



Съвет на
Европейския съюз

Брюксел, 15 юни 2017 г.
(OR. en)

Междуинституционално досие:
2017/0136 (COD)

10363/17
ADD 1

EF 129
ECOFIN 544
SURE 21
CODEC 1070

ПРЕДЛОЖЕНИЕ

От: Генералния секретар на Европейската комисия,
подписано от г-н Jordi AYET PUIGARNAU, директор

Дата на получаване: 15 юни 2017 г.

До: Г-н Јерре TRANHOLM-MIKKELSEN, генерален секретар на Съвета на
Европейския съюз

№ док. Ком.: COM(2017) 331 final - ПРИЛОЖЕНИЕ 1

Относно: ПРИЛОЖЕНИЕ към предложението за РЕГЛАМЕНТ НА
ЕВРОПЕЙСКИЯ ПАРЛАМЕНТ И НА СЪВЕТА за изменение на
Регламент (ЕС) № 1095/2010 за създаване на Европейски надзорен
орган (Европейски орган за ценни книжа и пазари) и на Регламент
(ЕС) № 648/2012 по отношение на процедурите и участващите органи
при лицензирането на ЦК, както и на изискванията за признаване на
ЦК от трети държави

Приложено се изпраща на делегациите документ COM(2017) 331 final - ПРИЛОЖЕНИЕ 1.

Приложение: COM(2017) 331 final - ПРИЛОЖЕНИЕ 1

Брюксел, 13.6.2017 г.
COM(2017) 331 final

ANNEX 1

ПРИЛОЖЕНИЕ

към предложението за

РЕГЛАМЕНТ НА ЕВРОПЕЙСКИЯ ПАРЛАМЕНТ И НА СЪВЕТА

за изменение на Регламент (ЕС) № 1095/2010 за създаване на Европейски надзорен орган (Европейски орган за ценни книжа и пазари) и на Регламент (ЕС) № 648/2012 по отношение на процедурите и участващите органи при лицензирането на ЦК, както и на изискванията за признаване на ЦК от трети държави

{SWD(2017) 246 final}

{SWD(2017) 247 final}

ПРИЛОЖЕНИЕ

Следното се добавя като приложения III и IV към Регламент (ЕС) № 648/2012.

„ПРИЛОЖЕНИЕ III

Списък на нарушенията, посочени в член 25ж, параграф 1

I. Нарушения, свързани с капиталовите изисквания:

а) ЦК от ниво 2 нарушава член 16, параграф 1, ако не разполага с постоянен и наличен първоначален капитал в размер най-малко на 7,5 милиона евро;

б) ЦК от ниво 2 нарушава член 16, параграф 2, ако не разполага с капитал, включително неразпределената печалба и резервите, пропорционален на рисковете, произтичащи от дейностите му, и достатъчен във всеки един момент за организирано преустановяване или реорганизиране на дейността в разумен срок, както и за подходяща защита на ЦК срещу кредитен риск, риск от контрагента, пазарен, операционен, правен и бизнес рискове, които не са покрити от специфичните финансови ресурси по членове 41, 42, 43 и 44.

II. Нарушения, свързани с организационните изисквания или конфликтите на интереси:

а) ЦК от ниво 2 нарушава член 26, параграф 1, ако не разполага с надеждни правила за управление, включващи ясна организационна структура с добре определена, прозрачна и последователна йерархия на отговорностите, ефективни процеси за определяне, управление, наблюдение и отчитане на рисковете, на които ЦК е изложен или може да бъде изложен, и адекватни механизми за вътрешен контрол, в т.ч. надеждни административни и счетоводни процедури;

б) ЦК от ниво 2 нарушава член 26, параграф 2, ако не въведе подходящи политики и процедури, с които достатъчно ефективно се осигурява спазването, включително от неговите управители и служители, на всички разпоредби на настоящия регламент;

в) ЦК от ниво 2 нарушава член 26, параграф 3, ако не поддържа или не прилага организационна структура, която осигурява непрекъснатост и нормално функциониране при изпълнението на неговите услуги и дейности, или ако не използва подходящи и пропорционални системи, ресурси или процедури;

г) ЦК от ниво 2 нарушава член 26, параграф 4, ако не разграничи ясно в отчетността си управлението на риска и другите свои дейности;

д) ЦК от ниво 2 нарушава член 26, параграф 5, ако не приеме, приложи и поддържа политика за възнагражденията, която насърчава надеждното и ефективно управление на риска и не създава предпоставки за отслабване на стандартите за управление на риска;

- е) ЦК от ниво 2 нарушава член 26, параграф 6, ако не осигури високи стандарти на сигурност, както и надеждност и поверителност на съхраняваната информация, чрез въвеждането на системи за информационните технологии, съответстващи на сложността, разнообразието и вида на осъществяваните услуги и дейности;
- ж) ЦК от ниво 2 нарушава член 26, параграф 7, ако не направи безвъзмездно публично достояние правилата си за управление и правилата, регулиращи дейността му, както и критериите си за допустимост за клиринговите членове;
- з) ЦК от ниво 2 нарушава член 26, параграф 8, ако не приеме извършването на чести и независими одити или ако не съобщава резултатите от тези проверки на ръководния съвет или не ги прави достъпни за ЕОЦКП;
- и) ЦК от ниво 2 нарушава член 27, параграф 1 или член 27, параграф 2, втора алинея, ако не гарантира, че висшият ръководен състав и членовете на ръководния съвет имат достатъчно добра репутация и опит, за да се осигури неговото стабилно и благоразумно управление;
- й) ЦК от ниво 2 нарушава член 27, параграф 2, ако не гарантира, че най-малко една трета, но не по-малко от двама, от членовете на ръководния съвет са независими, ако не покани представители на клиентите на клиринговите членове на заседание на ръководния съвет, на което се обсъждат въпроси, свързани с членове 38 и 39, или ако обвърже възнаграждението на независимите членове и на другите неизпълнителни членове на ръководния съвет с резултатите от дейността на ЦК;
- к) ЦК от ниво 2 нарушава член 27, параграф 3, ако не определи ясно ролите и отговорностите на ръководния съвет и не предостави на ЕОЦКП или на одиторите протоколите от неговите заседания;
- л) ЦК от ниво 2 нарушава член 28, параграф 1, ако не създаде комитет за управление на риска или ако не допусне в състава му представители на клиринговите членове, независимите членове на ръководния съвет и представители на своите клиенти; ако състави този комитет така, че една от тези групи на представители да има мнозинство в него; ако не информира надлежно ЕОЦКП за дейността и решенията на комитета в отговор на искане от ЕОЦКП за такова надлежно информиране;
- м) ЦК от ниво 2 нарушава член 28, параграф 2, ако не определи ясно мандата на комитета за управление на риска, правилата за управление, с които се осигурява независимостта му, работните процедури и критериите за прием или избор на неговите членове; ако не ги направи публично достъпни или чрез правила за управление не определи, че комитетът за управление на риска заседава редовно и се председателства от независим член на ръководния съвет, който докладва пряко на ръководния съвет;
- н) ЦК от ниво 2 нарушава член 28, параграф 3, ако не позволи на комитета за управление на риска да съветва ръководния съвет по

въпросите с отношение към управлението на риска на ЦК или ако при извънредни ситуации не положи добросъвестни усилия да се консултира с комитета за управление на риска относно промените, които оказват влияние върху управлението на риска;

о) ЦК от ниво 2 нарушава член 28, параграф 5, ако не уведоми своевременно ЕОЦКП за всяко решение, при което ръководният съвет не е спазил препоръката на комитета за управление на риска;

п) ЦК от ниво 2 нарушава член 29, параграф 1, ако не съхранява за срок от най-малко десет години всички данни за извършваните от него услуги и дейности, за да може ЕОЦКП да контролира спазването на настоящия регламент от ЦК;

р) ЦК от ниво 2 нарушава член 29, параграф 2, ако не съхранява цялата информация за всеки обработен от него договор за срок от най-малко десет години от прекратяването на съответния договор, така че да е възможно да се установят най-малко първоначалните условия по дадена трансакция преди клиринга от този ЦК;

с) ЦК от ниво 2 нарушава член 29, параграф 3, ако при поискване не предостави на ЕОЦКП и на съответните членове на ЕСЦБ данните и информацията по член 29, параграфи 1 и 2 или цялата информация за позициите по преминалите клиринг договори, независимо от мястото на търговия, на което трансакциите са били извършени;

т) ЦК от ниво 2 нарушава член 30, параграф 1, ако не уведоми или уведоми невярно или непълно ЕОЦКП за самоличността или наименованието на акционерите или съдружниците — преки или непреки, физически или юридически лица, които имат квалифицирано дялово участие, или за размера на това участие;

у) ЦК от ниво 2 нарушава член 30, параграф 4, ако позволи на посочените в член 30, параграф 1 лица да упражняват влияние, което може да бъде във вреда на стабилното му и благоразумно управление;

ф) ЦК от ниво 2 нарушава член 31, параграф 1, ако не уведоми или уведоми невярно или непълно уведоми ЕОЦКП за промяна в своето управление или не предостави на ЕОЦКП цялата необходима информация, за да се прецени спазването на член 27, параграф 1 или на член 27, параграф 2, втора алинея;

х) ЦК от ниво 2 нарушава член 33, параграф 1, ако не поддържа и прилага ефективни, писмено регламентирани организационни и административни мерки за разкриване и преодоляване на потенциалните конфликти на интереси между него, включително неговите управители, служители или всяко лице с пряк или непряк контрол или с тесни връзки с тях, и неговите клирингови членове или техните клиенти, известни на ЦК, или ако не поддържа и прилага подходящи процедури за преодоляване на потенциалните конфликти на интереси;

ц) ЦК от ниво 2 нарушава член 33, параграф 2, ако, в случай че организационните или административните му механизми за управление

на конфликти на интереси не предотвратяват в достатъчна степен риска от нанасяне на вреда на интересите на клирингов член или на клиент, той, преди да приеме нова трансакция от такъв клирингов член, не разкрие по ясен начин пред него или пред заинтересован негов клиент, който му е известен, естеството или източниците на конфликт на интереси;

ч) ЦК от ниво 2 нарушава член 33, параграф 3, ако не отчете в писмените си правила всички обстоятелства, с които е — или следва да бъде — запознат, които, поради структурата и дейността на другите предприятия, с които ЦК има взаимоотношения в качеството си на предприятие майка или дъщерно предприятие, могат да доведат до конфликт на интереси;

ш) ЦК от ниво 2 нарушава член 33, параграф 5, ако не предприеме всички целесъобразни мерки за предотвратяване на злоупотреби с информацията, съхранявана в неговите системи, или ако не предотврати използването на тази информация за други стопански дейности или възможността физическо лице, което има тесни връзки с ЦК, или юридическо лице, което има взаимоотношения с ЦК в качеството си на предприятие майка или дъщерно предприятие, да използва поверителна информация, регистрирана в същия ЦК, за всякакви търговски цели без предварителното съгласие на клиента, на когото принадлежи тази поверителна информация;

щ) ЦК от ниво 2 нарушава член 36, параграф 1, ако не действа коректно и професионално във възможно най-добрия интерес на своите клирингови членове и техните клиенти;

аа) ЦК от ниво 2 нарушава член 36, параграф 2, ако не разполага с достъпни, прозрачни и справедливи правила за бързо разглеждане на жалби;

бб) ЦК от ниво 2 нарушава член 37, параграфи 1 или 2, ако непрекъснато прилага дискриминационни, непрозрачни или субективни критерии за прием на клирингови членове, ако по друг начин не осигурява непрекъснато справедлив и открит достъп до себе си или не гарантира непрекъснато, че неговите клирингови членове разполагат с достатъчно финансови ресурси и оперативен капацитет, за да изпълняват задълженията си, произтичащи от участието им в него, или ако не извършва най-малко веднъж годишно обстоен преглед на спазването на нормативните изисквания от своите клирингови членове;

вв) ЦК от ниво 2 нарушава член 37, параграф 4, ако не разполага с обективни и прозрачни процедури за прекратяването на достъпа и организираното напускане на тези клирингови членове, които вече не покриват посочените в член 37, параграф 1 критерии;

гг) ЦК от ниво 2 нарушава член 37, параграф 5, ако откаже достъп на клирингов член, който покрива посочените в член 37, параграф 1 критерии, и този отказ не е надлежно обоснован писмено и не се основава на цялостен анализ на риска;

дд) ЦК от ниво 2 нарушава член 38, параграф 1, ако не позволи на клиентите на своите клирингови членове отделен достъп до конкретните предоставяни услуги;

ее) ЦК от ниво 2 нарушава член 39, параграф 7, ако не предложи различните нива на отделяне, посочени в същия параграф, при разумни търговски условия.

III. Нарушения, свързани с оперативните изисквания:

а) ЦК от ниво 2 нарушава член 34, параграф 1, ако не установи, приложи и поддържа адекватна политика за непрекъснатост на стопанската дейност и план за възстановяване при катастрофично събитие, които имат за цел да осигурят поддържане на неговите функции, своевременно възстановяване на дейността и изпълнение на задълженията му, както и позволяват възстановяването минимум на всички трансакции към момента на смущението, за да може ЦК да продължи по надежден начин дейността си и да приключи сетълмента към определената дата;

б) ЦК от ниво 2 нарушава член 34, параграф 2, ако не създаде, приложи и поддържа подходяща процедура за гарантиране на своевременния и организиран сетълмент или прехвърляне на активи и позиции на клиенти и клирингови членове в случай на оттегляне на признаване в изпълнение на решение, взето по силата на член 25;

в) ЦК от ниво 2 нарушава член 35, параграф 1, втора алинея, ако възложи на външни подизпълнители основни дейности, свързани с управлението му на риска;

г) ЦК нарушава член 39, параграф 1, ако не води отделни записи и отчетност, които във всеки един момент му позволяват незабавно да разграничи по откритите при него сметки активите и позициите, държани за сметка на даден клирингов член, от активите и позициите, държани за сметка на всеки друг клирингов член, и от собствените си активи;

д) ЦК нарушава член 39, параграф 2, ако не предложи да води отделни записи и отчетност, които позволяват на всеки клирингов член да разграничи по откритите при него сметки своите активи и позиции от тези, поддържани за сметка на неговите клирингови членове;

е) ЦК нарушава член 39, параграф 3, ако не предложи да води — или, при поискване, да не води — отделни записи и отчетност, които позволяват на всеки клирингов член да разграничи по откритите при него сметки активите и позициите, поддържани за сметка на даден клиент, от тези, поддържани за сметка на други клиенти, или ако при поискване не предложи на своите клирингови членове възможността да откриват повече сметки на тяхно име за сметка на техните клиенти;

ж) ЦК от ниво 2 нарушава член 40, ако не измерва и оценява в близък до реално време режим своята ликвидност и кредитна експозиция към всеки клирингов член и когато е приложимо — към друг ЦК, с който той е

сключил споразумение за оперативна съвместимост, или ако няма достъп на разумна цена до съответните ценови източници, необходими за ефективната оценка на неговите експозиции;

з) ЦК от ниво 2 нарушава член 41, параграф 1, ако не наложи, изиска или събере допълнителни обезпечения за ограничаване на кредитните си експозиции към клиринговите членове или когато е приложимо — към други ЦК, с които той е сключил споразумения за оперативна съвместимост; ако наложи, изиска или събере допълнителни обезпечения, които не са достатъчни, за да покрият потенциалните експозиции, които по негова оценка ще възникнат до ликвидацията на съответните позиции, нито загубите вследствие на най-малко 99 % от промяната на експозициите в рамките на подходящ времеви хоризонт, нито са достатъчни, за да се гарантира, че ЦК обезпечава напълно своите експозиции към всички свои клирингови членове, а когато е приложимо — към други ЦК, с които той е сключил споразумения за оперативна съвместимост, поне веднъж дневно, или, ако е необходимо, с оглед на всяко потенциално проциклично въздействие;

и) ЦК от ниво 2 нарушава член 41, параграф 2, ако при определянето на изискванията си за допълнително обезпечение не приложи модели и параметри, които отразяват характеристиките на риска на продуктите, които подлежат на клиринг, и отчитат времеви интервал между събиранията на допълнителните обезпечения, пазарната ликвидност и възможните промени по време на трансакцията;

й) ЦК от ниво 2 нарушава член 41, параграф 3, ако не изиска и събере допълнителни обезпечения в рамките на деня, най-малкото когато предварително определените прагове бъдат надхвърлени;

к) ЦК от ниво 2 нарушава член 42, параграф 3, ако не поддържа гаранционен фонд, който най-малкото му позволява да преодолее, при екстремни, но реалистични пазарни условия, неизпълнение от страна на клиринговия член, към който има най-голямата експозиция, или от страна на клиринговите членове, към които има втората и третата по големина експозиция, ако сборът на тези две експозиции е по-голям; ако не разработи сценарии, които отчитат периодите на най-голяма нестабилност, наблюдавани на пазарите, на които той предоставя своите услуги, както и редица възможни бъдещи сценарии, които отчитат внезапни продажби на финансови ресурси и бързо намаляване на пазарната ликвидност;

л) ЦК от ниво 2 нарушава член 43, параграф 2, ако неговият гаранционен фонд по член 42 и другите финансови ресурси по член 43, параграф 1 не му позволяват да преодолее неизпълнение от страна на двамата клирингови членове, към които има най-големите експозиции, при екстремни, но реалистични пазарни условия;

м) ЦК от ниво 2 нарушава член 44, параграф 1, ако не разполага по всяко време с достъп до подходяща ликвидност, за да извършва дейността си и да предоставя услуги, или ако не измерва ежедневно потенциалните си потребности от ликвидност;

н) ЦК от ниво 2 нарушава член 45, параграфи 1, 2 и 3, ако за покриване на загубите не използва допълнителните обезпечения, предоставени от клирингов член в изпълнение, преди да прибегне към други финансови ресурси;

о) ЦК от ниво 2 нарушава член 45, параграф 4, ако не използва предназначени за целта собствени ресурси, преди да използва вноските в гаранционния фонд на клиринговите членове, които не са в изпълнение;

п) ЦК от ниво 2 нарушава член 46, параграф 1, ако приеме друго освен високоликвидни обезпечения с минимален кредитен и пазарен риск, за да покрие първоначалната и текущата си експозиция към своите клирингови членове, когато друго обезпечение не е позволено по силата на делегиран акт, приет от Комисията по член 46, параграф 3;

р) ЦК от ниво 2 нарушава член 47, параграф 1, ако инвестира своите финансови ресурси в друго освен в парични средства или различни от високоликвидни финансови инструменти с минимален пазарен и кредитен риск, както и ако инвестициите му не могат да бъдат ликвидирани бързо с минимален отрицателен ценови ефект;

с) ЦК от ниво 2 нарушава член 47, параграф 3, ако не депозира финансовите инструменти, предоставени като допълнително обезпечение или като вноски в гаранционен фонд, при оператори на системи за сетълмент на ценни книжа, които осигуряват цялостната защита на тези финансови инструменти, когато такива оператори са налице, или ако не използва други споразумения с висока степен на сигурност с одобрени финансови институции;

т) ЦК от ниво 2 нарушава член 47, параграф 4, ако не депозира паричните си средства посредством споразумения с висока степен на сигурност с одобрени финансови институции или не използва наличните депозитни улеснения на централните банки или други съпоставими механизми, предоставени от централните банки;

у) ЦК от ниво 2 нарушава член 47, параграф 5, ако депозира активи при трета страна, без да се увери, че активите, принадлежащи на клиринговите членове, са разграничени от активите, принадлежащи на ЦК, и от активите, принадлежащи на тази трета страна, посредством отделно номерирани сметки в регистрите на третата страна или други еквивалентни мерки, които предоставят същото ниво на защита, както и ако при нужда няма бърз достъп до финансовите инструменти;

ф) ЦК от ниво 2 нарушава член 47, параграф 6, ако инвестира своя капитал или средствата, получени вследствие на изискванията по членове 41, 42, 43 или 44, в собствените си ценни книжа или в ценни книжа на своето предприятие майка или дъщерно предприятие;

х) ЦК от ниво 2 нарушава член 48, параграф 1, ако не разполага с подробни процедури, които се прилагат, когато клирингов член не изпълнява посочените в член 37 изисквания за участие в рамките на срока и в съответствие с процедурите, установени от този ЦК, ако не изложи

подробно процедурите, които се спазват, в случай че неизпълнението на клирингов член не е обявено от ЦК, или ако не преразглежда ежегодно тези процедури;

ц) ЦК от ниво 2 нарушава член 48, параграф 2, ако не вземе незабавни мерки за ограничаване на причинените от неизпълнението на клирингов член загуби и ликвидни затруднения и за гарантиране, че ликвидирането на позициите на който и да е клирингов член няма да наруши неговите операции или да изложи клиринговите членове, които не са в неизпълнение, на непредвидени или неконтролирани загуби;

ч) ЦК от ниво 2 нарушава член 48, параграф 3, ако не уведоми своевременно ЕОЦКП преди да бъде обявена или започната процедурата по неизпълнение;

ш) ЦК от ниво 2 нарушава член 48, параграф 4, ако не провери, че всичките му процедури за случай на неизпълнение подлежат на правоприлагане и ако не предприеме всички разумни мерки, осигуряващи му законовите правомощия да ликвидира собствените позиции на клиринговия член, който е в неизпълнение, и да прехвърли или ликвидира позициите на клиентите на клиринговия член, който изпада в неизпълнение.

аа) ЦК от ниво 2 нарушава член 49, параграф 1, ако не преразглежда редовно своите модели и параметри за изчисляване на приложимите към него изисквания за допълнителни обезпечения, вноски в гаранционния фонд, изисквания за обезпечения и други механизми за контрол на риска; ако не подлага тези модели на задълбочени и честни тестове за устойчивост (стрес тестове), за да оцени тяхната устойчивост при екстремни, но реалистични пазарни условия или не извършва бектестове, за да оцени надеждността на прилаганата методика; ако преди да извърши съществени промени в моделите и параметрите не получи независимо утвърждение и не информира ЕОЦКП за резултатите от извършените тестове или не получи утвърждение от ЕОЦКП;

бб) ЦК от ниво 2 нарушава член 49, параграф 2, ако не тества редовно ключовите елементи на своите процедури при неизпълнение или ако не предприеме всички разумни мерки, за да гарантира, че всички клирингови членове ги разбират и разполагат с подходящи процедури за реакция в случай на неизпълнение;

вв) ЦК от ниво 2 нарушава член 49, параграф 1а, ако приеме съществена промяна в моделите и параметрите по член 49, параграф 1, преди да получи утвърждение на тази промяна от ЕОЦКП;

гг) ЦК от ниво 2 нарушава член 50, параграф 1, ако, когато това е уместно и възможно, не осъществява сетълмент на сделките си по сметки при централната банка или, когато сетълментът не се осъществява чрез сметки при централната банка, не взема мерки за стриктното ограничаване на рисковете, свързани с паричния сетълмент;

дд) ЦК от ниво 2 нарушава член 50, параграф 3, ако когато има задължение да извърши или получи доставки на финансови инструменти

не премахва основния риск чрез използването на механизми за доставка срещу плащане, доколкото е възможно;

ее) ЦК от ниво 2 нарушава член 50а или член 50б, ако не изчисли $K_{ССР}$ съгласно посоченото в същия член или ако не спази правилата за изчисляване на $K_{ССР}$, определени в член 50а, параграф 2, член 50б и член 50г;

жж) ЦК от ниво 2 нарушава член 50а, параграф 3, ако изчислява $K_{ССР}$ по-рядко от веднъж на всеки три месеца или по-рядко, отколкото е изискал ЕОЦКП по силата на член 50а, параграф 3;

зз) ЦК от ниво 2 нарушава член 51, параграф 2, ако не разполага с недискриминационен достъп до данните, които са необходими за изпълнение на неговите функции във връзка с място на търговия — доколкото спазва определените от това място операционни и технически изисквания, както и до съответната система за сетълмент;

ии) ЦК от ниво 2 нарушава член 52, параграф 1, ако сключи споразумение за оперативна съвместимост, без да е изпълнено някое от изискванията, посочени в букви а), б), в) и г) от същия параграф;

йй) ЦК от ниво 2 нарушава член 53, параграф 1, ако не разграничи по сметките активите и позициите, държани за сметка на друг ЦК, с които е сключил споразумение за оперативна съвместимост;

кк) ЦК от ниво 2 нарушава член 54, параграф 1, ако сключи споразумение за оперативна съвместимост без предварителното одобрение от ЕОЦКП.

IV. Нарушения, свързани с прозрачността и наличието на информация:

а) ЦК от ниво 2 нарушава член 38, параграф 1, ако не оповести публично цените и таксите на всяка поотделно предоставяна услуга, включително отстъпките и рабатите, и условията за ползване на тези намаления;

б) ЦК от ниво 2 нарушава член 38, параграф 1, ако не предостави на ЕОЦКП информация за разходите и приходите от своите услуги;

в) ЦК от ниво 2 нарушава член 38, параграф 2, ако не информира клиринговите членове и техните клиенти за рисковете, свързани с предоставяните услуги;

г) ЦК от ниво 2 нарушава член 38, параграф 3, ако не предостави на своите клирингови членове или на ЕОЦКП ценовата информация, използвана в края на деня за изчисляване на експозициите му към неговите клирингови членове, или като не оповестява публично обемите на преминалите през клиринг трансакции за всеки инструмент, на който ЦК е извършил клиринг, на агрегирана основа;

е) ЦК от ниво 2 нарушава член 38, параграф 4, ако не оповести публично оперативните и техническите изисквания, свързани с протоколите за комуникация, които обхващат форматите за съдържание и съобщение,

които използва за взаимодействие с трети страни, включително оперативните и техническите изисквания, посочени в член 7;

е) ЦК от ниво 2 нарушава член 38, параграф 5, ако не оповести публично всяко нарушение от страна на клиринговите членове на критериите по член 37, параграф 1 или на изискванията по член 38, параграф 5, освен ако ЕОЦКП не прецени, че такова оповестяване би представлявало заплаха за финансовата стабилност или за доверието в пазара или би застрашило сериозно финансовите пазари, или би причинило несъразмерно голяма вреда на засегнатите страни;

ж) ЦК от ниво 2 нарушава член 39, параграф 7, ако не оповести публично равнищата на защита и разходите, свързани с различните нива на отделяне, които предлага;

з) ЦК от ниво 2 нарушава член 49, параграф 3, ако не оповести публично ключовата информация относно своя модел за управление на риска и допусканията, използвани при извършване на тестовете за устойчивост (стрес тестове) по член 49, параграф 1;

и) ЦК от ниво 2 нарушава член 50, параграф 2, ако не посочи ясно своите задължения във връзка с доставката на финансови инструменти, включително дали той има задължение да извърши или получи доставки на финансови инструменти или дали обезщетява участниците за загуби, възникнали в рамките на процеса на доставка;

к) ЦК от ниво 2 нарушава член 50в, параграф 1, ако не предостави на клиринговите си членове, които са институции, или на техните компетентни органи информацията, посочена в член 50в, параграф 1, букви а), б), в), г) и д);

л) ЦК от ниво 2 нарушава член 50в, параграф 2, ако уведомява своите клирингови членове, които са институции, по-рядко от веднъж на всеки три месеца или по-рядко, отколкото е изискал ЕОЦКП по силата на член 50в, параграф 2.

V. Нарушения, свързани с възпрепятстване на дейностите по надзора:

ЦК нарушава член 25в, като предоставя неточна или подвеждаща информация в отговор на обикновено искане за информация от страна на ЕОЦКП по силата на член 25в или в отговор на решение на ЕОЦКП по силата на член 25н, с което се изисква информация;

б) ЦК предоставя неточни или подвеждащи отговори на въпросите, поставени по силата на член 25г, параграф 1, буква г);

в) ЦК от ниво 2 не изпълнява своевременно надзорна мярка, изисквана с решение, прието от ЕОЦКП по силата на член 25н;

г) ЦК от ниво 2 не допуска проверка на място, изискана от решение за разследване, прието от ЕОЦКП по силата на член 25д.“

1. Добавя се следното приложение IV:

„ПРИЛОЖЕНИЕ IV

Списък на коефициентите, свързани с утежняващите и смекчаващите фактори за прилагането на член 25ж, параграф 3

Към основния размер на глобите, посочени в член 25ж, параграф 2, се прилагат кумулативно следните коефициенти:

I. I. Коригиращи коефициенти, свързани с утежняващи фактори:

а) ако нарушението е извършено повече от веднъж, за всяко следващо извършване се прилага допълнителен коефициент 1,1;

б) ако нарушението е извършвано в продължение на повече от шест месеца, се прилага коефициент 1,5;

в) ако нарушението е разкрило системни слабости в организацията на ЦК, по-специално в неговите процедури, системи на управление или вътрешен контрол, се прилага коефициент 2,2;

г) ако нарушението има негативно въздействие върху дейностите и услугите на ЦК, се прилага коефициент 1,5;

д) ако нарушението е извършено умишлено, се прилага коефициент 2;

е) ако след установяване на нарушението не са предприети коригиращи мерки, се прилага коефициент 1,7;

ж) ако висшето ръководство на ЦК не е оказало съдействие на ЕОЦКП при извършването на разследванията, се прилага коефициент 1,5.

II. Коригиращи коефициенти, свързани със смекчаващи фактори:

а) ако нарушението продължава по-малко от 10 работни дни, се прилага коефициент 0,9;

б) ако висшето ръководство на ЦК може да докаже, че е взело всички необходими мерки за предотвратяване на нарушението, се прилага коефициент 0,7;

в) ако ЦК е уведомил ЕОЦКП за нарушението по бърз, ефективен и изчерпателен начин, се прилага коефициент 0,4;

г) ако ЦК доброволно е предприел мерки, за да гарантира, че подобно нарушение не може да се извърши в бъдеще, се прилага коефициент 0,6.“