

Rozhodnutie Európskeho orgánu pre bankovníctvo EBA/DC/610

z 27. januára 2026

týkajúce sa opatrení pre funkciu potvrdenia modelu počiatočnej marže podľa nariadenia EMIR pre model ISDA SIMM

Rada orgánov dohľadu,

so zreteľom na nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 1093/2010 z 24. novembra 2010, ktorým sa zriaďuje Európsky orgán dohľadu (Európsky orgán pre bankovníctvo) a ktorým sa mení a dopĺňa rozhodnutie č. 716/2009/ES a zrušuje rozhodnutie Komisie 2009/78/ES¹ (ďalej len „nariadenie o EBA“), a najmä na jeho článok 1 ods. 2, článok 2, článok 8 ods. 1 písm. b) a j), článok 8 ods. 1a písm. a), článok 8 ods. 2 písm. j), článok 31 ods. 2 písm. a), b) a f) a článok 35, a

so zreteľom na nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 648/2012 zo 4. júla 2012 o mimoburzových derivátoch, centrálnych protistranách a archívoch obchodných údajov² (ďalej len „nariadenie EMIR“), a najmä na jeho článok 11 ods. 3 a článok 12a,

keďže:

- (1) V článku 11 ods. 3 a článku 12a nariadenia EMIR sa stanovuje, že EBA je zodpovedný za potvrdenie pro forma modelov a všetkých ich zmien. Takýmto pro forma modelom je aj model ISDA SIMM. Pokiaľ ide o potvrdenie modelu ISDA SIMM, mali by sa bližšie špecifikovať všetky aspekty funkcie potvrdenia, ktorú má vykonávať EBA v súlade s nariadením EMIR, pričom by sa mal dočasne a bez toho, aby bol dotknutý článok 89 ods. 11 nariadenia EMIR, zaviesť systém potvrdenia, kým nebude funkčná centrálna databáza ESMA uvedená v článku 17c nariadenia EMIR.
- (2) Vzhľadom na úlohu EBA ako centrálného potvrdzovateľa, ktorú plní aj prostredníctvom nepretržitého monitorovania, by sa malo usilovať o čo najširšiu účasť v systéme potvrdenia. V tejto súvislosti by sa EBA, EIOPA, ESMA, finančné a nefinančné protistrany používajúce model ISDA SIMM, relevantné príslušné orgány a Medzinárodná asociácia pre swapy a deriváty (ISDA) mali ako používatelia systému potvrdenia účinne zapájať do výmeny potrebných informácií o všetkých aspektoch funkcie potvrdenia údajov.
- (3) Na všetky informácie zahrnuté do systému potvrdenia by sa mal vzťahovať právny rámec EÚ týkajúci sa služobného tajomstva, dôvernosti a ochrany osobných údajov a že prístup k týmto informáciám by sa mal poskytnúť používateľom v súlade s nariadením o EBA. Keďže EBA sa stáva významným dátovým centrom, systém potvrdenia by sa mal v záujme zníženia záťaže a nákladov spojených s vykazovaním a zvýšením efektívnosti pre všetkých používateľov začleniť do Európskej centralizovanej infraštruktúry pre údaje v oblasti dohľadu (EUCLID).

¹ Ú. v. EÚ L 331, 15.12.2010, s. 12– 47.

² Ú. v. EÚ L 201 27.7.2012, s. 1.

- (4) S cieľom podporiť dobré fungovanie systému potvrdenia by žiadosti o potvrdenie mali podliehať predchádzajúcemu postupu nadviazania spolupráce. Na tento účel by EBA mal iniciovať štruktúrovaný proces nadviazania spolupráce s cieľom zhromaždiť všetky potrebné informácie na identifikáciu protistrán pomocou modelu ISDA SIMM. Príslušné orgány by mali EBA poskytnúť názvy a ďalšie relevantné údaje o finančných a nefinančných protistranách, ktoré požiadali o povolenie modelu počiatovej marže založeného na modeli ISDA SIMM v súlade s článkom 11 ods. 3 tretím pododsekom nariadenia EMIR. Súbežne a v súlade s článkom 11 ods. 12a druhým pododsekom nariadenia EMIR by asociácia ISDA mala spolupracovať s EBA tak, že mu poskytne informácie o protistranách používajúcich model ISDA SIMM. S cieľom zabrániť duplicitě a zabezpečiť presnosť údajov by mal EBA koordinovať proces nadviazania spolupráce a v prípade potreby sa môže spoľahnúť na potvrdenia príslušných orgánov.
- (5) Je potrebné zabezpečiť, aby príslušné orgány a ISDA bezodkladne poskytovali informácie o nových protistranách používajúcich model ISDA SIMM s cieľom uľahčiť proces nadviazania spolupráce, na základe ktorého protistrany splnia svoju povinnosť podľa nariadenia EMIR požiadať o potvrdenie svojho modelu prostredníctvom systému potvrdenia.
- (6) S cieľom odstrániť akúkoľvek zbytočnú záťaž a vzhľadom na to, že podľa nariadenia EMIR sa vyžaduje, aby ISDA účinne spolupracovala s EBA na účely potvrdenia, ISDA by mala zodpovedať za včasné poskytovanie všetkých potrebných informácií týkajúcich sa modelu a všetkých jeho aktualizácií. Na to, aby EBA mohol v plnom rozsahu porozumieť modelu a jeho plánovanej aktualizácii, tieto informácie by mali zahŕňať všeobecné aspekty modelu, ktoré sú aj nie sú predmetom aktualizácie.
- (7) Spolupracujúce finančné a nefinančné protistrany využívajúce model ISDA SIMM by mali požiadať EBA o potvrdenie potom, ako EBA potvrdí, že ISDA poskytla úplné informácie a podporné dokumenty o prvkoch a všeobecných aspektoch modelu ISDA SIMM prostredníctvom systému potvrdenia alebo akýmkoľvek iným spôsobom, ktorý EBA považuje za vhodný. Takéto žiadosti by sa po ich podaní mali považovať za žiadosti, ktoré sa týkajú pro forma modelu ISDA SIMM, ako ho ISDA ako tvorca modelu opísala v informáciách a podporných dokumentoch poskytnutých EBA. Takýto dvojstupňový postup, ktorý pozostáva z toho, že najprv ISDA predloží špecifiká modelu a všetky jeho zmeny a následne protistrana predloží žiadosť o potvrdenie svojho modelu zo strany EBA, sa má dodržiavať v prípade každej následnej zmeny modelu ISDA SIMM. S cieľom zabezpečiť maximálnu efektívnosť by sa v prípade prijatia žiadosti o potvrdenie po potvrdení aktuálneho modelu ISDA SIMM malo rozhodnutie o potvrdnení generovať automaticky prostredníctvom systému.
- (8) ISDA by mala informovať EBA o každej aktualizácii modelu ISDA SIMM, ale EBA by si mal zachovať flexibilitu pri posudzovaní toho, ktoré z týchto aktualizácií predstavujú zmenu modelu, ktorá si vyžaduje potvrdenie. Postup potvrdenia modelu ISDA SIMM by sa mal začať iba v prípade aktualizácií, ktoré EBA podľa svojho uváženia považuje za zmeny modelu.
- (9) Prvé potvrdenie modelu ISDA SIMM by malo zahŕňať všetky aktualizácie a zmeny modelu až do dátumu prijatia uvedeného pôvodného rozhodnutia o potvrdení. V tomto rozhodnutí by sa mala stanoviť aj šesťmesačná alebo trojmesačná lehota podľa nariadenia EMIR, v rámci ktorej je EBA zo zákona povinný udeliť alebo zamietnuť potvrdenie, a mala by sa začať prvou žiadosťou, ktorú EBA dostane prostredníctvom systému potvrdenia.
- (10) Keďže model ISDA SIMM sa vo veľkej miere používa na globálnom trhu a s cieľom zabrániť akémukoľvek narušeniu trhu by mal EBA pristúpiť k udeleniu potvrdenia hneď, ako ISDA

predloží všetky potrebné informácie o modeli, pokiaľ by sa takéto potvrdenie nepovažovalo za zjavne nevhodné vzhľadom na trhové podmienky alebo potrebu zabezpečiť finančnú stabilitu, pričom v takom prípade by sa potvrdenie malo zamietnuť. S cieľom zvýšiť istotu trhu a podporiť stabilitu by potvrdenie modelu ISDA SIMM nemalo byť časovo obmedzené, a práve z tohto dôvodu by malo byť sprevádzané overovaním trvalej vhodnosti modelu ISDA SIMM, ktoré by malo byť zabezpečené prostredníctvom nepretržitého monitorovania modelu zo strany EBA, ako sa stanovuje v článku 11 ods. 12a tretí pododsek nariadenia EMIR.

- (11) Potvrdenie modelu ISDA SIMM prostredníctvom časovo neobmedzeného rozhodnutia v podstate vyžaduje, aby bolo možné takéto rozhodnutie úplne alebo čiastočne kedykoľvek stiahnuť, ak sa EBA buď prostredníctvom svojho priebežného monitorovania, alebo *ad hoc*, a to aj v núdzových situáciách, domnieva, že zachovanie potvrdenia modelu ISDA SIMM by bolo neprimerané vzhľadom na trhové podmienky alebo potrebu zabezpečiť finančnú stabilitu. Malo by sa zabezpečiť, aby EBA zrušil potvrdenie modelu ISDA SIMM, ak sa jeho údržba považuje za nevhodnú, a to bez ohľadu na to, či ISDA alebo akýkoľvek iný používateľ systému potvrdenia, ktorému môžu byť takéto odporúčania adresované, dodržiava odporúčania, ktoré vydal EBA počas svojho priebežného monitorovania. Nespolupráca zo strany ISDA by mala viesť aj k zrušeniu potvrdenia modelu ISDA SIMM s výnimkou prípadov, keď a pokiaľ úvahy o finančnej stabilite alebo integrite trhu naznačujú opak, keďže takéto nespolupráca znemožňuje nepretržité monitorovanie vhodnosti modelu ISDA SIMM, ako sa vyžaduje v nariadení EMIR.
- (12) Vzhľadom na to, že priebežné monitorovanie prispieva k potvrdeniu modelu ISDA SIMM, je potrebné špecifikovať, ktoré prvky by sa mali minimálne zahrnúť do takéhoto monitorovania, ktoré vykonáva EBA. Na zabezpečenie transparentnosti by EBA mal do svojej výročnej správy uvedenej v nariadení EMIR zahrnúť svoje kľúčové zistenia vyplývajúce z tohto monitorovania.
- (13) Finančné alebo nefinančné protistrany majú právo na vypočutie len v prípade, ak EBA nemá v úmysle udeliť potvrdenie modelu ISDA SIMM alebo čiastočne či úplne zrušiť potvrdenie.
- (14) Je potrebné zabezpečiť, aby všetci používatelia systému potvrdenia efektívne a účinne spolupracovali s EBA, aby mohol vykonávať svoju funkciu potvrdenia. V tejto súvislosti by protistrany mali informovať EBA v prípade, že prestali plniť podmienky modelu ISDA SIMM v podobe, v akej je v súčasnosti potvrdený, zatiaľ čo príslušné orgány a protistrany priebežne alebo *ad hoc* informujú EBA o všetkých informáciách potrebných na funkciu potvrdenia.
- (15) S cieľom zabezpečiť včasnú reakciu a zároveň dodržať ustanovené zásady zákonného delegovania úloh by Stály výbor pre reguláciu a politiku (SCRePol) mal byť poverený udeľovaním potvrdení následných zmien, zatiaľ čo Rada orgánov dohľadu by mala udeľovať počiatočnú validáciu modelu ISDA SIMM a rozhodovať o akomkoľvek zamietnutí následného potvrdenia alebo úplnom alebo čiastočnom zrušení rozhodnutia o potvrdení. V záujme zvýšenia flexibility by výkonný riaditeľ mal byť poverený vykonaním všetkých technických rozhodnutí potrebných na prevádzku systému potvrdenia údajov a výkon funkcie potvrdenia. Rada orgánov dohľadu by mala byť informovaná o všetkých takýchto následných potvrdeniach výboru SCRePol a technických rozhodnutiach výkonného riaditeľa, pričom nič by Rade orgánov dohľadu nemalo brániť v tom, aby v prípade potreby takéto mandáty odvolala.
- (16) Na prijatie tohto rozhodnutia EBA viedol konzultácie s orgánmi EIOPA, ESMA a asociáciou ISDA, ako aj s príslušnými orgánmi, ktoré sa podieľajú na vnútornej štruktúre riadenia EBA.

rozhodla takto:**Článok 1 – Predmet a rozsah pôsobnosti**

1. Týmto rozhodnutím sa zriaďuje informačný systém („systém potvrdenia modelu ISDA SIMM“) ako dočasné opatrenie dovtedy, kým nebude funkčná databáza orgánu ESMA uvedená v článku 17c nariadenia EMIR.
2. EBA, ESMA, EIOPA, príslušné orgány uvedené v článku 2 ods. 13 nariadenia EMIR (ďalej len: „príslušné orgány“) a finančné a nefinančné protistrany uvedené v článku 11 nariadenia EMIR, ktoré používajú model ISDA SIMM („protistrany“), a ISDA sú používateľmi systému potvrdenia modelu ISDA SIMM („používatelia“).
3. Na informácie zahrnuté do systému potvrdenia modelu ISDA SIMM sa vzťahuje právny rámec EÚ týkajúci sa služobného tajomstva, dôvernosti a ochrany osobných údajov, ktorý sa vzťahuje na EBA. Prístup v súlade s článkami 70, 71 a 72 nariadenia o EBA.
4. Informácie predložené EBA prostredníctvom systému potvrdenia modelu ISDA SIMM sa považujú za informácie predložené prostredníctvom Európskej centralizovanej infraštruktúry pre údaje v oblasti dohľadu (EUCLID) a uplatňuje sa rozhodnutie EBA/DC/2020/335 z 5. júna 2020 týkajúce sa EUCLID s jeho budúcimi zmenami alebo náhradami.

Článok 2 – Nadviazanie spolupráce s protistranami

1. Príslušné orgány poskytujú EBA prostredníctvom systému potvrdenia modelu ISDA SIMM alebo akýmikoľvek inými prostriedkami, ktoré EBA považuje za vhodné, informácie uvedené v prílohe 1 za všetky protistrany, ktoré používajú model počiatočnej marže založený na modeli ISDA SIMM a od ktorých sa vyžaduje, aby požiadali o povolenie uvedené v článku 11 ods. 3 treťom pododseku nariadenia EMIR.
2. Príslušné orgány bez zbytočného odkladu poskytnú EBA informácie uvedené v prílohe 1 pre každú protistranu, ktorá požiada o takéto povolenie po dátume začatia uplatňovania tohto rozhodnutia.
3. ISDA poskytne EBA prostredníctvom systému potvrdenia modelu ISDA SIMM alebo akýmikoľvek inými prostriedkami, ktoré EBA považuje za vhodné, informácie uvedené v prílohe 2 pre všetky nové protistrany využívajúce model ISDA SIMM, od ktorých sa vyžaduje, aby požiadali o povolenie uvedené v článku 11 ods. 3 treťom pododseku nariadenia EMIR.
4. Po prijatí oznámenia od EBA protistrany bez zbytočného odkladu získajú prístup do systému potvrdenia, aby dokončili proces nadviazania spolupráce, a to aj prostredníctvom pridelenia prístupových práv k systému potvrdenia modelu ISDA SIMM („oprávnení používatelia“) a prijatia jazykových podmienok.
5. Protistrany, ktoré nedostali uvedené oznámenie a sú povinné požiadať EBA o potvrdenie svojho modelu v súlade s článkom 11 ods. 3 tretím pododsekom nariadenia EMIR, postúpia vec EBA. Dotknutý príslušný orgán bezodkladne na žiadosť EBA poskytne EBA informácie potrebné na nadviazanie spolupráce s danou protistranou.

Článok 3 – Poskytovanie informácií a podporných dokumentov týkajúcich sa modelu ISDA SIMM a akýchkoľvek jeho aktualizácií

1. ISDA poskytne v súlade s článkom 11 ods. 12a druhým pododsekom nariadenia EMIR bez zbytočného odkladu EBA prostredníctvom systému potvrdenia modelu ISDA SIMM alebo akýmkoľvek iným spôsobom, ktorý EBA považuje za vhodný, všetky informácie a podpornú dokumentáciu vrátane informácií o prvkoch a všeobecných aspektoch, kalibrácii, dizajne a pokrytí nástrojov, triedach aktív a rizikových faktoroch relevantných pre model ISDA SIMM a o všetkých jeho aktualizáciách.
2. Pri prvom potvrdení modelu ISDA SIMM sa ISDA bude snažiť poskytnúť informácie uvedené v odseku 1:
 - (a) v prípade modelu ISDA SIMM, ktorý je v súčasnosti platný, bez zbytočného odkladu po nadobudnutí účinnosti tohto rozhodnutia,
 - (b) v prípade akejkoľvek plánovanej aktualizácie modelu ISDA SMM, ktorý je v súčasnosti v platnosti, do 14. augusta 2026.
3. ISDA na účely potvrdenia akejkoľvek následnej zmeny modelu ISDA SIMM zabezpečí, aby sa informácie uvedené v odseku 1 poskytli EBA v každom prípade najneskôr štrnásť (14) týždňov pred dátumom začatia uplatňovania akejkoľvek aktualizácie.
4. ISDA oznámi a poskytne všetky relevantné informácie o všetkých aktualizáciách modelu ISDA SIMM. Ak aktualizácia oznámená asociáciou ISDA nepredstavuje zmenu stanoviska orgánu EBA, a to aj v prípadoch uvedených v odseku 6, predtým udelené potvrdenie sa bude naďalej uplatňovať a postup potvrdenia sa nezačne.
5. Nasledujúce aktualizácie modelu ISDA SIMM sa považujú za zmeny modelu ISDA SIMM:
 - (a) aktualizáciou sa menia štrukturálne základy modelu ISDA SIMM vrátane návrhu, zachytávania rizík alebo predpokladov alebo sa podstatne reviduje zaobchádzanie so závislosťami modelu ISDA SIMM,
 - (b) výsledkom aktualizácie je, že model ISDA SIMM zachytáva nové triedy aktív alebo druhy rizík alebo sa z modelu ISDA SIMM odstránia triedy aktív alebo druhy rizík, ktoré boli zachytené v minulosti.
6. Aktualizácie, ktoré majú vplyv len na parametre modelu vyplývajúce z existujúcej a potvrdenej metodiky modelu ISDA SIMM vrátane aktualizácií rizikových váh a korelácií alebo ktoré sa týkajú objasnení, vylepšení a opráv dokumentácie alebo technických modernizácií, sa nepovažujú za zmeny modelu ISDA SIMM.

Článok 4 – Žiadosť o potvrdenie

1. EBA poskytne prostredníctvom systému potvrdenia modelu ISDA SIMM alebo akýmkoľvek inými prostriedkami, ktoré považuje za vhodné, spolupracujúcim protistranám potvrdenie o tom, že ISDA predložila úplné informácie a dokumentáciu pre model ISDA SIMM v súlade s článkom 3.

2. Po prijatí potvrdenia uvedeného v predchádzajúcom odseku musia spolupracujúce protistrany bez zbytočného odkladu požiadať prostredníctvom systému potvrdenia modelu ISDA SIMM alebo akýmkoľvek iným spôsobom, ktorý EBA považuje za vhodný, o potvrdenie svojho modelu, pričom zároveň vyhlásia, že tento model je plne v súlade s pro forma modelom ISDA SIMM, ako ho opisuje ISDA v informáciách a podporných dokumentoch predložených v súlade s článkom 3.
3. Následné žiadosti o zmenu modelu ISDA SIMM budú automaticky vygenerované systémom potvrdenia modelu ISDA SIMM pre všetky spolupracujúce protistrany, ktoré v súlade s článkom 6 ods. 5 neoznámili, že prestali spĺňať požiadavky modelu ISDA SIMM alebo že sa už od nich nevyžaduje, aby žiadali o potvrdenie a autorizáciu v súlade s nariadením EMIR.
4. Ak EBA prijme žiadosť o potvrdenie modelu ISDA SIMM po jeho potvrdení, potvrdenie sa tejto žiadosti udelí automaticky prostredníctvom systému potvrdenia. Toto potvrdenie sa vzťahuje na potvrdený model ISDA SIMM.

Článok 5 – Potvrdenie a zamietnutie potvrdenia modelu ISDA SIMM

1. Ak ISDA vyhovela článku 3, EBA schváli potvrdenie modelu ISDA SIMM alebo každú jeho zmenu s výnimkou prípadov, v ktorých potvrdenie modelu ISDA SIMM alebo každú jeho zmenu EBA považuje za zjavne neprimerané vzhľadom na trhové podmienky alebo potrebu zabezpečiť finančnú stabilitu.
2. Prvé potvrdenie modelu ISDA SIMM sa vzťahuje na všetky jeho aktualizácie a zmeny až do dátumu nadobudnutia účinnosti rozhodnutia o potvrdení a rozhodne sa o ňom v súlade s odsekom 1 do šiestich mesiacov od prvej žiadosti doručenej EBA v súlade s článkom 4.
3. O potvrdení akejkoľvek zmeny modelu ISDA SIMM sa rozhodne v súlade s odsekom 1 do troch mesiacov od prijatia prvej žiadosti orgánom EBA v súlade s článkom 4. Každým následným rozhodnutím o potvrdení modelu ISDA SIMM po jeho zmene by sa malo zrušiť a nahradiť predchádzajúce rozhodnutia o potvrdení.
4. Potvrdenie alebo zamietnutie potvrdenia modelu ISDA SIMM alebo jeho zmeny sa adresuje všetkým protistranám, ktoré podali žiadosť v súlade s článkom 4.
5. Potvrdenie modelu ISDA SIMM nie je časovo obmedzené a môže byť zrušené v súlade s článkom 6.

Článok 6 – Zrušenie potvrdenia modelu ISDA SIMM

1. Ak z monitorovania uvedeného v článku 7 vyplynie, že zachovanie potvrdenia modelu ISDA SIMM je podľa názoru EBA neprimerané vzhľadom na trhové podmienky alebo potrebu zabezpečiť finančnú stabilitu, EBA takéto potvrdenie sa úplne alebo čiastočne zruší.
2. Aj keď sa odsek 1 neuplatňuje, EBA zruší potvrdenie modelu ISDA SIMM, ak ISDA nespolupracuje spôsobom stanoveným v tomto rozhodnutí vrátane prípadov, keď neposkytne požadované informácie, s výnimkou prípadov, keď by takéto zrušenie ohrozilo integritu trhu alebo finančnú stabilitu.
3. EBA zruší rozhodnutie o potvrdení v súlade s odsekmi 1 alebo 2 bez ohľadu na to, či adresáti vykonali odporúčania uvedené v článku 7 ods. 4.

4. Rozhodnutia o zrušení sú určené všetkým protistranám, ktorých modely boli potvrdené v súlade s týmto rozhodnutím.
5. Potvrdenie modelu ISDA SIMM sa automaticky zruší prostredníctvom systému potvrdenia modelu ISDA SIMM pre každú protistranu, ktorá v súlade s článkom 10 ods. 2 vyhlási, že buď prestala spĺňať požiadavky modelu ISDA SIMM potvrdeného EBA, alebo že už nie je povinná žiadať o potvrdenie a povolenie v súlade s nariadením EMIR.

Článok 7 – Monitorovanie

1. EBA priebežne monitoruje primeranosť potvrdeného modelu ISDA SIMM a analyzuje všetky nahlásené alebo iné vyplývajúce problémy. Svoje kľúčové zistenia zahrnie do výročnej správy uvedenej v článku 11 ods. 12a treťom pododseku nariadenia EMIR.
2. Monitorovanie EBA uvedené v odseku 1 zahŕňa aspoň tieto prvky:
 - (a) súlad modelu ISDA SIMM s kritériami pre všeobecné požiadavky, obdobie rizika do zabezpečenia, kalibrácia parametra, diverzifikácia, hedžing a kompenzácia rizika podľa podkladových aktív alebo s kvalitatívnymi požiadavkami delegovaného nariadenia Komisie (EÚ) 2016/2251 zo 4. októbra 2016, ktorým sa dopĺňa nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 648/2012 o mimoburzových derivátoch, centrálnych protistranách a archívoch obchodných údajov, pokiaľ ide o regulačné technické predpisy pre postupy zmierňovania rizika pre zmluvy o mimoburzových derivátoch, ktoré centrálna protistrana nezúčtovala³,
 - (b) posúdenie krytia a primeranosti rizikových faktorov, a to aj vzhľadom na vývoj na trhu a stresové udalosti,
 - (c) posúdenie kalibrácie modelu,
 - (d) posúdenie celkovej výkonnosti modelu na základe výsledkov spätného testovania,
 - (e) ďalšie prvky, na ktoré bol EBA upozornený EIOPA, ESMA, príslušnými orgánmi alebo asociáciou ISDA.
3. Monitorovanie EBA uvedené v tomto článku nebráni EBA v tom, aby na *ad hoc* základe, a to aj v krízových situáciách alebo pri nepriaznivom vývoji na trhu, opätovne posudzoval, či je potvrdenie modelu ISDA SIMM naďalej vhodné.
4. Vo výročnej správe uvedenej v článku 11 ods. 12a treťom pododseku nariadenia EMIR môže EBA vydať odporúčania týkajúce sa akýchkoľvek problémov, ktoré má riešiť asociácia ISDA alebo ktorýkoľvek používateľ systému potvrdenia. Tieto odporúčania sa môžu týkať rizík, faktorov, ktoré nie sú dostatočne zohľadnené v potvrdenom modeli ISDA SIMM, rozsahu uplatňovania, pokrytia nástrojov a tried aktív, kalibrácie alebo akejkoľvek inej metodiky na základe modelu ISDA SIMM potvrdeného EBA alebo na základe akejkoľvek predpokladanej zmeny tohto modelu.

Článok 8 – Právo na vypočutie

1. Ak EBA nemá v úmysle udeliť potvrdenie modelu ISDA SIMM alebo čiastočne alebo úplne zrušiť potvrdenie z dôvodu nevhodnosti modelu ISDA SIMM, protistrany, ktoré požiadali o potvrdenie

³ Ú. v. EÚ L 340, 15.12.2016, s. 9 – 46.

v súlade s článkom 4 alebo ich modely boli potvrdené na základe tohto rozhodnutia, budú informované o zámere EBA a bude im poskytnutá lehota dvadsať [20] pracovných dní, v rámci ktorej môžu vyjadriť svoje stanovisko.

2. Oznamovanie a vyjadrovanie stanovísk uvedené v predchádzajúcom odseku sa vykonáva prostredníctvom systému potvrdenia modelu ISDA SIMM alebo akýmkoľvek inými prostriedkami, ktoré EBA považuje za vhodné.

Článok 9 – Transparentnosť

1. Každé rozhodnutie o udelení alebo zamietnutí potvrdenia a každé rozhodnutie o čiastočnom alebo úplnom zrušení potvrdenia sa oznamuje všetkým používateľom prostredníctvom systému potvrdenia modelu ISDA SIMM.
2. V každom rozhodnutí o zamietnutí a každom rozhodnutí o čiastočnom alebo úplnom zrušení potvrdenia sa uvedú dôvody, na ktorých sa zakladá, a protistrany sa informujú o opravných prostriedkoch, ktoré sú k dispozícii podľa nariadenia o EBA.
3. Každé rozhodnutie o udelení alebo zamietnutí potvrdenia a každé rozhodnutie o čiastočnom alebo úplnom zrušení potvrdenia a každý názor predložený v súvislosti s výkonom práva na vypočutie sa bez zbytočného odkladu uverejnia na webovom sídle EBA, pokiaľ takéto uverejnenie nie je podľa EBA v rozpore s oprávneným záujmom týchto finančných inštitúcií alebo s ochranou ich obchodného tajomstva, alebo by mohlo vážne ohroziť riadne fungovanie a integritu finančných trhov alebo stabilitu celého finančného systému Únie alebo jeho časti.

Článok 10 – Požiadavky na poskytovanie informácií a spoluprácu

1. Príslušné orgány:
 - (a) zabezpečia, aby systém potvrdenia modelu ISDA SIMM obsahoval presné a aktuálne informácie o protistranách, ktoré požiadali o povolenie v súlade s článkom 11 ods. 3 tretím pododsekom nariadenia EMIR v prípade akéhokoľvek modelu počiatočnej marže založeného na modeli ISDA SIMM, a
 - (b) poskytnú EBA prostredníctvom systému potvrdenia modelu ISDA SIMM alebo akýmkoľvek inými prostriedkami, ktoré EBA považuje za vhodné, informácie, ktoré zhromaždili počas počiatočného a prebiehajúceho procesu udeľovania povolenia modelu ISDA SIMM na úrovni subjektu, alebo akékoľvek ich zmeny.
2. Protistrany bez zbytočného odkladu informujú EBA prostredníctvom systému potvrdenia modelu ISDA SIMM, ak prestali spĺňať požiadavky modelu ISDA SIMM v súčasnej potvrdennej podobe alebo už nie sú povinné žiadať o potvrdenie a povolenie v súlade s nariadením EMIR.
3. Prostredníctvom systému potvrdenia alebo akýmkoľvek iným spôsobom, ktorý EBA považuje za vhodný, poskytnú používatelia EBA informácie potrebné na účinné vykonanie potvrdenia a posúdenia vhodnosti modelu ISDA SIMM, vrátane, ale nie výlučne informácií uvedených v prílohe.
4. Prostredníctvom systému potvrdenia alebo akýmkoľvek inými prostriedkami, ktoré orgán EBA považuje za vhodné, poskytnú používatelia EBA všetky dodatočné informácie a údaje, ktoré bude orgán EBA považovať za potrebné na vykonávanie funkcie potvrdenia.

5. Informácie uvedené v predchádzajúcom odseku orientačne zahŕňajú informácie a údaje o používaní, výkonnosti, kalibrácii alebo uplatňovaní modelu ISDA SIMM, informácie a údaje o výške marží vypočítaných prostredníctvom štandardizovaných sieťových modelov alebo modelov počiatočnej marže, kvalitatívne informácie o explicitných rozhodnutiach nepoužívať modely počiatočnej marže, štatistiky o procesoch zosúladovania a sporoch, podrobnosti o najdôležitejších sporoch a štatistiky a údaje o navýšeniach uplatňovaných nad rámec počiatočnej marže.
6. Okrem poskytovania informácií a údajov uvedených v predchádzajúcich odsekoch používateľa bez zbytočného odkladu spolupracujú s EBA, aby mu umožnili vykonávať jeho funkciu potvrdenia, a prostredníctvom systému potvrdenia alebo akýmkoľvek prostriedkami, ktoré orgán EBA považuje za vhodné, poskytnú EBA všetky informácie, ktoré požaduje.

Článok 11 – Rozhodovanie

1. Prvé rozhodnutie o udelení potvrdenia modelu ISDA SIMM, rozhodnutie o zamietnutí potvrdenia a rozhodnutie o úplnom alebo čiastočnom zrušení potvrdenia prijme rada orgánov dohľadu v súlade s článkami 5 a 6.
2. Akékoľvek následné rozhodnutie o udelení potvrdenia zmeny modelu ISDA SIMM v súlade s článkom 5 ods. 1 prijíma Stály výbor pre reguláciu a politiku (SCRePol). Rada orgánov dohľadu je o takýchto rozhodnutiach riadne informovaná. Výbor SCRePol sa pri prijímaní rozhodnutia o udelení potvrdenia zmeny modelu ISDA SIMM usiluje o dosiahnutie konsenzu. V prípade, že sa nedosiahne konsenzus, rozhodnutie sa prijme jednoduchou väčšinou členov výboru SCRePol, ktorých vymenoval hlasujúci člen Rady orgánov dohľadu. Zdržanie sa hlasovania alebo nevyjadrenie názorov sa započítava v prospech rozhodnutia. Ak výbor SCRePol rozhodne, že potvrdenie zmeny modelu ISDA SIMM musí byť zamietnuté, zašle svoj návrh Rade orgánov dohľadu na konečné rozhodnutie.
3. Výkonný riaditeľ je oprávnený prijímať nasledujúce rozhodnutia, pričom o nich riadne informuje Radu orgánov dohľadu:
 - (a) požadovať dodatočné informácie alebo osobitnú spoluprácu od ktoréhokoľvek používateľa v súvislosti s konkrétnou otázkou týkajúcou sa uplatňovania tohto rozhodnutia a
 - (b) špecifikovať rozsah, obsah, formát, frekvenciu, referenčné dátumy, pravidlá IT, pravidlá validácie a pokyny týkajúce sa informácií a údajov zahrnutých do systému validácie modelu ISDA SIMM, určiť účel spracovania akýchkoľvek osobných údajov a právo na prístup k systému potvrdenia modelu ISDA SIMM a stanoviť akékoľvek iné prevádzkové pravidlá alebo technické špecifikácie potrebné (ďalej len „technické špecifikácie systému potvrdenia modelu ISDA SIMM“) na uplatňovanie tohto rozhodnutia.

Článok 12 – Záverečné ustanovenia

Toto rozhodnutie nadobúda účinnosť 1. marca 2026.

V Paríži

José Manuel Campa
Predseda

za Radu orgánov dohľadu

PRÍLOHA 1

Informácie uvedené ďalej sa poskytujú pre každý právny subjekt (t. j. protistranu v zmysle nariadenia EMIR) so sídlom v EHP, na ktorý sa vzťahuje požiadavka na výmenu počiatočnej marže v súlade s delegovaným nariadením Komisie (EÚ) 2016/2251⁴ (ďalej len „spoločné regulačné technické predpisy európskych orgánov dohľadu o nezúčtovaných mimoburzových derivátoch“) a ktorý je licencovaným používateľom modulu ISDA SIMM – či už individuálne, alebo ako súčasť skupiny (t. j. EHP alebo mimo EHP)

Identifikačné údaje

- názov právneho subjektu,
- identifikátor právnickej osoby,
- povaha subjektu (napr. nefinančná protistrana, úverová inštitúcia, investičná spoločnosť, podnik kolektívneho investovania do prevoditeľných cenných papierov (PKIPCP), alternatívny investičný fond (AIF), poisťovňa),
- krajina, v ktorej je subjekt usadený,
- príslušný orgán zodpovedný za povolenie modelu počiatočných marží daného subjektu,

Informácie o objeme počiatočnej marže

- Hodnotenie skupiny (t. j. fázy 1 až 6), do ktorého subjekt v súčasnosti patrí v súlade s článkom 36 spoločných regulačných technických predpisov európskych orgánov dohľadu o nezúčtovaných mimoburzových derivátoch (napr. AANA > 3 000 mld. EUR, 8 mld. EUR < AANA ≤ 50 mld. EUR),
- Uvedenie, či subjekt má mesačnú priemernú nesplatenú pomyselnú sumu mimoburzových derivátov nezúčtovaných centrálnu vo výške najmenej 750 miliárd EUR na úrovni skupiny, ako sa uvádza v článku 11 ods. 15 prvom pododseku písm. aa) nariadenia EMIR (áno/nie),

Kontaktné údaje a informácie v oblasti IT

- Funkčná e-mailová adresa tímu zodpovedného za povolenie modelu počiatočnej marže daného subjektu,
- E-mailové domény, ktoré používa daný subjekt,

⁴ Ú. v. EÚ L 340, 15.12.2016, s. 9 – 46.

- Kontaktné údaje pre kontaktnú osobu 1.
Kontaktná osoba 1 je zodpovedná za riadenie prístupu protistrany do systému potvrdenia EBA pre potvrdenie modelu ISDA SIMM. Táto kontaktná osoba môže mať aj úlohu predkladateľa údajov pre potvrdenie modelu počiatočnej marže:
 - meno a priezvisko
 - úloha v inštitúcii
 - e-mailová adresa a telefónne číslo
- kontaktné údaje pre kontaktné osoby 2 a 3
kontaktné osoby 2 a 3 majú úlohu predkladateľov údajov pre potvrdenie modelu počiatočnej marže:
 - meno a priezvisko
 - úloha v inštitúcii
 - e-mailová adresa a telefónne číslo

Informácie o skupine, do ktorej subjekt patrí

Ak je subjekt súčasťou skupiny z EHP, t. j. je priamou alebo nepriamou dcérskou spoločnosťou iného subjektu so sídlom v EHP, v prípade subjektu s najvyšším postavením v skupine, ktorá sa nachádza v EHP (hlavná materská spoločnosť v EHP) sa uvedie:

- názov hlavnej materskej spoločnosti v EHP,
- identifikátor právnickej osoby hlavnej materskej spoločnosti v EHP,
- krajina, v ktorej je usadená hlavná materská spoločnosť v EHP,
- povaha hlavnej materskej spoločnosti v EHP (napr. nefinančná protistrana, úverová inštitúcia, investičná spoločnosť, podnik kolektívneho investovania do prevoditeľných cenných papierov (PKIPCP), alternatívny investičný fond (AIF), poisťovňa).

Okrem toho, ak sú právne subjekty súčasťou skupiny mimo EHP (t. j. hlavná materská spoločnosť skupiny sa nachádza mimo EHP), v prípade subjektu s najvyšším postavením v skupine, ktorý sa nachádza mimo EHP (ďalej len „hlavná materská spoločnosť mimo EHP“), sa uvedie toto:

- názov hlavnej materskej spoločnosti mimo EHP,
- identifikátor právnickej osoby hlavnej materskej spoločnosti mimo EHP,
- krajina, v ktorej je usadená hlavná materská spoločnosť mimo EHP,

- povaha hlavnej materskej spoločnosti mimo EHP (napr. nefinančná protistrana, úverová inštitúcia, investičná spoločnosť, podnik kolektívneho investovania do prevoditeľných cenných papierov (PKIPCP), alternatívny investičný fond (AIF), poisťovňa).

Príslušné orgány poskytnú informácie vo formáte a v súlade s pokynmi stanovenými EBA.

PRÍLOHA 2

Informácie uvedené nižšie sa uvedú pre každú právnickú osobu (t. j. protistranu v zmysle nariadenia EMIR) so sídlom v EHP, na ktorý sa vzťahuje požiadavka na výmenu počiatočnej marže v súlade s delegovaným nariadením Komisie (EÚ) 2016/2251⁵ (ďalej len „spoločné regulačné technické predpisy európskych orgánov dohľadu o nezúčtovaných mimoburzových derivátoch“) a ktorý je licencovaným používateľom modulu ISDA SIMM – či už individuálne, alebo ako súčasť skupiny (t. j. EHP alebo mimo EHP)

Identifikačné údaje

- názov právnickej osoby na individuálnej úrovni,
- krajina, v ktorej je subjekt usadený,
- identifikátor právnickej osoby.

⁵ Ú. v. EÚ L 340, 15.12.2016, s. 9 – 46.