



V Bruseli 11. 11. 2016
C(2016) 7158 final

ANNEX 1

PRÍLOHY

k

DELEGOVANÉMU NARIADENIU KOMISIE (EÚ) .../...,

ktorým sa dopĺňa nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 909/2014, pokiaľ ide o regulačné technické predpisy týkajúce sa určitých prudenciálnych požiadaviek na centrálné depozitáre cenných papierov a určené úverové inštitúcie poskytujúce vedľajšie služby bankového typu

PRÍLOHA

Scenáre likvidácie alebo reštrukturalizácie

1. Scenár, keď centrálny depozitár cenných papierov nie je schopný získať nový kapitál, aby splnil požiadavky stanovené v článku 47 ods. 1 nariadenia (EÚ) č. 909/2014, sa považuje za spustenie reštrukturalizácie centrálného depozitára cenných papierov („reštrukturalizácia“), keď by udalosti opísané v scenári stále viedli centrálny depozitár cenných papierov, aby naďalej prevádzkoval systém vyrovnania transakcií s cennými papiermi podľa oddielu A bodu 3 prílohy k nariadeniu (EÚ) č. 909/2014 a poskytoval aspoň jednu ďalšiu hlavnú službu uvedenú v oddiele A prílohy k nariadeniu (EÚ) č. 909/2014.
2. Scenár, keď centrálny depozitár cenných papierov nie je schopný získať nový kapitál, aby splnil požiadavky stanovené v článku 47 ods. 1 nariadenia (EÚ) č. 909/2014, sa považuje za spustenie likvidácie jeho činností („likvidácia“), keď by udalosti opísané v scenári spôsobili, že centrálny depozitár cenných papierov nemôže splniť vymedzenie uvedené v článku 2 ods. 1 nariadenia (EÚ) č. 909/2014.
3. Scenáre uvedené v článku 7 písm. a) zahŕňajú tieto posúdenia:
 - a) v prípade reštrukturalizácie centrálny depozitár cenných papierov posúdi očakávaný počet mesiacov potrebných na zabezpečenie riadnej reštrukturalizácie svojich činností;
 - b) v prípade likvidácie očakávaný počet mesiacov potrebných na likvidáciu.
4. Scenáre musia byť primerané povahe obchodnej činnosti centrálného depozitára cenných papierov, jeho veľkosti, jeho prepojenosti s ďalšími inštitúciami a s finančným systémom, jeho obchodnému modelu a modelu financovania, jeho činnostiam a štruktúre, ako aj akýmkoľvek zisteným zraniteľným miestam alebo nedostatkom centrálného depozitára cenných papierov. Scenáre sú založené na udalostiach, ktoré sú výnimočné, ale reálne.
5. Centrálny depozitár cenných papierov spĺňa pri navrhovaní scenárov každú z týchto požiadaviek:
 - a) udalosti, ktoré scenár predvída, by mohli spôsobiť reštrukturalizáciu činností centrálného depozitára cenných papierov;
 - b) udalosti, ktoré scenár predvída, by mohli spôsobiť likvidáciu činností centrálného depozitára cenných papierov.
6. Plán zabezpečujúci riadnu reštrukturalizáciu alebo likvidáciu činností centrálného depozitára cenných papierov uvedený v článku 47 ods. 2 písm. b) nariadenia (EÚ) č. 909/2014 zahŕňa všetky tieto scenáre („idiosynkratické udalosti“):
 - a) zlyhanie významných protistrán;
 - b) poškodenie dobrého mena inštitúcie alebo skupiny;
 - c) závažný odlev likvidity;
 - d) nepriaznivé pohyby cien aktív, ktorým sú inštitúcia alebo skupina prevažne vystavené;
 - e) závažné úverové straty;
 - f) závažná strata vyplývajúca z operačného rizika.

7. Plán zabezpečujúci riadnu reštrukturalizáciu alebo likvidáciu činností centrálného depozitára cenných papierov podľa článku 47 ods. 2 písm. b) nariadenia (EÚ) č. 909/2014 zahŕňa všetky tieto scenáre („systémové udalosti“):
- a) zlyhanie významných protistrán majúce vplyv na finančnú stabilitu;
 - b) zníženie likvidity dostupnej na trhu s medzibankovými úvermi;
 - c) zvýšené riziko krajiny a všeobecný odlev kapitálu z významnej krajiny pôsobenia inštitúcie alebo skupiny;
 - d) nepriaznivé pohyby cien aktív na jednom alebo viacerých trhoch;
 - e) makroekonomický pokles.