

**Regulament de modificare a
Regulamentului Autorității de Supraveghere Financiară nr. 3/2013 pentru autorizarea și
funcționarea contrapărților centrale emis în conformitate cu prevederile Regulamentului
(UE) nr. 648/2012 al Parlamentului European și al Consiliului din 4 iulie 2012 privind
instrumentele financiare derivate extrabursiere,
contrapărțile centrale și registrele centrale de tranzacții**

- Proiect -

În temeiul prevederilor art. 1 alin. (2), art. 2 alin. (1) lit. a) și d), art. 3 alin. (1) lit. b), art. 6 alin. (2) și ale art. 14 din Ordonanța de urgență a Guvernului nr. 93/2012 privind înființarea, organizarea și funcționarea Autorității de Supraveghere Financiară, aprobată cu modificări și completări prin Legea nr. 113/2013, cu modificările și completările ulterioare,
având în vedere prevederile art. 187 - 191 și ale art. 234 lit.a) din Legea nr. 126/2018 privind piețele de instrumente financiare, cu modificările și completările ulterioare,
potrivit deliberărilor Consiliului Autorității de Supraveghere Financiară din ședința din data de 2022,

Autoritatea de Supraveghere Financiară emite prezentul regulament.

Art. I. - Regulamentul Autorității de Supraveghere Financiară nr. 3/2013 pentru autorizarea și funcționarea contrapărților centrale emis în conformitate cu prevederile Regulamentului (UE) nr. 648/2012 al Parlamentului European și al Consiliului din 4 iulie 2012 privind instrumentele financiare derivate extrabursiere, contrapărțile centrale și registrele centrale de tranzacții, aprobat prin Hotărârea Consiliului Autorității de Supraveghere Financiară nr. 28/2013, publicată în Monitorul Oficial al României, Partea I, nr. 552 din 30 august 2013, cu modificările și completările ulterioare, se modifică după cum urmează:

1. La articolul 2, alineatele (1) și (2) se modifică și vor avea următorul cuprins:

„Art. 2. -(1) Termenii și expresiile utilizate în prezentul regulament au semnificațiile prevăzute în Regulamentul (UE) nr. 648/2012 și în normele europene emise în aplicarea acestuia, în Legea nr.126/2018 privind piețele de instrumente financiare, cu modificările și completările ulterioare, denumită în continuare *Legea nr.126/2018*, și în reglementările emise în aplicarea acesteia de Autoritatea de Supraveghere Financiară, denumită în continuare A.S.F.

(2) Contrapartea centrală se interpune între contrapărțile la contractele tranzacționate pe una sau mai multe piețe financiare, devenind astfel cumpărător pentru fiecare vânzător și vânzător pentru fiecare cumpărător și este responsabilă pentru funcționarea unui sistem de compensare.”

2. La articolul 2 alineatul (3), partea introductivă și punctul 11 se modifică și vor avea următorul cuprins:

„(3) Termenii și expresiile de mai jos au următoarele semnificații:

...

11. participație calificată - definiția menționată la punctul 20 al art.2 din Regulamentul (UE) nr.648/2012;”

3. Articolul 3 se modifică și va avea următorul cuprins:

„Art. 3. - În vederea autorizării și pe toată perioada funcționării, contrapartea centrală trebuie să îndeplinească condițiile prevăzute în Regulamentul (UE) nr.648/2012, în normele europene emise în aplicarea acestuia, precum și prevederile capitolului III al titlului VI din Legea nr.126/2018, precum și prevederile prezentului regulament.”

4. La articolul 4 alineatul (2), literele g), l), n), p) și q) se modifică și vor avea următorul cuprins:

„g) pentru acționarii persoane fizice sau juridice, cu dețineri directe ori indirecte reprezentând o participație calificată într-o contraparte centrală documentele și informațiile prevăzute în Regulamentul A.S.F. nr. 3/2016 privind criteriile aplicabile și procedura pentru evaluarea prudentială a achizițiilor și majorărilor participațiilor la entitățile reglementate de Autoritatea de Supraveghere Financiară, cu modificările și completările ulterioare, denumit în continuare Regulamentul A.S.F. nr.3/2016;

...

l) declarația pe propria răspundere, sub semnătură olografă, din partea reprezentantului legal al contrapărții centrale, din care să rezulte faptul că societatea respectivă respectă prevederile Legii nr.126/2018, prevederile reglementărilor europene incidente, precum și prevederile prezentului regulament;

...

n) raport de audit la nivelul procesului de implementare, realizat de către un auditor de securitate informatică, cu calificări profesionale și certificări, inclusiv certificare CISA - Certified Information Security Auditor, auditor independent față de contrapartea centrală, care va certifica cel puțin următoarele:

- (i) revizuirea documentației de implementare: strategie, metodologie, și implementarea acestora în cadrul proiectului;

- (ii) evaluarea funcționării sistemului, inclusiv evaluarea relevanței proceselor de afaceri – workflows - și implementarea efectivă a acestora în cadrul proiectului de implementare;
- (iii) testarea interfațării cu sistemele informatice utilizate de către entitățile implicate în fluxul de implementare;
- (iv) rezultatele obținute în urma derulării testelor de acceptanță realizate în mediile de test, conform prevederilor art. 9 din Regulamentul delegat (UE) nr. 153/2013 al Comisiei din 19 decembrie 2012 privind completarea Regulamentului (UE) nr.648/2012 al Parlamentului European și al Consiliului din 4 iulie 2012, în ceea ce privește standarde tehnice de reglementare privind cerințele pentru contrapărțile centrale; mediile de test folosite sunt copia fidelă a modulelor de producție ale sistemelor informatice ce vor utilizate de CCP ulterior prestării efective a serviciilor; în cazul unei entități nou înființate, acesta este transmis A.S.F. până cel târziu la data acordării autorizației de către A.S.F. conform Regulamentului (UE) nr.648/2012.

...

p) copia contractului încheiat între societate și auditorul intern, în situația în care activitatea de audit intern este externalizată;

q) documentele prevăzute de Regulamentul A.S.F. nr. 1/2019 privind evaluarea și aprobarea membrilor structurii de conducere și a persoanelor care dețin funcții-cheie în cadrul entităților reglementate de Autoritatea de Supraveghere Financiară, pentru membrii structurii de conducere și persoanele care dețin funcții-cheie, cu modificările și completările ulterioare, denumit în continuare *Regulamentul A.S.F. nr. 1/2019*;

5. La articolul 4 alineatul (2), litera r) se abrogă.

6. La articolul 4alineatul (2), după litera s) se introduce o literă nouă, litera s¹), cu următorul cuprins:

„s¹) copia contractului de servicii încheiat cu entitatea care oferă soluția tehnică pentru sistemul IT folosit de contrapartea centrală în cazul în care a fost aleasă această soluție tehnică, dacă este cazul.”

7. La articolul 4,alineatul (2), litera ș) se abrogă.

8. La articolul 4, alineatele (4) și (5) se modifică și vor avea următorul cuprins:

„(4) Pentru documentele menționate la alin. (2), cu excepția celor prevăzute la alin. (2) lit. h) și i), vor fi depuse și traduceri legalizate în limba engleză.

(5) Evaluarea acționarilor prevăzuți la alin. (2) lit. g) conform prevederilor art. 31 și 32 din Regulamentul (UE) nr. 648/2012 se realizează în baza procedurilor, criteriilor și documentelor prevăzute de Regulamentul A.S.F nr.3/2016.”

9. La articolul 4, după alineatul (7) se introduce un alineat nou, alineatul (7¹), cu următorul cuprins:

„(7¹) Conform art. 17 alin. (4) din Regulamentul (UE) nr.648/2012, A.S.F. acordă autorizația CPC dacă aceasta este desemnată ca sistem conform Legii nr. 253/2004 privind caracterul definitiv al decontării în sistemele de plăți și în sistemele de decontare a operațiunilor cu instrumente financiare, cu modificările și completările ulterioare.”

10. La articolul 4, după alineatul (8) se introduce un alineat nou, alineatul (9), cu următorul cuprins:

„(9) La o lună după data începerii prestării efective a serviciilor, CPC va transmite A.S.F. un raport de audit care să certifice îndeplinirea condițiilor prevăzute la art. 25 din Legea nr.362/2018 privind asigurarea unui nivel comun ridicat de securitate a rețelelor și sistemelor informatice.”

11. La articolul 8, alineatele (1),(3) și (4) se modifică și vor avea următorul cuprins:

„Art. 8 - (1) În cazul retragerii autorizației în conformitate cu prevederile art. 20 din Regulamentul (UE) nr. 648/2012, cu excepția situației de solicitare a retragerii la cerere a autorizației, consiliul de administrație/consiliul de supraveghere/directoratul va efectua numai acte de administrare în sensul conservării patrimoniului existent la data retragerii autorizației, precum și supravegherea transferului operațiunilor, pozițiilor, garanțiilor (marjelor) și al fondului de garantare către o altă societate autorizată în baza Regulamentului (UE) nr. 648/2012 să efectueze operațiunile specifice contrapărții centrale și publicarea acestei situații, dacă este cazul.

...

(3) Transferul operațiunilor, pozițiilor, garanțiilor (marjelor) și al fondului de garantare către o altă contraparte centrală, dacă este cazul, va fi efectuat în cel mai scurt timp posibil, astfel încât să se evite pe cât posibil acumularea de pierderi în contul membrilor compensatori și al clienților acestora.”

„(4) În situația în care A.S.F. apreciază că societatea riscă să intre în insolvență, va adopta măsuri corespunzătoare în conformitate cu prevederile Regulamentului (UE) 2021/23 AL PARLAMENTULUI EUROPEAN ȘI AL CONSILIULUI din 16 decembrie 2020 privind un cadru pentru redresarea și rezoluția contrapărților centrale și de modificare a Regulamentelor (UE) nr. 1095/2010, (UE) nr. 648/2012, (UE) nr. 600/2014, (UE) nr. 806/2014 și (UE) 2015/2365 și a Directivelor 2002/47/CE, 2004/25/CE, 2007/36/CE, 2014/59/UE și (UE) 2017/1132, cu reglementările emise în aplicarea acestui regulament.”

12. La articolul 12 alineatul (1), partea introductivă și litera i) se modifică și vor avea următorul cuprins:

„Art.12. - (1) O contraparte centrală are obligația de întocmire a unor reglementări proprii prin care să se asigure îndeplinirea de către societate, consiliul de administrație și directori, respectiv consiliul de supraveghere și directoratul societății, angajații, participanții la contrapartea centrală și investitori a prevederilor Legii nr.126/2018, a normelor europene incidente și a prevederilor prezentului regulament, care trebuie să cuprindă cel puțin următoarele:

...

i) politici de continuitate a activității și un plan de redresare în caz de dezastru în conformitate cu prevederile art. 34 para (1) din Regulamentul (UE) nr. 648/2012 și ale art. 17-21 din Regulamentul delegat (UE) nr. 153/2013, precum și o procedură adecvată pentru a asigura decontarea corectă și la timp sau transferul activelor și pozițiilor clienților și ale membrilor compensatori în caz de retragere a autorizației în urma unei decizii luate în temeiul art. 20 din Regulamentul (UE) nr. 648/2012, în conformitate cu prevederile art. 34 para (2) din același regulament.”

13. La articolul 12, alineatul (3) se modifică și va avea următorul cuprins:

„(3) Orice modificare a reglementărilor proprii prevăzute la alin. (1) lit. b), e), f), i), j), l), n)-s) și t) este supusă autorizării A.S.F., anterior intrării în vigoare a acesteia. Autorizația pentru modificarea reglementărilor se emite de A.S.F. în termen de maximum 60 de zile de la data depunerii documentației complete pentru modificarea respectivă, cu excepția situațiilor în care modificarea reglementărilor se referă la extinderea obiectului de activitate al contrapărții centrale, pentru care se acordă autorizație în termen de 6 luni de la data depunerii documentației complete. Orice modificare a reglementărilor proprii, altele decât cele menționate la teza I, sunt notificate A.S.F. cu minimum 30 de zile anterior intrării în vigoare a acestora.”

14. La articolul 13, alineatul (3) se modifică și va avea următorul cuprins:

„(3) Contrapartea centrală are cel puțin doi angajați în cadrul structurii de conformitate. Prin excepție, de la teza I, de la data obținerii autorizației A.S.F. până la data începerii efective a prestării serviciilor, contrapartea centrală are cel puțin un angajat în cadrul structurii de conformitate.”

15. La articolul 15, alineatele (1) și (2) se modifică și vor avea următorul cuprins:

„Art. 15. - (1) În vederea evaluării caracterului adecvat al unui achizitor potențial conform prevederilor art. 31 și 32 din Regulamentul (UE) nr. 648/2012, achizitorul potențial are obligația de a transmite A.S.F. documentele și informațiile menționate în Regulamentul A.S.F. nr.3/2016.

(2) Actul constitutiv al contrapărții centrale trebuie să conțină prevederi referitoare la procentele menționate la art. 31 alin. (2) din Regulamentul (UE) nr. 648/2012, precum și dispoziții referitoare la aplicarea procedurii stabilite de art. 272 din Legea nr.126/2018.”

16. Articolul 19 se modifică și va avea următorul cuprins:

„Art. 19. - Atribuțiile și responsabilitățile consiliului de administrație și ale directorilor, respectiv ale consiliului de supraveghere și ale directoratului vor fi stabilite în actul constitutiv al societății, în conformitate cu Legea nr. 31/1990, republicată, cu modificările și completările ulterioare, cu respectarea prevederilor Legii nr.126/2018, ale prevederilor art. 26 și 27 din Regulamentul (UE) nr. 648/2012 și ale cap. III din Regulamentul delegat (UE) nr. 153/2013.”

17. Articolul 21 se modifică și va avea următorul cuprins:

„Art. 21. - Contrapartea centrală trebuie să garanteze nerepudierea tranzacțiilor în conformitate cu prevederile Regulamentul delegat (UE) 2017/582 al Comisiei din 29 iunie 2016 de completare a Regulamentului (UE) nr. 600/2014 al Parlamentului European și al Consiliului în ceea ce privește standardele tehnice de reglementare care prevăd obligația de compensare a instrumentelor financiare derivate tranzacționate pe piețele reglementate și termenele pentru acceptarea compensării.”

18. După articolul 23 se introduce un articol nou, articolul 23¹, cu următorul cuprins:

„Art. 23¹. - În situația în care contrapartea central externalizează funcții operaționale, servicii sau activități, aceasta rămâne pe deplin răspunzătoare de îndeplinirea obligațiilor care îi revin și se asigură în orice moment că respectă cerințele art. 35 din Regulamentul (UE) nr. 648/2012.”

19. La articolul 24 alineatul (1), litera j) se abrogă.

20. La articolul 24, alineatul (2) se modifică și va avea următorul cuprins:

„(2) Contrapartea centrală va supune validării A.S.F., individual, înaintea începerii exercitării mandatului, membrii consiliului de administrație/consiliului de supraveghere și va supune autorizării A.S.F. modificarea componenței, prezentând pentru fiecare membru documentele prevăzute de Regulamentul A.S.F. nr.1/2019.”

21. La articolul 28, literele c) și e) se modifică și vor avea următorul cuprins:

„c) aprobarea prealabilă a B.N.R. pentru orice modificare adusă sistemului de decontare a operațiunilor cu instrumente financiare, conform art. 404 alin. (1) din Ordonanța de urgență a Guvernului nr. 99/2006, aprobată cu modificări și completări prin Legea nr. 227/2007, cu modificările și completările ulterioare, dacă este cazul;

...

e) dovada vărsării capitalului social în cazul majorării capitalului social, respectiv fundamentarea necesității reducerii acestuia și raportul auditorului financiar cu privire la legalitatea majorării/reducerii capitalului social, pentru modificarea prevăzută la art. 24 alin. (1) lit. b);”

22. Articolul 29 se modifică și va avea următorul cuprins:

„Art. 29.- În vederea derulării în condiții de siguranță a operațiunilor specifice desfășurate cu instrumente financiare, contrapartea centrală trebuie să organizeze și să evalueze separat activitatea, delimitând responsabilitățile personalului implicat în operațiuni cu instrumente financiare, precum și ale personalului responsabil cu administrarea riscului, ale personalului care asigură funcția de conformitate.”

23. La articolul 32 alineatul (1), litera b) se modifică și va avea următorul cuprins:

„b) să închidă forțat pozițiile deschise deținute de client, până la acoperirea necesarului de marjă, în cazul în care deficitul nu a fost acoperit în termenul prevăzut în contract și contul de marjă nu se încadrează în limitele impuse, în cazul în care specificul instrumentului permite acest lucru.”

24. La articolul 35, alineatul (1) se modifică și va avea următorul cuprins:

„Art. 35. - (1) Membrul non-compensator trebuie să semneze un acord de compensare cu un singur membru compensator general.”

25. La articolul 37 alineatul (1), litera b) se modifică și va avea următorul cuprins:

„b) cerințe privind condițiile minime stabilite de CPC ce trebuie îndeplinite de personalul membrilor compensatori desemnați în relația cu contrapartea centrală;”

26. La articolul 38, alineatul (2) se modifică și va avea următorul cuprins:

„(2) În cazul suspendării membrului compensator, contrapartea centrală poate permite acestuia efectuarea de operațiuni care să aibă ca efect diminuarea/controlul expunerilor.”

27. Articolul 46 se modifică și va avea următorul cuprins:

„Art. 46. - A.S.F. supraveghează desfășurarea ordonată și transparentă a activității contrapărții centrale. Pentru respectarea prevederilor Legii nr.126/2018, ale reglementărilor emise de A.S.F. în aplicarea acesteia, ale prezentului regulament, ale Regulamentului (UE) nr. 648/2012, precum și ale normelor europene emise în aplicarea acestuia, A.S.F. poate solicita date, informații și documente necesare în vederea desfășurării activității de supraveghere, precum și organiza inspecții la sediul/sediile contrapărții centrale. ”

28. Articolul 49 se modifică și va avea următorul cuprins:

„Art. 49. - (1) Contrapartea centrală are obligația să transmită A.S.F., anual, în termen de maximum 150 de zile de la încheierea exercițiului financiar, un raport care trebuie să cuprindă:

a) situațiile financiare anuale compuse din: situația activelor, datoriilor și capitalurilor proprii, situația veniturilor și cheltuielilor, situația modificărilor capitalului propriu, situația fluxurilor de trezorerie, note explicative și raportul administratorilor;

b) raportul auditorului financiar împreună cu opinia sa;

c) raportul auditorului intern;

d) structura acționarilor contrapărții centrale, cu indicarea pentru fiecare acționar a numărului și tipului de acțiuni deținute, precum și a procentului de acțiuni cu drept de vot deținute;

e) lista membrilor compensatori;

f) raportul de activitate al contrapărții centrale;

g) un raport de evaluare a riscurilor la care CPC este sau poate fi expusă care să includă și riscurile pe care le suportă CPC din partea membrilor săi compensatori și, în măsura în care este posibil, din partea clienților, precum și riscurile pe care ea însăși le prezintă pentru aceștia, și riscurile pe care le suportă și le prezintă pentru alte entități, printre altele pentru contrapărțile centrale interoperabile, sistemele de plată și de decontare a titlurilor de valoare, băncile de decontare, furnizorii de lichidități, depozitarii centrali de valori mobiliare, locurile de tranzacționare deservite de CPC și alți furnizori de servicii critice, conform art. 4 alin.(2) din Regulamentul delegat (UE) nr. 153/2013.

(2) Comitetul de audit al CPC întocmește un raport anual privind activitatea desfășurată potrivit atribuțiilor sale și îl transmite A.S.F., cu respectarea cerințelor reglementărilor A.S.F. privind activitatea de audit statutar la entitățile autorizate, reglementate și supravegheate de către A.S.F. Raportul anual va cuprinde și recomandările formulate și adresate consiliului de administrație/consiliului de supraveghere cu privire la controlul intern, auditul intern și auditul financiar.”

29. Articolul 50 se modifică și va avea următorul cuprins:

„Art. 50. - (1) Contrapartea centrală are obligația să transmită A.S.F., pentru semestrul I al anului, în termen de 45 de la sfârșitul perioadei de raportare, un raport semestrial cuprinzând:

a) situațiile financiare semestriale compuse din: situația activelor, datoriilor și capitalurilor proprii, situația veniturilor și cheltuielilor, situația modificărilor capitalului propriu, situația fluxurilor de trezorerie, note explicative;

b) un raport de activitate;

c) un raport privind evaluarea riscurilor în perioada analizată în condițiile art. 49 lit. g);

d) un raport privind eficiența sistemului CPC de management al riscurilor și adecvarea mecanismelor de control intern pentru primul semestru.

(2) Contrapartea centrală are obligația de a transmite A.S.F., trimestrial, un raport cuprinzând următoarele informații:

a) situațiile financiare semestriale compuse din: situația activelor, datoriilor și capitalurilor proprii, situația veniturilor și cheltuielilor, situația modificărilor capitalului propriu, situația fluxurilor de trezorerie, precum și cauzele care au determinat apariția unor modificări față de conținutul raportărilor trimestriale anterioare, dacă este cazul;

b) situația plasamentelor efectuate și a activelor financiare cu grad mare de lichiditate;

c) situația privind gestionarea fondului/fondurilor de garantare conform Regulamentului (UE) nr. 648/2012;

d) raportul de evaluare a riscurilor pentru ultimul trimestru;

e) un raport privind conformitatea raportării informațiilor referitoare la orice contract derivat pe care l-au încheiat și la orice modificare sau încetare a contractului către un registru central de tranzacții sau, după caz, către ESMA conform art. 9 din EMIR și corectitudinea informațiilor raportate;

f) un raport privind testele de stres (rezistență), simulările de criză în sens invers realizate, precum și rezultatele testării procedurilor aplicabile în situații de neîndeplinire a obligațiilor de plată și ale examinării modelelor aplicate;

g) raportarea indicatorilor calculați în scopul Regulamentului (UE) nr. 575/2013 al Parlamentului European și al Consiliului din 26 iunie 2013 privind cerințele prudențiale pentru instituțiile de credit și de modificare a Regulamentului (UE) nr. 648/2012; atunci când deține mai multe fonduri de garantare CPC raportează informațiile pentru fiecare fond de garantare separat.

(3) Raportările trimestriale se transmit A.S.F. în cel mult 30 de zile de la sfârșitul fiecărui trimestru.

30. Articolul 53 se modifică și va avea următorul cuprins:

„**Art. 53.** - În scopul exercitării atribuțiilor A.S.F. de supraveghere a activității contrapărții centrale, auditorii financiari ai contrapărții vor raporta A.S.F. orice fapt sau act în legătură cu activitatea contrapărții centrale. Informațiile cuprinse în raportul auditorului financiar cu privire la operațiunile de compensare-decontare efectuate de contrapartea centrală vor fi transmise și B.N.R.”

31. Articolul 56 se modifică și va avea următorul cuprins:

„**Art. 56.** - Nerespectarea prevederilor prezentului regulament se sancționează potrivit dispozițiilor titlului X din Legea nr.126/2018.”

32. La Anexa nr.2 , Partea III, litera C), pct.a) se modifică și va avea următorul cuprins:

„a) Testele de senzitivitate pe care CPC le-a adoptat pentru evaluarea gradului de acoperire al modelului său de calculare a marjei în diferite condiții de piață, utilizând date istorice privind condiții de criză a pieței care deja s-au materializat și date ipotetice pentru condiții de criză a pieței care nu s-au materializat. În cazul unei entități nou înființate, care nu a desfășurat activități de compensare până la momentul transmiterii solicitării de autorizare, testele se vor realiza pe baza pozițiilor/portofoliilor estimate pentru toate produsele propuse spre a fi compensate.”

33. La Anexa nr.2 , Partea VI, litera F), pct.a) se modifică și va avea următorul cuprins:

„a) Simulările de criză în sens invers pe care CPC le-a adoptat pentru identificarea condițiilor de piață în care combinația dintre marje, fondul său de garantare și celelalte resurse financiare nu ar asigura o acoperire suficientă a expunerilor de credit și pentru care resursele sale financiare lichide ar putea fi insuficiente. În cazul unei entități nou înființate, care nu a desfășurat activități de compensare până la momentul transmiterii solicitării de autorizare, simulările se vor realiza pe baza pozițiilor/portofoliilor estimate pentru toate produsele propuse spre a fi compensate.”

Art. II. - Prezentul regulament se publică în Monitorul Oficial al României, Partea I, și intră în vigoare la data publicării.

**Președintele Autorității de Supraveghere Financiară,
Nicu MARCU**

București,
Nr.