

Pamatnostādnes

Par *CCP* atvaseļošanas plāna rādītājiem (*CCPRRR* 9. panta 5. punkts)

Satura rādītājs

I.	Piemērošanas joma	3
II.	Normatīvās atsauces, saīsinājumi un definīcijas	4
III.	Nolūks	6
IV.	Atbilstība un ziņošanas pienākumi	7
V.	Pamatnostādnes par <i>CCP</i> atvaseļošanas plāna rādītājiem.....	8
	1. pamatnostādne. <i>CCP</i> atvaseļošanas plāna rādītāju neautomātisks raksturs.....	8
	2. pamatnostādne. <i>CCP</i> atvaseļošanas plāna rādītāju kategorijas.....	8
	3. pamatnostādne. <i>CCP</i> atvaseļošanas plāna rādītāju izveide	9
	4. pamatnostādne. <i>CCP</i> atvaseļošanas plāna rādītāju integrācija <i>CCP</i> uzraudzības sistēmā	11
	5. pamatnostādne. <i>CCP</i> atvaseļošanas plāna rādītāju uzturēšana	11
VI.	Pielikumi	12

I. Piemērošanas joma

Kam?

1. Šīs pamatnostādnes piemēro kompetentajām iestādēm, kā definēts *CCPRRR* 2. panta 7. punktā, un *CCP*, kas saņēmuši atļauju saskaņā ar ETIR 14. pantu.

Par ko?

2. Šīs pamatnostādnes piemēro saistībā ar *CCPRRR* 9. panta 5. punktu, kas pilnvaro EVTI precizēt *CCPRRR* 9. panta 3. punktā minēto kvalitatīvo un kvantitatīvo rādītāju minimālo sarakstu, kas jāiekļauj *CCP* atvaseļošanas plānos. Šīs pamatnostādnes piemēro arī saistībā ar *CCPRRR* 9. panta 4. punktu, jo tās sniedz norādījumus par *CCP* atvaseļošanas plāna rādītāju integrēšanu *CCP* uzraudzības sistēmā.
3. Šīs pamatnostādnes būtu jālasa saistībā ar EVTI pamatnostādnēm par *CCP* atvaseļošanas plāna scenārijiem (ESMA ESMA91–372–1701).

Kad?

4. Šīs pamatnostādnes piemēro divus mēnešus pēc to publicēšanas dienas EVTI tīmekļa vietnē Eiropas Savienības oficiālajās valodās.

II. Normatīvās atsauces, saīsinājumi un definīcijas

Normatīvās atsauces

CCPRRR	Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) 2021/23 (2020. gada 16. decembris) par centrālo darījumu partneru atvēršanos un neregulējuma režīmu un ar ko groza Regulas (ES) Nr. 1095/2010, (ES) Nr. 648/2012, (ES) Nr. 600/2014, (ES) Nr. 806/2014 un (ES) 2015/2365 un Direktīvas 2002/47/EK, 2004/25/EK, 2007/36/EK, 2014/59/ES un (ES) 2017/1132 ¹
Deleģētā regula 152/2013	Komisijas Deleģētā regula (ES) Nr. 152/2013 (2012. gada 19. decembris) par kapitāla prasībām centrālajiem darījumu partneriem ²
Deleģētā regula 153/2013	Komisijas Deleģētā regula (ES) Nr. 153/2013 (2012. gada 19. decembris) par prasībām centrālajiem darījumu partneriem ³
ETIR	Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) 648/2012 (2012. gada 4. jūlijs) par ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, centrālajiem darījumu partneriem un darījumu reģistriem ⁴
EVTI Regula	Eiropas Parlamenta un Padomes 2010. gada 24. novembra Regula (ES) Nr. 1095/2010, ar ko izveido Eiropas Uzraudzības iestādi (Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestādi), groza Lēmumu Nr. 716/2009/EK un atceļ Komisijas Lēmumu 2009/77/EK ⁵

¹ OV L 22, 22.1.2021., 1.–102. lpp.

² OV L 52, 23.2.2013., 37. lpp.

³ OV L 52, 23.2.2013., 41. lpp.

⁴ OV L 201, 27.7.2012., 1. lpp.

⁵ OV L 331, 15.12.2010., 84. lpp.

Saīsinājumi

<i>BAU</i>	Parastā uzņēmējdarbība
<i>CCP</i>	Centrālais darījumu partneris
<i>EEZ</i>	Eiropas Ekonomikas zona
<i>EFUS</i>	Eiropas Finanšu uzraudzības sistēma
<i>EK</i>	Eiropas Komisija
<i>ES</i>	Eiropas Savienība
<i>ESRK</i>	Eiropas Sistēmisko risku kolēģija
<i>EVTI</i>	Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestāde
<i>FTI</i>	Finanšu tirgus infrastruktūra

Definīcijas

5. Ja vien nav norādīts citādi, šajās pamatnostādnēs izmantotajiem terminiem ir tāda pati nozīme kā *CCPRRR*, *ETIR* un Deleģētajās regulās 152/2013 un 153/2013.

III. Nolūks

6. Šo pamatnostādņu pamatā ir *CCPRRR* 9. panta 5. punkts, un tās ir izdotas saskaņā ar EVTI regulas 16. pantu. Šo pamatnostādņu mērķis ir izveidot konsekventu, efektīvu un konstruktīvu uzraudzības praksi EFUS ietvaros un nodrošināt *CCPRRR* 9. panta 3. punkta vienotu, viendabīgu un konsekventu piemērošanu. Jo īpaši to mērķis ir noteikt minimālo kvalitatīvo un kvantitatīvo rādītāju sarakstu, kas jāiekļauj *CCP* atveseļošanas plānos. Šādus rādītājus kompetentās iestādes novērtē atveseļošanas plānu novērtējuma ietvaros, kā noteikts *CCPRRR* 10. pantā un saskaņā ar to.
7. Atveseļošanas plāna rādītāju kopuma sagatavošanas mērķis ir noteikt izraisītājnotikumu kopumu, kas katram *CCP* būtu jāizmanto, lai noteiktu punktus, kuros tam jāpieņem lēmums par to, vai rīkoties saskaņā ar savu atveseļošanas plānu, un lai noteiktu, kādas konkrētas darbības vai pasākumus, kas ietverti atveseļošanas plānā, var veikt saskaņā ar *CCPRRR* izklāstītajiem nosacījumiem un prasībām.
8. Turklāt saskaņā ar EVTI regulas 16. panta 1. punktu EVTI var izdot pamatnostādnes, lai izveidotu konsekventu, efektīvu un konstruktīvu uzraudzības praksi EFUS ietvaros un nodrošinātu vienotu, vienveidīgu un konsekventu Savienības tiesību aktu piemērošanu. Šo pamatnostādņu darbības joma ir paplašināta ārpus *CCPRRR* 9. panta 5. punktā noteiktās darbības jomas, ieviešot 4. pamatnostādni, kas attiecas uz *CCP* atveseļošanas plāna rādītāju integrēšanu *CCP* uzraudzības sistēmā. Šo norādījumu mērķis ir nodrošināt visu attiecīgo riska veidu un avotu uzraudzību un to integrāciju uzraudzības sistēmā, jo tie ir nepieciešami pasākumi, lai nodrošinātu, ka atveseļošanas plāna rādītāji kopumā ir efektīvi.

IV. Atbilstība un ziņošanas pienākumi

Pamatnostādņu statuss

9. Saskaņā ar EVTI regulas 16. panta 3. punktu kompetentajām iestādēm un *CCP* jādarā viss iespējamais, lai nodrošinātu šo pamatnostādņu ievērošanu.
10. Kompetentajām iestādēm, uz kurām attiecas šīs pamatnostādnes, tās būtu jāievēro, vajadzības gadījumā iekļaujot tās savās valsts tiesiskajās un/vai uzraudzības sistēmās, tostarp gadījumos, kad konkrētas pamatnostādnes galvenokārt ir vērstas uz *CCP*. Šādā gadījumā kompetentajām iestādēm ar savu uzraudzību būtu jānodrošina, ka *CCP* ievēro pamatnostādnes.

Ziņošanas prasības

11. Divu mēnešu laikā no dienas, kad pamatnostādnes ir publicētas EVTI tīmekļa vietnē visās ES oficiālajās valodās, kompetentajām iestādēm, uz kurām attiecas šīs pamatnostādnes, ir jāpaziņo EVTI par to, vai tās i) ievēro, ii) neievēro, bet plāno ievērot vai iii) neievēro un neplāno ievērot pamatnostādnes.
12. Neievērošanas gadījumā kompetentajām iestādēm divu mēnešu laikā no dienas, kad pamatnostādnes publicētas EVTI tīmekļa vietnē visās ES oficiālajās valodās, ir jāinformē EVTI arī par pamatnostādņu neievērošanas iemesliem.
13. Paziņojumu veidne ir pieejama EVTI tīmekļa vietnē. Kad veidne ir aizpildīta, to nosūta EVTI.
14. *CCP*, uz kuriem attiecas šīs pamatnostādnes, skaidrā un detalizētā veidā ziņo savām kompetentajām iestādēm par to, vai tie ievēro šīs pamatnostādnes.

V. Pamatnostādnes par CCP atvaseļošanas plāna rādītājiem

1. pamatnostādne. CCP atvaseļošanas plāna rādītāju neautomātisks raksturs

15. CCP atvaseļošanas plāna rādītāja iestatīšanai vajadzētu būt notikumam, kam jāpievērš uzmanība augstākajai vadībai vai CCP valdei, lai tās, izskatot katru gadījumu atsevišķi, sāktu apsvērt un izlemtu, vai rīkoties saskaņā ar CCP atvaseļošanas plānu, un noteiktu, kādus konkrētus atvaseļošanas pasākumus var veikt saskaņā ar CCPRRR izklāstītajiem nosacījumiem un prasībām. Tāpēc CCP atvaseļošanas plāna rādītāja iestatīšana nebūtu jāsaprot kā notikums, kas izraisa automātisku reakciju.

2. pamatnostādne. CCP atvaseļošanas plāna rādītāju kategorijas

16. CCP atvaseļošanas plānā būtu jāiekļauj šādas rādītāju kategorijas:

CCP atvaseļošanas plāna rādītāji, kuru pamatā ir to stāvoklis atvaseļošanas plānā un CCP finansiālās vai darbības situācijas pasliktināšanās pakāpe:

- a) a) kategorija (“Rādītāji, kas nodrošina agrīnu brīdināšanu par atvaseļošanas darbībām”):
- (i) Šie rādītāji liecina par būtisku varbūtību, ka būs nepieciešams izmantot atvaseļošanas pasākumus, lai attaisnotu CCP atvaseļošanas plāna aktivizēšanai nepieciešamā pārvaldības procesa uzsākšanu (citiem vārdiem sakot, riska līmenis ir pietiekami augsts, lai atvaseļošanas plāna aktivizēšana būtu ticama, lai gan joprojām ir neskaidra).
- (ii) CCP šie rādītāji būtu jākalibrē un jānosaka atbilstošā līmenī, lai tie:
- atspoguļotu CCP īpašības un īpatnības attiecībā uz tā riska profilu (tostarp sarežģītības līmeni, struktūru utt.);
 - pēc iestatīšanas nodrošinātu pietiekami daudz laika, lai CCP varētu sākt pārvaldības procesu, paziņot par to augstākajai vadībai vai CCP valdei, veikt situācijas novērtējumu un pirms atvaseļošanas pasākumu piemērošanas pietiekami savlaicīgi informēt kompetento iestādi;
 - norādītu uz pietiekamu varbūtību, ka būs jāpiemēro atvaseļošanas pasākumi, lai tie nepārklātos ar agrīnās brīdināšanas rādītājiem, ko izmanto parastā uzņēmējdarbības riska pārvaldībai; un
 - nepārklātos ar b) kategorijas rādītājiem (“rādītāji, kas signalizē par pāreju no parastās uzņēmējdarbības riska pārvaldības uz atvaseļošanas posmu”).
- b) b) kategorija (“rādītāji, kas signalizē par pāreju no parastās uzņēmējdarbības riska pārvaldības uz atvaseļošanās posmu”):

- (i) Šie rādītāji liecina par pāreju no parastās uzņēmējdarbības riska pārvaldības posma uz atveseļošanas posmu nenovēršamas nepieciešamības izmantot atveseļošanas pasākumus dēļ (citiem vārdiem sakot, īstenotā ietekme pārsniedz parastās uzņēmējdarbības riska pārvaldības resursus un spējas, un ir vajadzīgi atveseļošanas pasākumi).
- (ii) CCP šie rādītāji būtu jākalibrē un jānosaka atbilstošā līmenī, lai tie:
 - o atspoguļotu CCP īpašības un īpatnības attiecībā uz tā riska profilu (tostarp sarežģītības pakāpi, struktūru utt.);
 - o skaidri noteiktu laiku, situāciju vai marķieri, kas rada nepieciešamību izmantot atveseļošanas pasākumus; un
 - o nepārklātos ar a) kategorijas rādītājiem (“rādītāji, kas nodrošina agrīnu brīdināšanu par atveseļošanas darbībām”).

CCP atveseļošanas plāna rādītāji, kas saistīti ar atveseļošanas pasākumiem:

- c) c) kategorija (“rādītāji, kas signalizē par īpašu atveseļošanas pasākumu izmantošanu”):
 - (i) Ja CCP aktivizē savu atveseļošanas plānu, šie rādītāji sniedz informāciju par konkrētiem apstākļiem vai robežvērtībām, kas izraisītu konkrēta atveseļošanas pasākuma izmantošanu, ja vienam atveseļošanas plāna scenārijam ir piešķirti vairāki pasākumi. Citiem vārdiem sakot, konkrēts atveseļošanas pasākums ir saistīts ar īpašu apstākļu vai seku esību un rādītājs norāda, ka šie apstākļi rodas.
 - (ii) Šiem rādītājiem būtu jāvirza lēmumu pieņemšanas process un jāpalīdz CCP izvēlēties konkrētajai situācijai vai apstākļiem piemērotu atveseļošanas pasākumu.
 - (iii) Tomēr tajā pašā laikā, kā jau paskaidrots 1. pamatnostādnē, CCP saglabā elastību izmantot jebkuru pasākumu, ko CCP galu galā nosaka kā attiecīgajai situācijai vispiemērotāko pasākumu saskaņā ar CCPRRR izklāstītajiem nosacījumiem un prasībām. Citiem vārdiem sakot, nav obligāti sagaidāms, ka CCP izmantos konkrēto atveseļošanas pasākumu, par ko liecina rādītājs.

3. pamatnostādne. CCP atveseļošanas plāna rādītāju izveide

17. CCP būtu jāsaista katrs no tā atveseļošanas plāna scenārijiem vismaz ar:

- a) Vienu a) kategorijas rādītāju (rādītājs, kas nodrošina agrīnu brīdināšanu par atveseļošanas darbībām);

- b) Vienu b) kategorijas rādītāju (rādītājs, kas norāda uz pāreju no ierastās riska pārvaldības uz atveseļošanas posmu).
18. Ja *CCP* apvieno divu veidu scenārijus vienā faktiskā scenārijā (saskaņā ar Pamatnostādnēm par *CCP* atveseļošanas plāna scenārijiem — ESMA91–372–1701), *CCP* būtu jāsaista šāds scenārijs ar vismaz diviem a) kategorijas rādītājiem (viens rādītājs katram scenārija veidam, ko izmanto apvienotajā scenārijā) un diviem b) kategorijas rādītājiem (viens rādītājs katram scenārija veidam, ko izmanto apvienotajā scenārijā).
19. *CCP* katram atveseļošanas plāna scenārijam būtu jāizveido a) un b) kategorijas rādītāji, izmantojot pielikuma 1. tabulā doto matricu. Lai novērstu šaubas, *CCP* būtu jāizveido šie rādītāji katram tā atveseļošanas plānā iekļautajam faktiskajam atveseļošanas plāna scenārijam (t. i., scenārijiem, kas izstrādāti katram no septiņiem scenāriju veidiem un jebkādiem papildu scenārijiem, kā arī jebkādiem turpmākiem scenārijiem, ko *CCP* izstrādājis saskaņā ar Pamatnostādnēm par *CCP* atveseļošanas plāna scenārijiem — ESMA91–372–1701).
20. Attiecībā uz a) kategorijas rādītājiem *CCP* var izveidot savus rādītājus šai kategorijai (t. i., rādītājus, kas nav norādīti pielikuma 1. tabulā) katram atveseļošanas plāna scenārijam, ja *CCP* uzskata, ka pielikuma 1. tabulā ierosinātie rādītāji nav piemēroti. Šādā gadījumā *CCP* būtu jāsniedz pamatojums savai kompetentajai iestādei.
21. *CCP* būtu jākalibrē un jākvantificē (piemēram, nosakot robežvērtības) a) un b) kategorijas rādītāji, ja iespējams, pamatojoties uz *CCP* iezīmēm un īpatnībām attiecībā uz tā riska profilu (tostarp sarežģītības pakāpi, struktūru utt.), saskaņā ar 2. pamatnostādni.
22. Lai izveidotu c) kategorijas rādītājus (rādītājus, kas norāda uz konkrētu atveseļošanas pasākumu izmantošanu), *CCP* būtu jāizmanto jebkura no šādām iespējām:
- a) definēt situāciju vai marķieri, kas norādītu uz konkrētā atveseļošanas pasākuma izmantošanu;
 - b) norādīt galvenos faktoros vai apstākļus, kas tiks izvērtēti, un virzīs lēmumu pieņemšanas procesu attiecībā uz atveseļošanas pasākumu izmantošanu;
 - c) nodrošināt plūsmkarti vai līdzīgu rīku, kurā aprakstīti atveseļošanas pasākumu izmantošanas kritēriji un lēmumu pieņemšanas process;
 - d) norādīt, ka atveseļošanas plāna pasākums ir daļa no sakārtotas secības (piemēram, *CCP* var izveidot diagrammu, kurā norādīta (pieņemtā) konkrētu atveseļošanas pasākumu secība, kas tiktu izmantota, lai neitralizētu katru atveseļošanas plāna scenāriju).
23. *CCP* būtu jāsniedz savai kompetentajai iestādei skaidrojums par to, kā tika noteikta rādītāju kalibrēšana, un analīze, kas pierāda, ka a) kategorijas rādītāji tiktu iedarbināti pietiekami savlaicīgi, lai tie būtu efektīvi.

4. pamatnostādne. CCP atveseļošanas plāna rādītāju integrācija CCP uzraudzības sistēmā

24. Lai atveseļošanas plāna rādītājus integrētu CCP uzraudzības sistēmā, CCP būtu:

- a) jāuzrauga visi “attiecīgie riska veidi un avoti” (kā noteikts Pamatnostādnēs par CCP atveseļošanas plāna scenārijiem — ESMA91–372–1701);
- b) jāuzrauga likviditāte un aktīvo tirgus dalībnieku skaits attiecībā uz darbībām, kurām tie veic tīrvērti, un aktīviem, kurus tie tur kā nodrošinājumu vai ieguldījumus;
- c) jāuzrauga jebkādas CCP un FTI incidentu skaita un smaguma tendences, kurām CCP ir pakļauti;
- d) jāuztur un jāuzrauga to struktūrvienību saraksts, kuras var būt būtiska riska avoti, tostarp:
 - (i) dalībnieki, kas ir galvenie CCP riska veicinātāji (piemēram, izmantojot fondu saistību neizpildes gadījumiem);
 - (ii) sadarbspējīgi CCP;
 - (iii) struktūrvienības, pakalpojumu sniedzēji vai finanšu tirgus infrastruktūras, kas finansiālu vai operacionālu grūtību gadījumā var radīt būtisku likviditātes risku;
 - (iv) dalībnieki, kas var būt būtisks vienlaicīgas ar saistību neizpildi saistītu un ar saistību neizpildi nesaistītu zaudējumu avots.

5. pamatnostādne. CCP atveseļošanas plāna rādītāju uzturēšana

25. CCP būtu jāpārskata un vajadzības gadījumā jāatjaunina savi atveseļošanas plāna rādītāji, ievērojot 1.–4. pamatnostādnes, ikreiz, kad CCP pārskata savu atveseļošanas plānu saskaņā ar CCPRRR 9. panta 9. punktu.

VI. Pielikumi

1. tabula. Matrica atvaseļošanas plāna rādītāju izveidei

Atvaseļošanas plāna scenāriju veidi	a) kategorijas rādītāji (<i>“Rādītāji, kas sniedz agrīnus brīdinājumus par atvaseļošanas darbībām”</i>)	b) kategorijas rādītāji (<i>“Rādītāji, kas signalizē par pāreju no parastās uzņēmējdarbības riska pārvaldības uz atvaseļošanas posmu”</i>)
1.a Saistību neizpildes gadījums, kas rada finansiālus zaudējumus, kuri palielinās CCP saistību neizpildes gadījumā, atgriežoties savietotā portfelī, izmantojot brīvprātīgus, uz tirgu balstītus instrumentus	<p>Viena vai vairāku dalībnieku saistību neizpilde, kuru kopējā ietekme varētu patērēt ievērojamu daļu no CCP saistību neizpildes fonda.</p> <p>Saistību neizpildes pārvaldības procesa sākums ar portfeli(-ļiem), kura(-u) tirgus zaudējumi pārsniedz [saistību nepildošā(-o) dalībnieka(-u) maržas + “Skin” spēlē + ievērojama summa no kopējā saistību neizpildes fonda apjoma].</p> <p>Liela saistību neizpildes varbūtība vienam vai vairākiem dalībniekiem, kuru kopējā ietekme varētu patērēt ievērojamu daļu no CCP saistību neizpildes fonda. Par saistību neizpildes varbūtību liecina tirgus rādītāji.</p>	<p>Noteiktie vai prognozētie saistību neizpildes dēļ izraisītie zaudējumi, kas patērētu visus saistību neizpildes fonda priekšfinansētos resursus.</p>
1.b Sadarbspējīga CCP saistību neizpildes gadījums, kas rada finansiālus zaudējumus, kuri palielinās CCP saistību “ūdenskritumā”	<p>Sadarbspējīga CCP saistību neizpilde saspringtos tirgus apstākļos, ja šāda veida struktūrvienība ir viens no lielākajiem CCP riska darījumiem.</p>	<p>Noteiktie vai prognozētie saistību nepildīšanas zaudējumi, kas patērētu visus attiecīgos priekšfinansētos resursus, kuri ir</p>

Atvaseļošanas plāna scenāriju veidi	a) kategorijas rādītāji (“Rādītāji, kas sniedz agrīnus brīdinājumus par atvaseļošanas darbībām”)	b) kategorijas rādītāji (“Rādītāji, kas signalizē par pāreju no parastās uzņēmējdarbības riska pārvaldības uz atvaseļošanas posmu”)
	<p>Liela varbūtība, ka sadarbspējīgs CCP nepilda saistības saspringtos tirgus apstākļos, ja šāda veida struktūrvienība ir viens no lielākajiem CCP riska darījumiem.</p> <p>Dalībnieka un sadarbspējīga CCP kombinēta saistību neizpilde, kuras kopējā ietekme radītu ievērojamas grūtības CCP finansējumam.</p> <p>Liela varbūtība, ka dalībnieks un sadarbspējīgs CCP nepildīs saistības, kuru kopējā ietekme radītu būtisku izaicinājumu CCP finansējumam.</p>	<p>pieejami, lai segtu sadarbspējīga CCP saistību neizpildi.</p>
<p>2. Saistību neizpildes gadījums, kas rada finansiālus zaudējumus saistību neizpildes pārvaldības procesā, kura dēļ ir jāizmanto obligāta, uz noteikumiem balstīta kārtība (kā noteikts CCP atvaseļošanas plānā), lai atjaunotu savietotu portfeli</p>	<p>Iespējama nespēja veiksmīgi atjaunot savietotu portfeli, izmantojot brīvprātīgus, uz tirgu balstītus instrumentus, agrīna noteikšana izolētā portfeļa īpašību, tirgus apstākļu vai operacionālo faktoru dēļ.</p>	<p>CCP nespēj atjaunot savietoto portfeli bez atvaseļošanas pasākumiem.</p>
<p>3. Notikums, kas nav saistīts ar saistību neizpildi un liedz CCP veikt tā būtiski svarīgās funkcijas</p>	<p>Uzņēmējdarbības nepārtrauktību ietekmējošs notikums vai operacionālu incidentu uzkrāšanās, vai CCP sistēmu vai pakalpojumu veiktspējas pasliktināšanās tendence no trešās</p>	<p>Trešā persona, kas sniedz būtiski svarīgus pakalpojumus CCP, nespēj</p>

Atvесеlоšanas plāna scenāriju veidi	a) kategorijas rādītāji (“Rādītāji, kas sniedz agrīnus brīdinājumus par atvесеlоšanas darbībām”)	b) kategorijas rādītāji (“Rādītāji, kas signalizē par pāreju no parastās uzņēmējdarbības riska pārvaldības uz atvесеlоšanas posmu”)
	<p>personas puses, kas sniedz būtiski svarīgus pakalpojumus CCP, vai pieaugoša kiberapdraudējuma uztvere.</p> <p>CCP uzzina par dažu saistītu pakalpojumu iespējamo pārtraukšanu.</p> <p>Iespējamās izmaiņas tiesiskajā regulējumā, kas būtiski apgrūtinātu CCP pakalpojumu sniegšanu.</p>	<p>vai nevēlas sniegt savu pakalpojumu.</p> <p>Nespēja turpināt CCP sistēmas darbību neatkarīgi no incidenta izcelsmes.</p> <p>Jaunas tiesību normas (piemēram, tiesību akti vai tiesas nolēmums) ietekmē CCP spēju veikt tā būtiski svarīgās funkcijas.</p>
4. Notikums, kas nav saistīts ar saistību neizpildi un kas rada finansiālus zaudējumus	<p>Trešās personas struktūrvienības pieļauta kļūme, kas var radīt būtiskus tiešus vai netiešus finansiālus zaudējumus.</p> <p>Liela varbūtība, ka trešās puses struktūrvienība pieļaus kļūmi, kas var radīt būtiskus tiešus vai netiešus finansiālus zaudējumus.</p> <p>Juridisks risks ar lielu īstenošanās varbūtību un iespējamību radīt būtisku ietekmi uz CCP resursiem.</p> <p>Krāpšana, kiberuzbrukums vai operacionāls notikums, kas var radīt būtiskus finansiālus zaudējumus.</p>	<p>Noteiktie vai prognozētie zaudējumi, kas patērētu visus attiecīgos kapitāla resursus.</p>

Atvaseļošanas plāna scenāriju veidi	a) kategorijas rādītāji (“Rādītāji, kas sniedz agrīnus brīdinājumus par atvaseļošanas darbībām”)	b) kategorijas rādītāji (“Rādītāji, kas signalizē par pāreju no parastās uzņēmējdarbības riska pārvaldības uz atvaseļošanas posmu”)
	Ieguldījumu zaudējumi, kas var radīt būtisku finansiālu ietekmi.	
5. Saistību neizpildes gadījums, kas izraisa likviditātes deficītu	<p>Viena vai vairāku dalībnieku nonākšana grūtībās, kuru kopējā ietekme būtiski apgrūtinātu CCP likviditātes stāvokli.</p> <p>Liela varbūtība, ka viens vai vairāki dalībnieki nonāks grūtībās un kuru kopējā ietekme radītu ievērojamas grūtības CCP likviditātes stāvoklim. Par saistību neizpildes varbūtību liecina tirgus rādītāji.</p> <p>Iekšējo likviditātes rādītāju pazemināšanās, kas signalizē par likviditātes pozīciju, kura ir zemāka par CCP noteikto minimālo sliekšni.</p>	<p>Noteiktais vai prognozētais likviditātes deficīts, kas iztukšotu visu parastā uzņēmējdarbībā īstenoto likviditātes veidošanas jaudu, kā to definējis CCP.</p>
6. Notikums, kas nav saistīts ar saistību neizpildi un kas izraisa likviditātes deficītu	<p>Iekšējo likviditātes rādītāju pazemināšanās, kas signalizē par likviditātes pozīciju, kura ir zemāka par CCP noteikto minimālo sliekšni.</p> <p>Likviditātes pakalpojuma zaudējumi/izslēgšana (līguma izbeigšana, darījumu partneris, kas noraida CCP, darījumu partneris, kas izstājas no šā pakalpojuma tirgus utt.), kas ir būtisks CCP likviditātes pozīcijai.</p>	<p>Noteiktais vai prognozētais likviditātes deficīts, kas iztukšotu visu parastā uzņēmējdarbībā īstenoto likviditātes veidošanas jaudu, kā to definējis CCP.</p>

Atvaseļošanas plāna scenāriju veidi	a) kategorijas rādītāji (<i>“Rādītāji, kas sniedz agrīnus brīdinājumus par atvaseļošanas darbībām”</i>)	b) kategorijas rādītāji (<i>“Rādītāji, kas signalizē par pāreju no parastās uzņēmējdarbības riska pārvaldības uz atvaseļošanas posmu”</i>)
	Trešās personas, finanšu tirgus infrastruktūras vai pakalpojumu sniedzēja darbības vai finansiālas grūtības, kas var būtiski ietekmēt CCP likviditātes pozīciju.	
7. Notikums(-i), kas izraisa vienlaicīgus ar saistību neizpildi saistītus un nesaistītus zaudējumus	<p>Tādas struktūrvienības bankrots, kas identificēta kā iespējams vienlaicīgu ar saistību neizpildi saistītu un nesaistītu zaudējumu avots.</p> <p>Liela varbūtība, ka uzņēmums varētu bankrotēt, kas ir identificēts kā iespējams vienlaicīgu ar saistību neizpildi saistītu un nesaistītu zaudējumu avots.</p>	<p>Vienas vai vairāku tādu struktūrvienību bankrots, kuru kopējā ietekme rada gan ar saistību neizpildi saistītus, gan nesaistītus zaudējumus, izraisot kādu no iepriekš minētās b) kategorijas rādītājiem (<i>rādītāji, kas norāda uz pāreju no parastā uzņēmējdarbībā īstenotās riska pārvaldības uz atvaseļošanas posmu</i>) attiecībā uz zaudējumiem, kas saistīti ar saistību neizpildi, kas nav saistīti ar saistību neizpildi, vai ir saistīti ar likviditātes nepietiekamību.</p>