

REFERAT DE APROBARE

privind proiectul de regulament de modificare a Regulamentului A.S.F. 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, cu modificările și completările ulterioare

Regulamentul A.S.F. nr.3/2013 stabilește norme privind autorizarea și funcționarea contrapărților centrale, 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 (EMIR), precum și în conformitate cu prevederile normelor europene emise în aplicarea acestuia.

Propunerile de modificare a Regulamentului ASF nr. 3/2013 supuse consultării publice vizează următoarele aspecte:

- a) modificarea lit.n) alin.(2) art. 4 referitor la raportul de audit care trebuie transmis la momentul depunerii cererii de autorizare, prin introducerea unui 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.

- b) abrogarea documentului care trebuie să însoțească cererea de autorizare a unei CCP prevăzut la lit. ș) alin.(2) art.4;
- c) completarea prevederilor art. 12 referitoare la politicile/procedurile/regulile ce trebuie întocmite și depuse o dată cu cererea de autorizare a unei CCP cu 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;
- d) introducerea unei excepții de la obligația de a avea cel puțin doi angajați în cadrul structurii de conformitate a CCP, astfel că, până la data începerii efective a prestării serviciilor, se permite existența unui singur angajat în cadrul acestei structuri;
- e) completarea informațiilor care trebuie cuprinse în rapoartele anuale, semestriale și trimestriale, în sensul detalierei situațiilor financiare care sunt compuse din situația activelor, datoriilor și capitalurilor proprii, situația veniturilor și cheltuielilor, situația modificărilor capitalului propriu, situația fluxurilor de trezorerie și note explicative și a introducerii raportului auditorului intern, a raportului de evaluare a riscurilor la care CCP este sau ar putea fi expusă, a raportului 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, etc precum și modificarea termenelor de raportare (30 de zile de la sfârșitul fiecărui trimestru, pentru rapoartele trimestriale, 45 de zile de la sfârșitul perioadei de raportare, pentru rapoartele semestriale);
- f) modificarea unor prevederi în urma revizuirii trimiterilor la legislația aplicabilă în prezent contrapărților centrale (*Legea nr.126/2018 privind piețele de instrumente financiare, Regulamentul ASF 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 , Regulamentul ASF nr.3/2016 privind criteriile aplicabile și procedura pentru evaluarea prudențială a achizițiilor și majorărilor participațiilor la entitățile reglementate de Autoritatea de Supraveghere Financiară, cu modificările și completările ulterioare*);
- g) actualizarea informațiilor din Anexa nr.2 cu informații specifice unei CCP nou înființate;
- h) modificarea unor prevederi pentru clarificarea/claritatea dispozițiilor respective.