

Az Európai Bankhatóság EBA/DC/610. sz. határozata

(2026. január 27.)

az ISDA SIMM-mel kapcsolatos, az EMIR szerinti alapletétmodell-jóváhagyási feladatkörre vonatkozó intézkedésekről

A felügyeleti tanács,

tekintettel az európai felügyeleti hatóság (Európai Bankhatóság) létrehozásáról, a 716/2009/EK határozat módosításáról és a 2009/78/EK bizottsági határozat hatályon kívül helyezéséről szóló, 2010. november 24-i 1093/2010/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletre ¹ (a továbbiakban: EBH-rendelet) és különösen annak 1. cikke (2) bekezdésére, 2. cikkére, 8. cikke (1) bekezdésének b) és j) pontjára, 8. cikke (1a) bekezdésének a) pontjára, 8. cikke (2) bekezdésének j) pontjára, 31. cikke (2) bekezdésének a), b) és f) pontjára és 35. cikkére, valamint

tekintettel a tőzsdén kívüli származtatott ügyletekről, a központi szerződő felekről és a kereskedési adattákról szóló, 2012. július 4-i 648/2012/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletre ² (a továbbiakban: az EMIR) és különösen annak 11. cikke (3) és (12a) bekezdésére,

mivel:

- (1) Az EMIR 11. cikkének (3) és (12a) bekezdése meghatározza, hogy az EBH felelős a formális modellek és azok bármely módosításának jóváhagyásáért. Az ISDA által kidolgozott SIMM (Standard Alapletétmodell) egy ilyen formális modell. Az ISDA SIMM jóváhagyása tekintetében tovább kell pontosítani az EBH által az EMIR-rel összhangban ellátandó jóváhagyási feladatkör valamennyi aspektusát, és egyúttal ideiglenesen és az EMIR 89. cikke (11) bekezdésének sérelme nélkül létre kell hozni egy jóváhagyási rendszert mindaddig, amíg az ESMA-nak az EMIR 17c. cikke szerinti központi adatbázisa működőképesé nem válik.
- (2) Az EBH központi jóváhagyási szerepére tekintettel, amelynek keretében folyamatos nyomon követést is végez, a jóváhagyási rendszerben a lehető legszélesebb körű részvételre kell törekedni. Ennek fényében az EBH-nak, az EIOPA-nak, az ESMA-nak, az ISDA SIMM-et használó pénzügyi és nem pénzügyi szerződő feleknek, az érintett illetékes hatóságoknak és a Csereügyletek és Derivatívák Nemzetközi Társaságának (ISDA) a jóváhagyási rendszer felhasználóiként hatékonyan együtt kell működniük a jóváhagyási feladatkör valamennyi aspektusához szükséges információk cseréje érdekében.
- (3) A jóváhagyási rendszerben megtalálható valamennyi információra a szakmai titoktartásra, a bizalmas kezelésre és a személyes adatok védelmére vonatkozó uniós jogi keret alkalmazandó, és az ezen információkhoz való hozzáférést az EBH-rendelettel összhangban kell a felhasználók

¹ HL L 331., 2010.12.15., 12–47. o.

² HL L 201., 2012.7.27., 1. o.

rendelkezésére bocsátani. Mivel az EBH egyre jelentősebb adatközponttá válik, az adatszolgáltatási terhek és költségek csökkentése, valamint valamennyi felhasználó hatékonyságának növelése érdekében integrálni kell a jóváhagyási rendszert a felügyeleti adatok európai központosított infrastruktúrájába (EUCLID).

- (4) A jóváhagyási rendszer megfelelő működésének támogatása érdekében a jóváhagyási kérelmeknek előzetes beléptetési folyamaton kell végigmenniük. E célból az EBH-nak strukturált beléptetési folyamatot kell kezdeményeznie az ISDA SIMM modellt alkalmazó szerződő felek azonosításához szükséges valamennyi információ összegyűjtése érdekében. Az illetékes hatóságoknak az EMIR 11. cikke (3) bekezdésének harmadik albekezdésével összhangban az EBH rendelkezésére kell bocsátaniuk azon pénzügyi és nem pénzügyi szerződő felek nevét és egyéb releváns adatait, amelyek az ISDA SIMM-en alapuló alapletétmodell engedélyezését kérelmezték. Ezzel párhuzamosan az EMIR 11. cikke (12a) bekezdésének 2. albekezdésével összhangban az ISDA-nak együtt kell működnie az EBH-val azáltal, hogy az ISDA SIMM-et használó ügyfelekről információkat szolgáltat. Az ismétlődések elkerülése és az adatok pontosságának biztosítása érdekében az EBH-nak koordinálnia kell az új ügyfelek beléptetésének folyamatát, és adott esetben támaszkodhat az illetékes hatóságoktól kapott megerősítésre.
- (5) Biztosítani kell, hogy az illetékes hatóságok és az ISDA haladéktalanul tájékoztatást nyújtsanak az ISDA SIMM-et használó új szerződő felekről annak érdekében, hogy megkönnyítsék a beléptetési folyamatot, amely alapján a szerződő felek teljesítik az EMIR szerinti azon kötelezettségüket, hogy modelljük jóváhagyását kérelmezzék a jóváhagyási rendszeren keresztül.
- (6) A szükségtelen terhek kiküszöbölése érdekében, valamint figyelembe véve, hogy az EMIR értelmében az ISDA-nak jóváhagyási célokból hatékonyan együtt kell működnie az EBH-val, az ISDA felel a modellre és annak bármely frissítésére vonatkozó valamennyi szükséges információ időben történő rendelkezésre bocsátásáért. Ahhoz, hogy az EBH teljes körű ismeretekkel rendelkezzen a modellről és a tervezett modellfrissítésről, ezeknek az információknak le kell fedniük a modellnek mind a frissítés tárgyát képező, mind a frissítés tárgyát nem képező általános szempontjait.
- (7) Az ISDA SIMM-et használó, beléptetett pénzügyi és nem pénzügyi szerződő feleknek azt követően kell kérelmezniük az EBH általi jóváhagyást, hogy az EBH megerősítette, az ISDA a jóváhagyási rendszeren keresztül vagy bármely más, az EBH által megfelelőnek ítélt módon rendelkezésre bocsátotta az ISDA SIMM elemekre és általános szempontjaira vonatkozó teljes körű tájékoztatást és valamennyi igazoló dokumentumot. Az ilyen kérelmeket benyújtásukkor úgy kell tekinteni, hogy azok az ISDA mint modellfejlesztő által az EBH-nak benyújtott információkban és igazoló dokumentumokban leírtak szerinti ISDA SIMM formális modellre hivatkoznak és vonatkoznak. Az ISDA SIMM modell bármely későbbi módosítása esetén ezt a kétféle lépéses folyamatot kell követni, amelynek első lépése az ISDA által a modell sajátosságaira és az azokhoz kapcsolódó bármely módosításra vonatkozó információk benyújtása, majd a második lépés a szerződő fél által az EBH-hoz benyújtott, modelljének jóváhagyására irányuló kérelem. A maximális hatékonyság biztosítása érdekében abban az esetben, ha a jóváhagyás iránti kérelem az aktuális ISDA SIMM jóváhagyását követően érkezik be, a jóváhagyási döntést automatikusan létre kell hozni a rendszeren keresztül.
- (8) Az ISDA-nak értesítenie kell az EBH-t az ISDA SIMM bármely frissítéséről, ugyanakkor az EBH-nak rugalmasan kell értékelnie, hogy ezek közül mely frissítések minősülnek jóváhagyást

igénylő modellmódosításnak. Csak az EBH által modellváltozásnak tekintett frissítések indíthatják el az ISDA SIMM jóváhagyási folyamatot.

- (9) Az ISDA SIMM első jóváhagyásának ki kell terjednie a modell valamennyi, a kezdeti jóváhagyási határozat elfogadásának időpontjáig elvégzett frissítésére és módosítására. E határozatban ki kell jelölni azt a hat hónapos vagy három hónapos határidőt is, amelyen belül az EBH jogilag köteles megadni vagy megtagadni a jóváhagyást, és ennek a határidőnek a jóváhagyási rendszeren keresztül az EBH-hoz beérkezett első kérelem beküldésének dátumával kell kezdődnie.
- (10) Tekintettel arra, hogy az ISDA SIMM-et széles körben alkalmazzák a globális piacon, valamint a piaci zavarok elkerülése érdekében az EBH-nak meg kell adnia a jóváhagyást, amint az ISDA benyújtja a modellre vonatkozó valamennyi szükséges információt, feltéve, hogy ez a jóváhagyás nem tekinthető nyilvánvalóan nem megfelelőnek a piaci feltételekre vagy a pénzügyi stabilitás biztosításának szükségességére tekintettel, amely esetben a jóváhagyást meg kell tagadni. A piaci bizonyosság növelése és a stabilitás előmozdítása érdekében az ISDA SIMM jóváhagyása nem lehet időben korlátozott, és éppen ezért azt az ISDA SIMM folyamatos megfelelőségére vonatkozó ellenőrzésnek kell kísérnie, amit az EMIR 11. cikke (12a) bekezdésének harmadik albekezdésében foglaltak szerint a modellnek az EBH által végzett folyamatos nyomon követése révén kell biztosítani.
- (11) Az ISDA SIMM időkorlát nélküli határozat útján történő jóváhagyása lényegében megköveteli, hogy az ilyen határozat részben vagy egészben szabadon visszavonható legyen, amennyiben az EBH – folyamatos nyomon követés révén vagy *eseti* alapon, többek között vészhelyzetek során – úgy ítéli meg, hogy az ISDA SIMM jóváhagyásának fenntartása a piaci feltételekre vagy a pénzügyi stabilitás biztosításának szükségességére tekintettel nem lenne helyénvaló. Biztosítani kell, hogy az EBH visszavonja az ISDA SIMM jóváhagyását, amennyiben annak fenntartása nem tekinthető megfelelőnek, függetlenül attól, hogy az ISDA vagy a jóváhagyási rendszer bármely más felhasználója, amelyhez az EBH a folyamatos nyomon követés során ajánlásokat intézett, eleget tett-e ezeknek az ajánlásoknak. Az ISDA együttműködésének hiánya az ISDA SIMM jóváhagyásának visszavonását is eredményezheti – kivéve, ha és ameddig a pénzügyi stabilitási vagy piaci integritási megfontolások ennek az ellenkezőjét diktálják –, mivel az együttműködés hiánya lehetetlenné teszi az ISDA SIMM alkalmasságának az EMIR által előírt folyamatos nyomon követését.
- (12) Tekintettel arra, hogy a folyamatos nyomon követés az ISDA SIMM jóváhagyásához szolgálat adatokat, fontos határozni, hogy az EBH által végzett ilyen nyomon követésnek legalább mely elemekre kell kiterjednie. Az átláthatóság biztosítása érdekében az EBH-nak az EMIR-ben említett éves jelentésébe be kell foglalnia a nyomon követésen alapuló legfontosabb megállapításait.
- (13) A pénzügyi vagy nem pénzügyi szerződő feleknek csak akkor van joguk meghallgatásra, ha az EBH nem szándékozik jóváhagyni az ISDA SIMM-et, illetve részben vagy egészben vissza kívánja vonni a jóváhagyást.
- (14) Biztosítani kell, hogy a jóváhagyási rendszer valamennyi felhasználója hatékonyan és eredményesen együttműködjön az EBH-val annak érdekében, hogy az el tudja látni jóváhagyási feladatkörét. Ennek fényében a szerződő feleknek tájékoztatniuk kell az EBH-t, ha már nem felelnek meg a jelenleg jóváhagyott ISDA SIMM-nek, az illetékes hatóságoknak és a szerződő

feleknek pedig folyamatosan vagy eseti alapon tájékoztatniuk kell az EBH-t a jóváhagyási feladatkörének teljesítéséhez szükséges információkról.

(15) A gyors válaszadási képesség biztosítása és egyúttal a feladatok jogszerű átruházására vonatkozóan megállapított elvek tiszteletben tartása érdekében a Szabályozással és Szakpolitikával Foglalkozó Állandó Bizottságot (SCRePol) fel kell hatalmazni a későbbi módosítások jóváhagyására, a felügyeleti tanácsot pedig az ISDA SIMM kezdeti jóváhagyására, valamint a későbbi jóváhagyások esetleges megtagadásáról vagy a jóváhagyási határozat teljes vagy részleges visszavonásáról való döntéshozatalra. A rugalmasság fokozása érdekében az ügyvezető igazgatót fel kell hatalmazni arra, hogy meghatározza a jóváhagyási rendszer működéséhez és a jóváhagyási feladatkör ellátásához szükséges valamennyi technikai szempontot. A felügyeleti tanácsot folyamatosan tájékoztatni kell az SCRePol általi későbbi jóváhagyásokról és az ügyvezető igazgató által meghatározott technikai szempontokról, ugyanakkor semmi sem akadályozhatja meg a felügyeleti tanácsot abban, hogy adott esetben visszavonja az ilyen megbízásokat.

(16) E határozat elfogadása tekintetében az EBH konzultációt folytatott az EIOPA-val, az ESMA-val és az ISDA-val, valamint az EBH belső irányítási struktúrájában részt vevő illetékes hatóságokkal.

a következőképpen határozott:

1. cikk – Tárgy és hatály

1. Ez a határozat ideiglenes intézkedésként létrehoz egy információs rendszert (a továbbiakban: ISDA SIMM jóváhagyási rendszer) addig, amíg az EMIR 17c. cikkében előírányzott ESMA-adatbázis működőképesé nem válik.
2. Az EBH, az ESMA, az EIOPA, az EMIR 2. cikkének (13) bekezdésében említett illetékes hatóságok (a továbbiakban: illetékes hatóságok) és az EMIR 11. cikkében említett, az ISDA SIMM modellt alkalmazó pénzügyi és nem pénzügyi szerződő felek (a továbbiakban: szerződő felek), valamint az ISDA az ISDA SIMM jóváhagyási rendszer felhasználói (a továbbiakban: felhasználók).
3. Az ISDA SIMM jóváhagyási rendszerben foglalt információkra kiterjed a szakmai titoktartásra, a bizalmas kezelésre és a személyes adatok védelmére vonatkozó, az EBH-ra alkalmazandó uniós jogi keret. A hozzáférés az EBH-rendelet 70., 71. és 72. cikke szerint biztosítandó.
4. Az ISDA SIMM jóváhagyási rendszeren keresztül az EBH-nak benyújtott információkat az Európai Központi Adatinfrastruktúrán (EUCLID) keresztül benyújtott információknak kell tekinteni, és az EUCLID-re vonatkozó 2020. június 5-i EBA/DC/2020/335 határozat, valamint annak jövőbeli módosításai vagy az annak helyébe lépő határozatok alkalmazandók rájuk.

2. cikk – Az ügyfelek beléptetése

1. Az illetékes hatóságok az ISDA SIMM jóváhagyási rendszeren keresztül vagy bármely más, az EBH által megfelelőnek ítélt módon az EBH rendelkezésére bocsátják az 1. mellékletben foglalt információkat minden olyan szerződő fél tekintetében, amely az ISDA SIMM-en alapuló alapterületmodellt alkalmaz, és köteles az EMIR 11. cikke (3) bekezdésének harmadik albekezdés szerinti engedélykérésre.

2. Az illetékes hatóságok indokolatlan késedelem nélkül az EBH rendelkezésére bocsátják az 1. mellékletben foglalt információkat minden olyan szerződő fél tekintetében, amely e határozat alkalmazásának kezdőnapját követően nyújt be ilyen engedély iránti kérelmet.
3. Az ISDA az ISDA SIMM jóváhagyási rendszeren keresztül vagy bármely más, az EBH által megfelelőnek ítélt módon benyújtja az EBH-nak a 2. mellékletben szereplő információkat minden olyan új szerződő félről, amely az ISDA SIMM-et használja, és amely köteles az EMIR 11. cikke (3) bekezdésének harmadik albekezdése szerinti engedélykérésre.
4. Az EBH értesítésének kézhezvételét követően a szerződő felek indokolatlan késedelem nélkül hozzáférést kapnak a jóváhagyási rendszerhez a beléptetési folyamat befejezése céljából, többek között az ISDA SIMM jóváhagyási rendszerhez hozzáférési jogosultsággal rendelkező személyek (a továbbiakban: jogosult felhasználók) kijelölése és a nyelvi feltételek elfogadása révén.
5. Azoknak a szerződő feleknek, amelyek nem kapták meg a fenti értesítést, és az EMIR 11. cikke (3) bekezdésének harmadik albekezdése szerint kötelesek az EBH-hoz fordulni modelljük jóváhagyása érdekében, az ügyet az EBH elé kell terjeszteniük. Az érintett illetékes hatóság az EBH kérésére haladéktalanul az EBH rendelkezésére bocsátja az adott szerződő fél beléptetéséhez szükséges információkat.

3. cikk – Az ISDA SIMM és annak bármely frissítésével kapcsolatos információk és kiegészítő dokumentáció rendelkezésre bocsátása

1. Az ISDA az EMIR 11. cikke (12a) bekezdésének második albekezdésével összhangban indokolatlan késedelem nélkül az EBH rendelkezésére bocsátja az ISDA SIMM jóváhagyási rendszerén keresztül vagy bármely más, az EBH által megfelelőnek ítélt módon az összes szükséges információt és alátámasztó dokumentációt, beleértve az egyes elemekre és általános szempontokra, a kalibrálásra, a kialakításra és az eszközök, eszközosztályok szerinti lefedettségre, valamint az ISDA SIMM és annak bármely frissítése szempontjából releváns kockázati tényezőkre vonatkozó információkat is.
2. Az ISDA törekszik arra, hogy az első ISDA SIMM jóváhagyás tekintetében az (1) bekezdésben említett információkat:
 - (a) a jelenleg hatályos ISDA SIMM modell esetében e határozat hatálybalépését követően indokolatlan késedelem nélkül;
 - (b) a jelenleg hatályos ISDA SMM modell bármely tervezett frissítése esetén 2026. augusztus 14-ig rendelkezésre bocsátssa.
3. Az ISDA SIMM bármely későbbi módosításának jóváhagyása esetén az ISDA gondoskodik arról, hogy az (1) bekezdés szerinti információkat minden esetben legkésőbb tizennégy (14) héttel a frissítés hatálybalépésének időpontja előtt megküldje az EBH-nak.
4. Az ISDA köteles értesítést küldeni az ISDA SIMM minden frissítéséről, és minden releváns információt megküldeni azokról. Amennyiben az ISDA által bejelentett frissítés az EBH megítélése szerint nem minősül módosításnak – beleértve a (6) bekezdésben említett eseteket is –, továbbra is a korábban megadott jóváhagyás alkalmazandó, és a jóváhagyási eljárás nem indul el.

5. Az ISDA SIMM bármely frissítése a következő esetben minősülnek az ISDA SIMM módosításának:

(a) a frissítés megváltoztatja az ISDA SIMM strukturális alapjait, beleértve a kialakítást, illetve a kockázatok leképezését vagy feltételezését, vagy jelentősen módosítja az ISDA SIMM függőségeinek kezelését;

(b) a frissítés eredményeképpen új, az ISDA SIMM által figyelembe vett eszközosztályok vagy kockázattípusok jönnek létre, illetve korábban figyelembe vett eszközosztályok vagy kockázattípusok kikerülnek az ISDA SIMM-ből.

6. A kizárólag a már meglévő és jóváhagyott ISDA SIMM módszertanból eredő modellparamétereket érintő frissítések – beleértve a kockázati súlyokra és a korrelációkra, illetve a pontosításokra, a dokumentáció finomítására és korrekciójára vagy a technikai fejlesztésekre vonatkozó frissítéseket is – nem tekintendők az ISDA SIMM módosításának.

4. cikk – Jóváhagyás iránti kérelem

1. Az EBH az ISDA SIMM jóváhagyási rendszeren keresztül vagy bármely más megfelelőnek ítélt módon megerősíti a beléptetett ügyfelek számára, hogy az ISDA a 3. cikknek megfelelően benyújtotta az ISDA SIMM-hez szükséges teljes körű információkat és dokumentációt.
2. Az előző bekezdés szerinti megerősítés kézhezvételét követően a beléptetett szerződő felek haladéktalanul kérelmezik az ISDA SIMM jóváhagyási rendszeren keresztül vagy bármely más, az EBH által megfelelőnek ítélt módon a modelljük jóváhagyását, nyilatkozva arról, hogy az teljes mértékben összhangban áll az ISDA SIMM formális modellnek az ISDA által a 3. cikknek megfelelően benyújtott tájékoztatóban és kiegészítő dokumentációban ismertetett formájával.
3. Az ISDA SIMM módosítására irányuló későbbi kérelmeket az ISDA SIMM jóváhagyási rendszere automatikusan elkészíti minden olyan beléptetett partner esetében, amelyek nem nyilatkoztak a 6. cikk (5) bekezdésével összhangban arról, hogy már nem felelnek meg az ISDA SIMM-nek, vagy pedig arról, hogy a továbbiakban már nem kell az EMIR szerinti jóváhagyást és engedélyt kérniük.
4. Amennyiben az EBH-hoz az ISDA SIMM jóváhagyását követően az ISDA SIMM jóváhagyása iránti kérelem érkezik be, az adott kérelem jóváhagyását a jóváhagyási rendszeren keresztül automatikusan meg kell adni. Ez a jóváhagyás az ISDA SIMM jóváhagyott formájára vonatkozik.

5. cikk – Az ISDA SIMM jóváhagyása és a jóváhagyás megtagadása

1. Amennyiben az ISDA eleget tett a 3. cikknek, az EBH jóváhagyja az ISDA SIMM-et vagy annak bármely módosítását, kivéve, ha az ISDA SIMM vagy annak bármely módosítása az EBH véleménye szerint nyilvánvalóan nem megfelelő a piaci feltételekre vagy a pénzügyi stabilitás biztosításának szükségességére tekintettel.
2. Az első ISDA SIMM jóváhagyás kiterjed a modellnek a jóváhagyási határozat hatálybalépéséig végrehajtott valamennyi frissítésére és módosítására, és arról az (1) bekezdéssel összhangban, az EBH-hoz a 4. cikk szerint beérkezett első kérelemtől számított hat hónapon belül kell határozni.

3. Az ISDA SIMM bármely módosításának jóváhagyásáról az EBH-hoz a 4. cikkel összhangban benyújtott első kérelemtől számított három hónapon belül, az (1) bekezdésnek megfelelően kell dönteni. Az ISDA SIMM-et annak módosítását követően jóváhagyó bármely későbbi határozat hatályon kívül helyezi a korábbi jóváhagyó határozatokat, és azok helyébe lép.
4. Az ISDA SIMM-re vagy annak módosítására vonatkozó jóváhagyást vagy jóváhagyás megtagadását minden olyan szerződő félnek kell címezni, amely a 4. cikkel összhangban kérelmet nyújtott be.
5. Az ISDA SIMM jóváhagyása időben nem korlátozott, és a 6. cikknek megfelelően visszavonható.

6. cikk – Az ISDA SIMM jóváhagyásának visszavonása

1. Amennyiben a 7. cikk szerinti nyomon követés alapján az ISDA SIMM jóváhagyásának fenntartása az EBH véleménye szerint a piaci feltételekre vagy a pénzügyi stabilitás biztosításának szükségességére tekintettel nem helyénvaló, a jóváhagyást az EBH részben vagy egészben visszavonja.
2. Amennyiben az ISDA nem működik együtt az e határozatban meghatározott módon, az EBH akkor is visszavonja az ISDA SIMM jóváhagyását, ha az (1) bekezdés nem alkalmazandó, ideértve azt az esetet is, ha az ISDA nem adja át a kért információkat – kivéve, ha a visszavonás veszélyeztetné a piac integritását vagy a pénzügyi stabilitást.
3. Az EBH az (1) vagy a (2) bekezdéssel összhangban visszavonja a jóváhagyási határozatot, függetlenül attól, hogy a 7. cikk (4) bekezdésében említett ajánlásokat azok címzettjei végrehajtották-e.
4. A visszavonásról szóló határozatokat minden olyan szerződő félnek kell címezni, amelynek modelljét az adott határozattal összhangban hagyták jóvá.
5. Az ISDA SIMM jóváhagyását automatikusan vissza kell vonni az ISDA SIMM jóváhagyási rendszerén keresztül minden olyan partner esetében, amely a 10. cikk (2) bekezdésével összhangban nyilatkozik arról, hogy már nem felel meg az EBH által jóváhagyott ISDA SIMM-nek, vagy a továbbiakban már nem köteles az EMIR szerinti jóváhagyást és engedélyezést kérni.

7. cikk – Nyomon követés

1. Az EBH folyamatosan nyomon követi a jóváhagyott ISDA SIMM megfelelőségét, és elemzi a bejelentett vagy más módon felmerülő problémákat. A legfontosabb megállapításait bele kell foglalnia az EMIR 11. cikke (12a) bekezdésének harmadik albekezdése szerinti éves jelentésébe.
2. Az (1) bekezdésben említett jelentésnek legalább a következőket kell tartalmaznia:
 - (a) az ISDA SIMM megfelelése a tőzsdén kívüli származtatott ügyletekről, a központi szerződő felekről és a kereskedési adattárakról szóló 648/2012/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletnek a nem központi szerződő félén keresztül elszámolt tőzsdén kívüli származtatott ügyletek kockázatcsökkentési technikáit meghatározó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről szóló, 2016. október 4-i (EU) 2016/2251 felhatalmazáson alapuló bizottsági rendeletben foglalt, az általános követelményekre, a letéti kockázati

periódusra, a paraméterek kalibrálására, a diverzifikációra, a fedezeti műveletekre és a kockázatkiegyenlítésre vonatkozó kritériumoknak³;

(b) a kockázati tényezők lefedettségének és megfelelőségének értékelése, figyelembe véve a piaci fejleményeket és a stresszhelyzeteket is;

(c) a modell kalibrálásának értékelése;

(d) a modell általános teljesítményének értékelése az utótesztelés eredményei alapján;

(e) az EIOPA, az ESMA, az illetékes hatóságok vagy az ISDA által az EBH tudomására hozott egyéb elemek.

3. Az EBH e cikk szerinti nyomon követése nem akadályozza meg az EBH-t abban, hogy – többek között vészhelyzetekben vagy kedvezőtlen piaci fejlemények esetén – *eseti* alapon újraértékelje, továbbra is megfelelő-e az ISDA SIMM jóváhagyása.
4. Az EMIR 11. cikke (12a) bekezdésének harmadik albekezdésében említett éves jelentésben az EBH ajánlásokat fogalmazhat meg az ISDA vagy a jóváhagyási rendszer bármely felhasználója által kezelendő kérdésekre vonatkozóan. Ezek az ajánlások vonatkozhatnak a kockázatokra, a jóváhagyott ISDA SIMM-ben nem megfelelően tükrözött tényezőkre, az alkalmazási körre, a lefedett instrumentumokra és eszközosztályokra, a kalibrálásra vagy bármely más, az EBH által jóváhagyott ISDA SIMM-en, illetve annak bármely előre látható módosításán alapuló módszertanra.

8. cikk – A meghallgatáshoz való jog

1. Amennyiben az EBH nem szándékozik jóváhagyni az ISDA SIMM-et, vagy az ISDA SIMM nem megfelelősége miatt részben vagy egészben vissza kívánja vonni a jóváhagyást, az EBH-nak értesítenie kell e szándékáról azokat a szerződő feleket, akik a 4. cikknek megfelelően jóváhagyást kértek, vagy akiknek modelljét e határozat alapján hagyták jóvá, és hús [20] munkanapos határidőt kell biztosítania számukra a véleményük kifejtésére.
2. Az előző bekezdés szerinti értesítést és véleménynyilvánítást az ISDA SIMM jóváhagyási rendszeren keresztül vagy bármely más, az EBH által megfelelőnek ítélt módon kell elvégezni.

9. cikk – Átláthatóság

1. Bármely, a jóváhagyás megadásáról vagy megtagadásáról szóló határozatról, valamint a jóváhagyás részleges vagy teljes visszavonásáról szóló határozatról minden felhasználót értesíteni kell az ISDA SIMM jóváhagyási rendszeren keresztül.
2. Bármely jóváhagyás megtagadására, illetve részleges vagy teljes visszavonására vonatkozó határozatban meg kell jelölni az annak alapjául szolgáló indokokat, és tájékoztatni kell a szerződő feleket az EBH-rendelet alapján rendelkezésre álló jogorvoslati lehetőségekről.
3. A jóváhagyás megadásáról vagy megtagadásáról, illetve a jóváhagyás részleges vagy teljes visszavonásáról szóló határozatokat, valamint a meghallgatáshoz való jog gyakorlásával összefüggésben benyújtott véleményeket indokolatlan késedelem nélkül közzé kell tenni az EBH

³ HL L 340., 2016.12.15., 9–46. o.

honlapján, kivéve, ha a közzététel az EBH megítélése szerint ellentétes a pénzügyi intézmények jogos érdekeivel vagy üzleti titkaik védelmével, illetve súlyosan veszélyeztetheti a pénzügyi piacok szabályos működését és integritását, vagy az uniós pénzügyi rendszer egészének vagy egy részének stabilitását.

10. cikk – Tájékoztatásnyújtási és együttműködési követelmények

4. Az illetékes hatóságoknak:

(a) biztosítaniuk kell, hogy az ISDA SIMM jóváhagyási rendszer pontos és naprakész információkat tartalmazzon azokról a szerződő felekről, amelyek az EMIR 11. cikke (3) bekezdésének harmadik albekezdése szerint engedélyt kértek az ISDA SIMM-en alapuló bármely alapletétmodellre vonatkozóan; és

(b) át kell adniuk az ISDA SIMM jóváhagyási rendszerén keresztül vagy bármely más, az EBH által megfelelőnek ítélt módon az ISDA SIMM-re vagy annak bármely módosítására vonatkozó kezdeti, illetve szervezeti szintű, folyamatos engedélyezési eljárás során összegyűjtött információkat az EBH számára.

5. A szerződő felek indokolatlan késedelem nélkül tájékoztatják az EBH-t az ISDA SIMM jóváhagyási rendszeren keresztül, ha már nem felelnek meg az ISDA SIMM jelenleg jóváhagyott formájának, vagy már nem kötelesek az EMIR szerinti jóváhagyás és engedélyezés kérelmezésére.

6. A felhasználók a jóváhagyási rendszeren keresztül vagy bármely más, az EBH által megfelelőnek ítélt módon az EBH rendelkezésére bocsátják az ISDA SIMM folyamatos megfelelőségének ellenőrzéséhez és értékeléséhez szükséges információkat, beleértve – de nem kizárólagos jelleggel – a mellékletben meghatározott információkat.

7. A felhasználók a jóváhagyási rendszeren keresztül vagy bármely más, az EBH által megfelelőnek ítélt módon az EBH rendelkezésére bocsátanak minden olyan további információt és adatot, amelyet az EBH a jóváhagyási feladatkör ellátásához szükségesnek ítél.

8. Az előző bekezdésben említett információknak indikatív jelleggel tartalmazniuk kell az ISDA SIMM használatára, teljesítményére, kalibrálására vagy alkalmazására vonatkozó információkat és adatokat, a letétek szabványosított ütemterv vagy alapletétmodellek használatával kiszámított összegére vonatkozó információkat és adatokat, az alapletétmodellek használatának kifejezett elutasítására vonatkozó kvalitatív információkat, az egyeztetési gyakorlatokra és vitákra vonatkozó statisztikákat, a legfontosabb viták részleteit, valamint az alapletetre alkalmazott többletekre vonatkozó statisztikákat és adatokat.

9. A fenti bekezdésekben említett információk és adatok rendelkezésre bocsátásán túlmenően a felhasználók kötelesek indokolatlan késedelem nélkül együttműködni az EBH-val annak érdekében, hogy az elláthassa jóváhagyási feladatkörét, és a jóváhagyási rendszeren keresztül vagy bármely más, az EBH által megfelelőnek ítélt módon az EBH rendelkezésére bocsátják az EBH által kért információkat.

11. cikk – Döntéshozatal

1. Az ISDA SIMM jóváhagyásáról szóló első határozatokat, a jóváhagyás megtagadásáról szóló határozatokat és a jóváhagyás részleges vagy teljes visszavonásáról szóló határozatokat az 5. és 6. cikkel összhangban a felügyeleti tanács hozza meg.

2. Az ISDA SIMM módosításának jóváhagyására vonatkozó későbbi határozatokat az 5. cikk (1) bekezdésével összhangban a Szabályozási és Politikai Állandó Bizottság (SCRePol) hozza meg. A felügyelőbizottságot megfelelően tájékoztatni kell ezekről a határozatokról. Az SCRePol az ISDA SIMM módosítását jóváhagyó határozatot elfogadásakor konszenzusra törekszik. Konszenzus hiányában a határozatot a felügyeleti tanács szavazati joggal rendelkező tagja által kinevezett SCRePol-tagok egyszerű többségével kell elfogadni. A tartózkodás és az állásfoglalás hiánya a határozat melletti szavazatnak számít. Amennyiben az SCRePol úgy határoz, hogy az ISDA SIMM modell módosításának jóváhagyását meg kell tagadni, javaslatát a végleges határozat meghozatala céljából megküldi a felügyeleti tanácsnak.
3. Az ügyvezető igazgató jogosult határozni a következőkről, és e határozatokról köteles a felügyelő bizottságot megfelelően tájékoztatni:
 - (a) további információkat vagy konkrét együttműködést kérhet bármely felhasználótól az e határozat alkalmazásával kapcsolatos konkrét kérdésekkel kapcsolatban; és
 - (b) meghatározhatja az ISDA SIMM jóváhagyási rendszerben szereplő információk és adatok hatályát, tartalmát, formátumát, gyakoriságát, referencia-időpontjait, informatikai szabályait, jóváhagyási szabályait és utasításait, a személyes adatok kezelésének célját és az ISDA SIMM jóváhagyási rendszerhez való hozzáférési jogokat, valamint az e határozat alkalmazásához szükséges egyéb üzemeltetési szabályokat vagy műszaki előírásokat (a továbbiakban: az ISDA SIMM jóváhagyási rendszer műszaki előírásai).

12. cikk – Záró rendelkezések

Ez a határozat 2026. március 1-jén lép hatályba.

Kelt Brüsszelben,

JOSÉ MANUEL CAMPA
elnök

a felügyeleti tanács részéről

1. MELLÉKLET

Az alábbiakban feltüntetett információkat minden olyan, az EGT-ben letelepedett jogalanyra (azaz az EMIR értelmében vett szerződő félre) vonatkozóan meg kell adni, amelyre érvényes az (EU) 2016/2251 felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelettel⁴ (a közös európai felügyeleti hatóságoknak az el nem számolt tőzsdén kívüli származtatott ügyletekről szóló szabályozástechnikai standardjai) összhangban az alapletét cseréjére vonatkozó követelmény, és amely az ISDA SIMM engedélyezett felhasználója, akár egyénileg, akár egy (EGT-n belüli vagy kívüli) csoport részeként.

Azonosító információk

- a jogi személy neve,
- LEI-kód,
- a szervezet jellege (pl. nem pénzügyi szerződő fél, hitelintézet, befektetési vállalkozás, átruházható értékpapírokkal foglalkozó kollektív befektetési vállalkozás (ÁÉKBV), alternatív befektetési alap (ABA), biztosító),
- a szervezet székhelye szerinti ország,
- a szervezet alapletétmodelljének engedélyezésért felelős illetékes hatóság.

Az alapletét-volumenre vonatkozó információk

- annak a csoportnak (azaz az 1–6. szakasz egyikének) az értékelése, amelyhez a szervezet az európai felügyeleti hatóságok el nem számolt, tőzsdén kívüli származtatott ügyletekről szóló közös szabályozástechnikai standardjainak 36. cikke szerint jelenleg tartozik (pl. aggregált átlagos névleges összeg > 3000 milliárd EUR; 8 milliárd EUR < aggregált átlagos névleges összeg ≤ 50 milliárd EUR),
- annak feltüntetése, hogy a gazdálkodó szervezet nem központilag elszámolt, tőzsdén kívüli származtatott ügyletei kintlévőségeinek havi átlagos névértéke eléri-e csoportszinten a havi legalább 750 milliárd EUR összeget az EMIR 11. cikke (15) bekezdése első albekezdésének aa) pontjában meghatározottak szerint (igen/nem).

Elérhetőségek és informatikai adatok

- a szervezet alapletétmodelljének engedélyezéséért felelős csoport (működő) e-mail-címe,
- a szervezet által használt e-mail-domének,

⁴ HL L 340., 2016.12.15., 9–46. o.

- Az 1. kapcsolattartó elérhetőségei.
Az 1. kapcsolattartó feladata, hogy kezelje a szerződő félnek az EBH-nak az ISDA SIMM jóváhagyására szolgáló rendszeréhez való hozzáférését. Ez a kapcsolattartó az alapletétmodell-jóváhagyással kapcsolatos adatok benyújtójának szerepét is betöltheti:
 - vezetéknév és utónév,
 - az intézményben betöltött szerep,
 - e-mail-cím és telefonszám.
- A 2. és 3. kapcsolattartó elérhetőségei.
A 2. és 3. kapcsolattartó az alapletétmodell-jóváhagyással kapcsolatos adatok benyújtójának szerepét is betöltheti:
 - vezetéknév és utónév,
 - az intézményben betöltött szerep,
 - e-mail-cím és telefonszám.

A szervezetet magában foglaló csoportra vonatkozó információk

Amennyiben a szervezet egy EGT-csoport része, azaz egy másik, az EGT-ben található szervezet közvetlen vagy közvetett leányvállalata, a csoport legmagasabb szintű, az EGT-ben megtalálható szervezete (a továbbiakban: legfelső szintű EGT-n belüli anyavállalat) esetében a következőket kell feltüntetni:

- a legfelső szintű EGT-szintű anyavállalat neve,
- a legfelső szintű EGT-n belüli anyavállalat LEI-kódja,
- a legfelső szintű EGT-n belüli anyavállalat székhelye szerinti ország,
- a legfelső szintű EGT-n belüli anyavállalat jellege (pl. nem pénzügyi szerződő fél, hitelintézet, befektetési vállalkozás, átruházható értékpapírokkal foglalkozó kollektív befektetési vállalkozás (ÁÉKBV), alternatív befektetési alap (ABA), biztosító).

Ezen túlmenően, amennyiben a jogi személyek egy nem az EGT-n belüli csoport részét képezik (azaz a csoport legfelső szintű anyavállalata az EGT-n kívül található), a csoporthoz tartozó, az EGT-n kívül található legmagasabb szintű vállalkozás (a továbbiakban: a legfelső szintű nem EGT-n belüli anyavállalat) esetében a következőket kell feltüntetni:

- a legfelső szintű nem EGT-n belüli anyavállalat neve,
- a legfelső szintű nem EGT-n belüli anyavállalat LEI-kódja,

- a legfelső szintű nem EGT-n belüli anyavállalat székhelye szerinti ország,
- a legfelső szintű nem EGT-n belüli anyavállalat jellege (pl. nem pénzügyi szerződő fél, hitelintézet, befektetési vállalkozás, átruházható értékpapírokkal foglalkozó kollektív befektetési vállalkozás (ÁÉKBV), alternatív befektetési alap (ABA), biztosító).

Az illetékes hatóságok az információkat az EBH által meghatározott formátumban és utasításoknak megfelelően nyújtják be.

2. MELLÉKLET

Az alábbiakban feltüntetett információkat minden olyan, az EGT-ben letelepedett jogalanyra (azaz az EMIR értelmében vett partnerre) vonatkozóan meg kell adni, amelyre érvényes az (EU) 2016/2251 felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelettel ⁵ (a közös európai felügyeleti hatóságoknak az el nem számolt tőzsdén kívüli származtatott ügyletekről szóló szabályozástechnikai standardjai) összhangban az alapletét cseréjére vonatkozó követelmény, és amely az ISDA SIMM engedélyezett felhasználójává vált, akár egyénileg, akár egy (EGT-n belüli vagy kívüli) csoport részeként.

Azonosító információk

- a jogi személy megnevezése egyedi szinten,
- a szervezet székhelye szerinti ország,
- LEI-kód.

⁵ HL L 340., 2016.12.15., 9–46. o.