



V Bruseli 13. 6. 2017  
COM(2017) 331 final

ANNEX 1

## **PRÍLOHA**

*k návrhu*

### **NARIADENIA EURÓPSKEHO PARLAMENTU A RADY,**

**ktorým sa mení nariadenie (EÚ) č. 1095/2010, ktorým sa zriaďuje Európsky orgán dohľadu (Európsky orgán pre cenné papiere a trhy) a ktorým sa mení nariadenie (EÚ) č. 648/2012, pokiaľ ide o postupy udeľovania povolení a orgány zúčastňujúce sa na udeľovaní povolení centrálnym protistranám a požiadavky na uznanie centrálnej protistrany z tretej krajiny**

{ SWD(2017) 246 final }

{ SWD(2017) 247 final }

## PRÍLOHA

V nariadení (EÚ) č. 648/2012 sa dopĺňajú tieto prílohy III a IV.

### „PRÍLOHA III

Zoznam porušení uvedených v článku 25g ods. 1

- I. Porušenia týkajúce sa kapitálových požiadaviek:
- a) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 16 ods. 1 tým, že nemá trvalé a dostupné počiatočné základné imanie vo výške aspoň 7,5 milióna EUR;
  - b) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 16 ods. 2 tým, že nemá základné imanie vrátane nerozdeleného zisku a rezerv, ktoré je úmerné riziku vyplývajúcemu z jej činností a ktoré je trvalo dostatočne vysoké na zaistenie riadneho ukončenia alebo reštrukturalizácie uvedených činností počas primeraného obdobia a na zaistenie dostatočnej ochrany centrálnej protistrany proti kreditnému riziku, riziku protistrany, trhovému riziku, prevádzkovému riziku, právnomu riziku a obchodnému riziku, ktoré ešte nie sú pokryté osobitnými finančnými zdrojmi v zmysle článkov 41, 42, 43 a 44.
- II. Porušenia týkajúce sa organizačných požiadaviek alebo konfliktov záujmov:
- a) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 26 ods. 1 tým, že nemá spoľahlivý systém správy, ktorý zahŕňa jasnú organizačnú štruktúru s presne definovanými, transparentnými a konzistentnými líniami zodpovednosti, účinné postupy zisťovania, riadenia, monitorovania a ohlasovania rizík, ktorým je alebo môže byť vystavená, ani primerané mechanizmy vnútornej kontroly vrátane spoľahlivých administratívnych a účtovných postupov;
  - b) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 26 ods. 2 tým, že neprijala primerané politiky a postupy, ktoré sú dostatočné na zaistenie dodržiavania súladu, a to i v prípade svojich manažérov a zamestnancov, so všetkými ustanoveniami tohto nariadenia;
  - c) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 26 ods. 3 tým, že nemá alebo neprevádzkuje organizačnú štruktúru, ktorou sa zabezpečí kontinuita a riadne fungovanie pri výkone jej služieb a činností, alebo tým, že nevyužíva vhodné a primerané systémy, zdroje a postupy;
  - d) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 26 ods. 4 tým, že nezachováva zreteľné oddelenie medzi ohlasovaním týkajúcim sa riadenia rizík a ohlasovaním týkajúcim sa ostatných činností centrálnej protistrany;
  - e) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 26 ods. 5 tým, že neprijala, nevykonala alebo neudržiava politiku odmeňovania, ktorá podporuje spoľahlivé a účinné riadenie rizík a ktorá nevytvára motivačné faktory na zmierňovanie noriem v oblasti rizík;
  - f) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 26 ods. 6 tým, že neudržiava primerané systémy informačných technológií na zvládnutie zložitosti, rôznorodosti a druhu vykonávaných služieb a činností na zaistenie vysokých noriem bezpečnosti, integrity a dôvernosti uchovávaných informácií;
  - g) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 26 ods. 7 tým, že nesprístupní verejnosti bez poplatkov svoj systém správy, pravidlá vzťahujúce sa na centrálnu protistranu ani svoje kritériá prístupu pre zúčtujúce členstvo;

- h) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 26 ods. 8 tým, že nepodlieha častým a nezávislým auditom, alebo tým, že výsledky týchto auditov neoznamuje rade, alebo tým, že tieto výsledky nesprístupňuje orgánu ESMA;
- i) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 27 ods. 1 alebo článok 27 ods. 2 druhý pododsek tým, že nezabezpečí, aby jej vrcholový manažment a členovia rady mali dostatočne dobrú povesť a skúsenosti na zabezpečenie zodpovedného a obozretného riadenia centrálnej protistrany;
- j) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 27 ods. 2 tým, že nezabezpečí, aby najmenej jedna tretina členov tejto rady, nie však menej ako dvaja členovia, bola nezávislá, alebo tým, že neprizve zástupcov klientov zúčtovacích členov na zasadnutia rady pri prerokúvaní otázok súvisiacich s článkami 38 a 39, alebo tým, že odmeňovanie nezávislých a iných nevykonných členov rady spojí s obchodnými výsledkami centrálnej protistrany;
- k) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 27 ods. 3 tým, že jednoznačne neurčí úlohy a povinnosti rady, alebo tým, že nesprístupní zápisnice zo zasadnutí rady orgánu ESMA alebo audítorom;
- l) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 28 ods. 1 tým, že neustanoví výbor pre riziká, alebo tým, že uvedený výbor pre riziká nebude pozostávať zo zástupcov jej zúčtovacích členov, nezávislých členov rady a zástupcov jej klientov, tým, že výbor pre riziká bude zostavený tak, že jedna z týchto skupín zástupcov má vo výbore pre riziká väčšinu, alebo tým, že riadne neinformuje orgán ESMA o činnostiach a rozhodnutiach výboru pre riziká, ak si orgán ESMA vyžiadal byť riadne informovaný;
- m) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 28 ods. 2 tým, že jednoznačne neurčí mandát výboru pre riziká, systém správy na zaistenie jeho nezávislosti, prevádzkové postupy, kritériá prijatia alebo mechanizmus voľby jeho členov, alebo tým, že uvedený systém správy nie je verejne dostupný, alebo tým, že sa v ňom nestanoví to, že predsedom výboru pre riziká je nezávislý člen rady a že výbor pre riziká podlieha priamo rade a má pravidelné zasadnutia;
- n) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 28 ods. 3 tým, že výboru pre riziká neumožní poskytovať poradenstvo k žiadnemu opatreniu, ktoré môže mať vplyv na riadenie rizík centrálnej protistrany, alebo tým, že v mimoriadnych situáciách sa nevyvalozí primerané úsilie na konzultáciu situácie, ktorá vplýva na riadenie rizík centrálnej protistrany, s výborom pre riziká;
- o) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 28 ods. 5 tým, že čo najskôr neinformuje orgán ESMA o akomkoľvek rozhodnutí, v ktorom sa rada rozhodne nepostupovať podľa rady výboru pre riziká;
- p) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 29 ods. 1 tým, že neuchováva minimálne desať rokov všetky záznamy o poskytnutých službách a činnostiach, ktoré sa vyžadujú na to, aby orgán ESMA monitoroval dodržiavanie tohto nariadenia centrálnou protistranou;
- q) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 29 ods. 2 tým, že neuchováva všetky informácie o všetkých zmluvách, ktoré spracovala, minimálne desať rokov od ukončenia zmluvy, spôsobom, ktorý umožní

identifikáciu pôvodných podmienok transakcie pred zúčtovaním touto centrálnou protistranou;

r) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 29 ods. 3 tým, že nesprístupní na žiadosť orgánu ESMA a relevantným členom ESCB záznamy a informácie uvedené v článku 29 ods. 1 a 2 alebo všetky informácie o pozíciách zúčtovaných zmlúv bez ohľadu na miesto, kde sa transakcie uskutočnili;

s) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 30 ods. 1 tým, že neinformuje alebo nepravdivo či neúplne informuje orgán ESMA o totožnosti svojich akcionárov alebo členov, priamych alebo nepriamych, fyzických alebo právnických osôb, ktoré majú kvalifikované podiely, alebo o výškach týchto podielov;

t) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 30 ods. 4 tým, že umožní osobám uvedeným v článku 30 ods. 1 uplatňovať vplyv, ktorý by mohol byť škodlivý pre spoľahlivé a obozretné riadenie centrálnej protistrany;

u) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 31 ods. 1 tým, že orgánu ESMA neoznami alebo nepravdivo či neúplne oznami akékoľvek zmeny vo svojom manažmente a neposkytne orgánu ESMA všetky informácie potrebné na posúdenie dodržiavania článku 27 ods. 1 alebo článku 27 ods. 2 druhého pododseku;

v) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 33 ods. 1 tým, že neudržiava alebo neriadi účinný písomný organizačný a administratívny rámec na zisťovanie alebo riadenie potenciálnych konfliktov záujmov medzi sebou vrátane svojich manažérov, zamestnancov alebo akejkoľvek osoby s priamym alebo nepriamym ovládajúcim či úzkym prepojením, a svojimi zúčtovacími členmi alebo ich klientmi, ktorých centrálna protistrana pozná, alebo tým, že neudržiava alebo neuplatňuje primerané postupy zamerané na riešenie prípadného konfliktu záujmov;

w) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 33 ods. 2 tým, že jednoznačne neoznami zúčtovaciemu členovi alebo dotknutému klientovi daného zúčtovacieho člena, ktorý je centrálnej protistrane známy, pred prijatím nových transakcií od dotknutého zúčtovacieho člena všeobecnú povahu alebo zdroje konfliktov záujmov, ak organizačný alebo administratívny rámec danej centrálnej protistrany na riadenie konfliktov záujmov nie je dostatočný na zaistenie toho, aby sa s primeranou istotou zamedzilo rizikám poškodenia záujmov zúčtovacieho člena alebo klienta;

x) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 33 ods. 3 tým, že nezohľadní v písomnom rámci okolnosti, ktorých si je vedomá alebo ktorých by si mala byť vedomá a ktoré môžu predstavovať dôvod vzniku konfliktu záujmov vyplývajúci zo štruktúry a obchodných činností iných podnikov, ku ktorým má vzťah ako materský alebo dcérsky podnik;

y) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 33 ods. 5 tým, že neprijme všetky primerané kroky na zabránenie zneužitiu informácií uchovávaných v jej systémoch alebo nezabráni využívaniu týchto informácií na iné obchodné činnosti, alebo tým, že fyzická osoba, ktorá má úzke prepojenie na centrálnu protistranu, alebo právnická osoba, ktorá má s centrálnou protistranou vzťah ako materský podnik alebo dcérsky podnik, použije dôverné informácie

uchovávané touto centrálnou protistranou na akékoľvek komerčné účely bez predchádzajúceho súhlasu klienta, ktorému tieto dôverné informácie patria;

z) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 36 ods. 1 tým, že nekoná spravodlivo a profesionálne v súlade s najlepšimi záujmami svojich zúčtovacích členov a ich klientov;

aa) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 36 ods. 2 tým, že nemá dostupné, transparentné a spravodlivé pravidlá včasného vybavovania sťažností;

bb) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 37 ods. 1 alebo 2 tým, že používa na priebežnom základe diskriminačné, nejasné alebo subjektívne kritériá prijatia, alebo tým, že inak na priebežnom základe nezabezpečí spravodlivý a otvorený prístup k centrálnej protistrane, alebo tým, že na priebežnom základe nezaistí, aby zúčtovací členovia mali dostatočné finančné zdroje a prevádzkovú kapacitu na splnenie povinností vyplývajúcich z účasti v danej centrálnej protistrane, alebo tým, že nevykoná raz ročne komplexné preskúmanie dodržiavania súladu jej zúčtovacími členmi;

cc) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 37 ods. 4 tým, že nemá objektívne a transparentné postupy na ukončenie členstva a riadny odchod zúčtovacích členov, ktorí prestanú spĺňať kritériá uvedené v článku 37 ods. 1;

dd) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 37 ods. 5 tým, že odoprie prístup zúčtovaciemu členovi, ktorý spĺňa kritériá uvedené v článku 37 ods. 1, len ak takéto odopretie prístupu nie je riadne písomne odôvodnené a na základe komplexnej analýzy rizika;

ee) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 38 ods. 1 tým, že klientom svojich zúčtovacích členov neumožní samostatný prístup ku konkrétnym poskytovaným službám;

ff) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 39 ods. 7 tým, že neponúkne rôzne úrovne oddelenia podľa uvedeného odseku za primeraných obchodných podmienok;

### III. Porušenia týkajúce sa prevádzkových požiadaviek:

a) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 34 ods. 1 tým, že nezavedie, nevykonáva alebo neudržiava primeranú politiku zabezpečovania kontinuity podnikateľskej činnosti a plán obnovy po havárii s cieľom zaistiť zachovanie svojich funkcií, včasnú obnovu činnosti a plnenie povinností centrálnej protistrany, ktorý umožňuje minimálne obnovu všetkých transakcií v čase výpadku, aby centrálna protistrana mohla pokračovať v činnosti s istotou a dokončiť vyrovnanie k plánovanému dátumu;

b) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 34 ods. 2 tým, že nezavedie, nevykonáva alebo neudržiava vhodný postup, ktorým sa zabezpečí včasné a riadne vyrovnanie alebo prevod aktív a pozícií klientov a zúčtovacích členov v prípade odňatia uznania na základe rozhodnutia podľa článku 25;

c) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 35 ods. 1 druhý pododsek tým, že zabezpečuje externe hlavné činnosti súvisiace s riadením rizika danej centrálnej protistrany;

- d) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 39 ods. 1 tým, že nevedie oddelené záznamy a účtovníctvo, ktoré jej umožňujú kedykoľvek a bezodkladne v účtoch vedených u centrálnej protistrany rozlišovať aktíva a pozície vedené na účet jedného zúčtovacieho člena od aktív a pozícií vedených na účet iného zúčtovacieho člena a od svojich vlastných aktív;
- e) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 39 ods. 2 tým, že neponúkne vedenie a nevedením oddelených záznamov a účtovníctva, ak sa o to požiada, ktoré každému zúčtovaciemu členovi umožňujú rozlišovať v účtoch vedených u centrálnej protistrany aktíva a pozície daného zúčtovacieho člena od aktív a pozícií vedených na účet jej zúčtovacích členov;
- f) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 39 ods. 3 tým, že neponúkne vedenie a nevedením oddelených záznamov a účtovníctva, ak sa o to požiada, ktoré každému zúčtovaciemu členovi umožní rozlíšiť v účtoch vedených u centrálnej protistrany aktíva a pozície vedené na účet klienta od aktív a pozícií vedených na účet iných klientov, alebo tým, že neponúkne svojim zúčtovacím členom na požiadanie možnosť otvoriť viac účtov na svoje meno alebo na účet ich klientov;
- g) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 40 tým, že nemeria a neposudzuje v čase blízkom reálnemu času svoju likviditu a expozície kreditného rizika voči každému zúčtovaciemu členovi, a podľa potreby voči inej centrálnej protistrane, s ktorou uzatvorila dohodu o interoperabilite, alebo tým, že nemá na účely účinného merania svojich expozícií prístup k príslušným zdrojom tvorby cien na základe primeraných nákladov;
- h) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 41 ods. 1 tým, že neukladá, nevyzýva na úhradu alebo nevyberá od svojich zúčtovacích členov a podľa potreby od centrálnych protistrán, s ktorými má dohody o interoperabilite, marže na obmedzenie svojich expozícií kreditného rizika, alebo tým, že ukladá, vyzýva na úhradu alebo vyberá marže, ktoré nie sú dostatočné na pokrytie potenciálnych expozícií, ktoré sa podľa odhadu centrálnej protistrany budú vyskytovať až do likvidácie príslušných pozícií, alebo na pokrytie strát, ktoré vyplývajú minimálne z 99 % zmien expozícií počas primeraného časového horizontu, alebo sú dostatočné na zaistenie toho, aby centrálna protistrana minimálne každodenne úplne kolateralizovala svoje expozície so všetkými svojimi zúčtovacími členmi, a podľa potreby so všetkými centrálnymi protistranami, s ktorými má dohody o interoperabilite, alebo v prípade potreby s cieľom zohľadniť možné procyklické účinky;
- i) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 41 ods. 2 tým, že neprijme pri stanovení maržových požiadaviek modely a parametre, ktoré zachytávajú rizikové charakteristiky zúčtovávaných produktov a zohľadňujú interval medzi výberom marží, trhovú likviditu a možnosť zmien počas trvania transakcie;
- j) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 41 ods. 3 tým, že nevyzýva na úhradu a nevyberá marže počas dňa, a to aspoň vtedy, keď dôjde k prekročeniu vopred stanovených prahových hodnôt;
- k) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 42 ods. 3 tým, že neudržiava fond pre prípad zlyhania, ktorý centrálnej protistrane umožňuje aspoň za extrémnych, ale realistických trhových podmienok znášať zlyhanie toho zúčtovacieho člena, voči ktorému má najväčšie expozície, alebo druhého a tretieho najväčšieho zúčtovacieho člena, ak je súčet ich expozícií väčší, alebo tým, že vypracuje scenáre, ktoré nezahŕňajú obdobia s najvyššou volatilitou,

ktoré boli zaznamenané na trhoch, pre ktoré centrálna protistrana poskytuje služby, ako aj súbor potenciálnych budúcich scenárov, ktoré zohľadňujú náhly predaj finančných zdrojov a rýchle zníženie likvidity trhu;

l) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 43 ods. 2, ak jej fond pre prípad zlyhania uvedený v článku 42 a jej ďalšie finančné zdroje uvedené v článku 43 ods. 1 jej neumožňujú za extrémnych, ale realistických trhových podmienok znášať zlyhanie dvoch zúčtovacích členov, voči ktorým má najväčšie expozície;

m) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 44 ods. 1 tým, že nemá vždy prístup k primeranej likvidite, aby mohla poskytovať svoje služby a vykonávať svoje činnosti, alebo tým, že denne nemeria svoju potenciálnu potrebu likvidity;

o) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 45 ods. 1, 2 a 3 tým, že pri krytí strát nepoužije pred ďalšími finančnými zdrojmi marže zložené zúčtovacím členom, ktorý zlyhal;

p) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 45 ods. 4 tým, že nepoužíva účelové vlastné zdroje pred použitím príspevkov zúčtovacích členov, ktorí nezlyhali, do fondu pre prípad zlyhania;

q) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 46 ods. 1 tým, že prijme na krytie svojej počiatočnej a priebežnej expozície voči svojim zúčtovacím členom iný ako vysokoliquidný kolaterál s minimálnym kreditným a trhovým rizikom, ak tento iný kolaterál nie je povolený podľa delegovaného aktu prijatého Komisiou podľa článku 46 ods. 3;

r) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 47 ods. 1 tým, že investuje svoje finančné zdroje inak ako do hotovosti alebo do vysoko likvidných finančných nástrojov s minimálnym trhovým a kreditným rizikom a tieto investície sa dajú rýchlo zlikvidovať s minimálnym negatívnym vplyvom na cenu;

s) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 47 ods. 3 tým, že finančné nástroje zložené ako marže alebo ako príspevky do fondu pre prípad zlyhania sa, ak je to možné, neukladajú u prevádzkovateľov systémov vyrovnania transakcií s cennými papiermi zabezpečujúcich plnú ochranu týchto finančných nástrojov, alebo tým, že nepoužíva iné vysoko bezpečné mechanizmy vo finančných inštitúciách, ktorým bolo udelené povolenie;

t) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 47 ods. 4 tým, že hotovostné vklady vykonáva inak ako prostredníctvom vysoko bezpečných mechanizmov dohodnutých s finančnými inštitúciami, ktoré majú povolenie, alebo využívania automatických vkladových operácií centrálnych bánk alebo iných podobných prostriedkov poskytovaných centrálnymi bankami;

u) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 47 ods. 5 tým, že uloží aktíva u tretej strany bez zabezpečenia toho, aby boli aktíva patriace zúčtovacím členom identifikovateľné oddelene od aktív patriacich centrálnaj protistrane a od aktív patriacich tejto tretej strane, a to prostredníctvom rôzne označených účtov v účtovných knihách tretej strany alebo iných rovnocenných opatrení, ktorými sa dosahuje rovnaká úroveň ochrany, alebo tým, že nemá na požiadanie rýchly prístup k finančným nástrojom;

v) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 47 ods. 6 tým, že investuje svoje základné imanie alebo sumy vyplývajúce z požiadaviek stanovených

v článkoch 41, 42, 43 alebo 44 do vlastných cenných papierov alebo do cenných papierov svojho materského alebo dcérskeho podniku;

w) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 48 ods. 1 tým, že nemá zavedené podrobné postupy, ktoré sa majú uplatňovať, ak zúčtovací člen nesplní požiadavky na účasť stanovené v článku 37 v danej lehote a v súlade s postupmi stanovenými centrálnou protistranou, alebo tým, že nestanoví podrobné postupy, ktoré sa majú uplatňovať v prípade, že centrálna protistrana nevyhlási zlyhanie zúčtovacieho člena, alebo tým, že tieto postupy sa každoročne nepreskúmajú;

x) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 48 ods. 2 tým, že neprijme bezodkladne opatrenia na tlmenie strát a tlakov na likviditu vyplývajúcich zo zlyhaní zúčtovacích členov a nezaistí, aby uzatvorenie pozícií ktoréhokoľvek zúčtovacieho člena nenarušilo jej činnosť alebo nevystavilo zúčtovacích členov, ktorí nezlyhali, stratám, ktoré nemôžu predpokladať ani regulovať;

y) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 48 ods. 3 tým, že bezodkladne neinformuje orgán ESMA pred tým, ako sa vyhlási alebo spustí postup pre prípad zlyhania;

z) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 48 ods. 4 tým, že neoverí, či sú jej postupy pre prípad zlyhania vynúiteľné, a tým, že neprijme všetky primerané kroky na zaistenie toho, aby mala právomoci na likvidáciu vlastníckych pozícií zúčtovacieho člena, ktorý zlyhal, a na prevod alebo likvidáciu pozícií klienta zúčtovacieho člena, ktorý zlyhal;

aa) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 49 ods. 1 tým, že pravidelne nepreskúma svoje modely a parametre prijaté na výpočet svojich maržových požiadaviek, príspevkov do fondu pre prípad zlyhania, požiadaviek na kolaterál či iných mechanizmov kontroly rizík a tým, že tieto modely nepodrobuje prísny a častým stresovým testom na posúdenie ich odolnosti v extrémnych, ale realizovateľných trhových podmienkach, a nevykoná spätné testy na posúdenie spoľahlivosti prijatej metodiky, alebo tým, že nezíska nezávislé potvrdenie, alebo neinformuje svoj orgán ESMA o výsledkoch vykonaných testov alebo pred prijatím každej významnej zmeny modelov a parametrov nezíska potvrdenie od orgánu ESMA;

bb) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 49 ods. 2 tým, že pravidelne netestuje rozhodujúce aspekty svojich postupov pre prípad zlyhania alebo tým, že neprijme všetky primerané kroky na zabezpečenie toho, aby im všetci zúčtovací členovia porozumeli a mali zavedené primerané riešenia pre prípad zlyhania;

cc) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 49 ods. 1a tým, že prijme akúkoľvek významnú zmenu modelov a parametrov uvedených v článku 49 ods. 1 pred tým, než získa potvrdenie tejto zmeny od orgánu ESMA;

dd) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 50 ods. 1 tým, že nepoužije na vyrovnanie svojich transakcií peniaze centrálnej banky, ak je to možné a sú k dispozícii, alebo tým, že, ak sa peniaze centrálnej banky nepoužijú, neprijme kroky na prísne obmedzenie rizík pri hotovostnom vyrovnaní;

ee) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 50 ods. 3 tým, že neodstráni hlavné riziká prostredníctvom čo najrozsiahljšieho využívania mechanizmov dodania proti zaplateniu, ak má táto centrálna protistrana povinnosť vykonať alebo prijať dodávku finančných nástrojov;



ff) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 50a alebo článok 50b tým, že nevypočíta  $K_{CCP}$  podľa uvedeného článku, alebo tým, že nedodríava pravidlá pre výpočet  $K_{CCP}$  stanovené v článku 50a ods. 2, článku 50b a článku 50d;

gg) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 50a ods. 3 tým, že  $K_{CCP}$  vypočítava menej než raz za štvrtrok alebo menej často, než vyžaduje orgán ESMA v súlade s článkom 50a ods. 3;

hh) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 51 ods. 2 tým, že nemá nediskriminačný prístup jednak k údajom, ktoré potrebuje na výkon svojich funkcií z miesta obchodovania, ak centrálna protistrana spĺňa prevádzkové a technické požiadavky stanovené týmto miestom obchodovania, a jednak k príslušnému systému vyrovnania;

ii) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 52 ods. 1 tým, že uzatvorí dohodu o interoperabilite bez splnenia ktorejkoľvek z požiadaviek stanovených v písmene a), písmene b), písmene c) a písmene d) uvedeného odseku;

jj) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 53 ods. 1 tým, že nerozlišuje v účtovníctve aktíva a pozície vedené na účet inej centrálnej protistrany, s ktorou uzatvorila dohodu o interoperabilite;

kk) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 54 ods. 1 tým, že uzatvorí dohodu o interoperabilite bez predchádzajúceho schválenia orgánom ESMA;

#### IV. Porušenia týkajúce sa transparentnosti a dostupnosti informácií:

a) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 38 ods. 1 tým, že nezverejňuje ceny a poplatky za každú službu poskytovanú samostatne vrátane zliav, rabatov a podmienok využitia týchto znížení;

b) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 38 ods. 1 tým, že nezverejňuje informácie orgánu ESMA o nákladoch na svoje služby a príjmoch z nich;

c) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 38 ods. 2 tým, že neoznamuje informácie svojim zúčtovacím členom a ich klientom o rizikách súvisiacich s poskytovanými službami;

d) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 38 ods. 3 tým, že neoznamuje svojim zúčtovacím členom alebo orgánu ESMA cenové informácie používané na výpočet svojich expozícií voči svojim zúčtovacím členom ku koncu dňa, alebo tým, že nezverejňuje objem zúčtovaných transakcií za každý nástroj, ktorý centrálna protistrana zúčtovala na kumulovanom základe;

f) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 38 ods. 4 tým, že nezverejní prevádzkové a technické požiadavky na komunikačné protokoly týkajúce sa obsahu a formátu správ, ktoré využíva na interakciu s tretími stranami, vrátane prevádzkových a technických požiadaviek uvedených v článku 7;

g) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 38 ods. 5 tým, že nezverejní prípadné porušenie kritérií uvedených v článku 37 ods. 1 alebo požiadaviek stanovených v článku 38 ods. 5 zo strany zúčtovacích členov okrem prípadu, keď sa orgán ESMA domnieval, že takéto zverejnenie by predstavovalo ohrozenie finančnej stability alebo dôvery trhu, alebo by vážne ohrozilo finančné trhy alebo spôsobilo neprímeranú škodu zúčastneným stranám;

h) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 39 ods. 7 tým, že nezverejňuje úrovne ochrany a náklady súvisiace s rôznymi úrovňami oddelenia, ktoré poskytuje;

i) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 49 ods. 3 tým, že nezverejní kľúčové informácie o svojom modeli riadenia rizík alebo predpoklady prijaté na vykonanie stresového testovania uvedeného v článku 49 ods. 1;

j) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 50 ods. 2 tým, že jednoznačne nestanoví svoje povinnosti v súvislosti s dodávkou finančných nástrojov vrátane toho, či má povinnosť vykonať alebo prijať dodávku finančného nástroja alebo či odškodní účastníkov v prípade strát vzniknutých v procese dodávky;

k) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 50c ods. 1 tým, že neoznamuje informácie uvedené v článku 50c ods. 1 písm. a), b), c), d) a e) tým svojim zúčtovacím členom, ktorí sú inštitúciami, alebo ich príslušným orgánom;

l) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 50c ods. 2 tým, že vykonáva oznamovanie svojim zúčtovacím členom, ktorí sú inštitúciami, menej než raz za štvrtrok alebo menej často, než vyžaduje orgán ESMA v súlade s článkom 50c ods. 2.

V. Porušenia týkajúce sa prekážok súvisiacich s činnosťami v oblasti dohľadu:

a) centrálna protistrana Tier 2 porušuje článok 25c tým, že v odpovedi na jednoduchú žiadosť ESMA o informácie v súlade s článkom 25c alebo v odpovedi na rozhodnutie ESMA, ktorým sa požadujú informácie v súlade s článkom 25n, poskytne nesprávne alebo zavádzajúce informácie;

b) centrálna protistrana poskytne nesprávne alebo zavádzajúce odpovede na otázky položené podľa článku 25d ods. 1 písm. d);

c) centrálna protistrana Tier 2 včas nedodrží opatrenie dohľadu vyžadované na základe rozhodnutia, ktoré prijal orgán ESMA podľa článku 25n;

d) centrálna protistrana Tier 2 sa nepodrobí kontrole na mieste vyžadovanej rozhodnutím o vyšetrovaní, ktoré prijal orgán ESMA podľa článku 25e“.

1. Vkladá sa táto príloha IV:

#### „PRÍLOHA IV

Zoznam koeficientov súvisiacich s prít'azujúcimi a poľahčujúcimi okolnosťami na účely uplatnenia článku 25g ods. 3

Nasledujúce koeficienty sú uplatniteľné kumulatívnym spôsobom na základné výšky uvedené v článku 25g ods. 2:

I. Korekčné koeficienty súvisiace s prít'azujúcimi okolnosťami:

a) ak bolo porušenie spáchané opakovane, za každý prípad opakovaného porušenia sa uplatňuje dodatočný koeficient 1,1;

b) ak bolo porušenie páchané počas obdobia dlhšieho ako šesť mesiacov, uplatňuje sa koeficient 1,5;

c) ak sa porušením zistili systémové nedostatky v organizácii centrálnej protistrany, najmä v jej postupoch, systémoch riadenia alebo vo vnútorných kontrolách, uplatňuje sa koeficient 2,2;

d) ak malo porušenie negatívny vplyv na kvalitu činností a služieb centrálnej protistrany, uplatňuje sa koeficient 1,5;

- e) ak bolo porušenie spáchané úmyselne, uplatňuje sa koeficient 2;
- f) ak sa od zistenia porušenia neprijalo nápravné opatrenie, uplatňuje sa koeficient 1,7;
- g) ak vrcholový manažment centrálnej protistrany nespolupracoval s orgánom ESMA pri vyšetrovaní, uplatňuje sa koeficient 1,5.

II. Korekčné koeficienty súvisiace s poľahčujúcimi okolnosťami:

- a) ak bolo porušenie páchané počas obdobia kratšieho ako 10 pracovných dní, uplatňuje sa koeficient 0,9;
- b) ak vrcholový manažment centrálnej protistrany môže preukázať, že prijal všetky opatrenia potrebné na zabránenie tohto porušenia, uplatňuje sa koeficient 0,7;
- c) ak centrálna protistrana urýchlene, účinne a v plnom rozsahu upozornila orgán ESMA na porušenie, uplatňuje sa koeficient 0,4;
- d) ak centrálna protistrana dobrovoľne prijala opatrenia, aby zabezpečila, že v budúcnosti nemôže dôjsť k podobnému porušeniu, uplatňuje sa koeficient 0,6.“