

Europos bankininkystės institucijos sprendimas EBI/DC/610

2026 m. sausio 27 d.

dėl ERIR numatytos ISDA SIMM pradinės garantinės įmokos modelio patvirtinimo funkcijos
vykdymo tvarkos

Priežiūros taryba,

atsižvelgdama į 2010 m. lapkričio 24 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (ES) Nr. 1093/2010, kuriuo įsteigiama Europos priežiūros institucija (Europos bankininkystės institucija), iš dalies keičiamas Sprendimas Nr. 716/2009/EB ir panaikinamas Komisijos sprendimas 2009/78/EB¹ (toliau – EBI reglamentas), ypač į jo 1 straipsnio 2 dalį, 2 straipsnį, 8 straipsnio 1 dalies b ir j punktus, 8 straipsnio 1a dalies a punktą, 8 straipsnio 2 dalies j punktą, 31 straipsnio 2 dalies a, b ir f punktus ir 35 straipsnį,

atsižvelgdama į 2012 m. liepos 4 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (ES) Nr. 648/2012 dėl ne biržos išvestinių finansinių priemonių, pagrindinių sandorio šalių ir sandorių duomenų saugyklų², visų pirma į jo 11 straipsnio 3 dalį ir 12a straipsnį,

kadangi:

- (1) ERIR 11 straipsnio 3 dalyje ir 12a straipsnyje nustatyta, kad EBI yra atsakinga už pro forma modelių ir bet kokių jų pakeitimų patvirtinimą. Toks pro forma modelis yra ISDA SIMM. Siekiant patvirtinti ISDA SIMM, reikėtų detaliau apibrėžti visus patvirtinimo funkcijos, kurią EBI turi vykdyti pagal ERIR, aspektus, o patvirtinimo sistema turėtų būti įdiegta laikinai ir nepažeidžiant ERIR 89 straipsnio 11 dalies, kol pradės veikti ERIR 17c straipsnyje numatyta ESMA centrinė duomenų bazė;
- (2) įvertinus EBI, kaip centrinės patvirtinančiosios institucijos, vaidmenį, taip pat jos vykdomą nuolatinę stebėseną, reikėtų užtikrinti kuo platesnį dalyvavimą patvirtinimo sistemoje. Atsižvelgiant į tai, EBI, EIOPA, ESMA, finansinės ir nefinansinės sandorio šalys, naudojančios ISDA SIMM, atitinkamos kompetentingos institucijos ir Tarptautinė apsigyvenimo sandorių ir išvestinių finansinių priemonių asociacija (ISDA) turėtų dalyvauti kaip patvirtinimo sistemos naudotojai ir veiksmingai bendradarbiauti keisdami informaciją, reikalingą įgyvendinant visus patvirtinimo funkcijos aspektus;
- (3) visai informacijai, įtrauktai į patvirtinimo sistemą, turėtų būti taikoma ES teisinė profesinės paslapties, konfidencialumo ir asmens duomenų apsaugos sistema, o prieiga prie šios informacijos vartotojams turėtų būti suteikiama laikantis EBI reglamento reikalavimų. Kadangi EBI tampa svarbiu duomenų centru, siekiant sumažinti ataskaitų teikimo naštą ir sąnaudas bei

¹ OL L 331, 2010 12 15, p. 12-47.

² OL L 16, 2012 7 27, p. 1.

padidinti efektyvumą visiems naudotojams, patvirtinimo sistema turėtų būti integruota į Europos centralizuotą priežiūros duomenų infrastruktūrą (EUCLID);

- (4) siekiant padėti užtikrinti tinkamą patvirtinimo sistemos veikimą, patvirtinimo prašymams turėtų būti taikoma išankstinė įtraukimo procedūra. Šiuo tikslu EBI turėtų inicijuoti struktūrizuotą įtraukimo procesą, kad būtų surinkta visa būtina informacija ISDA SIMM modelį naudojančioms sandorio šalims identifikuoti. Kompetentingos institucijos turėtų pateikti EBI finansinių ir nefinansinių sandorio šalių, kurios pagal ERIR 11 straipsnio 3 dalies trečią pastraipą pateikė prašymą leisti naudoti ISDA SIMM pagrįstą pradinės garantinės įmokos modelį, pavadinimus ir kitą susijusią informaciją. Tuo pačiu, kaip numatyta ERIR 11 straipsnio 12a dalies 2 punkte, ISDA turėtų bendradarbiauti su EBI teikdama informaciją apie sandorio šalis, naudojančias ISDA SIMM. Siekiant išvengti dubliavimo ir užtikrinti duomenų tikslumą, EBI turėtų koordinuoti įtraukimo procesą ir prireikus remtis kompetentingų institucijų patvirtinimais;
- (5) reikia užtikrinti, kad kompetentingos institucijos ir ISDA nedelsdamos pateiktų informaciją apie naujas ISDA SIMM naudojančias sandorio šalis, taip siekiant palengvinti įtraukimo į veiklą procesą; tuo pagrindu sandorio šalys vykdys ERIR numatytą prievolę kreiptis dėl savo modelio patvirtinimo per patvirtinimo sistemą;
- (6) siekiant išvengti bereikalingų sunkumų ir atsižvelgiant į tai, kad ERIR numatyta, jog ISDA privalo veiksmingai bendradarbiauti su EBI patvirtinimo tikslais, ISDA turėtų būti atsakinga už savalaikį visos būtinos informacijos apie modelį ir visus jo atnaujinimus, pateikimą. Kad EBI galėtų visapusiškai suprasti modelį ir planuojamus jo atnaujinimus, ta informacija turėtų apimti bendruosius modelio aspektus – ir ketinamus, ir neketinamus atnaujinti;
- (7) įtrauktos ISDA SIMM naudojančios finansinės ir nefinansinės sandorio šalys į EBI dėl patvirtinimo turėtų kreiptis tada, kai gaunamas EBI patvirtinimas, kad ISDA per patvirtinimo sistemą arba kitomis priemonėmis, kurias EBI laiko tinkamomis, pateikė išsamią informaciją apie ISDA SIMM elementus ir bendruosius aspektus bei patvirtinamuosius dokumentus. Turėtų būti daroma prielaida, kad pateiktuose prašymuose minimas ISDA SIMM pro forma modelis, kurį EBI pateiktoje informacijoje ir patvirtinamuosiuose dokumentuose ISDA apibūdino kaip sukurtąjį modelį. Toks dviejų etapų procesas, kai, pirma, ISDA pateikia informaciją apie modelio ypatumus ir visus jo pakeitimus, o tada sandorio šalis kreipiasi į EBI dėl modelio patvirtinimo, turėtų būti vykdomas kaskart, kai atliekami bet kokie ISDA SIMM modelio pakeitimai. Siekiant kuo didesnio veiksmingumo, jeigu prašymas dėl patvirtinimo gaunamas po to, kai dabartinis ISDA SIMM jau buvo patvirtintas, sprendimą dėl patvirtinimo sistema turėtų sugeneruoti automatiškai;
- (8) ISDA turėtų pranešti EBI apie bet kokius ISDA SIMM atnaujinimus, tačiau EBI turėtų būti leidžiama lanksčiai vertinti, kurie iš šių atnaujinimų laikomi patvirtinimo reikalaujančiais modelio pakeitimais. ISDA SIMM patvirtinimo procesas turėtų būti inicijuotas tik tada, kai EBI nusprendžia, kad atnaujinimai laikomi modelio pakeitimais;
- (9) pirmą kartą tvirtinant ISDA SIMM, visi modelio atnaujinimai ir pakeitimai turėtų būti pateikti iki sprendimo dėl pirminio patvirtinimo priėmimo dienos. Šiame sprendime taip pat turėtų būti nurodytas šešių arba trijų mėnesių ERIR nustatytas terminas, per kurį EBI teisiškai privalo ISDA SIMM patvirtinti arba atsisakyti tvirtinti, ir kuris turėtų prasidėti nuo tada, kai per patvirtinimo sistemą EBI gauna pirmą prašymą;

- (10) kadangi ISDA SIMM plačiai naudojamas pasaulinėje rinkoje, siekiant išvengti rinkos sutrikdymo, EBI turėtų modelį patvirtinti, kai tik ISDA pateikia visą būtiną informaciją apie jį, jei toks patvirtinimas nelaikomas akivaizdžiai netinkamu atsižvelgiant į rinkos sąlygas arba poreikį užtikrinti finansinį stabilumą – tokiu atveju modelį tvirtinti turėtų būti atsisakyta. Siekiant didinti užtikrintumą rinkoje ir stabilumą, ISDA SIMM patvirtinimas neturėtų būti ribotos trukmės ir būtent dėl šios priežasties kartu turėtų būti atliekamas nuolatinis ISDA SIMM tinkamumo tikrinimas, kuris turėtų būti užtikrinamas EBI nuolat stebint modelį, kaip nustatyta ERIR 11 straipsnio 12a dalies trečiojo pastraipoje;
- (11) tai, kad ISDA SIMM bus patvirtintas neterminuotu sprendimu, iš esmės reiškia, kad toks sprendimas gali būti visiškai arba iš dalies panaikintas, jei EBI, vykdydama nuolatinę stebėseną ar *ad hoc* pagrindu, taip pat ir kritiniais atvejais, mano, kad ISDA SIMM patvirtinimo statuso išsaugojimas būtų netinkamas atsižvelgiant į rinkos sąlygas arba poreikį užtikrinti finansinį stabilumą. Reikėtų užtikrinti, kad EBI panaikintų ISDA SIMM patvirtinimą, jei jo išsaugojimas laikomas netinkamu, neatsižvelgiant į tai, ar ISDA ar kiti patvirtinimo sistemos naudotojai, kuriems galėjo būti skirtos EBI rekomendacijos, parengtos nuolatinės stebėsenos metu, tokių rekomendacijų laikėsi. ISDA atsisakant bendradarbiauti, ISDA SIMM patvirtinimas taip pat turėtų būti panaikintas, išskyrus atvejus, kai finansinio stabilumo ar rinkos vientisumo išsaugojimo sumetimais verčia elgtis kitaip, nes nebendradarbiaujant tampa neįmanoma nuolat stebėti ISDA SIMM tinkamumo, kaip to reikalauja ERIR;
- (12) atsižvelgiant į tai, kad nuolatinė stebėseną padeda gauti daugiau duomenų, reikalingų tvirtinant ISDA SIMM, reikia nurodyti, kurie būtiniausi elementai turėtų būti įtraukti į tokią EBI vykdomą stebėseną. Siekdama užtikrinti skaidrumą, į ERIR nurodytą savo metinę ataskaitą EBI turėtų įtraukti pagrindines šios stebėsenos išvadas;
- (13) finansinės arba nefinansinės sandorio šalys turi teisę būti išklaustytos tik tuo atveju, jeigu EBI ketina nepatvirtinti ISDA SIMM arba iš dalies arba visiškai patvirtinimą panaikinti;
- (14) reikia užtikrinti visų patvirtinimo sistemos naudotojų veiksmingą ir efektyvų bendradarbiavimą su EBI, kad ji galėtų deramai vykdyti patvirtinimo funkciją. Atsižvelgiant į tai, sandorio šalys turėtų informuoti EBI, jeigu jos nebeatitinka šiuo metu patvirtintam ISDA SIMM taikomų reikalavimų, o kompetentingos institucijos ir sandorio šalys turi nuolat arba *ad hoc* pagrindu teikti EBI visą informaciją, kuri yra būtina patvirtinimo funkcijai vykdyti;
- (15) siekiant užtikrinti gebėjimą reaguoti laiku ir kartu laikytis nustatytų teisėto užduočių perdavimo principų, Nuolatiniam reguliavimo ir politikos komitetui (SCRePol) turėtų būti suteikti įgaliojimai tvirtinti vėlesnius pakeitimus, o Priežiūros taryba turėtų suteikti pradinį ISDA SIMM patvirtinimą ir spręsti dėl atsisakymo atlikti vėlesnį patvirtinimą arba dėl visiško arba dalinio patvirtinimo panaikinimo. Siekiant padidinti lankstumą, vykdomajam direktoriui turėtų būti suteikti įgaliojimai priimti visus techninius sprendimus, užtikrinančius patvirtinimo sistemos veikimą ir patvirtinimo funkcijos vykdymą. Priežiūros taryba turėtų būti nuolat informuojama apie bet kokius tolesnius SCRePol atliktus patvirtinimus ir vykdomojo direktoriaus techninius sprendimus, o Priežiūros tarybai neturėtų būti trukdoma prireikus tokius įgaliojimus atšaukti;
- (16) priimdama šį sprendimą EBI konsultavosi su EIOPA, ESMA ir ISDA, taip pat su kompetentingomis institucijomis, kurios dalyvauja EBI vidaus valdyme,

priėmė šį sprendimą:

1 straipsnis. Dalykas ir taikymo sritis

1. Šiuo sprendimu nustatoma, kad informacinė sistema („ISDA SIMM patvirtinimo sistema“) taps laikina priemone, kol pradės veikti ERIR 17c straipsnyje numatyta ESMA duomenų bazė.
2. ISDA SIMM patvirtinimo sistemos naudotojai („naudotojai“) yra EBI, ESMA, EIOPA, ERIR 2 straipsnio 13 dalyje nurodytos kompetentingos institucijos („kompetentingos institucijos“) ir ERIR 11 straipsnyje nurodytos finansinės ir nefinansinės sandorio šalys, naudojančios ISDA SIMM modelį („sandorio šalys“).
3. Į ISDA SIMM patvirtinimo sistemą įtrauktą informaciją reglamentuoja EBI taikoma profesinės paslapties, konfidencialumo ir asmens duomenų apsaugos ES teisinė sistema. Prieiga suteikiama pagal EBI reglamento 70, 71 ir 72 straipsnius.
4. Informacija, EBI pateikta per ISDA SIMM patvirtinimo sistemą, laikoma informacija, pateikta per Europos centralizuotą duomenų infrastruktūrą (EUCLID), ir jai taikomas 2020 m. birželio 5 d. Sprendimas EBA/DC/2020/335 dėl EUCLID su vėlesniais pakeitimais.

2 straipsnis. Sandorio šalių įtraukimas

1. Kompetentingos institucijos per ISDA SIMM patvirtinimo sistemą arba bet kokiomis kitomis priemonėmis, kurias EBI laiko tinkamomis, pateikia EBI 1 priede nurodytą informaciją apie visas sandorio šalis, kurios naudoja ISDA SIMM pagrįstą pradinės garantinės įmokos modelį, ir kurios turi gauti ERIR 11 straipsnio 3 dalies trečioje pastraipoje nurodytą leidimą.
2. Kompetentingos institucijos nepagrįstai nedelsdamos EBI pateikia 1 priede nurodytą informaciją apie visas sandorio šalis, kurios tokį leidimą prašo suteikti pradėjus taikyti šį sprendimą.
3. ISDA per ISDA SIMM patvirtinimo sistemą arba bet kokiomis kitomis priemonėmis, kurias EBI laiko tinkamomis, pateikia EBI 2 priede nurodytą informaciją apie visas naujas ISDA SIMM naudojančias sandorio šalis, kurios turi gauti ERIR 11 straipsnio 3 dalies trečioje pastraipoje nurodytą leidimą.
4. Gavusios EBI pranešimą, sandorio šalys nepagrįstai nedelsdamos turi prisijungti prie patvirtinimo sistemos, kad užbaigtų įsitraukimo procesą, įskaitant asmenų, turinčių prieigos teises prie ISDA SIMM patvirtinimo sistemos („įgalioti naudotojai“), paskyrimą ir sąlygų priėmimą.
5. Sandorio šalys, kurios negavo pirmiau nurodyto pranešimo ir privalo kreiptis į EBI dėl savo modelio patvirtinimo pagal ERIR 11 straipsnio 3 dalies trečią pastraipą, klausimą spręsti perduoda EBI. Atitinkama kompetentinga institucija EBI prašymu nedelsdama pateikia EBI būtiną informaciją, kad ta sandorio šalis galėtų įsitraukti į veiklą.

3 straipsnis. Informacijos apie ISDA SIMM ir visus atnaujinimus bei patvirtinamųjų dokumentų teikimas

1. Pagal ERIR 11 straipsnio 12a dalies antrą pastraipą ISDA per ISDA SIMM patvirtinimo sistemą arba bet kokiomis kitomis priemonėmis, kurias EBI laiko tinkamomis, nepagrįstai nedelsdama pateikia EBI visą informaciją apie ISDA SIMM ir reikiamus patvirtinamuosius dokumentus,

įskaitant informaciją apie modelio elementus ir bendruosius aspektus, priemonių kalibravimą, struktūrą ir aprėptį, turto klases ir rizikos veiksnius bei apie visus atnaujinimus.

2. Pirmą kartą tvirtindama ISDA SIMM, ISDA stengiasi pateikti 1 dalyje nurodytą informaciją:
 - (a) apie šiuo metu taikomą ISDA SIMM modelį – nepagrįstai nedelsiant kai tik šis sprendimas įsigalioja;
 - (b) apie bet koki planuojamą šiuo metu taikomo ISDA SMM modelio atnaujinimą – iki 2026 m. rugpjūčio 14 d.
3. Tvirtindama bet koki vėlesnį ISDA SIMM pakeitimą, ISDA užtikrina, kad 1 dalyje nurodyta informacija EBI būtų pateikta bet kuriuo atveju ne vėliau kaip likus keturiolikai (14) savaičių iki dienos, nuo kurios pradedamas taikyti atnaujinimas.
4. ISDA praneša apie visus ISDA SIMM atnaujinimus ir pateikia visą su jais susijusią informaciją. Jeigu dėl atnaujinimo, apie kurį pranešė ISDA, EBI nuostata nesikeičia, įskaitant 6 dalyje nurodytus atvejus, toliau lieka galioji anksčiau suteiktas patvirtinimas ir patvirtinimo procesas nepradedamas.
5. ISDA SIMM pakeitimais laikomi šie ISDA SIMM atnaujinimai:
 - (a) atnaujinimu keičiami ISDA SIMM struktūriniai pagrindai, įskaitant struktūrą, rizikos prisiėmimą ar prielaidas, arba iš esmės keičiasi ISDA SIMM priklausomybės traktavimas;
 - (b) atnaujinus modelį, į ISDA SIMM įtraukiamos naujos turto klasės ar rizikos rūšys arba iš ISDA SIMM pašalinamos anksčiau nustatytos turto klasės ar rizikos rūšys.
6. ISDA SIMM pakeitimais nelaikomi tie atnaujinimai, dėl kurių keičiasi tik modelio parametrai, pagrįsti jau taikoma ir patvirtinta ISDA SIMM metodika, įskaitant atnaujintus rizikos koeficientus ir koreliacijas, arba patikslintus paaiškinimus, dokumentus ir pataisymus ar techninius patobulinimus.

4 straipsnis. Patvirtinimo prašymas

1. EBI per ISDA SIMM patvirtinimo sistemą arba kitomis tinkamomis priemonėmis pateikia įtrauktoms sandorio šalims patvirtinimą, kad ISDA pateikė išsamią informaciją apie ISDA SIMM ir jo dokumentus, kaip numatyta 3 straipsnyje.
2. Gavusios ankstesnėje dalyje nurodytą patvirtinimą, prisijungusios sandorio šalys per ISDA SIMM patvirtinimo sistemą arba bet kokiomis kitomis priemonėmis, kurias EBI laiko tinkamomis jų modeliui patvirtinti, nepagrįstai nedelsdamos pateikia prašymą, kuriame taip pat nurodyta, kad jų modelis visiškai atitinka ISDA SIMM pro forma modelį, ISDA apibūdintą pateiktoje informacijoje ir patvirtinamuosiuose dokumentuose, kaip reikalaujama 3 straipsnyje.
3. Vėlesnius prašymus pereiti prie ISDA SIMM automatiškai parengia ISDA SIMM patvirtinimo sistema visoms įtrauktoms sandorio šalims, kurios pagal 6 straipsnio 5 dalį nėra pranešusios, kad nebevykdo ISDA SIMM reikalavimų arba kad joms nebereikia teikti prašymo dėl patvirtinimo ir leidimo suteikimo, kaip numatyta ERIR.

4. Jeigu EBI ISDA SIMM patvirtinimo prašymą gauna po to, kai ISDA SIMM jau patvirtintas, šis prašymas patvirtinamas automatiškai per patvirtinimo sistemą. Šis patvirtinimas taikomas patvirtintam ISDA SIMM.

5 straipsnis. ISDA SIMM patvirtinimas ir atsisakymas patvirtinti

1. Jeigu ISDA laikėsi 3 straipsnio reikalavimų, EBI patvirtina ISDA SIMM arba bet kokius jo pakeitimus, išskyrus atvejus, kai, EBI nuomone, ISDA SIMM arba bet kokių jo pakeitimų patvirtinimas, atsižvelgiant į rinkos sąlygas arba būtinybę užtikrinti finansinį stabilumą, yra akivaizdžiai netinkamas.
2. Pirmasis ISDA SIMM vertinimas apima visus modelio atnaujinimus ir pakeitimus iki patvirtinimo sprendimo įsigaliojimo dienos. Dėl jo sprendimas pagal 1 dalies reikalavimus priimamas per šešis mėnesius nuo tada, kai EBI gauna pirmą prašymą, kaip numatyta 4 straipsnyje.
3. Sprendimas dėl visų ISDA SIMM pakeitimų patvirtinimo laikantis 1 dalies reikalavimų priimamas per tris mėnesius nuo tada, kai EBI gauna pirmą prašymą, kaip numatyta 4 straipsnyje. Bet koks vėlesnis sprendimas patvirtinti ISDA SIMM po jo pakeitimo panaikina ir pakeičia ankstesnius patvirtinimo sprendimus.
4. Informacija apie ISDA SIMM ar jo pakeitimo patvirtinimą, atsisakymą jį patvirtinti teikiama visoms sandorio šalims, kurios pateikė prašymą pagal 4 straipsnį.
5. ISDA SIMM patvirtinimas nėra terminuotas ir panaikinamas laikantis 6 straipsnio reikalavimų.

6 straipsnis. ISDA SIMM patvirtinimo panaikinimas

1. Jeigu įvertinusi 7 straipsnyje nurodytos stebėsenos rezultatus ir rinkos sąlygas arba poreikį užtikrinti finansinį stabilumą, EBI mano, kad ISDA SIMM patvirtinimo išlaikymas yra netinkamas, EBI šį patvirtinimą visiškai arba iš dalies panaikina.
2. Net jei 1 dalis netaikoma, EBI panaikina ISDA SIMM patvirtinimą, jei ISDA nebendradarbiauja šiame sprendime nustatyta tvarka, taip pat ir tada, kai ji nepateikia reikiamos informacijos, išskyrus atvejus, kai toks panaikinimas keltų pavojų rinkos vientisumui ar finansiniam stabilumui.
3. EBI panaikina sprendimą dėl patvirtinimo laikydamasi 1 arba 2 dalies reikalavimų, neatsižvelgdama į tai, ar subjektai, kuriems buvo skirtos 7 straipsnio 4 dalyje nurodytos rekomendacijos, jas įgyvendino.
4. Sprendimai dėl panaikinimo skirti visoms sandorio šalims, kurių modeliai patvirtinti pagal šio sprendimo reikalavimus.
5. ISDA SIMM patvirtinimas automatiškai panaikinamas per ISDA SIMM patvirtinimo sistemą bet kuriai sandorio šaliai, kuri, kaip nurodyta 10 straipsnio 2 dalyje, pareiškia, kad nebeatitinka EBI patvirtintam ISDA SIMM taikomų reikalavimų arba kad nebeturi teikti prašymo dėl patvirtinimo ir leidimo suteikimo, kaip numatyta ERIR.

7 straipsnis. Stebėsena

1. EBI nuolat stebi patvirtinto ISDA SIMM tinkamumą ir analizuoja visas nurodytas ar kitokiu būdu iškilusias problemas. Pagrindines išvadas ji pateikia ERIR 11 straipsnio 12a dalies trečioje pastraipoje nurodytoje metinėje ataskaitoje.
2. 1 dalyje nurodyta EBI stebėsena apima bent šiuos elementus:
 - (a) ISDA SIMM atitiktį 2016 m. spalio 4 d. Komisijos deleguotajame reglamente (ES) 2016/2251, kuriuo papildomas Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 648/2012 dėl ne biržos išvestinių finansinių priemonių, pagrindinių sandorio šalių ir sandorių duomenų saugyklų papildomas ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių, kurių tarpuskaitys pagrindinė sandorio šalis neatlieka, rizikos mažinimo būdų techniniais reguliavimo standartais³, nustatytiems bendrųjų reikalavimų, garantinės įmokos rizikos laikotarpio, parametro kalibravimo, diversifikavimo, apsidraudimo ir rizikos užskaitys pagal pagrindinį turtą kriterijams arba kokybiniais reikalavimams;
 - (b) rizikos veiksmų aprėpties ir tinkamumo vertinimą, taip pat atsižvelgiant į rinkos pokyčius ir nepalankias aplinkybes;
 - (c) modelio kalibravimo vertinimą;
 - (d) modelio bendro veikimo vertinimą remiantis atgalinio testavimo rezultatais;
 - (e) kitus elementus, apie kuriuos EBI pranešė EIOPA, ESMA, kompetentingos institucijos arba ISDA.
3. Straipsnyje nurodyta EBI stebėsena EBI neužkerta kelio *ad hoc* pagrindu, be kita ko, susidarius kritinei padėčiai ar nepalankiems rinkos pokyčiams, iš naujo įvertinti, ar ISDA SIMM patvirtinimas tebėra tinkamas.
4. ERIR 11 straipsnio 12a dalies trečioje pastraipoje nurodytoje metinėje ataskaitoje EBI gali pateikti rekomendacijas dėl visų klausimų, kuriuos turi spręsti ISDA arba bet kuris patvirtinimo sistemos naudotojas. Tokios rekomendacijos gali būti susijusios su rizika, veiksniais, į kuriuos tinkamai neatsižvelgta patvirtintame ISDA SIMM, taikymo sritimi, priemonių ir turto klasių aprėptimi, kalibravimu arba bet kuria kita metodika, pagrįsta EBI patvirtintu ISDA SIMM arba bet kokiais numatytais jo pakeitimais.

8 straipsnis. Teisė būti išklausytam

1. Jeigu EBI ketina nepatvirtinti ISDA SIMM arba iš dalies ar visiškai panaikinti patvirtinimą dėl to, kad ISDA SIMM laiko netinkamu, sandorio šalys, kurios pateikė patvirtinimo prašymą pagal 4 straipsnį arba kurių modeliai yra patvirtinti pagal šį sprendimą, turi būti informuotos apie EBI ketinimą ir joms turi būti suteiktas dvidešimties [20] darbo dienų terminas, per kurį jos gali pareikšti savo nuomonę.
2. Kaip nurodyta ankstesnėje dalyje, šalys informuojamos ir gali pareikšti nuomonę per ISDA SIMM patvirtinimo sistemą arba bet kokiais kitais būdais, kuriuos EBI laiko tinkamais.

³ OL L 340, 2016 12 15, p. 9-46

9 straipsnis. Skaidrumas

1. Apie bet kokį sprendimą patvirtinimą suteikti arba nesuteikti ir apie bet kokį sprendimą iš dalies ar visiškai panaikinti patvirtinimą visiems naudotojams pranešama per ISDA SIMM patvirtinimo sistemą.
2. Bet kokiame sprendime atsisakyti suteikti patvirtinimą arba sprendime iš dalies arba visiškai panaikinti patvirtinimą nurodomos priežastys, kuriomis jis grindžiamas, o sandorio šalys informuojamos apie teises priemones, kurių jos gali imtis pagal EBI reglamentą.
3. Visi sprendimai suteikti arba atsisakyti suteikti patvirtinimą, sprendimai iš dalies arba visiškai panaikinti patvirtinimą ir visos nuomonės, pateiktos naudojantis teise būti išklausytam, skelbiami EBI interneto svetainėje nepagrįstai nedelsiant, išskyrus atvejus, kai, EBI nuomone, toks paskelbimas prieštarautų teisėtiems tų finansų įstaigų interesams arba pakenktų jų verslo paslapčių apsaugai ar galėtų sukelti didelį pavojų sklandžiam finansų rinkų veikimui ir vientisumui arba visos Sąjungos finansų sistemos ar jos dalies stabilumui.

10 straipsnis. Informacijos teikimas ir bendradarbiavimo reikalavimai

4. Kompetentingos institucijos:

(a) užtikrina, kad ISDA SIMM patvirtinimo sistemoje būtų saugoma tiksli ir aktuali informacija apie sandorio šalis, kurios kreipėsi dėl leidimo bet kokiame pirminės garantinės įmokos modeliui, pagrįstam ISDA SIMM, suteikimo pagal ERIR 11 straipsnio 3 dalies trečią pastraipą, ir

(b) per ISDA SIMM patvirtinimo sistemą arba bet kokiomis kitomis priemonėmis, kurias EBI laiko tinkamomis, teikia EBI informaciją, surinktą per institucijos lygiu tebevykstantį pradinį leidimo ISDA SIMM arba bet kokiems jo pakeitimams suteikimo procesą.

5. Sandorio šalys nedelsdamos informuoja EBI per ISDA SIMM patvirtinimo sistemą, jeigu jos nebeatitinka šiuo metu patvirtintam ISDA SIMM taikomų reikalavimų arba nebeturi teikti prašymo dėl patvirtinimo ir leidimo suteikimo, kaip numatyta ERIR.
6. Naudodamiesi tikrinimo sistema arba bet kokiomis kitomis priemonėmis, kurias EBI laiko tinkamomis, naudotojai teikia EBI informaciją, būtiną siekiant veiksmingai patvirtinti ir nuolat vertinti ISDA SIMM tinkamumą, įskaitant (tačiau tuo neapsiribojant) priede nurodytą informaciją.
7. Per patvirtinimo sistemą arba bet kokiomis kitomis priemonėmis, kurias EBI laiko tinkamomis, naudotojai pateikia EBI visą papildomą informaciją ir duomenis, kurie, EBI nuomone, bus reikalingi jos patvirtinimo funkcijai vykdyti.
8. Ankstesnėje dalyje nurodyta informacija bendrąja prasme apima informaciją ir duomenis apie ISDA SIMM naudojimą, veikimą, kalibravimą ar taikymą, informaciją ir duomenis apie garantinių įmokų sumą, apskaičiuotą pagal standartizuotą lentelę arba pradinės garantinės įmokos modelius, kokybinę informaciją, kai aiškiai apsisprendžiama nenaudoti pradinės garantinės įmokos modelių, statistinius duomenis apie suderinimo veiklą ir ginčus, išsamią informaciją apie svarbiausius ginčus, taip pat statistinius duomenis ir duomenis apie papildomus mokesčius, taikomus kartu su pradine garantine įmoka.

9. Naudotojai ne tik teikia pirmesnėse dalyse nurodytą informaciją ir duomenis, bet ir nepagrįstai nedelsdami bendradarbiauja su EBI, kad ši galėtų vykdyti patvirtinimo funkcijas, ir pateikia EBI visą jos prašomą informaciją per patvirtinimo sistemą arba bet kokiomis priemonėmis, kurias EBI laiko tinkamomis.

11 straipsnis. Sprendimų priėmimas

1. Pirmąjį sprendimą patvirtinti ISDA SIMM, sprendimą atsisakyti suteikti patvirtinimą ir sprendimą visiškai arba iš dalies panaikinti patvirtinimą pagal 5 ir 6 straipsnius priima Priežiūros taryba.
2. Bet kokią vėlesnę sprendimą patvirtinti ISDA SIMM pakeitimą pagal 5 straipsnio 1 dalį priima Reguliavimo ir politikos nuolatinis komitetas (SCRePol). Priežiūros taryba tinkamai informuojama apie tokius sprendimus. SCRePol stengsis sprendimą dėl ISDA SIMM pakeitimo patvirtinimo priimti bendru sutarimu. Nepasiekus bendro sutarimo, sprendimas priimamas paprasta Priežiūros tarybos balsavimo teisę turinčio nario paskirtų SCRePol narių balsų dauguma. Susilaikiusių arba nuomonės nepareiškusių narių balsai skaičiuojami kaip sprendimą palaikantys balsai. Jeigu SCRePol nusprendžia, kad ISDA SIMM modelio pakeitimo patvirtinti negalima, jis siunčia savo pasiūlymą Priežiūros tarybai, kad ši priimtų galutinį sprendimą.
3. Vykdantysis direktorius yra įgaliotas priimti šiuos sprendimus, apie juos tinkamai informuodamas Priežiūros tarybą:
 - (a) reikalauti iš bet kurio naudotojo papildomos informacijos arba prašyti jo bendradarbiauti konkrečiu klausimu, susijusiu su šio sprendimo taikymu, ir
 - (b) nurodyti informacijos ir duomenų, įtrauktų į ISDA SIMM patvirtinimo sistemą, taikymo sritį, turinį, formatą, dažnumą, ataskaitines datas, IT taisykles, patvirtinimo taisykles ir nurodymus, nustatyti visų asmens duomenų tvarkymo tikslą ir prieigos prie ISDA SIMM patvirtinimo sistemos teises, taip pat nustatyti visas kitas veiklos taisykles ar technines specifikacijas (toliau – ISDA SIMM patvirtinimo sistemos techninės specifikacijos), būtinas šiam sprendimui taikyti.

12 straipsnis. Baigiamosios nuostatos

Šis sprendimas įsigalioja 2026 m. kovo 1 d.

Priimta Paryžiuje

José Manuel Campa
Pirmininkas

Priežiūros tarybos vardu

1 PRIEDAS

Apie kiekvieną EEE įsisteigusį juridinį subjektą (t. y. sandorio šalį, kaip apibrėžta ERIR), kuriam pagal Komisijos deleguotąjį reglamentą (ES) 2016/2251⁴ taikomas reikalavimas keistis pradine garantine įmoka (toliau – Bendri EPI techniniai reguliavimo standartai dėl ne biržos išvestinių finansinių priemonių, kurioms neatlikta tarpuskaityta) ir kuris yra licencijuotas ISDA SIMM naudotojas, tiek individualiai, tiek kaip grupės dalis (t. y. EEE arba ne EEE), pateikiama toliau nurodyta informacija:

Identifikavimo informacija

- Juridinio asmens pavadinimas
- LEI kodas
- Subjekto pobūdis (pvz., nefinansinė sandorio šalis, kredito įstaiga, investicinė įmonė, kolektyvinio investavimo į perleidžiamus vertybinius popierius subjektas (KIPVPS), alternatyvaus investicijų fondo (AIF) valdytojas, draudimo bendrovė)
- Šalis, kurioje įsteigta įmonė
- Kompetentinga institucija, atsakinga už leidimo subjekto IM modeliui suteikimą

Informacija apie pradinės garantinės įmokos dydį

- Vertinimas, kuriai kategorijai (t. y. 1–6 etapai) subjektas šiuo metu priklauso pagal Bendrų EPI techninių reguliavimo standartų dėl ne biržos išvestinių finansinių priemonių, kurioms neatlikta tarpuskaityta, 36 straipsnį (pvz., AANA > 3 000 mlrd. EUR, 8 mlrd. EUR < AANA ≤ 50 mlrd. EUR)
- Nurodoma, ar subjekto vidutinė mėnesio neapmokėta ne biržos išvestinių finansinių priemonių, kurioms neatlikta tarpuskaityta, suma grupės lygmeniu yra bent 750 mlrd. EUR, kaip nurodyta ERIR 11 straipsnio 15 dalies pirmos pastraipos a) punkte (taip/ne)

Kontaktiniai duomenys ir IT informacija

- Subjekto už leidimo IM modeliui suteikimą atsakingos grupės funkcinis e. pašto adresas
- Subjekto naudojami e. pašto domenai
- 1 kontaktinio asmens kontaktiniai duomenys
1 kontaktinis asmuo yra atsakingas už sandorio šalies prieigos prie EBI patvirtinimo sistemos,

⁴ OL L 340, 2016 12 15, p. 9-46

per kurią tvirtinamas ISDA SIMM, valdymą. Šis kontaktinis asmuo taip pat gali būti IMMV duomenų teikėjas:

- Vardas ir pavardė
 - Pareigos įstaigoje
 - El. pašto adresas ir telefono numeris
- 2-ojo ir 3-iojo kontaktinių asmenų kontaktiniai duomenys
2-asis ir 3-iasis kontaktiniai asmenys atlieka IMMV duomenų teikėjų vaidmenį:
- Vardas ir pavardė
 - Pareigos įstaigoje
 - El. pašto adresas ir telefono numeris

Informacija apie grupę, kuriai priklauso subjektas

Jei subjektas priklauso EEE grupei, t. y. yra kito EEE esančio subjekto tiesioginė arba netiesioginė patronuojamoji įmonė, apie EEE esantį aukščiausio rango grupės subjektą (toliau – pagrindinė EEE patronuojančioji įmonė) nurodoma ši informacija:

- Pagrindinės EEE patronuojančiosios įmonės pavadinimas
- Pagrindinės EEE patronuojančiosios įmonės LEI kodas
- Šalis, kurioje įsteigta pagrindinė EEE patronuojančioji įmonė
- Pagrindinės EEE patronuojančiosios įmonės pobūdis (pvz., nefinansinė sandorio šalis, kredito įstaiga, investicinė įmonė, kolektyvinio investavimo į perleidžiamus vertybinius popierius įmonė (KIPVPS), alternatyvaus investavimo fondas (AIF), draudimo bendrovė)

Be to, kai juridiniai asmenys priklauso ne EEE grupei (t. y. pagrindinė grupės patronuojančioji įmonė yra įsisteigusi už EEE ribų), apie aukščiausio rango grupės įmonę, įsikūrusią už EEE ribų („pagrindinė ne EEE patronuojančioji įmonė“) turi būti nurodyta ši informacija:

- Pagrindinės ne EEE patronuojančiosios įmonės pavadinimas
- Pagrindinės ne EEE patronuojančiosios įmonės LEI kodas
- Šalis, kurioje įsteigta pagrindinė ne EEE patronuojančioji įmonė
- Pagrindinės ne EEE patronuojančiosios įmonės pobūdis (pvz., ne finansų sandorio šalis, kredito įstaiga, investicinė įmonė, kolektyvinio investavimo į perleidžiamus vertybinius popierius subjektas (KIPVPS), alternatyvaus investavimo fondas (AIF), draudimo bendrovė)

Kompetentingos institucijos informaciją teikia EBI nustatytu formatu ir laikydamosi jos pateiktų nurodymų.

2 PRIEDAS

Apie kiekvieną EEE įsisteigusį juridinį subjektą (t. y. sandorio šalį, kaip apibrėžta ERIR), kuriam pagal Komisijos deleguotąjį reglamentą (ES) 2016/2251⁵ taikomas reikalavimas keistis pradine garantine įmoka (toliau – Bendri EPI techniniai reguliavimo standartai dėl ne biržos išvestinių finansinių priemonių, kurioms neatlikta tarpuskaityta) ir kuris yra licencijuotas ISDA SIMM naudotojas, tiek individualiai, tiek kaip grupės dalis (t. y. EEE arba ne EEE), pateikiama toliau nurodyta informacija:

Identifikavimo informacija

- Juridinio asmens pavadinimas individualiu lygmeniu
- Šalis, kurioje įsteigta įmonė
- LEI kodas

⁵ OL L 340, 2016 12 15, p. 9-46