

Eiropas Banku iestādes lēmums EBI/DC/610

(2026. gada 27. janvāris)

par sākotnējās maržas modeļa validācijas funkcijas kārtību saskaņā ar ETIR *ISDA SIMM* vajadzībām

Uzraudzības padome,

ņemot vērā Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 1093/2010 (2010. gada 24. novembris), ar ko izveido Eiropas Uzraudzības iestādi (Eiropas Banku iestādi), groza Lēmumu Nr. 716/2009/EK un atceļ Komisijas Lēmumu 2009/78/EK¹ ("EBI regula"), un jo īpaši tās 1. panta 2. punktu, 2. pantu, 8. panta 1. punkta b) un j) apakšpunktu, 8. panta 1. punkta a) apakšpunkta a) punktu, 8. panta 2. punkta j) apakšpunktu, 31. panta 2. punkta a), b) un f) apakšpunktu un 35. pantu, un

ņemot vērā Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 648/2012 (2012. gada 4. jūlijs) par ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, centrālajiem darījumu partneriem un darījumu reģistriem² ("ETIR") un jo īpaši tās 11. panta 3. un 12.a punktu,

tā kā:

- (1) ETIR 11. panta 3. un 12.a punktā ir noteikts, ka EBI ir atbildīga par *pro forma* modeļu validāciju un par jebkādam to izmaiņām. *ISDA SIMM* ir šāds *pro forma* modelis. Attiecībā uz *ISDA SIMM* validāciju sīkāk jāprecizē visi validācijas funkcijas aspekti, kas EBI jāveic saskaņā ar ETIR, savukārt validācijas sistēma jāievieš provizoriski un neskarot ETIR 89. panta 11 punktu, līdz sāk darboties ETIR 17.c pantā paredzētā EVTI centrālā datubāze.
- (2) Ņemot vērā EBI lomu kā centrālajam validētājam, arī pateicoties tās nepārtrauktajai uzraudzībai, jācenšas panākt pēc iespējas plašāku līdzdalību validācijas sistēmā. Ņemot vērā iepriekš minēto, EBI, EAAPI, EVTI, finanšu un nefinanšu darījumu partneri, kas izmanto *ISDA SIMM*, attiecīgās kompetentās iestādes un Starptautiskā mijmaiņas darījumu un atvasinājumu asociācija (*ISDA*) kā validācijas sistēmas lietotāji efektīvi jāsadarbojas, lai apmainītos ar nepieciešamo informāciju par visiem validācijas funkcijas aspektiem.
- (3) Uz visu validācijas sistēmā iekļauto informāciju ir jāattiecas ES tiesiskajam regulējumam par dienesta noslēpumu, konfidencialitāti un personas datu aizsardzību, un par to, ka piekļuve šai informācijai tiek nodrošināta lietotājiem saskaņā ar EBI regulu. Tā kā EBI kļūst par nozīmīgu datu centru, lai samazinātu ziņošanas slogu un izmaksas un palielinātu efektivitāti visiem lietotājiem, validācijas sistēma jāintegrē Eiropas centralizētajā uzraudzības datu infrastruktūrā (*EUCLID*).

¹ OV L 331, 15.12.2010., 12.–47. lpp.

² OV L 201, 27.07.2012., 1. lpp.

- (4) Lai atbalstītu validēšanas sistēmas labu darbību, validēšanas pieteikumiem jāpiemēro iepriekšējs pievienošanas process. Tāpēc EBI jāuzsāk strukturēts uzņemšanas process, lai savāktu visu nepieciešamo informāciju darījumu partneru identifikācijai, izmantojot *ISDA SIMM* modeli. Kompetentajām iestādēm saskaņā ar ETIR 11. panta 3. punkta trešo daļu jāsniedz EBI to finanšu un nefinanšu darījumu partneru nosaukumi un cita būtiska informācija, kuri ir iesnieguši pieteikumu, lai saņemtu atļauju sākotnējās drošības rezerves modelim, pamatojoties uz *ISDA SIMM*. Vienlaikus un saskaņā ar ETIR 11. panta 12.a punkta otro daļu *ISDA* jāsadarbības ar EBI, sniedzot informāciju par darījumu partneriem, kas izmanto *ISDA SIMM*. Lai izvairītos no dublēšanās un nodrošinātu datu precizitāti, EBI jākoordinē pievienošanas process, un attiecīgā gadījumā tā var paļauties uz kompetento iestāžu apstiprinājumiem.
- (5) Ir jānodrošina, ka kompetentās iestādes un *ISDA* nekavējoties sniedz informāciju par jauniem darījumu partneriem, kas izmanto *ISDA SIMM*, lai atvieglotu uzņemšanas procesu, uz kura pamata darījumu partneri izpildīs savu pienākumu saskaņā ar ETIR pieteikties savu modeļu validācijai, izmantojot validācijas sistēmu.
- (6) Lai novērstu nevajadzīgu slogu un ņemot vērā to, ka saskaņā ar ETIR *ISDA* ir efektīvi jāsadarbības ar EBI validācijas nolūkos, *ISDA* vajadzētu būt atbildīgai par visas nepieciešamās informācijas savlaicīgu sniegšanu par modeli un tā atjauninājumiem. Lai EBI varētu pilnībā izprast modeli un plānoto modeļa atjauninājumu, šai informācijai jāaptver modeļa vispārīgie aspekti, kas ir gan atjauninājuma priekšmets, gan nav tā priekšmets.
- (7) Piesaistītie finanšu un nefinanšu darījumu partneri, kas izmanto *ISDA SIMM*, iesniedz EBI pieteikumu validācijai pēc tam, kad EBI ir apstiprinājusi, ka *ISDA*, izmantojot validācijas sistēmu vai jebkādos citus līdzekļus, ko EBI uzskata par piemērotiem, ir iesniegusi pilnīgu informāciju un apliecinājumus dokumentus par *ISDA SIMM* elementiem un vispārējiem aspektiem. Ja šādi pieteikumi tiek iesniegti, jāpieņem, ka tie attiecas uz *ISDA SIMM pro forma* modeli, ko *ISDA* kā modeļa izstrādātājs aprakstījis EBI iesniegtajā informācijā un apliecinātajos dokumentos. Šāds divpakāpju process, kas ietver vispirms *ISDA* iesniegumu par modeļa specifiku un jebkurām izmaiņām tajā, un pēc tam darījumu partnera pieteikumu EBI par sava modeļa validāciju, ir jāievēro saistībā ar jebkurām turpmākām *ISDA SIMM* modeļa izmaiņām. Lai nodrošinātu maksimālu efektivitāti, ja validācijas pieprasījums tiek saņemts pēc tam, kad pašreizējais *ISDA SIMM* ir validēts, validācijas lēmums jāpieņem automātiski, izmantojot sistēmu.
- (8) *ISDA* jāpaziņo EBI par visiem *ISDA SIMM* atjauninājumiem, bet EBI jā saglabā elastība, lai novērtētu, kuri no šiem atjauninājumiem ir modeļa izmaiņas, kas jāapstiprina. Tikai atjauninājumi, kurus EBI pēc saviem ieskatiem uzskata par modeļa izmaiņām, var izraisīt *ISDA SIMM* validācijas procesu.
- (9) Pirmajā *ISDA SIMM* validācijā jāiekļauj visi modeļa atjauninājumi un izmaiņas līdz minētā sākotnējā validācijas lēmuma pieņemšanas dienai. Šajā lēmumā jānosaka arī Eiropas tirgus infrastruktūras regulas (ETIR) sešu mēnešu vai trīs mēnešu termiņš, līdz kuram EBI ir juridisks pienākums piešķirt vai atteikt validāciju, un tas sākas ar pirmo pieteikumu, ko EBI saņēmusi ar validācijas sistēmas starpniecību.

- (10) Tā kā *ISDA SIMM* tiek plaši izmantots globālajā tirgū un lai izvairītos no jebkādiem tirgus traucējumiem, EBI jāturpina validācijas piešķiršana, tiklīdz *ISDA* ir iesniegusi visu nepieciešamo informāciju par modeli, ja vien šāda validācija netiktu uzskatīta par acīmredzami nepiemērotu, ņemot vērā tirgus apstākļus vai nepieciešamību nodrošināt finanšu stabilitāti, kurā gadījumā validācija jānoraida. Lai uzlabotu tirgus noteiktību un veicinātu stabilitāti, *ISDA SIMM* validācijai nevajadzētu būt ierobežotai laikā, un tieši šā iemesla dēļ tā jāpapildina ar *ISDA SIMM* pastāvīgas piemērotības pārbaudi, kas jānodrošina, EBI pastāvīgi uzraugot modeli, kā noteikts ETIR 11. panta 12.a punkta trešajā daļā.
- (11) *ISDA SIMM* validācija ar lēmumu, kam nav noteikts termiņš, būtībā nosaka, ka šādu lēmumu var brīvi atsaukt pilnībā vai daļēji, ja EBI, veicot pastāvīgu uzraudzību vai *ad hoc*, tostarp ārkārtas situācijās, uzskata, ka *ISDA SIMM* validācijas saglabāšana nepiemērota, ņemot vērā tirgus apstākļus vai nepieciešamību nodrošināt finanšu stabilitāti. Jānodrošina, ka EBI atsauc *ISDA SIMM* validāciju, ja tās uzturēšana tiek uzskatīta par neatbilstošu, neatkarīgi no tā, vai *ISDA* vai jebkurš cits validācijas sistēmas lietotājs, kam šādi ieteikumi var būt adresēti, ir ievērojis EBI ieteikumus, kas sniegti tās nepārtrauktas uzraudzības laikā. *ISDA* nesadarbošanās gadījumā arī *ISDA SIMM* validācija jāatsauc, izņemot gadījumus, kad un tik ilgi, kamēr finanšu stabilitātes vai tirgus integritātes apsvērumi liek domāt citādi, jo šādas nesadarbošanās dēļ nav iespējams pastāvīgi uzraudzīt *ISDA SIMM* piemērotību saskaņā ar ETIR prasībām.
- (12) Ņemot vērā to, ka nepārtraukta uzraudzība tiek izmantota *ISDA SIMM* validācijā, ir nepieciešams precizēt, kādi elementi vismaz jāiekļauj šādā EBI veiktā uzraudzībā. Lai nodrošinātu pārredzamību, EBI savā ETIR minētajā gada ziņojumā iekļauj galvenos secinājumus, kas izdarīti šīs uzraudzības rezultātā.
- (13) Finanšu vai nefinanšu darījumu partneriem ir tiesības tikt uzklautiem tikai tad, ja EBI plāno nepiešķirt *ISDA SIMM* validāciju vai daļēji vai pilnībā atsaukt validāciju.
- (14) Ir jānodrošina, ka visi validācijas sistēmas lietotāji efektīvi un lietderīgi sadarbojas ar EBI, lai tā varētu veikt savu validācijas funkciju. Ņemot vērā iepriekš minēto, darījumu partneriem jāinformē EBI, ja tie vairs neatbilst pašlaik apstiprinātajam *ISDA SIMM*, savukārt kompetentajām iestādēm un darījumu partneriem jāinformē EBI par jebkādu informāciju, kas nepieciešama validācijas funkcijas veikšanai pastāvīgi vai *ad hoc*.
- (15) Lai nodrošinātu savlaicīgu reaģēšanu, vienlaikus ievērojot noteiktos principus par uzdevumu likumīgu deleģēšanu, Regulējuma un politikas pastāvīgajai komitejai (*SCRePoI*) jāpiešķir pilnvaras apstiprināt turpmākas izmaiņas, bet Uzraudzības padomei jāpiešķir sākotnējā *ISDA SIMM* validācija un jāpieņem lēmums par jebkādu turpmākas validācijas atteikumu vai validācijas lēmuma pilnīgu vai daļēju atsaukšanu. Lai palielinātu elastību, izpilddirektoram vajadzētu būt pilnvarotam veikt visus tehniskos konstatējumus, kas vajadzīgi validācijas sistēmas darbībai un validācijas funkcijas veikšanai. Uzraudzības padomei jābūt informētai par visām šādām *SCRePoI* veiktajām validācijām un izpilddirektora tehniskajiem lēmumiem, vienlaikus nekas nedrīkst traucēt Uzraudzības padomei atcelt šādus pilnvarojumus, ja tas ir nepieciešams.
- (16) Lai pieņemtu šo lēmumu, EBI ir apspriedusies ar EAAP, EVTI un *ISDA*, kā arī ar kompetentajām iestādēm, kas piedalās EBI iekšējās pārvaldības struktūrā.

Ir nolēmusi šādi.

1. pants. Lēmuma priekšmets un tvērums

1. Ar šo lēmumu izveido informācijas sistēmu ("*ISDA SIMM* validācijas sistēma") kā pagaidu pasākumus līdz brīdim, kad sāks darboties ETIR 17.c pantā paredzētā *ESMA* datubāze.
2. *ISDA SIMM* validācijas sistēmas lietotāji ("lietotāji") ir EBI, *ESMA*, *EAAP*, ETIR 2. panta 13. punktā minētās kompetentās iestādes ("kompetentās iestādes") un ETIR 11. pantā minētie finanšu un nefinanšu darījumu partneri, kas izmanto *ISDA SIMM* modeli ("darījumu partneri") un *ISDA*.
3. Uz *ISDA SIMM* validācijas sistēmā iekļauto informāciju attiecas ES tiesiskais regulējums par dienesta noslēpumu, konfidencialitāti un personas datu aizsardzību, kas piemērojams EBI. Piekļuve saskaņā ar EBI regulas 70., 71. un 72. pantu.
4. Informāciju, kas EBI iesniegta, izmantojot *ISDA SIMM* validācijas sistēmu, uzskata par informāciju, kas iesniegta, izmantojot Eiropas centralizēto datu infrastruktūru (*EUCLID*), un piemēro 2020. gada 5. jūnija Lēmumu EBI/DC/2020/335 par *EUCLID* ar tā turpmākajiem grozījumiem vai aizstājējiem.

2. pants. Darījumu partneru ievadīšana darbā

1. Kompetentās iestādes, izmantojot *ISDA SIMM* validācijas sistēmu vai citus līdzekļus, ko EBI uzskata par piemērotiem, sniedz EBI 1. pielikumā iekļauto informāciju par visiem darījumu partneriem, kuri izmanto sākotnējās drošības rezerves modeli, kura pamatā ir *ISDA SIMM*, un kuriem ir jāpieprasa atļauja, kas minēta ETIR 11. panta 3. punkta trešajā daļā.
2. Kompetentās iestādes bez nepamatotas kavēšanās sniedz EBI 1. pielikumā iekļauto informāciju par jebkuru darījumu partneri, kas pieprasa šādu atļauju pēc šā lēmuma piemērošanas dienas.
3. *ISDA*, izmantojot *ISDA SIMM* validācijas sistēmu vai jebkādus citus līdzekļus, ko EBI uzskata par piemērotiem, sniedz EBI 2. pielikumā iekļauto informāciju par visiem jaunajiem darījumu partneriem, kuri izmanto *ISDA SIMM* un kuriem ir jāsaņem ETIR 11. panta 3. punkta trešajā daļā minētā atļauja.
4. Saņemot paziņojumu no EBI, darījumu partneri bez nepamatotas kavēšanās piekļūst validācijas sistēmai, lai pabeigtu darbā ievadīšanas procesu, tostarp piešķirot personām piekļuves tiesības *ISDA SIMM* validācijas sistēmai ("pilnvarotie lietotāji") un pieņemot valodas terminus.
5. Darījumu partneri, kas nav saņēmuši iepriekš minēto paziņojumu un kam saskaņā ar ETIR 11. panta 3. punkta trešo daļu ir pienākums vērsties EBI, lai apstiprinātu savu modeli, nodos šo jautājumu izskatīšanai EBI. Attiecīgā kompetentā iestāde tūlīt pēc EBI pieprasījuma sniedz EBI informāciju, kas nepieciešama minētā darījumu partnera piesaistīšanai.

3. pants. ISDA SIMM un tās atjauninājumu informācijas un apliecinājošo dokumentu sniegšana

1. ISDA saskaņā ar ETIR 11. panta 12.a punkta otro daļu bez liekas kavēšanās, izmantojot ISDA SIMM validācijas sistēmu vai izmantojot jebkādu citu līdzekļus, ko EBI uzskata par piemērotiem, bez liekas kavēšanās sniedz EBI visu informāciju un apliecinājošos dokumentus, tostarp informāciju par elementiem un vispārīgajiem aspektiem, instrumentu kalibrēšanu, izstrādi un tvērumu, aktīvu klasēm un riska faktoriem, kas attiecas uz ISDA SIMM, un par jebkuru tā atjauninājumu.
2. Veicot pirmo ISDA SIMM validāciju, ISDA cenšas sniegt 1. punktā minēto informāciju:
 - (a) attiecībā uz pašlaik spēkā esošo ISDA SIMM modeli – bez liekas kavēšanās pēc šā lēmuma stāšanās spēkā;
 - (b) ja ir plānots atjaunināt pašlaik spēkā esošo ISDA SIMM modeli – līdz 2026. gada 14. augustam.
3. Lai apstiprinātu jebkādas turpmākas ISDA SIMM izmaiņas, ISDA nodrošina, ka 1. punktā minētā informācija jebkurā gadījumā tiek sniegta EBI ne vēlāk kā četrpadsmit (14) nedēļas pirms datuma, kad jebkurš atjauninājums kļūst piemērojams.
4. ISDA paziņo un sniedz visu attiecīgo informāciju par visiem ISDA SIMM atjauninājumiem. Ja ISDA paziņotais atjauninājums neizraisa izmaiņas EBI viedoklī, tostarp 6. punktā minētajos gadījumos, iepriekš piešķirtā validācija turpina būt spēkā un validācijas process netiek uzsākts.
5. Šādus ISDA SIMM atjauninājumus uzskata par ISDA SIMM izmaiņām:
 - (a) atjauninājums maina ISDA SIMM strukturālos pamatus, tostarp projektēšanu, riska uztveršanu vai pieņēmumus, vai tajā būtiski tiek pārskatīta ISDA SIMM atkarības apstrāde;
 - (b) atjauninājuma rezultātā no ISDA SIMM tiek segtas jaunas aktīvu kategorijas vai risku veidi vai arī iepriekš uztvertās aktīvu kategorijas vai risku veidi tiek izslēgti no ISDA SIMM.
6. Atjauninājumi, kas ietekmē tikai modeļa parametrus, kuri izriet no jau esošās un apstiprinātās ISDA SIMM metodikas, tostarp atjauninājumi par riska svāriem un korelācijām, vai kas attiecas uz precizējumiem, dokumentācijas uzlabojumiem un labojumiem vai tehniskajiem uzlabojumiem, netiek uzskatīti par ISDA SIMM izmaiņām.

4. pants. Validācijas pieteikums

1. EBI, izmantojot ISDA SIMM validācijas sistēmu vai jebkādu citu līdzekļus, ko uzskata par piemērotiem, sniedz piesaistītajiem darījumu partneriem apstiprinājumu, ka ISDA SIMM ir iesniegusi pilnīgu informāciju un dokumentāciju saskaņā ar 3. pantu.
2. Pēc iepriekšējā punktā minētā apstiprinājuma saņemšanas jaunieceltie darījumu partneri bez nepamatotas kavēšanās iesniedz pieteikumu, izmantojot ISDA SIMM validācijas sistēmu vai jebkuru citu līdzekļus, kurus EBI uzskata par piemērotiem, lai validētu savu modeli, turklāt norādot, ka tas pilnībā atbilst ISDA SIMM *pro forma* modelim, ko ISDA aprakstījusi informācijā un apliecinājošajos dokumentos, kas iesniegti saskaņā ar 3. pantu.

3. *ISDA SIMM* validācijas sistēma automātiski sagatavo turpmākus pieteikumus par izmaiņām *ISDA SIMM* attiecībā uz visiem pievienotajiem darījumu partneriem, kuri saskaņā ar 6. panta 5. punktu nav paziņojuši, ka tie ir pārtraukuši atbilstību *ISDA SIMM* vai ka tiem vairs nav jāiesniedz pieteikums validācijai un atļaujas saņemšanai saskaņā ar ETIR.
4. Ja EBI saņem *ISDA SIMM* validācijas pieteikumu pēc *ISDA SIMM* validācijas, validācija šim pieteikumam tiek piešķirta automātiski, izmantojot validācijas sistēmu. Validācijā jāatsaucas uz *ISDA SIMM*, kas ir validēts.

5. pants. *ISDA SIMM* validācija un validācijas atteikums

1. Ja *ISDA* ir izpildījusi 3. panta prasības, EBI apstiprina *ISDA SIMM* vai jebkādas izmaiņas tajā, izņemot gadījumus, kad *ISDA SIMM* vai jebkādu izmaiņu tajā validācija, pēc EBI uzskata, ir acīmredzami nepiemērota, ņemot vērā tirgus apstākļus vai nepieciešamību nodrošināt finanšu stabilitāti.
2. Pirmā *ISDA SIMM* validācija aptver visus modeļa atjauninājumus un izmaiņas līdz dienai, kad stājas spēkā validācijas lēmums, un lēmumu par to pieņem saskaņā ar 1. punktu sešu mēnešu laikā no pirmā pieteikuma saņemšanas EBI saskaņā ar 4. pantu.
3. Lēmumu par jebkādu izmaiņu validāciju *ISDA SIMM* pieņem saskaņā ar 1. punktu trīs mēnešu laikā no pirmā pieteikuma saņemšanas EBI saskaņā ar 4. pantu. Visi turpmākie lēmumi par *ISDA SIMM* validēšanu pēc izmaiņu veikšanas tajā atceļ un aizstāj iepriekšējos validēšanas lēmumus.
4. Validāciju vai atteikumu validēt *ISDA SIMM* vai tā izmaiņas adresē visiem darījumu partneriem, kas ir pieteikušies saskaņā ar 4. pantu.
5. *ISDA SIMM* validācija nav ierobežota laikā un tiek atsaukta saskaņā ar 6. pantu.

6. pants. *ISDA SIMM* validācijas atsaukšana

1. Ja 7. pantā minētā uzraudzība liecina, ka *ISDA SIMM* validācijas saglabāšana, pēc EBI uzskata, nav piemērota, ņemot vērā tirgus apstākļus vai nepieciešamību nodrošināt finanšu stabilitāti, EBI pilnībā vai daļēji atsauc šādu validāciju.
2. Pat tad, ja 1. punkts nav piemērojams, EBI atsauc *ISDA SIMM* validāciju, ja *ISDA* nesadarbojas tā, kā noteikts šajā lēmumā, tostarp, ja tā nesniedz nepieciešamo informāciju, izņemot gadījumus, kad šāda atsaukšana apdraudētu tirgus integritāti vai finanšu stabilitāti.
3. EBI atsauc validācijas lēmumu saskaņā ar 1. vai 2. punktu neatkarīgi no tā, vai 7. panta 4. punktā minētos ieteikumus ir īstenojuši to adresāti.
4. Atsaukšanas lēmumus adresē visiem darījumu partneriem, kuru modeļi ir validēti saskaņā ar šo lēmumu.
5. *ISDA SIMM* validācija tiek automātiski atsaukta, izmantojot *ISDA SIMM* validācijas sistēmu, attiecībā uz jebkuru darījumu partneri, kas saskaņā ar 10. panta 2. punktu paziņo, ka vairs neatbilst EBI validētajam *ISDA SIMM* vai ka vairs nav nepieciešams pieteikties validācijai un atļaujai saskaņā ar ETIR.

7. pants. Uzraudzība

1. EBI pastāvīgi uzrauga apstiprinātā *ISDA SIMM* atbilstību un analizē visus ziņotos vai citādi radušos jautājumus. Tā iekļauj savus galvenos secinājumus ETIR 11. panta 12.a punkta trešajā daļā minētajā gada ziņojumā.
2. EBI 1. punktā minētā uzraudzība ietver vismaz šādus elementus:
 - (a) *ISDA SIMM* atbilstība vispārīgo prasību kritērijiem, maržinālā riska periodam, parametra kalibrēšanai, diversifikācijai, riska ierobežošanai un riska kompensācijai atbilstoši pamatā esošajam aktīvam vai kvalitatīvajām prasībām, kas noteiktas Komisijas Deleģētajā regulā (ES) 2016/2251 (2016. gada 4. oktobris), ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 648/2012 par ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, centrālajiem darījumu partneriem un darījumu reģistriem papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem riska mazināšanas metodēm, kas paredzētas ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem, kuriem tīrvērti neveic centrālais darījumu partneris³;
 - (b) riska faktoru seguma un atbilstības novērtējums, ņemot vērā arī tirgus attīstību un stresa notikumus;
 - (c) modeļa kalibrēšanas novērtējums;
 - (d) modeļa vispārējās veiktspējas novērtējums, pamatojoties uz atpakaļejošās testēšanas rezultātiem;
 - (e) citi elementi, uz kuriem EAAP, ESMA, kompetentās iestādes vai *ISDA* ir norādījušas EBI uzmanību.
3. EBI uzraudzība, kas minēta šajā pantā, neliedz EBI uz *ad hoc* pamata, tostarp ārkārtas situācijās vai saistībā ar nelabvēlīgu tirgus attīstību, atkārtoti novērtēt, vai *ISDA SIMM* validācija joprojām ir atbilstoša.
4. ETIR 11. panta 12.a punkta trešajā daļā minētajā gada ziņojumā EBI var sniegt ieteikumus par visiem jautājumiem, kas jārisina *ISDA* vai jebkuram validācijas sistēmas lietotājam. Šādi ieteikumi var būt saistīti ar riskiem, faktoriem, kas nav pienācīgi atspoguļoti validētajā *ISDA SIMM*, piemērošanas jomu, instrumentu un aktīvu klašu segumu, kalibrēšanu vai jebkuru citu metodiku, pamatojoties uz *ISDA SIMM*, ko validējusi EBI, vai pamatojoties uz jebkādam paredzamām izmaiņām tajā.

8. pants. Tiesības tikt uzklaštam

1. Ja EBI plāno nepiešķirt validāciju *ISDA SIMM* vai daļēji vai pilnībā atsaukt validāciju *ISDA SIMM* neatbilstības dēļ, darījumu partneriem, kas ir iesnieguši validācijas pieprasījumu saskaņā ar 4. pantu vai kuru modeļi ir apstiprināti saskaņā ar šo lēmumu, paziņo par EBI nodomu un piešķir divdesmit [20] darbdienu termiņu, kurā tie var izteikt savu viedokli.
2. Iepriekšējā punktā minētais paziņojums un viedokļa izteikšana veicama, izmantojot *ISDA SIMM* validācijas sistēmu vai jebkādu citu līdzekļus, ko EBI uzskata par piemērotiem.

³ OV L 340, 15.12.2016., 9.–46. lpp.

9. pants. Pārredzamība

1. Par jebkuru lēmumu piešķirt vai atteikt validāciju un par jebkuru lēmumu daļēji vai pilnībā atsaukt validāciju paziņo visiem lietotājiem, izmantojot *ISDA SIMM* validācijas sistēmu.
2. Jebkurā lēmumā par validācija noraidīšanu un jebkurā lēmumā par daļēju vai pilnīgu atsaukšanu norāda iemeslus, kas ir tā pamatā, un informē darījumu partnerus par tiesiskās aizsardzības līdzekļiem, kas ir pieejami saskaņā ar EBI regulu.
3. Jebkuru lēmumu piešķirt vai atteikt validāciju un jebkuru lēmumu daļēji vai pilnībā atsaukt validāciju un jebkuru viedokli, kas iesniegts saistībā ar tiesību tikt uzklausi tam īstenošanu, bez liekas kavēšanās publicē EBI tīmekļa vietnē, ja vien EBI neuzskata, ka šāda publicēšana ir pretrunā minēto finanšu iestāžu likumīgajām interesēm vai to komercnoslēpumu aizsardzībai vai varētu nopietni apdraudēt finanšu tirgu pienācīgu darbību un integritāti vai visas Savienības finanšu sistēmas vai tās daļas stabilitāti.

10. pants. Informācijas sniegšanas un sadarbības prasības

1. Kompetentajām iestādēm:

(a) jānodrošina, ka *ISDA SIMM* validācijas sistēmā ir ietverta precīza un aktuāla informācija par darījumu partneriem, kas ir pieteikušies atļaujai saskaņā ar EMIR 11. panta 3 punkta trešo daļu jebkuram sākotnējās maržas modelim, kas balstīts uz *ISDA SIMM*; un

(b) jāsniedz EBI, izmantojot *ISDA SIMM* validācijas sistēmu vai jebkurus citus līdzekļus, ko EBI uzskata par piemērotiem, informāciju, ko tās ir apkopojušas *ISDA SIMM* sākotnējā un notiekošā struktūras līmeņa atļaujas piešķiršanas procesā vai par jebkādam izmaiņām tajā.

2. Darījumu partneri bez nepamatotas kavēšanās informē EBI, izmantojot *ISDA SIMM* validācijas sistēmu, ja tie vairs neatbilst pašlaik validētajam *ISDA SIMM* vai vairs nav pienākums pieteikties validācijai un atļaujai saskaņā ar ETIR.
3. Lietotāji, izmantojot validācijas sistēmu vai jebkādu citu līdzekli, ko EBI uzskata par piemērotiem, sniedz EBI informāciju, kas vajadzīga, lai efektīvi veiktu *ISDA SIMM* pastāvīgas piemērotības validēšanu un novērtēšanu, tostarp bez ierobežojumiem pielikumā izklāstīto informāciju.
4. Lietotāji, izmantojot validācijas sistēmu vai jebkādu citu līdzekli, ko EBI uzskata par piemērotiem, sniedz EBI jebkādu papildu informāciju un datus, ko EBI uzskatīs par nepieciešamiem savas validācijas funkcijas izpildei.
5. Iepriekšējā punktā minētā informācija indikatīvi ietver informāciju un datus par *ISDA SIMM* izmantošanu, veikspēju, kalibrēšanu vai piemērošanu, informāciju un datus par drošības rezervju apjomu, kas aprēķināts, izmantojot standartizētu tīklu vai sākotnējās drošības rezerves modeļus, kvalitatīvu informāciju par skaidru izvēli neizmantojot sākotnējās drošības rezerves modeļus, statistiku par saskaņošanas pasākumiem un strīdiem, sīkāku informāciju par svarīgākajiem strīdiem, kā arī statistiku un datus par papildinājumiem, kas piemēroti papildus sākotnējai drošības rezervei.

6. Papildus iepriekšējos punktos minētās informācijas un datu sniegšanai lietotāji bez liekas kavēšanās sadarbojas ar EBI, lai tā varētu veikt savu validācijas funkciju, un, izmantojot validācijas sistēmu vai jebkākus līdzekļus, ko EBI uzskata par piemērotiem, sniedz EBI visu tās pieprasīto informāciju.

11. pants. Lēmumu pieņemšana

1. Pirmo lēmumu par *ISDA SIMM* validāciju, lēmumu par validācijas atteikšanu un lēmumu par validācijas pilnīgu vai daļēju atsaukšanu pieņem Uzraudzības padome saskaņā ar 5. un 6. pantu.
2. Jebkuru turpmāku lēmumu par *ISDA SIMM* izmaiņu validāciju saskaņā ar 5. panta 1. punktu pieņem Regulējuma un politikas pastāvīgā komiteja (*SCRePol*). Uzraudzības padome tiek pienācīgi informēta par šādiem lēmumiem. Pieņemot lēmumu par *ISDA SIMM* izmaiņu validāciju, *SCRePol* cenšas panākt vienprātību. Ja neizdodas panākt vienprātību, lēmumu pieņem ar to *SCRePol* locekļu vienkāršu balsu vairākumu, kurus iecēlis Uzraudzības padomes balsstiesīgais loceklis. Atturēšanās vai viedokļu nepaušana tiek uzskatīta par labu lēmumam. Ja *SCRePol* nosaka, ka *ISDA SIMM* modeļa izmaiņu validācija ir jāatsaka, tā nosūta savu priekšlikumu Uzraudzības padomei galīgā lēmuma pieņemšanai.
3. Izpilddirektors ir pilnvarots pieņemt šādus lēmumus, pienācīgi informējot par tiem Uzraudzības padomi:
 - (a) pieprasīt papildu informāciju vai pieprasīt konkrētu sadarbību no jebkura lietotāja attiecībā uz konkrētu jautājumu, kas attiecas uz šī lēmuma piemērošanu; un
 - (b) noteikt *ISDA SIMM* validācijas sistēmā iekļautās informācijas un datu darbības jomu, saturu, formātu, biežumu, atsaucē datumus, IT noteikumus, validācijas noteikumus un norādījumus, noteikt jebkādu personas datu apstrādes mērķi un piekļuves tiesības *ISDA SIMM* validācijas sistēmai, kā arī noteikt jebkādos citus darbības noteikumus vai tehniskās specifikācijas ("*ISDA SIMM* validācijas sistēmas tehniskās specifikācijas"), kas nepieciešamas šī lēmuma piemērošanai.

12. pants. Nobeiguma noteikumi

Šis lēmums stājas spēkā 2026. gada 1. martā.

Parīzē,

José Manuel Campa
Priekšsēdētājs

Uzraudzības padomes vārdā

1. PIELIKUMS

Turpmāk norādīto informāciju sniedz par katru EEZ reģistrētu juridisko personu (t. i., darījumu partneri ETIR nozīmē), uz kuru attiecas prasība apmainīties ar sākotnējo drošības rezervi saskaņā ar Komisijas Deleģēto regulu (ES) 2016/2251⁴ ("Kopīgie EUI RTS par ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, kuriem nav veikta tīrvērte") un kura ir licencēts ISDA SIMM lietotājs – atsevišķi vai kā grupas daļa (t. i., EEZ vai ārpus EEZ)

Identifikācijas informācija

- Juridiskās personas nosaukums.
- LEI kods.
- Struktūras veids (piemēram, nefinanšu darījumu partneris, kredītiestāde, ieguldījumu brokeru sabiedrība, pārvedamu vērtspapīru kolektīvo ieguldījumu uzņēmums (PVKIU), alternatīvo ieguldījumu fonds (AIF), apdrošināšanas sabiedrība).
- Valsts, kurā struktūra ir reģistrēta.
- Kompetentā iestāde, kas ir atbildīga par infrastruktūras pārvaldītāja modeļa atļaujas piešķiršanu struktūrai.

Informācija par sākotnējās drošības rezerves apjomu

- Novērtējums par kategoriju (t. i., no 1. līdz 6. posms), kurai uzņēmums pašlaik pieder saskaņā ar 36. pantu kopīgajos EUI RTS par ārpusbiržas atvasinātiem finanšu instrumentiem, kuriem nav veikta tīrvērte (piemēram, AANA > 3 000 miljardiem EUR, EUR 8 miljardiem < AANA ≤ 50 miljardiem EUR).
- Norāde par to, vai uzņēmumam ir vidējā mēneša neatmaksātā nosacītā summa par ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, kuriem centrāli nav veikta tīrvērte, vismaz 750 miljardu EUR apmērā grupas līmenī, kā minēts ETIR 11. panta 15. punkta pirmajā daļā, aa) apakšpunktā (jā/nē).

Kontaktinformācija un IT informācija

- Iestādes IM modeļa autorizācijas komandas funkcionālā e-pasta adrese.
- Iestādes izmantotie e-pasta domēni.

⁴ OV L 340, 15.12.2016., 9.–46. lpp.

- 1. kontaktpersonas kontaktinformācija.
1. kontaktpersona ir atbildīga par to, kā tiek pārvaldīta darījuma partnera piekļuve EBI validācijas sistēmai *ISDA SIMM* validācijai. Šai kontaktpersonai var būt arī *IMMV* datu iesniedzēja loma:
 - vārds un uzvārds;
 - loma iestādē
 - e-pasta adrese un tālruna numurs.
- 2. un 3. kontaktpersonas kontaktinformācija.
2. un 3. kontaktpersonai būs *IMMV* datu iesniedzēju loma:
 - vārds un uzvārds;
 - loma iestādē
 - e-pasta adrese un tālruna numurs.

Informācija par grupu, kurai pieder struktūra

Ja struktūra ir daļa no EEZ grupas, t. i., ir tieša vai netieša citas EEZ esošas struktūras meitasuzņēmums, par augstākā ranga grupas struktūru, kas atrodas EEZ ("galējā EEZ mātesuzņēmuma"), jānorāda sekojošais:

- galējās EEZ mātesuzņēmuma nosaukums;
- galējās EEZ mātesuzņēmuma *LEI* kods;
- valsts, kurā ir izveidota galējā EEZ mātesuzņēmuma juridiskā adrese;
- galējās EEZ mātesuzņēmuma darbības veids (piemēram, nefinanšu darījumu partneris, kredītiestāde, ieguldījumu sabiedrība, pārvedamu vērtspapīru kolektīvo ieguldījumu uzņēmums (PVKIU), alternatīvo ieguldījumu fonds (AIF), apdrošināšanas sabiedrība).

Turklāt, ja juridiskas personas ir daļa no grupas, kas neatrodas EEZ (t. i., grupas galējais mātesuzņēmums atrodas ārpus EEZ), par augstākā ranga grupas struktūru, kas atrodas ārpus EEZ ("galējais ārpus EEZ esošais mātesuzņēmums"), jānorāda sekojošais:

- galējā ārpus EEZ esošā mātesuzņēmuma nosaukums;
- galējā ārpus EEZ esošā mātesuzņēmuma *LEI* kods;
- valsts, kurā reģistrēts galējais ārpus EEZ esošais mātesuzņēmums;

- galējā ārpus EEZ esošā mātesuzņēmuma darbības veids (piemēram, nefinanšu darījumu partneris, kredītiestāde, ieguldījumu sabiedrība, pārvedamu vērtspapīru kolektīvo ieguldījumu uzņēmums (PVKIU), alternatīvo ieguldījumu fonds (AIF), apdrošināšanas sabiedrība)).

Kompetentās iestādes sniedz informāciju EBI noteiktajā formātā un saskaņā ar EBI norādījumiem.

2. PIELIKUMS

Turpmāk norādīto informāciju sniedz par katru EEZ reģistrētu juridisko personu (t. i., darījumu partneri ETIR nozīmē), uz kuru attiecas prasība apmainīties ar sākotnējo drošības rezervi saskaņā ar Komisijas Deleģēto regulu (ES) 2016/2251⁵ ("Kopīgie EUI RTS par ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, kuriem nav veikta tīrvērtē") un kura ir kļuvusi par licencētu *ISDA SIMM* lietotāju – atsevišķi vai kā grupas daļa (t. i., EEZ vai ārpus EEZ).

Identifikācijas informācija

- Juridiskās personas nosaukums individuālā līmenī.
- Valsts, kurā struktūra ir reģistrēta.
- *LEI* kods.

⁵OV L 340, 15.12.2016., 9.–46. lpp.