

НАРЕДБА № 75 от 06.04.2023 г. за изискванията към дейността на администраторите на бенчмаркове

Обн. - ДВ, бр. 35 от 18.04.2023 г.

Приета с Решение № 254-Н от 6.04.2023 г. на Комисията за финансов надзор

Глава първа ОБЩИ ПОЛОЖЕНИЯ

Чл. 1. С тази наредба се уреждат:

1. изисквания, на които трябва да отговарят администраторите на бенчмаркове с малка значимост, относно функцията по наблюдение по чл. 5 от Регламент (ЕС) 2016/1011 на Европейския парламент и на Съвета от 8 юни 2016 г. относно индекси, използвани като бенчмаркове за целите на финансови инструменти и финансови договори или за измерване на резултатите на инвестиционни фондове, и за изменение на директиви 2008/48/ЕО и 2014/17/ЕС и на Регламент (ЕС) № 596/2014 (ОВ, L 171/1 от 29 юни 2016 г.), наричан по-нататък „Регламент (ЕС) 2016/1011“, входящите данни по чл. 11 от Регламент (ЕС) 2016/1011 и прозрачността на методиката по чл. 13 от Регламент (ЕС) 2016/1011;

2. изисквания за управлението и контрола за поднадзорните доставчици на входящи данни по чл. 16 от Регламент (ЕС) 2016/1011;

3. изисквания към администраторите на критични и значими бенчмаркове, когато се провежда консултация относно съществени промени в методиката или относно използването на алтернативна методика при извънредни обстоятелства, заедно с подходяща функция по наблюдение;

4. изисквания към администраторите на критични бенчмаркове, когато възлагат услуги „в облак“ на външни доставчици;

5. изисквания към администраторите на критични и значими бенчмаркове, както и на бенчмаркове с малка значимост, относно съхраняването на данни, свързани с използването на алтернативна методика.

Глава втора ИЗИСКВАНИЯ КЪМ АДМИНИСТРАТОРИТЕ НА БЕНЧМАРКОВЕ С МАЛКА ЗНАЧИМОСТ

Раздел I

Изисквания към функцията по наблюдение по чл. 5 от Регламент (ЕС) 2016/1011 на администратор на бенчмарк с малка значимост

Чл. 2. (1) Администраторът на бенчмарк с малка значимост установява и поддържа функция по наблюдение по смисъла на чл. 5, параграф 4 от Регламент (ЕС) 2016/1011.

(2) Функцията по наблюдение се изпълнява от един или повече членове, които заедно притежават необходимите умения и опит за осъществяване на наблюдение на изготвянето на конкретен бенчмарк и за отговорностите, които функцията по наблюдение трябва да изпълнява. Членовете на функцията по наблюдение притежават познания за базовия пазар или за икономическите показатели, които бенчмаркът има за цел да измерва, както и за различните видове ползватели на бенчмарка и доставчици на входящи данни за бенчмарка.

(3) Администраторът на бенчмаркове от регулирани данни може да включи като членове на функцията по наблюдение представители на лицата, изброени в определението на „бенчмарк от регулирани данни“ в чл. 3, параграф 1, т. 24 от Регламент (ЕС) 2016/1011.

(4) Администраторът на бенчмарк гарантира, че членовете на функцията по наблюдение с конфликт на интереси са по-малко от останалите членове, в случаите, когато даден бенчмарк се основава на предоставени входящи данни и представителите на доставчиците на входящи данни, или на поднадзорните субекти, които използват бенчмарка, са членове на функцията по наблюдение. Преди назначаването на членовете по изречение първо администраторът трябва да идентифицира и да вземе предвид конфликтите, произтичащи от взаимоотношенията между потенциалните членове и други външни заинтересовани страни.

(5) Лица, които са участвали пряко в изготвянето на бенчмарк и които са членове на функцията по наблюдение, не трябва да имат право на глас.

(6) Представители на управителния или контролния орган на администратора не могат да бъдат членове или наблюдатели, но могат да присъстват на заседания на функцията по наблюдение без право на глас.

(7) Членове на функцията по наблюдение не могат да са лица, на които са налагани административни или наказателни санкции във връзка с манипулиране на пазара на финансови инструменти или опит за манипулиране съгласно Регламент (ЕС) № 596/2014 на Европейския парламент и на Съвета от 16 април 2014 г. относно пазарната злоупотреба (Регламент относно пазарната злоупотреба) и за отмяна на Директива 2003/6/ЕО на Европейския парламент и на Съвета и директиви 2003/124/ЕО, 2003/125/ЕО и 2004/72/ЕО на Комисията (ОВ, L 173/1 от 12 юни 2014 г.).

Чл. 3. (1) Функцията по наблюдение е част от организационната структура на администратора на бенчмарк с малка значимост или на дружеството майка на групата, към която принадлежи администраторът, но трябва да бъде отделена от управителния и контролния орган на администратора на бенчмарк и от други ръководни функции на администратора на бенчмарк.

(2) Функцията по наблюдение преценява и когато е необходимо, изразява несъгласие с решенията на управителния и контролния орган на администратора по отношение на изпълнението на изискванията на Регламент (ЕС) 2016/1011. Функцията по наблюдение изготвя препоръки във връзка с наблюдението на бенчмарк до управителния орган, съответно контролния орган на администратора.

(3) Когато функцията по наблюдение установи, че управителният или контролният орган на администратора е предприел или възнамерява да предприеме действия, които противоречат на нейни препоръки или решения, тя отразява ясно това обстоятелство в протокола от следващото си заседание или в регистъра на решенията си.

Чл. 4. (1) Функцията по наблюдение на администратор на бенчмарк с малка значимост прилага процедури, приети от администратора на бенчмарк, които се отнасят най-малко до:

1. критериите за подбор на нейните членове;
2. избирането, номинирането или отстраняването и заместването на нейните членове;
3. временно ограничаване на правото на глас на членове, които не са представители или служители на администратора на бенчмарк, при решения, които биха повлияли пряко върху стопанската дейност на представляваните от тях организации;
4. изискване към членовете да оповестяват съществен конфликт на интереси преди обсъждане на точка от дневния ред по време на заседанията на функцията по наблюдение;
5. отвод или отстраняване на членове в случаите, когато е налице конфликт на интереси по конкретни обсъждания;
6. достъпа до документацията, необходима за изпълнение на задълженията ѝ;
7. мерките, които трябва да се предприемат при нарушения на кодекса за поведение;

8. уведомяването на Комисията за финансов надзор за всякакви предполагаеми пазарни злоупотреби от страна на доставчиците на входящи данни или на администратора на бенчмарка;

9. предотвратяването на неправомерно разкриване на чувствителна информация или защитена от закона информация, получена, изготвена или обсъждана от функцията по наблюдение;

10. публичното оповестяване на декларациите за съществени конфликти на интереси на членовете.

(2) Когато функцията по наблюдение се изпълнява от физическо лице, ал. 1, т. 3 и 5 не се прилагат и администраторът определя алтернативно подходящо звено или физическо лице, за да гарантира, че задълженията на функцията по наблюдение ще се изпълняват по последователен начин в случай на отсъствие на лицето, отговарящо за функцията по наблюдение.

(3) Алинеи 1 и 2 не се прилагат за администратори на бенчмаркове с малка значимост, които са избрали да не прилагат чл. 5, параграф 2 от Регламент (ЕС) 2016/1011.

Чл. 5. При определяне на структурата и състава на функцията по наблюдение се вземат предвид едно или повече от следните правила:

1. когато сложността или уязвимостта на бенчмаркове с малка значимост не налагат друго, функцията по наблюдение се упражнява от едно или повече физически лица, които са членове на персонала на администратора, или други физически лица, чиито услуги са предоставени на разположение на администратора или са под контрола на администратора и които не участват пряко в изготвянето на съответен бенчмарк и нямат конфликти на интереси, по-специално конфликти на интереси, произтичащи от потенциален интерес към стойността на бенчмарка;

2. функцията по наблюдение се упражнява от независим комитет за наблюдение или посредством друг подходящ механизъм за управление, който се състои от балансирано представителство на заинтересовани страни, включително поднадзорни субекти, които използват бенчмарка, доставчици на входящи данни за бенчмарка и други външни заинтересовани страни, както и независими членове и персонал на администратора, които не участват пряко в изготвянето на съответните бенчмаркове, нито в свързани с това дейности;

3. когато администраторът не е изцяло притежаван или контролиран от доставчици на входящи данни за бенчмарка или поднадзорни субекти, които го използват, и не съществуват други конфликти на интереси в рамките на функцията по наблюдение, функцията по наблюдение се упражнява от комитет за наблюдение или посредством друг подходящ механизъм за управление, който се състои от служители на администратора на бенчмарка, които не участват пряко в изготвянето на съответните бенчмаркове, нито в свързани с това дейности, или когато такива служители не са на разположение, от независими членове;

4. когато функцията по наблюдение се състои от множество комитети, подходящи механизми за управление или лица, администраторът на бенчмарка определя едно от тях, което да отговаря за цялостното ръководство и координацията на функцията по наблюдение и за взаимодействието с управителния и контролния орган на администратора и с Комисията за финансов надзор.

Раздел II

Изисквания относно входящите данни по чл. 11 от Регламент (ЕС) 2016/1011

Чл. 6. (1) За целите на чл. 11, параграф 3, букви „а“ и „б“ от Регламент (ЕС) 2016/1011 администраторът на бенчмаркове с малка значимост осигурява цялата необходима информация, за да може да проверява дали:

1. подателят има право да предоставя входящите данни от името на доставчика на входящи данни съгласно изискванията за разрешение по чл. 15, параграф 2, буква „б“ от Регламент (ЕС) 2016/1011;

2. входящите данни се предоставят от доставчика на входящи данни или се избират от източник, посочен от администратора на бенчмарка, в срок, определен от администратора;

3. входящите данни съответстват на изискванията, посочени в методиката на бенчмарка.

(2) Алинея 1, т. 1 и 2 не се прилагат за администратори на бенчмаркове с малка значимост, които са избрали да не прилагат чл. 11, параграф 1, буква „б“ от Регламент (ЕС) 2016/1011.

Чл. 7. (1) Вътрешните процедури за наблюдение и проверка на доставчика на входящи данни, наличието на които администраторът на бенчмаркове с малка значимост гарантира в съответствие с чл. 11, параграф 3, буква „б“ от Регламент (ЕС) 2016/1011, включват най-малко:

1. процедури, които уреждат:

а) предоставянето на информация на администратора по негово искане;

б) редовното докладване за изпълнение на задълженията от трите нива на контролните функции пред управителния, съответно контролния орган на доставчика на входящи данни;

в) механизмите за сътрудничество и обмен на информация между трите нива на контролните функции;

2. създаване и поддържане на вътрешна функция, която изпълнява ролята на първо ниво на контрол за предоставянето на входящите данни и:

а) извършва ефективна проверка на входящите данни преди предоставянето им;

б) извършва проверка дали подателят има право да предоставя входящи данни от името на доставчика на входящи данни съгласно изискванията по чл. 15, параграф 2, буква „б“ от Регламент (ЕС) 2016/1011;

в) гарантира, че достъпът до входящите данни е ограничен до лицата, които участват в процеса на предоставянето им, освен когато достъпът е необходим за целите на одита, разследването или за цели, изисквани от закона;

3. създаване и поддържане на вътрешна функция, която изпълнява ролята на второ ниво на контрол за предоставянето на входящите данни и отговаря за:

а) въвеждане и поддържане на процедура за подаване на сигнали за нарушения, която включва подходящи мерки за защита на лицата, които подават такива сигнали;

б) въвеждане и поддържане на процедури за вътрешно докладване за всеки опит за манипулиране или действително манипулиране на входящите данни, за всяко нарушение на свързаните с бенчмаркове политики на доставчика на входящи данни и за разследване на такива случаи незабавно, след като станат известни;

в) наблюдение на обмена на информация между служителите, които участват пряко в предоставянето на входящи данни и имат задължения, свързани с първото ниво на контрол, както и обмена на информация между тези служители и други вътрешни функции или външни лица, когато в резултат на проверките, извършени от функцията на второ ниво, се породят съмнения за неправомерни действия;

г) разработване, поддържане и функциониране на политика относно конфликтите на интереси по отношение на действителни или потенциални съществени конфликти на интереси, която осигурява: аа) идентифициране и оповестяване пред администратора на действителни или потенциални конфликти на интереси по отношение на служителите, които участват в процеса на предоставянето на входящи данни и имат задължения, свързани с първото ниво на контрол; бб) липса на пряка или косвена връзка между възнаграждението на подател на входящи данни и стойността на бенчмарка, стойността на конкретни подадени данни или извършването на дейност,

изпълнявана от доставчика на входящи данни, която би могла да доведе до конфликт на интереси във връзка с предоставянето на входящи данни за бенчмарка; вв) ясно разделение на задълженията между служителите, които участват в процеса на предоставянето на входящи данни и имат задължения, свързани с първото ниво на контрол, и другите служители от първото ниво на контрол, когато е приложимо, като се вземат предвид степента на преценка от съответните служители за използването на входящи данни, естеството, мащабът и сложността на дейностите на доставчика на входящи данни, както и дали може да възникне конфликт на интереси между предоставянето на входящи данни за бенчмарка и търговията или други дейности, извършвани от доставчика на входящи данни;

4. създаване и поддържане на вътрешна функция, независима от първото и второто ниво на контрол, която изпълнява ролята на трето ниво на контрол за предоставянето на входящите данни и отговаря за извършването на редовни проверки на контрола, осъществяван от другите две контролни функции.

(2) Алинея 1 не се прилага за администратори на бенчмаркове с малка значимост, които са бенчмаркове от регулирани данни, и за администратори на бенчмаркове с малка значимост, които са избрали да не прилагат чл. 11, параграф 3 от Регламент (ЕС) 2016/1011.

Раздел III

Изисквания относно прозрачността на методиката по чл. 13 от Регламент (ЕС) 2016/1011

Чл. 8. (1) Информацията, която администратор на бенчмарк с малка значимост или на група бенчмаркове с малка значимост предоставя в съответствие с чл. 13, параграф 1, буква „а“ от Регламент (ЕС) 2016/1011, включва най-малко следните елементи, когато е приложимо:

1. определяне и описание на бенчмарка или групата бенчмаркове с малка значимост, пазара на инструментите, включени в бенчмарка или икономическите показатели, които той има за цел да измерва;

2. валутата или друга мерна единица на бенчмарка или групата бенчмаркове с малка значимост;

3. видовете входящи данни, използвани за определяне на бенчмарка или групата бенчмаркове с малка значимост, и поредността на всеки вид;

4. описание на елементите на бенчмарка или групата бенчмаркове с малка значимост, критериите, използвани при подбора на тези елементи, и определянето на тяхната тежест;

5. минималните изисквания за количеството входящи данни и минималните стандарти за качеството на използваните входящи данни;

6. ясни правила, определящи как и кога може да се упражнява правото на преценка при определянето на бенчмарка или групата бенчмаркове с малка значимост;

7. състава на всяка група доставчици на входящи данни и критериите, използвани за определяне на допустимостта за членство в групата;

8. дали бенчмаркът или групата бенчмаркове с малка значимост взема предвид евентуално реинвестиране на дивиденди или купони, платени от негови елементи;

9. потенциалните ограничения на методиката и методика, която да се използва при изключителни обстоятелства, включително в случай на нисколиквиден пазар, в периоди на сътресения или когато източниците на данни за сделки може да са недостатъчни, неточни или ненадеждни;

10. в случаите, когато методиката може да се променя периодично с цел да се гарантира, че бенчмаркът или групата бенчмаркове продължава да бъде представителен за пазара на инструментите, включени в бенчмарка или

икономическите показатели, които той има за цел да измерва - критериите, въз основа на които се извършва тази промяна.

(2) За целите на ал. 1, т. 1 се взема предвид, когато е приложимо:

1. общи принципи за определяне на извънредните обстоятелства;
2. резюме на алтернативните начини за изчисляване на бенчмарк при извънредни обстоятелства или на всеки съществен елемент на методиката, който не може да бъде изпълнен при такива обстоятелства;
3. обхват на прилагане на всяка методика, която се използва при извънредни обстоятелства, като се взема предвид видът на базовите активи в изготвения бенчмарк;
4. обосновка за използването на методиката, посочена в т. 3, като се взема предвид обхватът на прилагане на тази методика.

Чл. 9. Информацията, която администратор на бенчмарк с малка значимост или на група бенчмаркове с малка значимост предоставя в съответствие с чл. 13, параграф 1, буква „б“ от Регламент (ЕС) 2016/1011, включва най-малко описание на политиките и процедурите, свързани с вътрешния преглед и одобрение на методиката.

Чл. 10. Информацията, която администратор на бенчмарк с малка значимост или на група бенчмаркове с малка значимост предоставя в съответствие с чл. 13, параграф 1, буква „в“ от Регламент (ЕС) 2016/1011, включва най-малко описание на информацията, която администраторът трябва да оповести в началото на всяка консултация с ползватели или заинтересовани страни, включително изискване за оповестяване на основните елементи на методиката, които според него могат да бъдат засегнати от предлаганата съществена промяна.

Глава трета

ИЗИСКВАНИЯ ЗА УПРАВЛЕНИЕТО И КОНТРОЛА ЗА ПОДНАДЗОРНИТЕ ДОСТАВЧИЦИ НА ВХОДЯЩИ ДАННИ ПО ЧЛ. 16 ОТ РЕГЛАМЕНТ (ЕС) 2016/1011

Чл. 11. Механизмите за контрол, които поднадзорният доставчик на входящи данни за бенчмаркове с малка значимост трябва да въведе съгласно чл. 16, параграф 1 от Регламент (ЕС) 2016/1011, включват установяване и поддържане най-малко на следните елементи:

1. ефективен механизъм за наблюдение на процеса на предоставяне на входящи данни, който включва система за управление на риска, идентифициране на служители с ръководни функции, които отговарят за процеса по предоставяне на данни, и участие на всички функции по осигуряване на съответствието и вътрешен одит в рамките на организацията на доставчика на входящи данни;
2. политика за подаване на сигнали за нарушения, която включва подходящи мерки за защита на лицата, които подават такива сигнали;
3. процедура за откриване и управление на нарушения на Регламент (ЕС) 2016/1011, която включва и преглед на всяко установено нарушение или грешка и документиране на предприетите действия.

Чл. 12. Системите и механизмите за контрол, които поднадзорният доставчик на входящи данни за бенчмаркове с малка значимост трябва да въведе съгласно чл. 16, параграф 2, буква „а“ от Регламент (ЕС) 2016/1011, включват документиран и ефективен процес за предоставяне на данните и най-малко следните елементи:

1. процедура за определяне на податели и за определяне на заместници;
2. процедури и системи за наблюдение на данните, които се използват за предоставянето, както и самото предоставяне на данни, които процедури и системи са способни да генерират предупредителни сигнали в съответствие с параметрите, предварително зададени от доставчика на входящи данни.

Чл. 13. (1) Мерките за управление на конфликтите на интереси, които поднадзорният доставчик на входящи данни трябва да въведе съгласно чл. 16, параграф 2, буква „в“ от Регламент (ЕС) 2016/1011, включват най-малко следното:

1. актуален регистър на съществените конфликти на интереси за документиране на всички установени съществени конфликти на интереси и всички мерки, предприети за управляването им;

2. физическо отделяне на подателите от други служители на доставчика на входящи данни, когато такова отделяне е подходящо, като се вземат предвид степента на преценка от съответните служители за използването на входящи данни, естеството, мащабът и сложността на дейностите на поднадзорния доставчик на входящи данни, както и дали може да възникне конфликт на интереси между предоставянето на входящи данни за бенчмарка и търговията или други дейности, извършвани от доставчика на входящи данни.

(2) Поднадзорният доставчик на входящи данни може да въведе правила, регламентиращи взаимодействията между подателите и служителите, участващи в предоставянето на входящи данни, като в този случай мерките по ал. 1, т. 2 не се прилагат.

(3) Мерките за управление на конфликти на интереси включват и политики за възнагражденията на подателите, които гарантират, че възнагражденията им за подаване на входящи данни за бенчмаркове с малка значимост от името на поднадзорен доставчик на входящи данни не е свързано със:

1. стойността на бенчмарка;

2. конкретните стойности на подадените данни;

3. изпълнението на конкретна дейност на поднадзорния доставчик на входящи данни, която може да породии конфликт на интереси с предоставянето на входящи данни за бенчмаркове с малка значимост.

Чл. 14. Данните за съобщенията във връзка с предоставянето на входящи данни, които поднадзорният доставчик на входящи данни трябва да съхранява съгласно чл. 16, параграф 2, буква „г“ от Регламент (ЕС) 2016/1011, включват пълна информация за предоставените входящи данни и наименованията на подателите.

Чл. 15. Членове 12 - 14 не се прилагат за предоставянето на данни за бенчмаркове с малка значимост, за които администраторът е избрал да не прилага чл. 16, параграф 2 от Регламент (ЕС) 2016/1011.

Чл. 16. (1) Политиките, които поднадзорният доставчик на входящи данни прилага съгласно чл. 16, параграф 3 от Регламент (ЕС) 2016/1011, когато входящите данни се основават на експертно мнение, включват най-малко:

1. механизъм, гарантиращ съгласуваност между различните податели и съгласуваност във времето при използването на мнение или упражняването на правото на преценка;

2. процедури за редовен преглед на всяко използване на мнение или упражняване на правото на преценка.

(2) Алинея 1 не се прилага за предоставянето на данни за бенчмаркове с малка значимост, за които администраторът е избрал да не прилага чл. 16, параграф 3 от Регламент (ЕС) 2016/1011.

Глава четвърта

ИЗИСКВАНИЯ КЪМ АДМИНИСТРАТОРИТЕ НА КРИТИЧНИ И ЗНАЧИМИ БЕНЧМАРКОВЕ

Раздел I

Изисквания към методиката, която да се използва за определяне на критичен или значим бенчмарк при изключителни обстоятелства

Чл. 17. Администраторът на критични или значими бенчмаркове, а когато е приложимо - на група от бенчмаркове, като част от подробностите за всяка методика, която да се използва при изключителни обстоятелства съгласно чл. 13, параграф 1, буква „а“ от Регламент (ЕС) 2016/1011 и чл. 2, параграф 1, буква „л“ от Делегиран регламент (ЕС) 2018/1641 на Комисията от 13 юли 2018 г. за допълнение на Регламент (ЕС) 2016/1011 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на регулаторните технически стандарти за допълнително конкретизиране на информацията, която администраторите на критични или значими бенчмаркове предоставят относно използваната методика за определяне на бенчмарка, вътрешния преглед и одобряване на методиката и относно процедурите за извършване на съществени промени в методиката (ОВ, L 274/21 от 5 ноември 2018 г.), наричан по-нататък „Делегиран регламент (ЕС) 2018/1641“, определя най-малко следните елементи, доколкото те са относими към този бенчмарк или група от бенчмаркове, или към входящите данни, използвани за определянето му, когато е приложимо:

1. общите принципи за определяне на извънредните обстоятелства, допълнени от примери за тези обстоятелства;
2. алтернативните начини за изчисляване на бенчмарка при извънредни обстоятелства или всеки ключов елемент на методиката, който не може да бъде изпълнен при такива обстоятелства;
3. обхвата на прилагане на всяка методика, която да се използва при извънредни обстоятелства, като се взема предвид видът на базовите активи в изготвения бенчмарк;
4. обосновката за използването на която и да било методика, посочена в т. 3, като се взема предвид обхватът на прилагане на тази методика;
5. периода от време, през който се очаква за изчисляване на бенчмарка да се използва методиката, посочена в т. 3;
6. дали се очаква използването на методиката, посочена в т. 3, да окаже въздействие върху стойността на бенчмарка.

Чл. 18. (1) Администраторът на критични или значими бенчмаркове, а когато е приложимо - на група от бенчмаркове, гарантира, че по-краткият срок, в който може да се проведе консултация относно предложените съществени промени в методиката, която да се използва за определяне на критичен или значим бенчмарк при извънредни обстоятелства съгласно чл. 13, параграф 1, буква „в“ и чл. 13, параграф 2 от Регламент (ЕС) 2016/1011 и чл. 4, параграф 1, буква „в“ от Делегиран регламент (ЕС) 2018/1641, е достатъчен, за да се даде възможност на ползвателите и потенциалните ползватели на бенчмарка да извършат оценка на предложените съществени промени.

(2) С цел определяне на това дали даден по-кратък срок е достатъчен, както е предвидено в ал. 1, администраторът взема предвид сложността и естеството на предложените промени, въздействието, което те биха имали върху бенчмарка, и неотложността на тяхното прилагане.

(3) Процедурите за консултация в по-кратък срок се определят по достатъчно ясен начин, за да могат ползвателите и потенциалните ползватели на бенчмарка да разберат какви са стъпките в рамките на процеса на консултиране.

Раздел II

Изисквания към функцията по наблюдение по отношение на критични и значими бенчмаркове

Чл. 19. (1) За да се гарантира, че функцията по наблюдение по отношение на критични и значими бенчмаркове съгласно чл. 5 от Регламент (ЕС) 2016/1011 и чл. 1,

параграф 3 от Делегиран регламент (ЕС) 2018/1637 на Комисията от 13 юли 2018 г. за допълване на Регламент (ЕС) 2016/1011 на Европейския парламент и на Съвета във връзка с регулаторни технически стандарти за процедурите и характеристиките на функцията по наблюдение (ОВ, L 274/1 от 5 ноември 2018 г.) се състои от изпълнители, които заедно имат уменията и експертните познания, подходящи за наблюдение на изготвянето на даден бенчмарк, и за отговорностите, които се изисква функцията по наблюдение да изпълнява, администраторът на критични или значими бенчмаркове гарантира, в зависимост от управлението на функцията по наблюдение, че изпълнителите на функцията по наблюдение заедно имат подходящ общ поглед и разбиране по отношение на различните видове ползватели на бенчмарка и на доставчиците на входящи данни за бенчмарка и съответно - са в състояние да изпълняват отговорностите на функцията по наблюдение.

(2) Когато функцията по наблюдение се изпълнява от физическо лице, ал. 1 не се прилага.

Раздел III

Възлагане на услуги „в облак“ на външни доставчици от администраторите на критични бенчмаркове

Чл. 20. При възлагане на услуги „в облак“ на външни доставчици администраторите на критични бенчмаркове спазват Насоките за възлагане на дейности на външни доставчици на компютърни услуги „в облак“ (ESMA50-164-4285), издадени от Европейския орган за ценни книжа и пазари, за които Комисията е взела решение за прилагането им съгласно чл. 13, ал. 1, т. 26 от Закона за Комисията за финансов надзор.

Глава пета

ИЗИСКВАНИЯ ОТНОСНО СЪХРАНЯВАНЕТО НА ДАННИ СЪГЛАСНО ЧЛ. 8, ПАРАГРАФ 1, БУКВА „Д“ ОТ РЕГЛАМЕНТ (ЕС) 2016/1011

Чл. 21. За всяко отклонение от стандартната методика администраторът на критични и значими бенчмаркове, както и на бенчмаркове с малка значимост, съхранява данни относно:

1. продължителността на отклонението;
2. обосновката за решението за допускане на отклонението;
3. процеса на одобрение на решението за допускане на отклонението.

ДОПЪЛНИТЕЛНИ РАЗПОРЕДБИ

§ 1. По смисъла на наредбата:

1. „**Бенчмарк с малка значимост**“ е понятие по смисъла на чл. 3, параграф 1, т. 27 от Регламент (ЕС) 2016/1011;
2. „**Значим бенчмарк**“ е понятие по смисъла на чл. 3, параграф 1, т. 26 от Регламент (ЕС) 2016/1011;
3. „**Критичен бенчмарк**“ е понятие по смисъла на чл. 3, параграф 1, т. 25 от Регламент (ЕС) 2016/1011;
4. „**Поднадзорен доставчик на входящи данни**“ е понятие по смисъла на чл. 3, параграф 1, т. 10 от Регламент (ЕС) 2016/1011.

§ 2. (1) Тази наредба въвежда изискванията на следните насоки, издадени от Европейския орган за ценни книжа и пазари:

1. Насоките относно методиката, функцията по наблюдение и съхраняването на данни съгласно Регламента за бенчмарковете (ESMA81-393-288);
2. Насоките относно бенчмарковете с малка значимост съгласно Регламента за бенчмарковете (ESMA70-145-1209).

(2) С тази наредба се осигурява прилагането на Насоките за възлагане на дейности на външни доставчици на компютърни услуги „в облак“ (ESMA50-164-4285), издадени от Европейския орган за ценни книжа и пазари.

ЗАКЛЮЧИТЕЛНИ РАЗПОРЕДБИ

§ 3. Администраторите на бенчмаркове привеждат дейността си в съответствие с изискванията на тази наредба в срок до 3 месеца от влизането ѝ в сила.

§ 4. Наредбата се издава на основание чл. 4а и чл. 227с, ал. 2 от Закона за пазарите на финансови инструменти и е приета с Решение № 254-Н от 6.04.2023 г. на Комисията за финансов надзор.

Председател: Бойко Атанасов