapy a deriváty (ISDA) a měly by účinně spolupracovat při výměně informací nezbytných pro všechny aspekty funkce validace.
- (3) Na všechny informace obsažené v systému validace by se měl vztahovat právní rámec EU týkající se služebního tajemství, důvěrnosti a ochrany osobních údajů a přístup k těmto informacím by měl být poskytnut uživatelům v souladu s nařízením o orgánu EBA. Jelikož se orgán EBA stává významným datovým centrem, měl by být systém validace v zájmu snížení zátěže a nákladů spojených s vykazováním a zvýšení účinnosti pro všechny uživatele začleněn do Evropské centralizované infrastruktury pro údaje z oblasti dohledu (EUCLID).

¹ Úř. věst. L 331, 15.12.2010, s. 12–47.

² Úř. věst. L 201, 27.7.2012, s. 1.

- (4) Aby se podpořilo řádné fungování systému validace, měly by žádosti o validaci podléhat předchozímu procesu onboardingu. Za tímto účelem by měl orgán EBA zahájit strukturovaný proces onboardingu s cílem shromáždit všechny informace potřebné k identifikaci smluvních stran používajících model ISDA SIMM. Příslušné orgány by měly orgánu EBA poskytnout názvy a další relevantní údaje o finančních a nefinančních smluvních stranách, které požádaly o povolení modelu počátečních marží založeného na modelu ISDA SIMM v souladu s čl. 11 odst. 3 třetím pododstavcem nařízení EMIR. Souběžně by v souladu s čl. 11 odst. 12a druhým pododstavcem nařízení EMIR měla asociace ISDA spolupracovat s orgánem EBA a poskytovat mu informace o smluvních stranách, které používají model ISDA SIMM. Aby se zabránilo zdvojení činnosti a zajistila se přesnost údajů, měl by orgán EBA proces onboardingu koordinovat, přičemž se může případně spoléhat na potvrzení ze strany příslušných orgánů.
- (5) Je třeba zajistit, aby příslušné orgány a asociace ISDA neprodleně poskytovaly informace o nových smluvních stranách používajících model ISDA SIMM k usnadnění procesu onboardingu, na jehož základě smluvní strany splní svou povinnost podle nařízení EMIR požádat o validaci svého modelu prostřednictvím systému validace.
- (6) V zájmu odstranění zbytečné zátěže a s ohledem na skutečnost, že nařízení EMIR vyžaduje, aby za účelem validace asociace ISDA účinně spolupracovala s orgánem EBA, by asociace ISDA měla nést odpovědnost za včasné poskytnutí všech nezbytných informací týkajících se modelu a jeho případných aktualizací. Aby měl orgán EBA ucelený přehled o modelu a jeho plánovaných aktualizacích, měly by tyto informace zahrnovat jak obecné aspekty modelu, které jsou předmětem aktualizace, tak i ty, na něž se aktualizace nevztahuje.
- (7) Onboardované finanční a nefinanční smluvní strany používající model ISDA SIMM by měly orgán EBA požádat o validaci poté, co orgán EBA potvrdí, že asociace ISDA poskytla prostřednictvím systému validace nebo jiným způsobem, který orgán EBA považuje za vhodný, úplné informace a podpůrnou dokumentaci, pokud jde o prvky a obecné aspekty modelu ISDA SIMM. Při podávání těchto žádostí by se mělo předpokládat, že se vztahují k a týkají se pro forma modelu ISDA SIMM, jak jej popsala asociace ISDA jakožto vývojář modelu v informacích a podpůrné dokumentaci poskytnutých orgánu EBA. Tento dvoustupňový proces, který zahrnuje nejprve předložení údajů o specifikách modelu a jeho případných změnách asociací ISDA a poté podání žádosti smluvní stranou o validaci jejího modelu orgánem EBA, by měl být dodržován i v případě jakékoli následné změny modelu ISDA SIMM. K zajištění maximální účinnosti by v případě, že žádost o validaci je obdržena po validaci stávajícího modelu ISDA SIMM, mělo být rozhodnutí o validaci generováno automaticky prostřednictvím systému.
- (8) Asociace ISDA by měla orgánu EBA oznámit jakoukoli aktualizaci modelu ISDA SIMM, orgán EBA by si však měl zachovat flexibilitu při posuzování toho, které z těchto aktualizací představují změnu modelu vyžadující validaci. Proces validace modelu ISDA SIMM by měl být zahájen pouze v případě aktualizací, které orgán EBA podle svého uvážení považuje za změny modelu.
- (9) První validace modelu ISDA SIMM by měla zahrnovat všechny aktualizace a změny modelu do data přijetí uvedeného rozhodnutí o prvotní validaci. V tomto rozhodnutí by měla být rovněž stanovena lhůta v délce šesti nebo tří měsíců podle nařízení EMIR, ve které je orgán EBA podle právních předpisů povinen validaci udělit nebo zamítnout, a tato lhůta by měla začít běžet od první žádosti, kterou orgán EBA obdrží prostřednictvím systému validace.

- (10) Vzhledem k tomu, že model ISDA SIMM je na světovém trhu široce využíván, a aby se zabránilo jakémukoli narušení trhu, měl by orgán EBA přistoupit k udělení validace, jakmile asociace ISDA předloží všechny nezbytné informace o modelu, pokud tato validace nebude považována za zjevně nevhodnou s ohledem na podmínky na trhu nebo potřebu zajistit finanční stabilitu. V takovém případě by měla být validace zamítnuta. Ke zvýšení jistoty trhu a na podporu stability by validace modelu ISDA SIMM neměla být časově omezená, a právě z tohoto důvodu by měla být současně ověřována trvalá vhodnost modelu ISDA SIMM, což by mělo být zajištěno průběžným sledováním modelu orgánem EBA, jak je stanoveno v čl. 11 odst. 12a třetím pododstavci nařízení EMIR.
- (11) Validace modelu ISDA SIMM prostřednictvím rozhodnutí bez časového omezení v podstatě vyžaduje, aby takové rozhodnutí bylo možné zcela nebo částečně kdykoli zrušit, jestliže orgán EBA na základě svého průběžného sledování nebo *ad hoc* (včetně v naléhavých situacích) dospěje k závěru, že by zachování validace modelu ISDA SIMM nebylo vzhledem k podmínkám na trhu nebo potřebě zajistit finanční stabilitu vhodné. Mělo by být zajištěno, aby orgán EBA v případech, kdy je zachování validace modelu ISDA SIMM považováno za nevhodné, zrušil jeho validaci bez ohledu na to, zda asociace ISDA nebo jakýkoli jiný uživatel systému validace dodržel doporučení orgánu EBA vydaná během jeho průběžného sledování, jež jim mohla být určena. Ke zrušení validace modelu ISDA SIMM by měla vést rovněž skutečnost, že asociace ISDA nespolupracuje, s výjimkou případů, pokud a dokud to z důvodu finanční stability nebo integrity trhu není vhodné, neboť taková nespolupráce znemožňuje průběžné sledování vhodnosti modelu ISDA SIMM, jak to vyžaduje nařízení EMIR.
- (12) Jelikož průběžné sledování slouží k validaci modelu ISDA SIMM, je třeba upřesnit, které prvky by měly být minimálně zahrnuty do sledování prováděného orgánem EBA. V zájmu zajištění transparentnosti by orgán EBA měl do své výroční zprávy uvedené v nařízení EMIR zahrnout klíčová zjištění vyplývající z tohoto sledování.
- (13) Finanční nebo nefinanční smluvní strany mají právo být vyslechnuty pouze v případě, že orgán EBA zamýšlí validaci modelu ISDA SIMM neudělit nebo ji částečně či zcela zrušit.
- (14) Je třeba zajistit, aby všichni uživatelé systému validace s orgánem EBA účinně a účelně spolupracovali a umožnili mu tak vykonávat jeho funkci validace. V této souvislosti by smluvní strany měly orgán EBA informovat, pokud přestanou splňovat požadavky aktuálně validovaného modelu ISDA SIMM, přičemž by příslušné orgány a smluvní strany měly orgánu EBA průběžně nebo *ad hoc* poskytovat veškeré informace nezbytné pro funkci validace.
- (15) Aby byla zajištěna včasná reakce a zároveň byly dodrženy zavedené zásady pro přenesení úkolů v souladu s právními předpisy, měl by být Stálý výbor pro regulaci a politiku (SCRePol) pověřen udělováním validací následných změn, zatímco rada orgánů dohledu by měla udělovat prvotní validaci modelu ISDA SIMM a rozhodovat o zamítnutí následné validace nebo o úplném či částečném zrušení rozhodnutí o validaci. V zájmu větší flexibility by měl být výkonný ředitel pověřen přijímáním všech technických rozhodnutí nezbytných pro fungování systému validace a výkon funkce validace. Rada orgánů dohledu by měla být informována o všech takových následných validacích provedených výborem SCRePol a o technických rozhodnutích výkonného ředitele, přičemž radě orgánů dohledu by nic nemělo bránit v tom, aby v případě potřeby tato pověření zrušila.
- (16) Při přijímání tohoto rozhodnutí konzultoval orgán EBA orgány EIOPA a ESMA i asociaci ISDA, jakož i příslušné orgány, které se podílejí na vnitřní struktuře správy a řízení orgánu EBA,

rozhodla takto:

Článek 1 – Předmět a oblast působnosti

1. Tímto rozhodnutím se zřizuje informační systém (dále jen „systém validace modelu ISDA SIMM“) jako prozatímní opatření do doby, než bude funkční databáze orgánu ESMA uvedená v článku 17c nařízení EMIR.
2. Uživateli systému validace modelu ISDA SIMM (dále jen „uživatelé“) jsou orgány EBA, ESMA a EIOPA, příslušné orgány uvedené v čl. 2 bodě 13 nařízení EMIR (dále jen „příslušné orgány“) a finanční a nefinanční smluvní strany uvedené v článku 11 nařízení EMIR, které používají model ISDA SIMM (dále jen „smluvní strany“), a asociace ISDA.
3. Na informace obsažené v systému validace modelu ISDA SIMM se vztahuje právní rámec EU týkající se služebního tajemství, důvěrnosti a ochrany osobních údajů platný pro orgán EBA. Přístup se řídí články 70, 71 a 72 nařízení o orgánu EBA.
4. Informace předložené orgánu EBA prostřednictvím systému validace modelu ISDA SIMM se považují za informace předložené prostřednictvím Evropské centralizované datové infrastruktury (EUCLID), přičemž se použije rozhodnutí EBA/DC/2020/335 ze dne 5. června 2020 týkající se EUCLID, včetně budoucích změn nebo nahrazení.

Článek 2 – Onboarding smluvních stran

1. Příslušné orgány poskytnou orgánu EBA prostřednictvím systému validace modelu ISDA SIMM nebo jiným způsobem, který orgán EBA považuje za vhodný, informace uvedené v příloze 1 pro všechny smluvní strany, které používají model počátečních marží založený na modelu ISDA SIMM a mají povinnost požádat o povolení uvedené v čl. 11 odst. 3 třetím pododstavci nařízení EMIR.
2. Příslušné orgány poskytnou orgánu EBA bez zbytečného odkladu informace uvedené v příloze 1 pro jakoukoli smluvní stranu, která o takové povolení požádá po datu použitelnosti tohoto rozhodnutí.
3. Asociace ISDA poskytne orgánu EBA prostřednictvím systému validace modelu ISDA SIMM nebo jiným způsobem, který orgán EBA považuje za vhodný, informace uvedené v příloze 2 pro všechny nové smluvní strany používající model ISDA SIMM, které mají povinnost požádat o povolení uvedené v čl. 11 odst. 3 třetím pododstavci nařízení EMIR.
4. Po obdržení oznámení od orgánu EBA získají smluvní strany bez zbytečného odkladu přístup k systému validace, aby mohly dokončit proces onboardingu, včetně stanovení osob s právem přístupu k systému validace modelu ISDA SIMM (dále jen „oprávnění uživatelé“) a přijetí jazykových podmínek.
5. smluvní strany, které neobdrží výše uvedené oznámení a mají povinnost požádat orgán EBA o validaci svého modelu v souladu s čl. 11 odst. 3 třetím pododstavcem nařízení EMIR, postoupí záležitost orgánu EBA. Relevantní příslušný orgán neprodleně poskytne orgánu EBA na jeho žádost informace nezbytné pro onboarding dotyčné smluvní strany.

Článek 3 – Poskytování informací a podpůrné dokumentace, pokud jde o model ISDA SIMM a jeho aktualizace

1. Asociace ISDA poskytne v souladu s čl. 11 odst. 12a druhým pododstavcem nařízení EMIR bez zbytečného odkladu orgánu EBA prostřednictvím systému validace modelu ISDA SIMM nebo jiným způsobem, který orgán EBA považuje za vhodný, veškeré informace a podpůrnou dokumentaci, včetně informací o prvcích a obecných aspektech, kalibraci, návrhu a pokrytí nástrojů, kategoriích aktiv a rizikových faktorech relevantních pro model ISDA SIMM a o všech jeho aktualizacích.
2. Pro první validaci modelu ISDA SIMM se asociace ISDA vynasnaží poskytnout informace uvedené v odstavci 1:
 - a) pro model ISDA SIMM, který je v současné době v platnosti, bez zbytečného odkladu po vstupu tohoto rozhodnutí v platnost;
 - b) v případě jakékoli plánované aktualizace v současnosti platného modelu ISDA SMM do 14. srpna 2026.
3. Pro účely validace jakékoli následné změny modelu ISDA SIMM asociace ISDA zajistí, aby byly informace uvedené v odstavci 1 poskytnuty orgánu EBA v každém případě nejpozději čtrnáct (14) týdnů před datem, k němuž se aktualizace stane použitelnou.
4. Asociace ISDA oznámí veškeré aktualizace modelu ISDA SIMM a poskytne k nim všechny relevantní informace. Pokud aktualizace oznámená asociací ISDA nepředstavuje podle orgánu EBA změnu, včetně případů uvedených v odstavci 6, zůstává dříve udělená validace v platnosti a proces validace se nezahajuje.
5. Za změny modelu ISDA SIMM se považují tyto aktualizace:
 - a) aktualizace, které změní strukturální základy modelu ISDA SIMM, včetně návrhu, zachycování rizik či předpokladů, nebo podstatně pozmění zacházení se závislostmi v rámci modelu ISDA SIMM;
 - b) aktualizace, které povedou k tomu, že model ISDA SIMM bude zachycovat nové kategorie aktiv nebo druhy rizik nebo že již nebude zachycovat dříve zachycované kategorie aktiv nebo druhy rizik.
6. Aktualizace ovlivňující pouze parametry modelu vyplývající z již existujících a validovaných metodiky modelu ISDA SIMM, včetně aktualizací rizikových vah a vzájemných vztahů, nebo aktualizace týkající se objasnění, zpřesnění a oprav dokumentace nebo technických aktualizací se za změny modelu ISDA SIMM nepovažují.

Článek 4 – Žádost o validaci

1. Orgán EBA poskytne prostřednictvím systému validace modelu ISDA SIMM nebo jiným způsobem, který považuje za vhodný, onboardovaným smluvním stranám potvrzení, že asociace ISDA předložila pro model ISDA SIMM úplné informace a dokumentaci v souladu s článkem 3.

2. Po obdržení potvrzení uvedeného v předchozím odstavci požádají onboardované smluvní strany bez zbytečného odkladu prostřednictvím systému validace modelu ISDA SIMM nebo jiným způsobem, který orgán EBA považuje za vhodný, o validaci svého modelu a zároveň prohlásí, že tento model je plně v souladu s pro forma modelem ISDA SIMM, jak jej popisuje asociace ISDA v informacích a podpůrné dokumentaci předložených podle článku 3.
3. Následné žádosti o změnu modelu ISDA SIMM generuje systém validace modelu ISDA SIMM automaticky pro všechny onboardované smluvní strany, které v souladu s čl. 6 odst. 5 neuvedly, že přestaly splňovat požadavky modelu ISDA SIMM nebo že již nemají povinnost požádat o validaci a povolení v souladu s nařízením EMIR.
4. Pokud orgán EBA obdrží žádost o validaci modelu ISDA SIMM poté, co byl validován, udělí se validace této žádosti automaticky prostřednictvím systému validace. Tato validace se vztahuje na validovaný model ISDA SIMM.

Článek 5 – Validace a zamítnutí validace modelu ISDA SIMM

1. Pokud asociace ISDA splní článek 3, orgán EBA udělí validaci modelu ISDA SIMM nebo jeho změny, s výjimkou případů, kdy je validace modelu ISDA SIMM nebo jeho změny podle orgánu EBA zjevně nevhodná s ohledem na podmínky na trhu nebo potřebu zajistit finanční stabilitu.
2. První validace modelu ISDA SIMM se vztahuje na všechny aktualizace a změny modelu až do dne, kdy rozhodnutí o validaci vstoupí v platnost, a rozhodne se o ní v souladu s odstavcem 1 do šesti měsíců od první žádosti, kterou orgán EBA obdrží podle článku 4.
3. O validaci případné změny modelu ISDA SIMM se rozhodne v souladu s odstavcem 1 do tří měsíců od první žádosti, kterou orgán EBA obdrží podle článku 4. Následné rozhodnutí o validaci modelu ISDA SIMM po jeho změně zruší a nahradí předchozí rozhodnutí o validaci.
4. O validaci nebo zamítnutí validace modelu ISDA SIMM či jeho změny jsou informovány všechny smluvní strany, které podaly žádost v souladu s článkem 4.
5. Validace modelu ISDA SIMM není časově omezená a zruší se v souladu s článkem 6.

Článek 6 – Zrušení validace modelu ISDA SIMM

1. Pokud ze sledování uvedeného v článku 7 vyplýne, že zachování validace modelu ISDA SIMM není podle orgánu EBA vhodné s ohledem na podmínky na trhu nebo potřebu zajistit finanční stabilitu, orgán EBA tuto validaci zcela nebo částečně zruší.
2. I když se odstavec 1 nepoužije, orgán EBA validaci modelu ISDA SIMM zruší, pokud asociace ISDA nebude spolupracovat tak, jak je stanoveno v tomto rozhodnutí, mimo jiné pokud neposkytne požadované informace, s výjimkou případů, kdy by takové zrušení ohrozilo integritu trhu nebo finanční stabilitu.
3. Orgán EBA zruší rozhodnutí o validaci v souladu s odstavci 1 nebo 2 bez ohledu na to, zda strany, pro něž byla vydána doporučení uvedená v čl. 7 odst. 4, tato doporučení provedly.
4. Rozhodnutí o zrušení validace se zašlou všem smluvním stranám, jejichž modely byly validovány v souladu s tímto rozhodnutím.

5. Validace modelu ISDA SIMM se automaticky zruší prostřednictvím systému validace modelu ISDA SIMM pro každou smluvní stranu, která v souladu s čl. 10 odst. 2 prohlásí, že přestala splňovat požadavky modelu ISDA SIMM, jak byl validován orgánem EBA, nebo že již nemá povinnost požádat o validaci a povolení v souladu s nařízením EMIR.

Článek 7 – Sledování

1. Orgán EBA bude průběžně sledovat vhodnost validovaného modelu ISDA SIMM a bude analyzovat veškeré nahlášené či jinak vzniklé problémy. Klíčová zjištění zahrne do výroční zprávy uvedené v čl. 11 odst. 12a třetím pododstavci nařízení EMIR.
2. Sledování ze strany orgánu EBA uvedené v odstavci 1 zahrnuje alespoň toto:
 - a) soulad modelu ISDA SIMM s kritérii pro obecné požadavky, období krytí rizika marží, kalibraci parametru, diverzifikaci rizika, zajištění a kompenzaci rizika podle podkladových aktiv nebo kvalitativní požadavky nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2016/2251 ze dne 4. října 2016, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 648/2012 o OTC derivátech, ústředních protistranách a registrech obchodních údajů, pokud jde o regulační technické normy pro techniky zmírňování rizika u OTC derivátových smluv, jejichž clearing neprovádí ústřední protistrana³;
 - b) posouzení pokrytí rizikových faktorů a jejich přiměřenosti, také s ohledem na vývoj na trhu a zátěžové události;
 - c) posouzení kalibrace modelu;
 - d) posouzení celkové výkonnosti modelu na základě výsledků zpětného testování;
 - e) další skutečnosti, na něž orgán EBA upozorní orgány EIOPA a ESMA, příslušné orgány nebo asociace ISDA.
3. Sledování prováděné orgánem EBA podle tohoto článku mu nebrání v tom, aby *ad hoc* znovu posoudil, zda je validace modelu ISDA SIMM i nadále vhodná, a to i v naléhavých situacích nebo při nepříznivém vývoji na trhu.
4. Ve výroční zprávě uvedené v čl. 11 odst. 12a třetím pododstavci nařízení EMIR může orgán EBA vydat doporučení s ohledem na případné problémy, které má asociace ISDA či některý uživatel systému validace vyřešit. Tato doporučení se mohou týkat rizik, faktorů, jež nejsou ve validovaném modelu ISDA SIMM odpovídajícím způsobem zohledněny, oblasti působnosti, pokrytí nástrojů a kategorií aktiv, kalibrace nebo jakékoli jiné metodiky na základě modelu ISDA SIMM validovaného orgánem EBA nebo na základě předpokládané změny tohoto modelu.

Článek 8 – Právo být vyslechnut

1. Pokud orgán EBA zamýšlí neudělit validaci modelu ISDA SIMM nebo částečně či zcela validaci zrušit z důvodu nevhodnosti modelu ISDA SIMM, smluvní strany, které požádaly o validaci v souladu s článkem 4 nebo jejichž modely byly validovány podle tohoto rozhodnutí, jsou o úmyslu orgánu EBA vyzooměny a je jim poskytnuta lhůta v délce dvaceti [20] pracovních dnů, během níž mohou vyjádřit své stanovisko.

³ Úř. věst. L 340, 15.12.2016, s. 9–46.

2. Oznámení a vyjádření stanoviska uvedené v předchozím odstavci se uskuteční prostřednictvím systému validace modelu ISDA SIMM nebo jiným způsobem, který orgán EBA považuje za vhodný.

Článek 9 – Transparentnost

1. Každé rozhodnutí o udělení nebo zamítnutí validace a každé rozhodnutí o částečném nebo úplném zrušení validace se prostřednictvím systému validace modelu ISDA SIMM oznámí všem uživatelům.
2. Každé rozhodnutí o zamítnutí a každé rozhodnutí o částečném nebo úplném zrušení validace uvádí důvody, na nichž je založeno, a informuje smluvní strany o dostupných opravných prostředcích podle nařízení o orgánu EBA.
3. Každé rozhodnutí o udělení nebo zamítnutí validace a každé rozhodnutí o částečném nebo úplném zrušení validace a každé stanovisko předložené v souvislosti s výkonem práva být vyslechnut se bez zbytečného odkladu zveřejní na internetových stránkách orgánu EBA, ledaže je takové zveřejnění podle orgánu EBA v rozporu s oprávněnými zájmy těchto finančních institucí nebo s ochranou jejich obchodního tajemství nebo by mohlo vážně ohrozit řádné fungování a integritu finančních trhů nebo stabilitu celého finančního systému Unie nebo jeho části.

Článek 10 – Požadavky na poskytování informací a spolupráci

1. Příslušné orgány:
 - a) zajistí, aby systém validace modelu ISDA SIMM obsahoval přesné a aktuální informace o smluvních stranách, které požádaly o povolení v souladu s čl. 11 odst. 3 třetím pododstavcem nařízení EMIR pro jakýkoli model počátečních marží založený na modelu ISDA SIMM, a
 - b) poskytují orgánu EBA prostřednictvím systému validace modelu ISDA SIMM nebo jiným způsobem, který orgán EBA považuje za vhodný, informace, které shromáždily během počátečního či probíhajícího postupu povolování modelu ISDA SIMM či změny tohoto modelu na úrovni subjektů.
2. Smluvní strany bez zbytečného odkladu informují orgán EBA prostřednictvím systému validace modelu ISDA SIMM, pokud přestanou splňovat požadavky aktuálně validovaného modelu ISDA SIMM nebo již nemají povinnost požádat o validaci a povolení v souladu s nařízením EMIR.
3. Uživatelé poskytnou orgánu EBA prostřednictvím systému validace nebo jiným způsobem, který orgán EBA považuje za vhodný, informace nezbytné pro účinné provedení validace a posouzení trvalé vhodnosti modelu ISDA SIMM, mimo jiné včetně informací uvedených v příloze.
4. Uživatelé poskytnou orgánu EBA prostřednictvím systému validace nebo jiným způsobem, který orgán EBA považuje za vhodný, veškeré doplňující informace a údaje, které orgán EBA považuje za nezbytné pro výkon funkce validace.

5. Informace uvedené v předchozím odstavci zahrnují orientačně informace a údaje o použití, výkonnosti, kalibraci nebo uplatňování modelu ISDA SIMM, informace a údaje o výši marží vypočítaných pomocí standardizované tabulky nebo modelů počátečních marží, kvalitativní informace o výslovných rozhodnutích nepoužití modely počátečních marží, statistiky o urovnáních a sporech, podrobnosti o nejdůležitějších sporech a statistiky a údaje o navýšeních uplatněných nad rámec počáteční marže.
6. Kromě poskytování informací a údajů uvedených v předchozích odstavcích uživatelé bez zbytečného odkladu s orgánem EBA spolupracují, aby mu umožnili vykonávat jeho funkci validace, a prostřednictvím systému validace nebo jakýmkoli způsobem, který orgán EBA považuje za vhodný, poskytují orgánu EBA veškeré informace, které si vyžádá.

Článek 11 – Přijímání rozhodnutí

1. První rozhodnutí o udělení validace modelu ISDA SIMM, rozhodnutí o zamítnutí validace a rozhodnutí o úplném či částečném zrušení validace přijímá v souladu s články 5 a 6 rada orgánů dohledu.
2. Následné rozhodnutí o udělení validace změny modelu ISDA SIMM v souladu s čl. 5 odst. 1 přijímá Stálý výbor pro regulaci a politiku (SCRePol). Rada orgánů dohledu je o těchto rozhodnutích řádně informována. Při přijímání rozhodnutí o udělení validace změny modelu ISDA SIMM usiluje výbor SCRePol o dosažení shody. Není-li shody dosaženo, přijímá se rozhodnutí prostou většinou členů výboru SCRePol jmenovaných členem rady orgánů dohledu s hlasovacím právem. Zdržení se hlasování či nevyjádření stanoviska se započítává ve prospěch rozhodnutí. Pokud výbor SCRePol zjistí, že validace změny modelu ISDA SIMM musí být zamítnuta, zašle svůj návrh radě orgánů dohledu, aby mohla přijmout konečné rozhodnutí.
3. Výkonný ředitel je oprávněn činit následující rozhodnutí, přičemž o nich řádně informuje radu orgánů dohledu:
 - a) vyžádat si od kteréhokoli uživatele doplňující informace nebo jej požádat o zvláštní spolupráci v souvislosti s konkrétní otázkou týkající se uplatňování tohoto rozhodnutí a
 - b) upřesnit oblast působnosti, obsah, formát, četnost, referenční data, pravidla týkající se IT, pravidla pro validaci a pokyny týkající se informací a údajů obsažených v systému validace modelu ISDA SIMM, určit účel zpracování osobních údajů a právo přístupu k systému validace modelu ISDA SIMM a stanovit veškerá další nezbytná provozní pravidla nebo technické specifikace (dále jen „technické specifikace systému validace modelu ISDA SIMM“) pro uplatňování tohoto rozhodnutí.

Článek 12 – Závěrečná ustanovení

Toto rozhodnutí vstupuje v platnost dne 1. března 2026.

V Paříži dne

José Manuel Campa
předseda

Za radu orgánů dohledu

PŘÍLOHA 1

Níže uvedené informace se poskytují pro každou právnickou osobu (tj. smluvní stranu ve smyslu nařízení EMIR) usazenou v EHP, na kterou se vztahuje požadavek na výměnu informací o počáteční marži v souladu s nařízením Komise v přenesené pravomoci (EU) 2016/2251⁴ (dále jen „společná regulační technická norma evropských orgánů dohledu pro OTC deriváty, u nichž se neprovádí clearing“) a která je licencovaným uživatelem modelu ISDA SIMM – ať už individuálně, nebo v rámci skupiny (tj. v EHP nebo mimo EHP).

Identifikační údaje

- název právnické osoby,
- kód LEI,
- povaha právnické osoby (např. nefinanční smluvní strana, úvěrová instituce, investiční podnik, subjekt kolektivního investování do převoditelných cenných papírů (SKIPCP), alternativní investiční fond, pojišťovna),
- země, v níž je právnická osoba usazena,
- příslušný orgán odpovědný za povolení modelu počátečních marží dané právnické osoby.

Informace o objemu počáteční marže

- posouzení pásma (tj. fáze 1 až 6), do něhož právnická osoba v současné době patří podle článku 36 společné regulační technické normy evropských orgánů dohledu pro OTC deriváty, u nichž se neprovádí clearing (např. souhrnná průměrná pomyslná hodnota > 3 000 miliard EUR; 8 miliard EUR < souhrnná průměrná pomyslná hodnota ≤ 50 miliard EUR),
- údaj o tom, zda má právnická osoba měsíční průměrnou nesplacenou pomyslnou hodnotu OTC derivátů, u nichž se neprovádí centrální clearing, ve výši nejméně 750 miliard EUR na úrovni skupiny, jak je uvedeno v čl. 11 odst. 15 prvním pododstavci písm. aa) nařízení EMIR (ano/ne).

Kontaktní údaje a informace týkající se IT

- funkční e-mailová adresa týmu dané právnické osoby odpovědného za povolení modelu počátečních marží,
- e-mailové domény používané danou právnickou osobou,

⁴ Úř. věst. L 340, 15.12.2016, s. 9–46.

- kontaktní údaje kontaktní osoby č. 1.
Kontaktní osoba č. 1 odpovídá za řízení přístupu smluvní strany k systému validace modelu ISDA SIMM zřízenému orgánem EBA. Tato kontaktní osoba může plnit také úlohu předkladatele údajů pro validaci modelu počátečních marží:
 - jméno a příjmení,
 - úloha v instituci,
 - e-mailová adresa a telefonní číslo,
- kontaktní údaje kontaktních osob č. 2 a 3.
Kontaktní osoby č. 2 a 3 plní úlohu předkladatelů údajů pro validaci modelu počátečních marží:
 - jméno a příjmení,
 - úloha v instituci,
 - e-mailová adresa a telefonní číslo.

Informace o skupině, ke které právnická osoba patří

Pokud je právnická osoba součástí skupiny z EHP, tj. je přímým nebo nepřímým dceřiným podnikem jiného subjektu nacházejícího se v EHP, uvedou se tyto informace o nejvýše postaveném subjektu ve skupině, který se nachází v EHP (dále jen „nejvyšší mateřský podnik v EHP“):

- název nejvyššího mateřského podniku v EHP,
- kód LEI nejvyššího mateřského podniku v EHP,
- země, v níž je nejvyšší mateřský podnik v EHP usazen,
- povaha nejvyššího mateřského podniku v EHP (např. nefinanční smluvní strana, úvěrová instituce, investiční podnik, subjekt kolektivního investování do převoditelných cenných papírů (SKIPCP), alternativní investiční fond, pojišťovna).

Navíc pokud jsou právnické osoby součástí skupiny mimo EHP (tj. nejvyšší mateřský podnik skupiny se nachází mimo EHP), uvedou se tyto informace o nejvýše postaveném subjektu ve skupině, který se nachází mimo EHP (dále jen „nejvyšší mateřský podnik mimo EHP“):

- název nejvyššího mateřského podniku mimo EHP,
- kód LEI nejvyššího mateřského podniku mimo EHP,
- země, v níž je nejvyšší mateřský podnik mimo EHP usazen,

- povaha nejvyššího mateřského podniku mimo EHP (např. nefinanční smluvní strana, úvěrová instituce, investiční podnik, subjekt kolektivního investování do převoditelných cenných papírů (SKIPCP), alternativní investiční fond, pojišťovna)).

Příslušné orgány poskytují informace ve formátu stanoveném orgánem EBA a v souladu s jeho pokyny.

PŘÍLOHA 2

Níže uvedené informace se poskytují pro každou právnickou osobu (tj. smluvní stranu ve smyslu nařízení EMIR) usazenou v EHP, na kterou se vztahuje požadavek na výměnu informací o počáteční marži v souladu s nařízením Komise v přenesené pravomoci (EU) 2016/2251⁵ („společná regulační technická norma evropských orgánů dohledu pro OTC deriváty, u nichž se neprovádí clearing“) a která se stala licencovaným uživatelem modelu ISDA SIMM – ať už individuálně, nebo v rámci skupiny (tj. v EHP nebo mimo EHP).

Identifikační údaje

- název právnické osoby na individuální úrovni,
- země, v níž je právnická osoba usazena,
- kód LEI.

⁵ Úř. věst. L 340, 15.12.2016, s. 9–46.