

ROZPORZĄDZENIE DELEGOWANE KOMISJI (UE) NR 876/2013

z dnia 28 maja 2013 r.

uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych dotyczących kolegiów ds. kontrahentów centralnych

(Tekst mający znaczenie dla EOG)

KOMISJA EUROPEJSKA,

uwzględniając Traktat o funkcjonowaniu Unii Europejskiej,

uwzględniając rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 z dnia 4 lipca 2012 r. w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i repozytoriów transakcji ⁽¹⁾, w szczególności jego art. 18 ust. 6,

a także mając na uwadze, co następuje:

- (1) Aby zapewnić konsekwentne i spójne funkcjonowanie kolegiów w całej Unii, konieczne jest dokonanie ustaleń dotyczących uczestnictwa w kolegiach ds. CCP do celów ułatwienia wykonywania zadań określonych w rozporządzeniu (UE) nr 648/2012.
- (2) Wyłączenie banku centralnego emitującego odpowiednią walutę unijną będącą walutą instrumentów finansowych rozliczanych w CCP nie ma wpływu na prawa tego banku centralnego emitującego walutę do żądania i otrzymywania informacji zgodnie z art. 18 ust. 3 i art. 84 rozporządzenia (UE) nr 648/2012.
- (3) Działalność CCP może interesować dany bank centralny ze względu na wolumen transakcji rozliczanych w walucie emitowanej przez ten bank centralny. Przy określaniu znaczenia danej waluty, które uzasadniałoby uczestnictwo banku centralnego emitującego tę walutę w kolegium do spraw CCP, należy się jednak kierować wielkością udziału pozycji wyrażonych w tej walucie w średnich otwartych rozliczonych pozycjach CCP, tak aby utrzymać proporcjonalny skład kolegium.
- (4) Aby zapewnić skuteczność posiedzeń kolegium, organ właściwy dla CCP powinien wyraźnie określić, w porozumieniu z członkami kolegium, cele każdego posiedzenia lub działania kolegium. Cele te należy udostępniać uczestnikom posiedzeń z odpowiednim wyprzedzeniem, razem z dokumentacją przygotowaną przez organ właściwy dla CCP lub przez innych członków kolegium, aby stworzyć podstawę do owocnej dyskusji.
- (5) Funkcją kolegiów jest ułatwienie wykonywania zadań określonych w rozporządzeniu (UE) nr 648/2012, a zadania powierzone członkom kolegiów, a także skład kolegiów oraz sposób ich powoływania i zarządzania nimi zostały określone przez prawodawcę w rozporządzeniu jako obowiązki prawne i w związku z tym są wiążące oraz bezpośrednio stosowane we wszystkich państwach członkowskich. Aby kolegium mogło zacząć funkcjonować w praktyce, jego członkowie powinni zawrzeć umowę na piśmie. Aby zapewnić stosowanie w kolegiach CCP standardowych pisemnych umów, wdrożenie najlepszych praktyk dotyczących działalności kolegium i spójnych podejść w działaniach właściwych organów, a także aby ułatwić szybkie ustanawianie kolegiów CCP w terminie określonym w art. 18 ust. 1 rozporządzenia (UE) nr 648/2012, ESMA powinien wydawać wytyczne i zalecenia zgodnie z procedurą określoną w art. 16 rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 1095/2010 z dnia 24 listopada 2010 r. w sprawie ustanowienia Europejskiego Urzędu Nadzoru (Europejskiego Urzędu Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych) ⁽²⁾.
- (6) Żaden przepis niniejszego aktu nie powinien wpłynąć na prawo Komisji do wszczęcia postępowań w sprawie uchybienia zobowiązaniom państwa członkowskiego zgodnie z art. 258 TFUE, ani do działań przewidzianych w art. 265 i 271 lit. d) TFUE.
- (7) Aby zapewnić odpowiednio szybką wymianę aktualnych informacji pomiędzy członkami kolegium, posiedzenia kolegium powinny odbywać się regularnie i powinny dawać członkom możliwość omówienia przeglądu, dokonanego przez właściwy organ, dotyczącego uzgodnień, strategii, procesów i mechanizmów wdrożonych przez CCP w celu przestrzegania przepisów rozporządzenia (UE) nr 648/2012, a także wniesienia wkładu w ten przegląd oraz możliwość przedyskutowania dokonanej przez właściwy organ oceny ryzyka, na jakie dany CCP jest lub może być narażony, i którego może być źródłem.
- (8) Aby zapewnić należyte uwzględnienie wszystkich opinii członków kolegium, właściwy organ powinien dołożyć najlepszych starań w celu zapewnienia rozstrzygnięcia wszelkich ewentualnych sporów pomiędzy organami, które mają zostać członkami kolegium, przed ostatecznym zredagowaniem pisemnej umowy w sprawie powołania i funkcjonowania kolegium. W stosownych przypadkach ESMA powinien przyczynić się do ostatecznego zredagowania umowy w ramach swojej funkcji mediatorskiej.
- (9) Podstawę niniejszego rozporządzenia stanowi projekt regulacyjnych standardów technicznych przedłożony Komisji przez Europejski Urząd Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych (ESMA).

⁽¹⁾ Dz.U. L 201 z 27.7.2012, s. 1.⁽²⁾ Dz.U. L 331 z 15.12.2010, s. 84.

(10) Przed przedłożeniem projektu standardów technicznych stanowiącego podstawę niniejszego rozporządzenia ESMA odbył, w stosownych przypadkach, konsultacje z Europejskim Urzędem Nadzoru Bankowego (EUNB), Europejską Radą ds. Ryzyka Systemowego oraz członkami Europejskiego Systemu Banków Centralnych (ESBC). Zgodnie z art. 10 rozporządzenia (UE) nr 1095/2010 ESMA przeprowadził otwarte konsultacje społeczne poświęcone projektowi tych regulacyjnych standardów technicznych, przeanalizował potencjalne koszty i korzyści oraz wystąpił o ich zaopiniowanie do Grupy Interesariuszy z Sektora Giełd i Papierów Wartościowych ustanowionej zgodnie z art. 37 rozporządzenia (UE) nr 1095/2010,

PRZYJMUJE NINIEJSZE ROZPORZĄDZENIE:

Artykuł 1

Ustalenie walut o największym znaczeniu

1. Unijne waluty o największym znaczeniu ustala się na podstawie względnego udziału każdej waluty w średnich otwartych pozycjach CCP na koniec dnia z tytułu wszystkich instrumentów finansowych rozliczanych przez CCP, obliczanych przez okres jednego roku.
2. Unijne waluty o największym znaczeniu są to trzy waluty o najwyższym względnym udziale obliczonym zgodnie z ust. 1, pod warunkiem że każdy z tych udziałów osobno jest wyższy niż 10 %.
3. Względny udział walut oblicza się co roku.

Artykuł 2

Struktura operacyjna kolegiów

1. Po stwierdzeniu kompletności wniosku zgodnie z art. 17 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012 organ właściwy dla CCP przekazuje wstępny projekt umowy na piśmie, przewidzianej na mocy art. 18 ust. 5 rozporządzenia (UE) nr 648/2012, członkom kolegium określonym zgodnie z art. 18 ust. 2 rozporządzenia (UE) nr 648/2012. Umowa na piśmie przewiduje procedurę corocznego przeglądu. Określa ona także procedurę zmiany umowy, w ramach której z propozycją zmian może wystąpić w każdym czasie organ właściwy dla CCP lub pozostali członkowie kolegium, z zastrzeżeniem zatwierdzenia zmian przez kolegium zgodnie z procedurą określoną w niniejszym artykule.
2. Jeżeli członkowie kolegium, o których mowa w ust. 1, nie zgłoszą żadnych uwag w terminie 10 dni kalendarzowych, organ właściwy dla CCP przeprowadza procedurę przyjęcia umowy na piśmie przez kolegium i powołuje kolegium zgodnie z art. 18 ust. 1 rozporządzenia (UE) nr 648/2012.
3. W przypadku gdy członkowie kolegium mają uwagi dotyczące projektu umowy na piśmie przekazanego zgodnie z ust. 1, uwagi te przedkładają, wraz ze szczegółowymi wyjaśnieniami, organowi właściwemu dla CCP w terminie 10 dni kalendarzowych. Jeżeli ma to zastosowanie, organ właściwy dla CCP przygotowuje zmieniony projekt i zwołuje posiedzenie w celu

uzgodnienia ostatecznej umowy na piśmie, uwzględniając przy tym termin określony w art. 18 ust. 1 rozporządzenia (UE) nr 648/2012.

4. Kolegium uznaje się za powołane po przyjęciu umowy na piśmie.
5. Umowa na piśmie przyjęta zgodnie z ust. 1–3 niniejszego artykułu wiąże wszystkich członków kolegium.

Artykuł 3

Uczestnictwo w kolegiach

1. W przypadku gdy właściwy organ państwa członkowskiego, który nie jest członkiem kolegium, żąda dostarczenia informacji zgodnie z art. 18 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012, organ właściwy dla CCP, po zasięgnięciu opinii kolegium, podejmuje decyzję w sprawie najbardziej odpowiednich sposobów dostarczania informacji organom niebędącym członkami kolegium i występowania o informacje do tych organów.
2. Każdy członek kolegium wyznacza jednego uczestnika biorącego udział w posiedzeniach kolegium i może wyznaczyć jego jednego zastępcę, z wyjątkiem organu właściwego dla CCP, który może potrzebować dodatkowych uczestników, którym nie przysługują jednak prawo głosu.
3. W przypadku gdy istnieje więcej niż jeden bank centralny będący bankiem centralnym emitującym unijną walutę o największym znaczeniu, odpowiednie banki centralne wyznaczają wspólnego przedstawiciela, który będzie uczestnikiem kolegium.
4. Jeżeli organowi przysługuje prawo uczestnictwa w kolegium na mocy dwóch lub większej liczby liter art. 18 ust. 2 lit. c)–h) rozporządzenia (UE) nr 648/2012, organ ten może wyznaczyć dodatkowych uczestników, którym nie przysługują prawo głosu.
5. Jeżeli zgodnie z przepisami niniejszego artykułu istnieje dwóch lub większa liczba uczestników reprezentujących tego samego członka kolegium lub gdy liczba członków kolegium z tego samego państwa członkowskiego jest większa niż liczba głosów, które mogą być wykonywane przez tych członków kolegium zgodnie z art. 19 ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 648/2012, to taki członek kolegium lub tacy członkowie kolegium muszą poinformować kolegium, którzy uczestnicy wykonują prawa głosu.

Artykuł 4

Zarządzanie kolegiami

1. Organ właściwy dla CCP zapewnia, aby praca kolegium ułatwiała wykonywanie zadań, które mają być wykonywane zgodnie z rozporządzeniem (UE) nr 648/2012.
2. Kolegium zawiadamia ESMA o wszelkich zadaniach wykonywanych przez kolegium zgodnie z ust. 1. ESMA pełni funkcję koordynacyjną przy monitorowaniu zadań wykonywanych przez kolegium i zapewnia, w miarę możliwości, zgodność celów danego kolegium z celami pozostałych kolegiów.

3. Organ właściwy dla CCP zapewnia przynajmniej:
- wyraźne określenie celów każdego posiedzenia lub działania kolegium;
 - utrzymanie skuteczności posiedzeń lub działań kolegium, zapewniając jednocześnie, aby wszyscy członkowie kolegium byli wyczerpująco poinformowani o działaniach kolegium, którymi są zainteresowani;
 - określenie harmonogramu posiedzeń lub działań kolegium, tak aby wyniki tych posiedzeń lub działań wspomagały nadzór nad CCP;
 - dogłębne zrozumienie roli i funkcjonowania kolegium przez CCP i pozostałe najważniejsze zainteresowane strony;
 - regularne przeglądy działań kolegium oraz podejmowanie działań naprawczych w przypadku nieskutecznego funkcjonowania kolegium;
 - ustalenie z członkami kolegium, w razie potrzeby we współpracy z CCP, porządku obrad dorocznego posiedzenia poświęconego planowaniu zarządzania w sytuacji kryzysowej.
4. Aby zapewnić skuteczność i efektywność kolegium, organ właściwy dla CCP działa jako centralny punkt kontaktowy w związku ze wszystkimi kwestiami praktycznymi dotyczącymi funkcjonowania kolegium. Organ właściwy dla CCP wykonuje co najmniej następujące zadania:
- przygotowanie, aktualizacja i udostępnianie listy kontaktowej członków kolegium;
 - udostępnianie porządku obrad i dokumentów związanych z posiedzeniami lub działaniami kolegium;
 - sporządzanie protokołów posiedzeń i nadawanie formalnego charakteru zadaniom wyznaczonym podczas posiedzeń;
 - zarządzanie stroną internetową kolegium lub innym elektronicznym systemem udostępniania informacji, jeżeli taki istnieje;
 - w miarę możliwości wspieranie kolegium w wykonywaniu zadań poprzez dostarczanie informacji i udostępnianie wyspecjalizowanych zespołów, w zależności od przypadku;
 - rozpowszechnianie, w odpowiedni sposób, informacji wśród członków kolegium.

5. Częstotliwość posiedzeń kolegium jest ustalana przez organ właściwy dla CCP, z uwzględnieniem wielkości, charakteru, skali i złożoności CCP, jego wpływu systemowego na

państwa i waluty, potencjalnych skutków działań CCP, okoliczności zewnętrznych, a także biorąc pod uwagę ewentualne wnioski członków kolegium. Kolegium zbiera się co najmniej raz w roku, a jeżeli organ właściwy dla CCP uznaje to za konieczne – za każdym razem, gdy wymagane jest podjęcie decyzji na mocy rozporządzenia (UE) nr 648/2012. Organ właściwy dla CCP organizuje okresowo spotkania pomiędzy członkami kolegium a kierownictwem CCP wyższego szczebla.

6. Umowa na piśmie, o której mowa w art. 2, określa kworum wynoszące dwie trzecie liczby członków, które jest wymagane podczas posiedzeń kolegium.

7. Organ właściwy dla CCP dąży do zapewnienia na każdym posiedzeniu kolegium obowiązującego kworum wymaganego do podejmowania decyzji. W przypadku braku kworum przewodniczący zapewnia wstrzymanie wszelkich koniecznych decyzji do czasu zebrania kworum, uwzględniając przy tym odpowiednie terminy określone rozporządzeniem (UE) nr 648/2012.

Artykuł 5

Wymiana informacji pomiędzy organami

1. Każdy członek kolegium dostarcza organowi właściwemu dla CCP, w odpowiednich terminach, wszystkie informacje konieczne do działalności operacyjnej kolegium i do realizacji najważniejszych działań, w których uczestniczą członkowie. Organ właściwy dla CCP dostarcza członkom kolegium podobne informacje w odpowiednich terminach.

2. Organ właściwy dla CCP dostarcza kolegium przynajmniej następujące informacje:

- istotne zmiany struktury organizacyjnej i własnościowej grupy CCP;
- istotne zmiany poziomu kapitału CCP;
- zmiany dotyczące organizacji, kierownictwa wyższego szczebla, procesów lub ustaleń, jeżeli mają one istotny wpływ na zarządzanie CCP lub zarządzanie ryzykiem;
- wykaz członków rozliczających CCP;
- informacje o organach uczestniczących w nadzorze nad CCP, w tym o wszelkich zmianach ich obowiązków;
- informacje o wszelkich istotnych zagrożeniach mogących mieć wpływ na zdolność CCP do przestrzegania rozporządzenia (UE) nr 648/2012 i odpowiednich rozporządzeń delegowanych i wykonawczych;

- g) problemy wiążące się z potencjalnie znaczącymi efektami zewnętrznymi;
 - h) czynniki sugerujące potencjalnie wysokie ryzyko wystąpienia efektu domina;
 - i) istotne zmiany kondycji finansowej CCP;
 - j) wczesne ostrzeżenia dotyczące możliwości wystąpienia kłopotów płynnościowych lub poważnych oszustw;
 - k) przypadki niewykonania zobowiązania przez członka i ewentualne działania następcze;
 - l) sankcje i nadzwyczajne środki nadzorcze;
 - m) sprawozdania dotyczące problemów dotyczących działalności CCP lub zaistniałych incydentów i podjętych działań naprawczych;
 - n) regularne dane dotyczące działalności CCP, których zakres i częstotliwość jest uzgadniana w ramach umowy na piśmie, o której mowa w art. 2;
 - o) opis najważniejszych ofert handlowych, w tym planowanych ofert nowych produktów lub usług;
 - p) zmiany modelu ryzyka, testów warunków skrajnych i weryfikacji historycznej stosowanych przez CCP;
 - q) zmiany uzgodnień interoperacyjnych CCP, w stosownych przypadkach.
3. Wymiana informacji pomiędzy członkami kolegium jest odpowiednia w świetle ich obowiązków i potrzeb informacyjnych. Aby zapobiec zbędnym przepływom informacji, wymiana informacji powinna mieć charakter proporcjonalny i skupiać się na ryzykach.
4. Członkowie kolegium rozważają najbardziej efektywne metody przekazywania informacji w celu zapewnienia stałej, terminowej i proporcjonalnej wymiany informacji.

5. Sprawozdanie z oceny ryzyka, które organ właściwy dla CCP ma obowiązek przygotować zgodnie z art. 19 ust. 1 rozporządzenia (UE) nr 648/2012, jest przedkładane kolegium w odpowiednim terminie, tak aby zapewnić członkom kolegium możliwość zapoznania się z tym sprawozdaniem i, w razie konieczności, zgłoszenia do niego uwag.

Artykuł 6

Dobrowolne dzielenie się zadaniami i ich delegowanie

1. Członkowie kolegium uzgadniają szczegółowe warunki ewentualnych szczególnych porozumień w sprawie delegowania zadań i porozumień w sprawie dobrowolnego powierzenia zadań innym członkom, w szczególności w przypadku, gdy takie delegowanie prowadzi do przekazania podstawowych zadań nadzorczych członka.
2. Strony szczególnych porozumień w sprawie delegowania zadań i porozumień w sprawie dobrowolnego powierzenia zadań uzgadniają szczegółowe warunki, które obejmują przynajmniej następujące kwestie:
 - a) konkretne zadania w wyraźnie określonych obszarach, które zostaną powierzone lub delegowane;
 - b) procedury i procesy, które mają być stosowane;
 - c) rolę i obowiązki każdej strony;
 - d) rodzaj informacji, które mają być wymieniane pomiędzy stronami.
3. Celem dzielenia się zadaniami i ich delegowania nie może być doprowadzenie do zmiany zakresu przyznaných uprawnień decyzyjnych przysługujących organowi właściwemu dla CCP.

Artykuł 7

Wejście w życie

Niniejsze rozporządzenie wchodzi w życie dwudziestego dnia po jego opublikowaniu w *Dzienniku Urzędowym Unii Europejskiej*.

Niniejsze rozporządzenie wiąże w całości i jest bezpośrednio stosowane we wszystkich państwach członkowskich.

Sporządzono w Brukseli dnia 28 maja 2013 r.

W imieniu Komisji
José Manuel BARROSO
Przewodniczący