



European Securities and
Markets Authority

Gairės

**dėl bendrųjų priežiūros peržiūros ir PSS vertinimo proceso pagal ERIR 21
straipsnį procedūrų ir metodikos**



Turinys

1. Taikymo sritis	3
2. Nuorodos į teisės aktus, santrumpos ir sąvokų apibrėžtys	4
3. Paskirtis.....	5
4. Atitikties ir ataskaitų teikimo įpareigojimai	6
5. Gairės dėl bendrųjų priežiūros peržiūros ir PSŠ vertinimo proceso pagal ERIR 21 straipsnį procedūrų ir metodikos.....	7
5.1 Peržiūros ir vertinimo taikymo sritis.....	7
5.2 Peržiūros ir vertinimo forma ir išsamumas.....	7
5.3 Peržiūros ir vertinimo dažnumas	8
5.4 Informacija: šaltiniai ir metodika	8
5.5 Priežiūros peržiūros rezultatai. Metodika	9
I priedas. PSŠ reikalavimų sąrašas, įskaitant su jais susijusias atitinkamas ERIR ir RTS nuostatas	10
II priedas. Metodika pagal kiekvieną straipsnį ir reikalavimą	2

1. Taikymo sritis

Kam skirtos šios gairės?

1. Šios gairės taikomos pagal ERIR 22 straipsnį paskirtoms kompetentingoms institucijoms, prižiūrinčioms pagrindines sandorio šalis, kurioms suteiktas leidimas pagal ERIR 14 straipsnį.

Koks šių gairių taikymo pagrindas?

2. Šios gairės yra susijusios su bendrosiomis priežiūros peržiūros ir vertinimo proceso pagal ERIR 21 straipsnį procedūromis ir metodika. Šiomis gairėmis pagrindinėms sandorio šalims nenustatomi nauji reikalavimai, išskyrus nurodytus ERIR arba kituose atitinkamuose techniniuose standartuose.

Nuo kada taikomos šios gairės?

3. Šios gairės taikomos nuo Gegužės 11d. 2022.

2. Nuorodos į teisės aktus, santrumpas ir sąvokų apibrėžtys

Nuorodos į teisės aktus

ERIR	2012 m. liepos 4 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 648/2012 dėl ne biržos išvestinių finansinių priemonių, pagrindinių sandorio šalių ir sandorių duomenų saugyklų ¹
ESMA reglamentas	2010 m. lapkričio 24 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 1095/2010, kuriuo įsteigiama Europos priežiūros institucija (Europos vertybinių popierių ir rinkų institucija) ir iš dalies keičiamas Sprendimas Nr. 716/2009/EB bei panaikinamas Komisijos sprendimas 2009/77/EB ² .
RTS 153/2013	2012 m. gruodžio 19 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) Nr. 153/2013 dėl pagrindinėms sandorio šalims taikomų reikalavimų ³ .

Santrumpas

<i>EEE</i>	Europos ekonominė erdvė
<i>EK</i>	Europos Komisija
<i>EFPI</i>	Europos finansų priežiūros institucijų sistema
<i>ES</i>	Europos Sąjunga
<i>ESMA</i>	Europos vertybinių popierių ir rinkų institucija

Terminų apibrėžtys

4. Šiame konsultaciniame dokumente vartojamos sąvokos turi tokią pat reikšmę kaip ir ERIR ir RTS 153/2013, išskyrus atvejus, kai nustatyta kitaip.
5. Be to, taikomos šios apibrėžtys:

Kolegija pagal ERIR 18 straipsnį įsteigta kolegija

¹ OL L 201, 2012 7 27, p. 1.

² OL L 331, 2010 12 15, p. 84.

³ OL L 52, 2013 2 23, p. 41.

3. Paskirtis

6. Šios gairės grindžiamos ESMA reglamento 16 straipsnio 1 dalimi ir ERIR 21 straipsnio 6 dalimi.
7. Šiomis gairėmis siekiama nustatyti nuoseklią, veiksmingą ir efektyvią Europos finansų priežiūros institucijų sistemos priežiūros praktiką ir užtikrinti bendrą, vienodą ir nuoseklų ERIR 21 straipsnio taikymą.
8. Šiomis gairėmis visų pirma siekiama padėti kompetentingoms institucijoms taikyti ERIR nuostatas atliekant pagrindinių sandorio šalių peržiūrą ir vertinimą, todėl jose išsamiau aprašomos procedūros ir metodika, kad būtų užtikrinta nuosekli šių peržiūrų ir vertinimų forma, dažnumas ir išsamumas.

4. Atitikties ir ataskaitų teikimo įpareigojimai

Gairių statusas

9. Šios gairės bus paskelbtos pagal ESMA reglamento 16 straipsnį ir adresuotos kompetentingoms institucijoms. Pagal ESMA reglamento 16 straipsnio 3 dalį kompetentingos institucijos privalo dėti visas pastangas siekdamas laikytis šių gairių.
10. Gairėse išdėstoma ESMA nuomonė dėl tinkamos priežiūros praktikos Europos finansų priežiūros institucijų sistemoje (EFPIS) arba dėl to, kaip ES teisė turėtų būti taikoma tam tikroje srityje. Todėl ESMA tikisi, kad visos kompetentingos institucijos, kurioms taikomos šios gairės, jų laikysis. Kompetentingos institucijos, kurioms taikomos šios gairės, turi jų laikytis ir atitinkamai įtraukti jas į savo priežiūros praktiką (pvz., pakeisti savo teisinę sistemą ar savo priežiūros procesus).

Pranešimo reikalavimai

11. Pagal ESMA reglamento 16 straipsnio 3 dalį kompetentingos institucijos privalo informuoti ESMA apie tai, ar jos i) laikosi šių gairių, ii) nesilaiko šių gairių, tačiau ketina jų laikytis, arba iii) nesilaiko ir neketina laikytis šių gairių.
12. Be to, nesilaikymo atveju kompetentingos institucijos privalo per du mėnesius nuo gairių paskelbimo ESMA svetainėje visomis oficialiosiomis ES kalbomis dienos pranešti, dėl kokių priežasčių jų nesilaiko.
13. Pranešimo šabloną galima rasti ESMA svetainėje. Užpildytas šablonas turi būti perduotas ESMA.

5. Gairės dėl bendrųjų priežiūros peržiūros ir PSŠ vertinimo proceso pagal ERIR 21 straipsnį procedūrų ir metodikos

5.1 Peržiūros ir vertinimo taikymo sritis

14. Peržiūros ir vertinimo taikymo sritis apima visus PSŠ taikomus reikalavimus, nustatytus ERIR ir jį papildančiuose techniniuose reguliavimo standartuose (RTS 152/2013 ir 153/2013, toliau kartu vadinami PSŠ RTS). Vertintinos rizikos mastas apima visas rizikas, kurios kyla arba gali kilti PSŠ, įskaitant, bet neapsiribojant finansine ir veiklos rizika.
15. Išsamus PSŠ reikalavimų ir su jais susijusių ERIR nuostatų sąrašas ir atitinkami PSŠ taikomus RTS papildantys straipsniai pateikiami gairių I priede. Tai, be kita ko, yra kapitalo reikalavimai, organizaciniai reikalavimai, verslo etikos reikalavimai, rizikos ribojimo reikalavimai, hipotetinio kapitalo apskaičiavimo reikalavimai ir su tuo susijusių ataskaitų teikimo ir sąveikos susitarimų reikalavimai.

5.2 Peržiūros ir vertinimo forma ir išsamumas

16. Kompetentingos institucijos, atlikdamos bet kurios PSŠ peržiūrą ir vertinimą, turėtų įvertinti visus I priede pateiktus reikalavimus.
17. Atlikdamos pagrindinę bet kurios PSŠ peržiūrą, kompetentingos institucijos turėtų atsižvelgti į visus II priedo trečiame stulpelyje „Pagrindinė peržiūra“ išvardytus aspektus. Pagrindinė peržiūra turėtų būti atliekama net jeigu peržiūros laikotarpiu PSŠ neinformavo kompetentingų institucijų apie bet kokius pakeitimus. Tik tais atvejais, kai kompetentingos institucijos pačios teigiamai įvertina, kad peržiūros laikotarpiu nebuvo jokių pakeitimų, susijusių su konkrečiais reikalavimais, prielaidomis ir faktais, pagrindžiančiais jų ankstesnę analizę, tuomet jų atitinkama pagrindinė peržiūra galėtų būti ne tokia išsami.
18. Jeigu, atsižvelgiant į atitinkamą reikalavimą, PSŠ atitinka bet kurį veiksni, dėl kurio gali būti pagrįstai atliekama išsami arba konkreti peržiūra, kaip nurodyta II priedo ketvirtame stulpelyje, kompetentingos institucijos dėl šio atitinkamo reikalavimo, be pagrindinės peržiūros, turėtų atlikti išsamią peržiūrą, kaip aprašyta II priedo penktame stulpelyje.
19. Jeigu kompetentingos institucijos atlieka PSŠ peržiūrą ir vertinimą dėl konkretaus reikalavimo, reikėtų atsižvelgti į bet kuriuos ESMA priimtus 3 lygmens aktus (pvz., gaires, nuomones, klausimus ir atsakymus).

5.3 Peržiūros ir vertinimo dažnumas

20. Kompetentingos institucijos kasmet (t. y. paeiliui kiekvienais metais) turėtų atlikti PSŠ priežiūros peržiūros ir vertinimo procedūrą.
21. Papildoma *ad hoc* peržiūra
 - Dėl bet kokių reikšmingų ir nepasikartojančių veiklos, techninio, finansinio arba su rizikos ribojimu susijusių PSŠ pakeitimų, išskyrus išvardytus 7 gairės 2 dalyje, turėtų būti atliekama papildoma *ad hoc* priežiūros peržiūros ir vertinimo procedūra, po kurios gali būti įgyvendinamas reikšmingas pakeitimas, siekiant konkrečiai aptarti sistemų, procesų, procedūrų ir rizikos valdymo politikos pokyčius.
 - Į šios *ad hoc* peržiūros taikymo sritį neįtraukiami šie reikšmingi ir nepasikartojantys pakeitimai:
 - PSŠ veiklos ir paslaugų srities išplėtimas (pagal ERIR 15 straipsnį);
 - PSŠ siūlomas įsigijimas (pagal ERIR 32 straipsnį);
 - užsakomųjų paslaugų, susijusių su pagrindine PSŠ rizikos valdymo veikla, pakeitimas (pagal ERIR 35 straipsnį);
 - PSŠ modelių ir parametru peržiūra (pagal ERIR 49 straipsnį);
 - naujas sąveikos susitarimas su PSŠ (pagal ERIR 54 straipsnį).
 - *Ad hoc* peržiūra turėtų būti orientuota į patį pakeitimą ir visas galimas pasekmes, kurias šis pakeitimas gali sukelti PSŠ laikantis visų I priede išvardytų reikalavimų.
 - Jeigu būtų atliekama tokia *ad hoc* peržiūra, kompetentinga institucija turėtų informuoti kolegiją apie šios *ad hoc* peržiūros rezultatus. Ši informacija kolegijai turėtų būti pateikta kaip įmanoma greičiau po *ad hoc* peržiūros ir turėtų būti pateikta laiku, kad ja būtų galima remtis per metinės peržiūros procedūrą.

5.4 Informacija: šaltiniai ir metodika

22. Priežiūros peržiūroms būtina informacija turėtų būti gaunama iš dviejų papildomų šaltinių:
 - informacijos, surinktos kompetentingai institucijai vykdant nuolatinę kontrolę ir priežiūrą, ir
 - informacijos, kurią kompetentinga institucija surinko būtent tam, kad atliktų peržiūrą ir vertinimą.
23. Informaciją, surinktą kompetentingai institucijai vykdant nuolatinę PSŠ kontrolę ir priežiūrą turėtų sudaryti bent jau:

- bet kokia informacija apie PSŠ nustatytus bet kokius savo vidaus taisyklių, pvz., procedūrų, politikos, pakeitimus, taip pat viešai prieinama informacija;
 - visi dokumentai, įrodymai, vertinimai, patvirtinimai ir ataskaitos, kuriuos pateikė PSŠ arba parengė kompetentinga institucija atsižvelgdama į PSŠ prašymus išplėsti veiklos ir paslaugų sritį (pagal ERIR 15 straipsnį), ir reikšmingų PSŠ modelių ir parametrų pakeitimų patvirtinimas (pagal ERIR 49 straipsnį), taip pat bet kokie klausimai, kuriuos ataskaitiniais metais galėjo konkrečiai patvirtinti kompetentinga institucija, ir kolegijos nuomonė (pvz., ERIR 30–32, 35, 51 ir 54 straipsniai);
 - dokumentų peržiūros ir patikrinimų vietoje, kuriuos per metus atliko kompetentinga institucija, rezultatai.
24. Informaciją, kurią kompetentingos institucijos surinko būtent siekdamos atlikti PSŠ susitarimų, strategijų, procesų ir mechanizmų peržiūrą ir vertinimą, siekdamos papildyti iš nuolatinės kontrolės ir priežiūros veiklos gautą informaciją, turėtų sudaryti bent jau:
- peržiūrėtas PSŠ savarankiškas vertinimas;
 - iš PSŠ gauta atnaujinta informacija, kaip nurodyta ESMA neoficialiame rizikos vertinimo ataskaitos šablone, kuriame turėtų būti pateikta PSŠ rizikos modelių, naudotų per praėjusius metus, veiksmingumo analizė, įskaitant PSŠ garantinių įmokų modelius, testavimo nepalankiausiomis sąlygomis sistemą, likvidumo rizikos valdymo priemonės, įkaltai taikomi įvertinimai mažesne nei rinkos verte;
 - išsamūs *ad hoc* susitikimų ir pokalbių su PSŠ atstovu, surengtų siekiant pasirengti peržiūrai ir atitinkamiems kolegijos susitikimams, protokolai;
 - PSŠ parengti dokumentai, skirti pristatyti rizikos komitetui, taip pat rizikos komiteto nuomonės.

5.5 Priežiūros peržiūros rezultatai. Metodika

25. Kolegijos informavimo tikslais priežiūros peržiūros rezultatai turėtų būti pateikti ataskaitos forma. Šioje kolegijos nariams ir ESMA skirtoje ataskaitoje turėtų būti pirmiausia pateiktas ne tik apibendrintas svarbių per peržiūros laikotarpį PSŠ padarytų pakeitimų sąrašas, bet ir pateikta atnaujinta, išsami ir konsoliduota vertinimo versija, kurioje daromas aiškus skirtumas tarp to, kas buvo pakeista peržiūros laikotarpiu ir ankstesnių metų vertinimo.

I priedas. PSŠ reikalavimų sąrašas, įskaitant su jais susijusias atitinkamas EIR ir RTS nuostatas

Reikalavimai	EIR nuostatos	RTS 152/2013 ir 153/2013
Kapitalo reikalavimai	16 straipsnis	RTS 152/2013 1–5 straipsniai
Organizaciniai reikalavimai		
Bendrosios nuostatos dėl organizacinių reikalavimų	26 straipsnis	RTS 153/2013 3–11 straipsniai
Vyresnioji vadovybė ir valdyba	27 straipsnis	
Rizikos komitetas	28 straipsnis	
Įrašų saugojimas	29 straipsnis	RTS 153/2013 12–16 straipsniai
Informacijos teikimas kompetentingoms institucijoms	31 straipsnio 1 dalis	
Interesų konfliktai	33 straipsnis	
Veiklos tęstinumas	34 straipsnis	RTS 153/2013 17–23 straipsniai
Užsakomosios paslaugos	35 straipsnis	
Verslo etika [EIR 2 skyrius]		
Bendrosios verslo etikos nuostatos	36 straipsnis	
Dalyvavimo reikalavimai	37 straipsnis	
Skaidrumas	38 straipsnis	
Atskyrimas ir perkeliamumas	39 straipsnis	
Rizikos ribojimo reikalavimai [EIR 3 skyrius]		
Pozicijų valdymas	40 straipsnis	
Garantinės įmokos reikalavimai	41 straipsnis	RTS 153/2013 24–28 straipsniai
Įsipareigojimų neįvykdymo fondas	42 straipsnis	RTS 153/2013 29–31 straipsniai
Kiti finansiniai ištekliai	43 straipsnis	
Likvidumo rizikos valdymo priemonės	44 straipsnis	RTS 153/2013 32–34 straipsniai
Įsipareigojimų neįvykdymo šaltinis	45 straipsnis	RTS 153/2013 35–36 straipsniai
Įkaito reikalavimai	46 straipsnis	RTS 153/2013 37–42 straipsniai
Investavimo politika	47 straipsnis	RTS 153/2013 43–46 straipsniai
Įsipareigojimų neįvykdymo atveju taikomos procedūros	48 straipsnis	
Modelių peržiūra, testavimas nepalankiausiomis sąlygomis ir grįžtamasis patikrinimas	49 straipsnis	RTS 153/2013 47–61 straipsniai
Atsiskaitymas	50 straipsnis	
Apskaičiavimai ir ataskaitų teikimas pagal Reglamentą (ES) Nr. 575/2013 dėl rizikos ribojimo reikalavimų kredito įstaigoms ir investiciniams įmonėms [EIR 4 skyrius]		
KCCP apskaičiavimas	50a straipsnis	
Bendros KCCP apskaičiavimo taisyklės	50b straipsnis	
Informacijos teikimas	50c straipsnis	
Specialių straipsnių, apie kuriuos turi pranešti pagrindinė sandorio šalis, apskaičiavimas	50d straipsnis	
Sąveikos susitarimai [EIR V antraštinė dalis]		
Sąveikos susitarimai	51 straipsnis	
Rizikos valdymas	52 straipsnis	
Pagrindinių sandorio šalių garantinių įmokų teikimas tarpusavyje	53 straipsnis	

II priedas. Metodika pagal kiekvieną straipsnį ir reikalavimą

Reikalavimai	ERIR	Pagrindinė apžvalga	Veiksniai, dėl kurių gali būti pagrįstai atliekama išsami / konkreti peržiūra	Išsami peržiūra
Kapitalo reikalavimai	16 straipsnis RTS 152/2013 1–5 straipsniai	<ul style="list-style-type: none"> - PSŠ kapitalo reikalavimų apskaičiavimo metodų vertinimai, įskaitant bet kokį pradinių duomenų, procedūrų, scenarijų, taikytų kapitalo reikalavimams apskaičiuoti, pakeitimą, susijusį su: <ul style="list-style-type: none"> o likvidavimu arba restruktūrizavimu, įskaitant tai, kaip PSŠ apibrėžia tinkamą savo veiklos likvidavimo laikotarpį; o veiklos ir teisine rizika; o kredito rizika, priešingos šalies kredito rizika, rinkos rizika; o verslo rizika, įskaitant verslo iniciatyvų poveikį peržiūros laikotarpiu, ir PSŠ apyvartos raidą. - PSŠ procedūrų, taikomų apskaičiuojant ir stebint jos turimo kapitalo sumą, vertinimas. - PSŠ kapitalo investicijų analizė, įskaitant duomenis apie laiką, reikalingą kapitalui likviduoti ir juo pasinaudoti. 	- Netaikoma	- Netaikoma

		<ul style="list-style-type: none"> - Įrodymai apie PSŠ kapitalo reikalavimus ir padėtį peržiūros laikotarpiu, įskaitant: <ul style="list-style-type: none"> o kapitalo reikalavimų sumą pagal rizikos rūšį; o kapitalo sumą, įskaitant nepaskirstytąjį pelną ir rezervus, kuriuos galima panaudoti kapitalo reikalavimams patenkinti; o įrodymus, kad PSŠ peržiūros laikotarpiu turi ne mažesnę nei 7,5 mln. EUR nuolatinį ir prieinamą pradinį kapitalą. 		
organizaciniai reikalavimai [IV antraštinės dalies 1 skyrius]				
Bendrosios nuostatos	26 straipsnis RTS 153/2013 3–11 straipsniai	<ul style="list-style-type: none"> - Korporacijos ir organizacinės struktūros, valdymo sąrangos, rizikos valdymo ir vidaus kontrolės mechanizmų, įskaitant atitikties funkciją, vidaus auditą ir informacinių technologijų struktūrą, vertinimą. 	<ul style="list-style-type: none"> - PSŠ priklauso grupei ir dalijasi kai kuriomis funkcijomis, darbuotojais arba sistemomis su vienu ar keliais grupės subjektais. 	<ul style="list-style-type: none"> - Sąveikos su kitais grupės subjektais vertinimas (pvz., dalijimasis darbuotojais, komandiravimas, užsakomosios paslaugos) ir atitinkamos nepriklausomumo apsaugos priemonės (pvz., interesų konfliktų prevencija, susitarimai dėl paslaugų lygio, ilgas pranešimo apie sutarties nutraukimą terminas, pereinamojo laikotarpio nuostatos nutraukus sutartį ir pan.).

<p>Vyresnioji vadovybė ir valdyba</p>	<p>27 straipsnis</p>	<ul style="list-style-type: none"> - PSŠ vyresniosios vadovybės ir valdybos narių patirties įrodymai, kuriais patvirtinama pakankamai gera jų reputacija ir patirtis, reikalinga užtikrinant patikimą ir apdairų PSŠ valdymą. - Valdybos narių nepriklausomumo vertinimas. - Valdybos sudėties vertinimas, įskaitant bet kokio peržiūros laikotarpiu atlikto atnaujinimo vertinimą, įskaitant įrodymus, patvirtinančius, kad bent trečdalis ir ne mažiau kaip du nariai yra nepriklausomi, įskaitant duomenis apie tarpuskaitos narių klientų atstovavimą. 	<p>- Netaikoma</p>	<p>- Netaikoma</p>
<p>Rizikos komitetas</p>	<p>28 straipsnis</p>	<ul style="list-style-type: none"> - Rizikos komiteto sudėties ir vaidmens vertinimas, įskaitant bet kokį peržiūros laikotarpiu padarytą pakeitimą, susijusį su: <ul style="list-style-type: none"> o narių patirtimi ir kompetencija, taip pat komiteto pirmininko nepriklausomumu; o įgaliojimais ir konsultavimosi su rizikos komitetu bet kurių taisyklių, kurios gali daryti poveikį PSŠ rizikos valdymui, klausimais procedūra; o duomenimis apie atstovavimą klientui rizikos komitete. 		

<p>Įrašų saugojimas</p>	<p>29 straipsnis RTS 153/2013 12–16 straipsniai</p>	<ul style="list-style-type: none"> - Procedūros / politikos, įgyvendintos siekiant tvarkyti sandorius, pozicijas ir veiklos įrašus, vertinimas, įskaitant bet kokius pakeitimus, susijusius su tuo, kaip PSS užtikrina tinkamą informacijos patvarumą, prieinamumą ir išsamumą. 	<ul style="list-style-type: none"> - PSS tvarko įrašus už Sąjungos ribų. 	<ul style="list-style-type: none"> - Jeigu PSS įrašus tvarko už Sąjungos ribų, pateikiami įrodymai, susiję su tuo, kaip užtikrinama NKI, ESMA ir ECBS visapusiška prieiga prie įrašų.
<p>Informacijos teikimas kompetentingoms institucijoms</p>	<p>31 straipsnio 1 dalis</p>	<ul style="list-style-type: none"> - NKI teikiamų pranešimų apie bet kokį jos valdymo pakeitimą ir bet kokią kitą informaciją, būtina atitikčiai 27 straipsnio 1 daliai arba 27 straipsnio 2 dalies antrai pastraipai įvertinti, procedūrų vertinimas. 	<ul style="list-style-type: none"> - Netaikoma 	<ul style="list-style-type: none"> - Netaikoma
<p>Interesų konfliktai</p>	<p>33 straipsnis</p>	<ul style="list-style-type: none"> - Interesų konfliktų valdymo įmonės lygmeniu politikos vertinimas, įskaitant bet kokius pakeitimus, susijusius su: <ul style="list-style-type: none"> o politika / procedūromis / priemonėmis, skirtomis visai potencialiai ir faktinei vadovų, darbuotojų arba bet kurio asmens, turinčio tiesioginę arba netiesioginę kontrolę arba glaudžius ryšius, interesų konfliktų rizikai įvertinti ir sušvelninti; o procedūromis, kurios taikomos atskleidžiant informaciją apie bendro pobūdžio interesų konfliktų, susijusių su tarpuskaitos nariais arba tarpuskaitos narių klientais, šaltinius; 	<ul style="list-style-type: none"> - PSS yra patronuojančioji įmonė arba patronuojamoji įmonė. 	<ul style="list-style-type: none"> - Procedūrų ir politikos, skirtų bet kurio interesų konflikto, kuris gali kilti dėl kitų įmonių, kurios kartu su PSS turi bendrą patronuojančiąją įmonę arba yra saistomos patronuojančiosios arba patronuojamosios įmonės ryšiais, struktūros ir verslo veiklos, prevencijai, stebėsenai ir atskleidimui, vertinimas. - Peržiūros laikotarpiu pateikiami išsamūs duomenys apie bet kokį interesų konfliktą, kuris galėjo būti nustatytas / sušvelnintas atsižvelgiant į grupės struktūrą.

		<ul style="list-style-type: none"> o procedūromis, kurios naudojamos užkertant kelią bet kokiam PSŠ sistemoje laikomos informacijos netinkamam panaudojimui. - Darbo užmokesčio politikos atitikties PSŠ verslo ir rizikos strategijoms, įmonės kultūrai ir vertybėms, ilgalaikiams PSŠ interesams ir priemonėms, kurių reikia imtis interesų konfliktams išvengti, vertinimas. - Esama įrodymų apie tvirtą organizacijos kultūrą, interesų konfliktų valdymą ir informavimo apie pažeidimus procesus. - Procedūrų, kurias taikant įvertinamas tokių taisyklių veiksmingumas, vertinimas, įskaitant jų reguliarią peržiūrą. 		
Veiklos tęstinumas	34 straipsnis RTS 153/2013 17–23 straipsniai	<ul style="list-style-type: none"> - PSŠ veiklos tęstinumo politikos ir pagrindinių veiklos atkūrimo po ekstremaliųjų įvykių plano aspektų vertinimas, įskaitant: <ul style="list-style-type: none"> o išsamią informaciją apie veiklos tęstinumo politikos valdymą ir patvirtinimo procesą, ir nepriklausomos peržiūros dažnumą ir procesus; o išsamią informaciją apie esmines verslo funkcijas ir sistemas, apie kurias užsimenama politikoje, joms nustatyti naudojamus kriterijus ir 	- PSŠ yra patrunuojančioji įmonė arba patrunuojamoji įmonė.	- Grupės veiklos tęstinumo ir veiklos atkūrimo po ekstremaliųjų įvykių plane nustatytos politikos vertinimas, kai tokia politika gali daryti poveikį PSŠ.

		<p>metodus, taikomus jų tęstinumui užtikrinti;</p> <ul style="list-style-type: none"> ○ nuorodą į tarpusavio ryšius ir priklausomybę nuo kitų išorės sistemų ir užsakomųjų paslaugų, įskaitant informaciją apie tai, kaip PSŠ valdo galimą verslo riziką, kuri gali būti susijusi tiek su išorės sistemomis, tiek su užsakomosiomis paslaugomis. bendro PSŠ sutrikimo poveikio rinkai, kurią ji aptarnauja, analizė; ○ išsami informacija apie PSŠ procedūras, kuriomis užtikrinama, kad tuo atveju, kai panaikinamas leidimas, būtų laiku ir tvarkingai atsiskaitoma už klientų ir tarpuskaitos narių turtą ir pozicijas ar tas turtas ir pozicijos būtų laiku ir tvarkingai perduoti. <ul style="list-style-type: none"> - Veiklos tęstinumo ir veiklos atkūrimo po ekstremaliųjų įvykių testavimo taisyklių ir rezultatų analizė, įskaitant tai, kaip dažnai ir kokia tvarka atsižvelgiama į bet kokią po testavimo įgytą patirtį ir kaip ji įgyvendinama. - Krizės funkcijos turinio / procedūrų vertinimas. 		
--	--	--	--	--

<p>Užsakomosios paslaugos</p>	<p>35 straipsnis</p>	<ul style="list-style-type: none"> - Komunikacijos plano, įskaitant tai, kaip visi susiję suinteresuotieji subjektai informuojami per krizę, vertinimas. - Visų susitarimų dėl užsakomųjų paslaugų aprašymas, įskaitant išsamią informaciją apie užsakomąsias funkcijas, paslaugų teikėjų tapatybę, paslaugų lygį, veiklos rodiklius ir sutarties nutraukimo sąlygas. - Šalių atsakomybės, teisių ir pareigų, įskaitant įrodymus apie tai, kaip PSŠ išlaiko visišką atsakomybę už visų savo pareigų pagal ERIR vykdymą, ir kaip ji užtikrina, kad visada būtų įvykdytos 35 straipsnio sąlygos, analizė. 	<ul style="list-style-type: none"> - PSŠ didžiąją dalį su rizikos valdymu susijusios veiklos perduota vykdyti rangovui. 	<ul style="list-style-type: none"> - NKI atlikto vertinimo, kuris paskatino patvirtinti tokią užsakomąją veiklą, santrauka.
<p>Verslo etika [IV antraštinės dalies 2 skyrius]</p>				
<p>Bendrosios verslo etikos nuostatos</p>	<p>36 straipsnis</p>	<ul style="list-style-type: none"> - Įrodymai, kad PSŠ yra nustačiusi prieinamas, skaidrias ir sąžiningas greito skundų nagrinėjimo taisykles. 	<ul style="list-style-type: none"> - Netaikoma 	<ul style="list-style-type: none"> - Netaikoma
<p>Dalyvavimo reikalavimai</p>	<p>37 straipsnis</p>	<ul style="list-style-type: none"> - Kriterijų, taikomų norint tapti tarpuskaitos nariu, vertinimas, įskaitant jų sąžiningumo, objektyvumo, santykio su rizika ir proporcingumu, įskaitant tarpuskaitos klientams teikiamų paslaugų nuostatas, analizę. - Nustatyto proceso ir procedūrų, kurios sudarytų sąlygas nuolat vertinti ir 	<ul style="list-style-type: none"> - Netaikoma 	<ul style="list-style-type: none"> - Netaikoma

		<p>kasmet išsamiai peržiūrėti atitiktį šiems kriterijams ir atvejų, kai šių reikalavimų nebesilaikoma, valdymas.</p>		
<p>Skaidrumo reikalavimai</p>	<p>38 straipsnis</p>	<ul style="list-style-type: none"> - Įrodymai, susiję su PSS atitinkamos informacijos atskleidimu (pvz., interneto svetainė), įskaitant: <ul style="list-style-type: none"> o viešai atskleistą informaciją apie kainas ir mokesčius, nuolaidas ir permokos grąžinimą bei sąlygas, kuriomis jos taikomos; o tarpuskaitos nariams ir klientams atskleistą informaciją apie riziką, susijusią su suteiktomis paslaugomis; o tarpuskaitos nariams ir NKI atskleistą informaciją, naudojamą apskaičiuojant savo tarpuskaitos narių pozicijas dienos pabaigoje; o viešai atskleistą informaciją apie kiekvienos klasės priemonių sandorių, kurių tarpuskaita atlikta, skaičių; o viešai atskleistą informaciją apie dalyviams taikomus teisinius, veiklos ir techninius reikalavimus. - Procesų, kuriuos PSS įgyvendino siekdama užtikrinti nuolatinį tinklalapių atnaujinimą ir tikslumą, vertinimas ir bet 	<p>- Netaikoma</p>	<p>- Netaikoma</p>

		<p>kokie įrodymai, susiję su informacijos atnaujinimu peržiūros laikotarpiu.</p>		
<p>Atskyrimas ir perkeliamumas</p>	<p>39 straipsnis</p>	<ul style="list-style-type: none"> - PSS taisyklių, procedūrų ir komercinių sąlygų vertinimas siekiant: <ul style="list-style-type: none"> o visą atitinkamo tarpuskaitos nario vardu laikomą turtą ir pozicijas nustatyti ir įregistruoti atskirai nuo PSS turto ir kitų tarpuskaitos narių vardu laikomo turto ir pozicijų; o užtikrinti, kad visas atitinkamo tarpuskaitos nario klientų turtas ir pozicijos būtų laikomos atskirai nuo tarpuskaitos nario įmonės vardu laikomo turto ir pozicijų (bendras klientų atskyrimas); o užtikrinti, kad PSS suteiktų galimybę taikyti bendrą arba individualų klientų atskyrimą; o užtikrinti, kad tuo atveju, kai klientas nusprendė taikyti individualų atskyrimą, visas kliento turtas ir pozicijos laikomos atskirai nuo bendros sąskaitos ir kitų tarpuskaitos narių klientų turto ir pozicijų. - Taisyklių, pagal kurias viešai atskleidžiama informacija apie išlaidas 	<ul style="list-style-type: none"> - PSS, be pagrindinių sąskaitų, bendro ir individualaus klientų sąskaitų atskyrimo, siūlo papildomus atskiros sąskaitos sprendimus. 	<ul style="list-style-type: none"> - Papildomų tarpuskaitos nariams prieinamų atskirtų sąskaitų formų vertinimas, įskaitant įrodymus, kad tokiomis formomis užtikrinamas bent jau lygiavertis atskyrimas ir turto bei pozicijų apsauga kaip ir PSS taisyklių dėl bendro ir individualaus atskyrimo atveju.

		<p>ir apsaugos lygį dėl kiekvienos siūlomos sąskaitos formos, aprašymas ir analizė.</p> <ul style="list-style-type: none"> - PSŠ galimybės pakartotinai panaudoti įkaitą, pateiktą kaip garantinę įmoką, arba tarpuskaitos narių ir jų klientų įnašą į įsipareigojimų neįvykdymo fondą. - PSŠ taisyklių vertinimas, kuriomis tarpuskaitos nario įsipareigojimų neįvykdymo atveju užtikrinamos: <ul style="list-style-type: none"> o pastangos atskirti įsipareigojimų neįvykdžiusių tarpuskaitos nario klientų pozicijas ir turtą; o tokių pozicijų likvidavimas, jeigu šios pastangos nebuvo sėkmingos, ir įkaito grąžinimas klientams. 		
Rizikos ribojimo reikalavimai [ERIR IV antraštinės dalies 3 skyrius]				
Pozicijų valdymas	40 straipsnis	<ul style="list-style-type: none"> - Metodikos ir procedūrų, nustatytų siekiant beveik tikruoju laiku įvertinti PSŠ likvidumą ir tarpuskaitos nariams kylančią kredito riziką, įskaitant PSŠ naudotų kainos išteklių aprašymą ir analizę. 	<ul style="list-style-type: none"> - Rizika sąveikaujančioms PSŠ. 	<ul style="list-style-type: none"> - Metodikos ir procedūrų, nustatytų siekiant įvertinti PSŠ likvidumą ir sąveikaujančioms PSŠ kylančią kredito riziką, analizė.
Garantinės įmokos reikalavimai	41 straipsnis RTS 153/2013 24–28 straipsniai	<ul style="list-style-type: none"> - Pradinių garantinių įmokų apskaičiavimo modelio ir metodikos, taikomos kalibruojant pagrindinius modelio parametrus (patikimumo vertinimas, patikrinimo laikotarpis, likvidavimo laikotarpis) vertinimas, 	<ul style="list-style-type: none"> - PSŠ vykdo įvairių turto klasių tarpuskaitą (naudodama skirtingus garantinės įmokos modelius). - Išvestinėms finansinėms priemonėms taikomi 	<ul style="list-style-type: none"> - Išsamus užstato nustatymo dėl kiekvienos turto klasės / verslo linijos metodikos vertinimas. - Jeigu bendras modelis taikomas įvairioms verslo linijoms, atliekamas

		<p>įskaitant vertinimą, kaip šiuo atveju garantuojama, kad pradinės garantinės įmokos nebūtų mažesnės, palyginti su garantinėmis įmokomis, kurios būtų buvusios apskaičiuotos taikant ERIR minimalius reikalavimus.</p> <ul style="list-style-type: none"> - Procedūrų, skirtų pradinėms garantinėms įmokoms surinkti, vertinimas, įskaitant kasdienių garantinių įmokų apskaičiavimo periodiškumo ir galutinių kasdienių įkaito vertės ribų vertinimą. - Galimybės, pasirinktos procikliškumui riboti, vertinimas, įskaitant duomenis apie tai, kaip modelis veikia nepalankiausiomis sąlygomis. - PSŠ garantinės įmokos grįžtamojo patikrinimo rezultatų per peržiūros laikotarpį santrauka ir analizė. 	<p>pagrindiniai parametrai (pasitikėjimo intervalas / likvidavimo laikotarpis), yra mažesni, palyginti su standartu (kaip leidžiama pagal RTS 153/2013 24 straipsnio 4 dalį ir 26 straipsnio 4 dalį).</p> <ul style="list-style-type: none"> - PSŠ įvairioms priemonėms taiko portfelio užstato nustatymą, įskaitant atvejus, kai viršijama 80 proc. riba. - PSŠ garantinės įmokos apskaičiuoja ir keičia naudodama sąveikumo sąsają. 	<p>vertinimas, kaip atsižvelgiama į kiekvienos turto klasės ypatumus.</p> <ul style="list-style-type: none"> - Jeigu išvestinėms finansinėms priemonėms taikomi pagrindiniai parametrai yra mažesni, palyginti su standartu, pateikiami įrodymai, kad tokie parametrai būtų tinkamesni atsižvelgiant į konkrečius nagrinėjamų išvestinių finansinių priemonių ypatumus. - Požiūrio, taikomo portfelio užstato nustatymui atsižvelgiant į skirtingas priemones, vertinimas, įskaitant: - garantinės įmokos sumažinimų reikšmingumo analizę; - finansinių priemonių koreliacijos lygmens ir patikimumo (arba bet kurio kito statistinio priklausomumo parametro) vertinimą; - nustatytos metodikos ir procedūrų, skirtų keistis garantinėmis įmokomis per sąveikumo sąsają, analizė.
--	--	--	---	---

<p>Įsipareigojimų neįvykdymo fondas</p>	<p>42 straipsnis RTS 153/2013 29–31 straipsniai</p>	<ul style="list-style-type: none"> - Kiekvieno įsipareigojimų neįvykdymo fondo dydžio nustatymo metodikos vertinimas, įskaitant tai, kaip nustatomos mažiausios / didžiausios vertės. - Įsipareigojimų neįvykdymo fondo įmokų paskirstymo metodikos ir įsipareigojimų neįvykdymo fondo įmokų procedūrų, įskaitant fondo papildymą, vertinimas. - Metodikos, kuri buvo taikoma apibrėžiant ekstremalius, tačiau tikėtinus scenarijus dėl įsipareigojimų neįvykdymo fondų dydžio nustatymo, vertinimas, įskaitant bet kokį testavimų nepalankiausiomis sąlygomis scenarijų sąrašo pakeitimą peržiūros laikotarpiu. - Įsipareigojimų neįvykdymo fondo pakankamumo ekstremaliomis, bet tikėtinomis rinkos sąlygomis apsaugoti nuo tarpuskaitos nario, kurio pozicijos didžiausios, arba antro ir trečio pagal dydį tarpuskaitos narių įsipareigojimų neįvykdymo, vertinimas. 	<ul style="list-style-type: none"> - PSŠ turi keletą verslo linijų / įsipareigojimų neįvykdymo fondų. 	<ul style="list-style-type: none"> - Dėl kiekvieno įsipareigojimų neįvykdymo fondo / verslo linijos atliekamas išsamus pasinaudojimo įsipareigojimų neįvykdymo fonu metodikos vertinimas, įskaitant specialius ekstremalius, tačiau tikėtinus scenarijus.
<p>Kiti finansiniai ištekliai</p>	<p>43 straipsnis</p>	<ul style="list-style-type: none"> - Iš anksto finansuojamų išteklių pakankamumo ekstremaliomis, bet tikėtinomis rinkos sąlygomis apsaugoti nuo tarpuskaitos nario, kurio pozicijos didžiausios, arba antro ir trečio pagal dydį tarpuskaitos narių įsipareigojimų neįvykdymo, vertinimas. 	<p>Netaikoma</p>	<p>Netaikoma</p>

<p>Likvidumo rizikos valdymo priemonės</p>	<p>44 straipsnis RTS 153/2013 32–34 straipsniai</p>	<ul style="list-style-type: none"> - Prieinamo likvidžiojo turto, suskirstyto pagal rūšį (grynieji pinigai, įsipareigota kredito linija, įsipareigotas atpirkimo sandoris, lengvai parduodamos finansinės priemonės) vertinimas, įskaitant likvidumą palaikančių subjektų tapatybę, atsakomybę, šalių teises ir pareigas, sutarties nutraukimo sąlygas ir pan. - PSŠ likvidumo pozicijų analizė, įskaitant datas / scenarijus / tarpuskaitos narius, dėl kurių atsiranda didžiausios pozicijos, peržiūros laikotarpiu. - Rizikos valdymo sistemos analizė, įskaitant tai, kaip pagal įvairius scenarijus padengiami likvidumo poreikiai, taip pat bet koks priemonių, kurių buvo imtasi pažeidimo atveju nurodymas aprašymas. - Procedūros ir metodikos, siekiant kontroliuoti ir stebėti likvidumo pozicijų koncentracijos riziką, vertinimas. 	<ul style="list-style-type: none"> - PSŠ priemonių tarpuskaitą vykdo įvairiomis valiutomis. - PSŠ priemonių tarpuskaitą vykdo taikydama didelio likvidumo reikalavimus (pvz., saugyklos). 	<ul style="list-style-type: none"> - Nustatytų taisyklių, susijusių su likvidumo užtikrinimu įvairiomis valiutomis, aprašymas ir analizė. - Dėl kiekvienos valiutos pateikiamas modelių / procedūrų / procesų, nustatytų siekiant stebėti likvidumo pozicijas, aprašymas ir vertinimas.
<p>Įsipareigojimų neįvykdymo srautas</p>	<p>45 straipsnis RTS 153/2013 35–36 straipsniai</p>	<ul style="list-style-type: none"> - PSŠ nuosavų išteklių apskaičiavimo vertinimas ir metodika. - PSŠ nuosavų išteklių sudėties aprašymas ir analizė ir išteklių investavimo analizė. 	<ul style="list-style-type: none"> - Keletas verslo linijų / įsipareigojimų neįvykdymo srautų - PSŠ nuosavų išteklių paskirstymas tarp įsipareigojimų neįvykdymo srautų 	<ul style="list-style-type: none"> - Įvertinama, kaip PSŠ užtikrina tinkamą nuosavų išteklių paskirstymą tarp įsipareigojimų neįvykdymo srautų.

		<ul style="list-style-type: none"> - Nuosavų išteklių lygmens stebėsenos procedūrų vertinimas ir NKI informavimas apie pažeidimą. 		
Įkaito reikalavimai	46 straipsnis RTS 153/2013 37–42 straipsniai	<ul style="list-style-type: none"> - Tinkamo įkaito, kurį priima PSŠ, taikymo srities vertinimas, įskaitant duomenis apie priemones ar grynuosius pinigus Sąjungos valiuta ir tai, ar taikomos kokios nors ribos. - Įkaito, laikomo i) grynųjų pinigų Sąjungos ir ne Sąjungos valiuta, ii) vyriausybės obligacijomis, iii) ES įmonės obligacijomis ir iv) kita Sąjungos valiuta išleistais vertybiniais popieriais suskirstymas (pagal valiutą). - Metodikos ir kriterijų, taikomų užtikrinant, kad įkaitas negrynaisiais pinigais galėtų būti laikomas labai likvidžiu įkaitu pagal RTS 153/2013 I priedą. - Rizikos švelninimo metodikos, kurią PSŠ taiko įkaitui, vertinimas, įskaitant: <ul style="list-style-type: none"> o įkaito įvertinimo beveik tikroju laiku metodiką ir procedūrą; o įvertinimų mažesne nei rinkos verte kalibravimo metodiką; 	<ul style="list-style-type: none"> - PSŠ priima ir laiko grynuosius pinigus įvairiomis valiutomis. - PSŠ priima ir laiko finansines priemones įvairiomis valiutomis. 	<ul style="list-style-type: none"> - Dėl kiekvienos valiutos atliekamas vertinimas, kaip PSŠ valdo valiutos riziką, kylančią iš jos turimo įkaito, kartu darant skirtumą tarp grynųjų pinigų ir finansinių priemonių.

<p>Investavimo politika</p>	<p>47 straipsnis RTS 153/2013 43–46 straipsniai</p>	<ul style="list-style-type: none"> ○ koncentracijos ribų nustatymo metodiką. 		<ul style="list-style-type: none"> - Vertinimas, kaip PSŠ valdo riziką, kuri kyla iš jos <ul style="list-style-type: none"> ○ investicijų į finansines priemones; ○ grynujų pinigų indėlius. - Jeigu turtas laikomas pas trečiąją šalį, pateikiama analizė, kaip tarpuskaitos nariams priklausantis turtas atskiriamas nuo PSŠ ir trečiajai šaliai priklausančio turto.
		<ul style="list-style-type: none"> - PSŠ investavimo politikos analizė, visų pirma investuoto įkaito paskirstymas atsižvelgiant į grynuosius pinigus ir finansines priemones peržiūros laikotarpiu. - Finansinių priemonių, į kurias PSŠ investavo peržiūros laikotarpiu, sąrašas ir metodikos, taikytos nustatant, ar tokios priemonės yra labai likvidžios pagal RTS 153/2013 II priedą, vertinimas. - Finansinių įstaigų, kuriose deponuojamos priemonės, analizė ir metodika, naudota siekiant įvertinti kredito riziką ir taisykles, kurios padeda užkirsti kelią nuostoliams dėl šių įstaigų įsipareigojimų neįvykdymo arba nemokumo. - Metodikos, taikytos apibrėžiant koncentracijos ribas, stebint PSŠ finansinių išteklių koncentraciją ir mažinant koncentracijos riziką, vertinimas. 	<ul style="list-style-type: none"> - PSŠ investicijas laiko įvairiomis valiutomis. - PSŠ nustatė finansinių priemonių / grynujų pinigų laikymo pas trečiąją šalį taisykles (ES kredito įstaiga arba trečiosios šalies finansų įstaiga). 	

<p>Įsipareigojimų neįvykdymo atveju taikomos procedūros</p>	<p>48 straipsnis</p>	<ul style="list-style-type: none"> - PSŠ procedūrų tinkamumo ir vykdymo užtikrinimo valdant įsipareigojimų neįvykdymą analizė, įskaitant įsipareigojimų neįvykdymo nustatymą, suinteresuotųjų subjektų informavimą, klientų turto ir pozicijų perleidimą, portfelių likvidavimą. - Aprašymas ir įrodymai, kad atliekamas nuolatinis testavimas ir patikrinimas siekiant užtikrinti procedūrų vykdymą (pratybos) ir kad atsižvelgiama į tokios peržiūros rezultatus. <ul style="list-style-type: none"> o Kai tinkama, peržiūra apima bet kokio peržiūros laikotarpiu atlikto testavimo rezultatus. 	<ul style="list-style-type: none"> - Įvairios verslo linijos (priemonių likvidavimas įvairiose rinkose). - PSŠ įvykdo priemonių, kurioms būdinga sudėtinga rizika, tarpuskaitą (pvz., išvestinės finansinės priemonės, kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriai, palūkanų normų apsikeitimo sandoriai). - Koordinavimas grupėje atsižvelgiant į įsipareigojimų neįvykdymo valdymą. - Konkreti paslaugų nutraukimo procedūra susijusi sąveikiąją sąsają. 	<ul style="list-style-type: none"> - Dėl kiekvienos verslo linijos pateikiamas taikomos įsipareigojimų neįvykdymo procedūros aprašymas. - Kai taikytina, įrodymai, kad PSŠ keliose rinkose vienu metu įgyvendino ir išbandė sutarties nevykdančios šalies portfelio likvidavimo valdymo procedūras. - Kai taikytina, įrodymai, kad PSŠ gali remtis būtina vidaus patirtimi arba išorės konsultacijomis, siekdama valdyti ir likviduoti sudėtingus produktus, įskaitant nepalankų laikotarpį. - Kai taikytina, grupės lygmeniu nustatytų procedūrų, skirtų valdyti tarpuskaitos nario įsipareigojimų neįvykdymo pasekmes, vertinimas. - Kai taikytina, procedūrų, kurios buvo įgyvendintos siekiant valdyti sąveikiosios sąsajos paslaugos teikimo nutraukimą, vertinimas.
<p>Modelių peržiūra, testavimas nepalankiausiomis sąlygomis ir grįžtamasis patikrinimas</p>	<p>49 straipsnis</p> <p>RTS 153/2013 47–61 straipsniai</p>	<ul style="list-style-type: none"> - PSŠ grįžtamojo patikrinimo programos, jautrumo testavimo, testavimo nepalankiausiomis sąlygomis programos ir atvirkštinio testavimo nepalankiausiomis sąlygomis programos vertinimas, įskaitant bet kokį 	<ul style="list-style-type: none"> - Netaikoma 	<ul style="list-style-type: none"> - Netaikoma

		<p>pakeitimą politikos, kuri taikoma nustatant:</p> <ul style="list-style-type: none"> ○ tinkamą testavimų laikotarpį; ○ kaip dažnai šie testai atliekami; ○ istorinius ir hipotetinius scenarijus, taikomus testavimui nepalankiausiomis sąlygomis, jautrumo testavimą ir atvirkštinį testavimą nepalankiausiomis sąlygomis; ○ rezultatams įvertinti naudotus kriterijus; ○ veiksmus, kurių reikia imtis priklausomai nuo rezultatų, ir rizikos komitetui teiktinas ataskaitas; ○ tarpuskaitos nariams ir klientams atskleidžiamos informacijos apie rezultatus išsamumą. 		
Atsiskaitymas	50 straipsnis	<ul style="list-style-type: none"> - Visų atsiskaitymo už sandorius taisyklių aprašymas. - Tarpuskaitos nariams pateiktos informacijos, susijusios su finansinių priemonių pristatymu, skaidrumo lygio vertinimas, įskaitant tai, ar PSS yra įsipareigojusi pristatyti finansines priemones arba jas gauti. 	<ul style="list-style-type: none"> - PSS nenaudoja centrinio banko pinigų savo sandoriams įvykdyti. 	<ul style="list-style-type: none"> - Jei centrinio banko pinigai nenaudojami atsiskaitymo priemonėms, atliekama alternatyvių sprendimų analizė, įskaitant informaciją apie: <ul style="list-style-type: none"> ○ naudojamų komercinių bankų sąrašą; ○ srautus pagal valiutą ir banką;

		<ul style="list-style-type: none"> - Jeigu PSŠ nėra įpareigota pristatyti arba prisiimti atsakomybės už sutarčių, kurių tarpuskaitą ji įvykdė, pristatymą, atliekamas vertinimas, ar nepristatymo rizika yra aiškiai nurodyta PSŠ taisyklių sąvade, įskaitant potencialią kompensaciją dalyviams. - Jeigu PSŠ yra įpareigota fiziškai pristatyti finansines priemones arba jas gauti: <ul style="list-style-type: none"> o atliekamas naudojamų vienalaikio vertybinių popierių ir lėšų pateikimo mechanizmų vertinimas. o jeigu sutartyse nenaudojami vienalaikio vertybinių popierių ir lėšų pateikimo mechanizmai, atliekama analizė, kaip PSŠ prisiima ir sumažina pagrindinę riziką. 		<ul style="list-style-type: none"> o analizę, kaip stebima atsiskaitymo grynaisiais pinigais rizika, ir įgyvendintas rizikos mažinimo priemonės.
<p>Apskaičiavimai ir ataskaitų teikimas pagal Reglamentą (ES) Nr. 575/2013 dėl rizikos ribojimo reikalavimų kredito įstaigoms ir investicinėms įmonėms [ERIR 4 skyrius]</p>				
<p>Apskaičiavimas ir 50a–50d ataskaitų teikimas straipsniai pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013</p>	<ul style="list-style-type: none"> - Procedūros ir metodikos, susijusios su tuo, kaip PSŠ apskaičiuoja KCCP, laikydamasi reikalavimų, vertinimas. - Įrodymai, kad PSŠ tinkamai praneša informaciją savo tarpuskaitos nariams, t. y. įstaigoms, arba savo kompetentingoms institucijoms. 	<p>- Netaikoma</p>	<p>- Netaikoma</p>	

Sąveikos susitarimai [ERIR V antraštinė dalis]				
Sąveikos susitarimai	51 straipsnis	- Kai tinkama, nediskriminuojančios prieigos prie duomenų, kurie yra reikalingi PSS savo funkcijoms prekybos vietoje atlikti, vertinimas.	- Netaikoma	Netaikoma
Rizikos valdymas	52 straipsnis	- Politikos, procedūrų ir sistemų, susijusių su PSS sąveikumo susitarimu, vertinimas, įskaitant: <ul style="list-style-type: none"> o kredito ir likvidumo rizikos valdymą; o tarpusavio priklausomybę ir koreliacinį ryšį su sąveikumu; o įkaito valdymą, įskaitant pakartotinį įkaito panaudojimą, kai tai leidžiama; o įsipareigojimų neįvykdymo valdymą ir procedūras, kurias taikant nutraukiamas sąveikusis ryšys įsipareigojimų neįvykdymo atveju dėl vienos ar kitos PSS. - Jeigu rizikos valdymo modeliai, kuriuos naudoja sąveikiosios PSS, yra skirtingi, pateikiamas procedūrų, kurios nustatytos siekiant išsiaiškinti šiuos skirtumus, įvertinti riziką ir ją sušvelninti, vertinimas.	- Netaikoma	Netaikoma
Pagrindinių sandorio šalių garantinių įmokų teikimas tarpusavyje	53 straipsnis	- PSS, su kuriomis PSS yra sudariusi sąveikumo susitarimą, vardu laikomo	- Netaikoma	Netaikoma



VIEŠAM ESMA NAUDOJIMUI

		turto ir pozicijų atskyrimo procedūrų vertinimas.		
--	--	---	--	--