

Brusel 15. června 2017
(OR. en)

**Interinstitucionální spis:
2017/0136 (COD)**

**10363/17
ADD 1**

**EF 129
ECOFIN 544
SURE 21
CODEC 1070**

NÁVRH

| | |
|-----------------|---|
| Odesílatel: | Jordi AYET PUIGARNAU, ředitel, za generálního tajemníka Evropské komise |
| Datum přijetí: | 15. června 2017 |
| Příjemce: | Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, generální tajemník Rady Evropské unie |
| Č. dok. Komise: | COM(2017) 331 final ANNEX 1 |
| Předmět: | PŘÍLOHA návrhu NAŘÍZENÍ EVROPSKÉHO PARLAMENTU A RADY, kterým se mění nařízení (EU) č. 1095/2010 o zřízení Evropského orgánu dohledu (Evropského orgánu pro cenné papíry a trhy) a nařízení (EU) č. 648/2012, pokud jde o postupy a orgány zapojené do povolování ústředních protistran a požadavky na uznávání ústředních protistran ze třetích zemí |

Delegace naleznou v příloze dokument COM(2017) 331 final ANNEX 1.

Příloha: COM(2017) 331 final ANNEX 1



EVROPSKÁ
KOMISE

V Bruselu dne 13.6.2017
COM(2017) 331 final

ANNEX 1

PŘÍLOHA

návrhu

NAŘÍZENÍ EVROPSKÉHO PARLAMENTU A RADY,

kterým se mění nařízení (EU) č. 1095/2010 o zřízení Evropského orgánu dohledu (Evropského orgánu pro cenné papíry a trhy) a nařízení (EU) č. 648/2012, pokud jde o postupy a orgány zapojené do povolování ústředních protistran a požadavky na uznávání ústředních protistran ze třetích zemí

{SWD(2017) 246 final}

{SWD(2017) 247 final}

PŘÍLOHA

Doplňují se přílohy III a IV nařízení (EU) č. 648/2012, které znějí:

„PŘÍLOHA III

Seznam porušení povinnosti uvedených v čl. 25g odst. 1

- I. Porušení povinnosti související s kapitálovými požadavky:
 - a) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 16 odst. 1 tím, že nemá stálý a dostupný počáteční kapitál ve výši alespoň 7,5 milionu EUR;
 - b) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 16 odst. 2 tím, že nemá kapitál, včetně nerozděleného zisku a rezervních fondů, přiměřený riziku plynoucímu z jejich činností trvale postačující k zajištění řádného ukončení nebo restrukturalizace činností v příslušném časovém rozpětí a k zajištění adekvátní ochrany ústřední protistrany proti úvěrovému riziku, riziku protistrany, tržnímu riziku a operačním, právním a obchodním rizikům, která ještě nejsou kryta zvláštními finančními zdroji uvedenými v člancích 41, 42, 43 a 44.
- II. Porušení povinnosti související s organizačními požadavky nebo se střetem zájmů:
 - a) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 26 odst. 1 tím, že nemá spolehlivé řídicí systémy, včetně jasné organizační struktury s dobře vymezenými, transparentními a konzistentními hranicemi odpovědnosti, účinné postupy k zjišťování, řízení, kontrole a oznamování rizik, kterým je, nebo by mohla být vystavena, a přiměřené mechanismy vnitřní kontroly, včetně řádných administrativních a účetních postupů;
 - b) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 26 odst. 2 tím, že nepřijímá adekvátní strategie a postupy, které jsou dostatečně účinné k zajištění toho, aby ona sama i jeho řídicí pracovníci a zaměstnanci dodržovali veškerá ustanovení tohoto nařízení;
 - c) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 26 odst. 3 tím, že nemá nebo neprovozuje organizační strukturu, která zajišťuje nepřetržitý a řádný výkon jejích služeb a činností, nebo nevyužívá vhodné a přiměřené systémy, zdroje a postupy;
 - d) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 26 odst. 4 tím, že zřetelně neodděluje hierarchické vztahy pro řízení rizik a pro své ostatní operace;
 - e) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 26 odst. 5 tím, že nepřijímá, neprovádí a nedodržuje politiku odměňování, která podporuje spolehlivé a účinné řízení rizik, a která nevytváří pobídky k podhodnocení rizik;
 - f) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 26 odst. 6 tím, že neudržuje informační systémy odpovídající složitosti, rozmanitosti a typům vykonávaných služeb a činností tak, aby byly zajištěny vysoké bezpečnostní standardy a neporušenost a důvěrnost uchovávaných informací;

- g) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 26 odst. 7 tím, že bezplatně nezveřejňuje své řídicí systémy, pravidla, kterými se řídí, a kritéria účastenství ve svém clearingovém systému;
- h) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 26 odst. 8 tím, že se nepodrobuje častým a nezávislým auditům, nebo výsledky těchto auditů nesděluje radě a neposkytuje je orgánu ESMA;
- i) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 27 odst. 1 nebo druhý pododstavec čl. 27 odst. 2 tím, že nezabezpečuje, aby její vrcholné vedení a členové rady měli dostatečně dobrou pověst a dostatek zkušeností k zajištění řádného a obezřetného řízení ústřední protistrany;
- j) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 27 odst. 2 tím, že nezabezpečuje, aby v radě byla alespoň jedna třetina členů, nejméně však dva členové, nezávislí, nebo nezve zástupce klientů členů clearingového systému k účasti na schůzích rady při projednávání otázek souvisejících s články 38 a 39, nebo spojuje odměnu nezávislých a jiných nevykonných členů rady s obchodními výsledky ústřední protistrany;
- k) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 27 odst. 3 tím, že jednoznačně neurčuje úkoly a povinnosti rady, nebo orgánu ESMA a auditorům neposkytuje zápisy ze zasedání rady;
- l) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 28 odst. 1 tím, že nezřídila výbor pro rizika, nebo se tento výbor pro rizika neskládá ze zástupců členů jejího clearingového systému, nezávislých členů rady a jejich klientů, nebo je výbor pro rizika složený tak, aby jedna z těchto skupin zástupců v něm měla většinu, nebo náležitě neinformuje orgán ESMA o činnostech a rozhodnutích výboru pro rizika, pokud orgán ESMA požádal, aby byl patřičně informován.
- m) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 28 odst. 2 tím, že jednoznačně neurčuje pověření, řídicí systémy k zajištění své nezávislosti, provozní postupy, kritéria účastenství nebo volební mechanismus členů výboru pro rizika, nebo tyto řídicí systémy nejsou veřejně dostupné a neurčují, že výboru pro rizika předsedá nezávislý člen rady, že výbor je přímo podřízen radě a že zasedá pravidelně;
- n) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 28 odst. 3 tím, že radě neposkytuje rady ke všem opatřením, která mohou mít dopad na řízení rizik ústřední protistrany, nebo nevyvíjí náležité úsilí, aby byly s výborem pro rizika konzultovány skutečnosti, které mohou mít dopad na řízení rizik ústřední protistrany v naléhavých situacích;
- o) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 28 odst. 5 tím, že bezodkladně neinformuje orgán ESMA o každém rozhodnutí rady, že se nebude řídit radou výboru pro rizika;
- p) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 29 odst. 1 tím, že nevede všechny záznamy o poskytnutých službách a uskutečněných činnostech nejméně po dobu posledních deseti let, aby orgán ESMA mohl sledovat dodržování tohoto nařízení ústřední protistranou;

- q) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 29 odst. 2 tím, že po dobu alespoň deseti let od ukončení smlouvy neuchovává veškeré informace o všech smlouvách, které zpracovala tak, aby umožňovaly zjistit původní podmínky obchodu předtím, než tato ústřední protistrana provedla clearing;
- r) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 29 odst. 3 tím, že na požádání neposkytuje orgánu ESMA a příslušným členům ESCB záznamy a informace uvedené v čl. 29 odst. 1 a 2 nebo všechny informace o pozicích vyplývajících ze smluv, jejichž clearing byl proveden, bez ohledu na obchodní systém, ve kterém byly obchody uzavřeny;
- s) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 30 odst. 1 tím, že neinformuje orgán ESMA, nebo ho informuje nepravdivě či neúplně, o totožnosti akcionářů nebo společníků, ať přímých či nepřímých, fyzických či právnických osob, kteří mají kvalifikované účasti, a o výši těchto kvalifikovaných účastí;
- t) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 30 odst. 4 tím, že umožňuje osobám uvedeným v čl. 30 odst. 1 vykonávat vliv, který by mohl být na újmu řádnému a obezřetnému řízení ústřední protistrany;
- u) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 31 odst. 1 tím, že nepravdivě nebo neúplně oznamuje orgánu ESMA změnu jejího řízení, nebo mu neposkytuje veškeré informace potřebné k posouzení dodržování čl. 27 odst. 1 nebo druhého pododstavce čl. 27 odst. 2;
- v) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 33 odst. 1 tím, že neudrhuje nebo neuplatňuje písemná organizační a administrativní opatření ke zjišťování a řešení veškerých potenciálních střetů zájmů mezi sebou, včetně svých řídicích pracovníků, zaměstnanců nebo jakékoli osoby, která je s nimi přímo či nepřímo ve vztahu kontroly nebo úzkého propojení, a členy svého clearingového systému nebo jejich klienty, kteří jí jsou známi, nebo neudrhuje nebo neuplatňuje odpovídající postupy za účelem řešení případných konfliktů zájmů;
- w) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 33 odst. 2 tím, že před přijetím nového obchodu od příslušného člena clearingového systému nesděljuje jasně obecnou povahu nebo zdroje střetů zájmů členovi clearingového systému nebo jeho dotčenému klientovi, který je ústřední protistraně známý, pokud organizační nebo administrativní opatření přijatá ústřední protistranou k řízení střetů zájmů nejsou dostatečná k tomu, aby s přiměřenou jistotou zajistila, že bude zabráněno rizikům poškození zájmů člena clearingového systému nebo jeho klienta;
- x) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 33 odst. 3 tím, že v písemných opatřeních nezohledňuje veškeré okolnosti, kterých si ústřední protistrana je, nebo by měla být vědoma, a které mohou vést ke střetu zájmů vyplývajícimu ze struktury a podnikatelských činností jiných podniků, s nimiž je ve vztahu mateřského nebo dceřiného podniku;
- y) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 33 odst. 5 tím, že nečiní veškeré přiměřené kroky, aby zabránila jakémukoli zneužití informací uložených ve svých systémech a využívání těchto informací pro jiné podnikatelské činnosti nebo fyzickou osobou, která má s touto ústřední protistranou úzké propojení, nebo právnickou osobou, která je s touto ústřední protistranou

ve vztahu mateřského či dceřiného podniku, a využívá k obchodním účelům důvěrné informace zaznamenané v dané ústřední protistraně bez předchozího souhlasu klienta, jemuž tato důvěrná informace patří.

z) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 36 odst. 1 tím, že nejedná spravedlivě a profesionálně v souladu s nejlepšími zájmy členů svého clearingového systému a jejich klientů;

aa) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 36 odst. 2 tím, že nemá dostupná, transparentní a spravedlivá pravidla pro rychlé vyřizování stížností;

bb) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 37 odst. 1 nebo 2 tím, že soustavně používá diskriminační, nejasné nebo subjektivní kritéria účastenství, nebo jinak průběžně nezajišťuje spravedlivý a otevřený přístup k této ústřední protistraně, nebo trvale nezajišťuje, aby členové jejího clearingového systému měli dostatečné finanční zdroje a provozní kapacitu pro plnění povinností, které vyplývají z účasti v ústřední protistraně, nebo jednou ročně neprovádí komplexní přezkum toho, jak členové jejího clearingového systému dodržují právní předpisy;

cc) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 37 odst. 4 tím, že nemá objektivní a transparentní postupy pro pozastavení členství a ukončení účasti členů clearingového systému, kteří již nespĺňují kritéria uvedená v čl. 37 odst. 1;

dd) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 37 odst. 5 tím, že odepírá přístup členům clearingového systému, kteří splňují kritéria uvedená v čl. 37 odst. 1, a toto odmítnutí přístupu není řádně písemně odůvodněno a založeno na komplexní analýze rizik;

ee) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 38 odst. 1 tím, že neumožňuje klientům členů svého clearingového systému samostatný přístup k poskytovaným zvláštním službám;

ff) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 39 odst. 7 tím, že za přiměřených obchodních podmínek nenabízí jednotlivé úrovně oddělení podle uvedeného odstavce.

III. Porušení povinností související s provozními požadavky:

a) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 34 odst. 1 tím, že nezavádí, neprovádí a neudrží vhodnou politiku pro zachování provozu a plán obnovy činnosti s cílem zajistit zachování svých funkcí, včasné obnovení operací a plnění povinností ústřední protistrany, která umožňuje alespoň obnovit všechny obchody k okamžiku přerušení, aby ústřední protistrana mohla nadále s jistotou fungovat a dokončit vypořádání ve stanovený den;

b) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 34 odst. 2 tím, že nezavádí, neprovádí a neudrží vhodný postup, který zajišťuje včasné a řádné vypořádání nebo převod aktiv a pozic klientů a členů clearingového systému v případě, že jí je odňato uznání na základě rozhodnutí podle článku 25;

- c) ústřední protistrana tier 2 porušuje druhý pododstavec čl. 35 odst. 1 tím, že většinu svých činností spojených s řízením rizik zajišťuje outsourcingem;
- d) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 39 odst. 1 tím, že nevede oddělené záznamy a účetnictví, které jí umožňují kdykoli a bezodkladně odlišit v účtech s ústřední protistranou aktiva a pozice držené na účet jednoho člena clearingového systému od aktiv a pozic držených na účet kteréhokoli jiného člena clearingového systému, i od vlastních aktiv;
- e) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 39 odst. 2 tím, že na požádání nenabízí vedení oddělených záznamů a účetnictví umožňujících, aby každý člen clearingového systému v účtech s ústřední protistranou odlišoval svá aktiva a pozice od aktiv a pozic držených na účet svých klientů, a nevede takové záznamy;
- f) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 39 odst. 3 tím, že na požádání nenabízí vedení oddělených záznamů a účetnictví umožňujících, aby každý člen clearingového systému v účtech s ústřední protistranou odlišoval aktiva a pozice držené na účet jednoho klienta od aktiv a pozic držených na účet jiných klientů, a nevede takové záznamy a účetnictví, nebo na požádání nenabízí členům svého clearingového systému možnost, aby si otevřeli více účtů na své jméno nebo na účet svých klientů;
- g) ústřední protistrana tier 2 porušuje článek 40 tím, že neměří a neposuzuje svou likviditu a úvěrové expozice vůči každému členu clearingového systému a popřípadě vůči jiné ústřední protistraně, se kterou uzavřela dohodu o interoperabilitě, téměř v reálném čase, nebo nemá přístup k příslušným zdrojům ocenění, aby mohla účinně měřit své expozice za přiměřených nákladů;
- h) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 41 odst. 1 tím, že členům svého clearingového systému a popřípadě ústředním protistranám, se kterými má dohody o interoperabilitě, neukládá marže, nevyzývá je k dodatkové úhradě marží a nerealizuje marže k omezení svých úvěrových expozic, aby pokryla potenciální expozice, které podle odhadu ústřední protistrany nastanou do likvidace příslušných pozic, nebo aby pokryla ztráty, které vznikají alespoň z 99 % pohybů expozic v příslušném časovém horizontu, a dostatečně nezabezpečuje, aby ústřední protistrana plně zajistila své expozice vůči všem členům svého clearingového systému a popřípadě vůči ústředním protistranám, s nimiž má uzavřeny dohody o interoperabilitě, a nejméně denně nesleduje a v případě potřeby nezohledňuje možné procyklické účinky;
- i) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 41 odst. 2 tím, že pro stanovování svých maržových požadavků nepřijala modely a parametry, které postihují rizikové znaky produktů, jejichž clearing byl proveden, a berou v úvahu interval mezi realizacemi marží, tržní likviditu a možnost změn po dobu trvání obchodu;
- j) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 41 odst. 3 tím, že nevyzývá k dodatkové úhradě marží a nerealizuje marže v průběhu dne alespoň tehdy, jsou-li překročeny předem vymezené prahy;

k) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 42 odst. 3 tím, že neudržuje fond pro riziko selhání, který za mimořádných, ale možných tržních podmínek umožňuje přinejmenším odolat selhání člena clearingového systému, vůči kterému má největší expozice, nebo druhého a třetího největšího člena clearingového systému, je-li součet jejich expozic větší, nebo nevypracovává scénáře, které zahrnují nejvíce proměnlivá období, jež zažily trhy, pro které ústřední protistrana poskytuje své služby, a řadu možných budoucích scénářů, jež přihlížejí k náhlým výprodejům finančních zdrojů a prudkým snížením tržní likvidity;

l) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 43 odst. 2 tím, že její fond pro riziko selhání uvedený v článku 42 a další finanční zdroje uvedené v čl. 43 odst. 1 ústřední protistraně neumožňují za mimořádných, ale možných tržních podmínek odolat selhání dvou členů clearingového systému, vůči kterým má největší expozice.

m) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 44 odst. 1 tím, že nemá vždy přístup k přiměřené likviditě, aby mohla vykonávat své služby a činnosti, nebo každodenně neprovádí výpočet, kolik likvidity bude potenciálně potřebovat;

o) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 45 odst. 1, 2 a 3 tím, že při krytí ztrát nepoužívá před ostatními finančními zdroji marže složené členem clearingového systému, který selhal;

p) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 45 odst. 4 tím, že nepoužívá vyčleněné vlastní zdroje dříve, než začne využívat příspěvky do fondu pro riziko selhání pocházející od členů clearingového systému, kteří neselhali;

q) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 46 odst. 1 tím, že ke krytí svých počátečních i dlouhodobých expozic vůči členům svého clearingového systému přijímá jiný než vysoce likvidní kolaterál s minimálním úvěrovým a tržním rizikem, když jiný kolaterál není přípustný podle aktu v přenesené pravomoci, který přijala Komise v souladu s čl. 46 odst. 3;

r) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 47 odst. 1 tím, že investuje své finanční zdroje jinak než do hotovosti nebo do vysoce likvidních finančních nástrojů s minimálním tržním a úvěrovým rizikem, které by bylo možné rychle zlikvidnit s minimálním nepříznivým účinkem na cenu;

s) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 47 odst. 3 tím, že finanční nástroje složené jako marže nebo jako příspěvky do fondu pro riziko selhání neukládá u provozovatelů systémů vypořádání cenných papírů, kteří zajišťují plnou ochranu uvedených finančních nástrojů, jsou-li k dispozici, nebo nevyužívá jiná vysoce bezpečná ujednání s povolenými finančními institucemi;

t) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 47 odst. 4 tím, že hotovostní vklady provádí prostřednictvím jiných než vysoce bezpečných ujednání s povolenými finančními institucemi nebo využíváním stálých vkladových nástrojů (facilit) centrálních bank či jiných srovnatelných prostředků poskytovaných centrálními bankami;

u) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 47 odst. 5 tím, že ukládá aktiva u třetí strany, aniž by zajistila, aby aktiva náležející členům clearingového systému

byla rozeznatelná od aktiv náležejících ústřední protistraně a od aktiv náležejících dané třetí straně, a to pomocí odlišných názvů účtů v účetních knihách třetí strany nebo pomocí jiných rovnocenných opatření, která zajišťují stejnou úroveň ochrany, nebo nemá na požádání k finančním nástrojům okamžitý přístup;

v) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 47 odst. 6 tím, že investuje svůj kapitál nebo částky, které vyplývají z požadavků stanovených v člancích 41, 42, 43 nebo 44, do vlastních cenných papírů nebo do cenných papírů svého mateřského nebo dceřiného podniku;

w) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 48 odst. 1 tím, že nemá zavedeny podrobné postupy, které se mají uplatnit, pokud člen clearingového systému ve lhůtě a v souladu s postupy stanovenými ústřední protistranou neplní požadavky na účast stanovené v článku 37, nebo podrobně neurčuje postupy, které se mají uplatnit v případě, že selhání člena clearingového systému není ústřední protistranou oznámeno, nebo tyto postupy nepodléhají každoročnímu přezkumu;

x) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 48 odst. 2 tím, že neprodleně nepřijímá opatření k omezení ztrát a tlaků na likviditu vzniklých selháním člena clearingového systému a nezajišťuje, aby uzavření pozic kteréhokoli člena clearingového systému nenarušilo její operace ani nevystavilo členy clearingového systému, kteří neselhali, ztrátám, jež nemohou předvídat či kontrolovat;

y) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 48 odst. 3 tím, že neprodleně neinformuje orgán ESMA předtím, než je oznámeno nebo zahájeno řízení pro selhání;

z) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 48 odst. 4 tím, že neověřuje, zda jsou její postupy v případě selhání vymahatelné, a nepřijímá veškeré přiměřené kroky, aby zajistila, že má právem uznanou pravomoc likvidovat vlastní pozice člena clearingového systému, který selhal, a převádět nebo likvidovat pozice klientů člena clearingového systému, jenž selhal;

aa) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 49 odst. 1 tím, že pravidelně neprovádí přezkum svých modelů a parametrů přijatých k výpočtu svých maržových požadavků, příspěvků do fondu pro riziko selhání, požadavků na kolaterál a jiných mechanismů kontroly rizik a tyto modely nepodrobuje důsledným a častým stresovým testům k posouzení jejich odolnosti v mimořádných, ale možných tržních podmínkách, nebo neprovádí zpětné testy k posouzení spolehlivosti přijaté metodiky, nezískává nezávislé ověření, neinformuje orgán ESMA o výsledcích provedených testů a před přijetím jakékoli významné změny modelů a parametrů nezíská jeho souhlas;

bb) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 49 odst. 2 tím, že pravidelně netestuje klíčové aspekty svých postupů v případě selhání a nepřijímá veškeré přiměřené kroky k zajištění toho, aby jim všichni členové clearingového systému rozuměli a měli zavedena vhodná opatření za účelem reakce na selhání;

cc) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 49 odst. 1a tím, že přijímá významné změny modelů a parametrů uvedené v čl. 49 odst. 1 před získáním souhlasu orgánu ESMA;

dd) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 50 odst. 1 tím, že k vypořádání svých obchodů nepoužívá peněžní prostředky centrální banky, je-li jejich využití účelné a jsou-li dostupné, nebo nepřijímá kroky k přísnému omezení rizik vypořádání v hotovosti, nejsou-li peněžní prostředky centrální banky použity;

ee) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 50 odst. 3 tím, že neomezuje hlavní rizika maximálním využitím mechanismů dodání proti zaplacení, je-li ústřední protistrana povinna provádět nebo přijímat dodání finančních nástrojů;

ff) ústřední protistrana tier 2 porušuje článek 50a nebo 50b tím, že nevypočítává koeficient K_{CCP} stanovený v uvedeném článku nebo nedodrží pravidla pro výpočet koeficientu K_{CCP} stanovená v čl. 50a odst. 2, článku 50b a 50d;

gg) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 50a odst. 3 tím, že vypočítává koeficient K_{CCP} méně často než čtvrtletně nebo méně často, než to vyžaduje orgán ESMA v souladu s čl. 50a odst. 3;

hh) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 51 odst. 2 tím, že nemá nediskriminační přístup jak k údajům, které potřebuje k výkonu svých funkcí v souvislosti s uvedeným konkrétním obchodním systémem, v rozsahu, v němž splňuje provozní a technické požadavky stanovené daným obchodním systémem, tak i k příslušnému vypořádacímu systému;

ii) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 52 odst. 1 tím, že uzavírá dohody o interoperabilitě, aniž by splňovala požadavky stanovené v písmenech a), b), c) a d) uvedeného odstavce;

jj) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 53 odst. 1 tím, že neodlišuje na účtech aktiva a pozice držené na účet jiné ústřední protistrany, s níž uzavřela dohodu o interoperabilitě;

kk) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 54 odst. 1 tím, že uzavřela dohodu o interoperabilitě bez předchozího schválení orgánu ESMA.

IV. Porušení povinnosti související s transparentností a dostupností údajů:

a) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 38 odst. 1 tím, že nesděljuje ceny a poplatky za každou službu poskytovanou samostatně, včetně slev, rabatů a podmínek využití uvedených snížení;

b) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 38 odst. 1 tím, že orgánu ESMA nesděljuje informace o nákladech a příjmech svých služeb;

c) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 38 odst. 2 tím, že nesděljuje členům svého clearingového systému a jejich klientům rizika spojená s poskytovanými službami;

d) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 38 odst. 3 tím, že nesděljuje členům svého clearingového systému nebo orgánu ESMA informace o cenách

používané k výpočtu svých expozic ke konci dne vůči členům svého clearingového systému, nebo nezveřejňuje souhrnně pro každou kategorii nástrojů celkové objemy obchodů, jejichž clearing provedla;

f) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 38 odst. 4 tím, že nezveřejňuje provozní a technické požadavky na komunikační protokoly zahrnující obsah a formát zpráv, které používá ve vztahu ke třetím stranám, včetně provozních a technických požadavků uvedených v článku 7;

g) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 38 odst. 5 tím, že nezveřejňuje každé porušení kritérií uvedených v čl. 37 odst. 1 nebo požadavků stanovených v čl. 38 odst. 5 členy clearingového systému, s výjimkou případů, kdy se orgán ESMA domnívá, že by zveřejnění těchto údajů ohrozilo finanční stabilitu nebo důvěru trhu, závažně ohrozilo finanční trhy, či způsobilo nepřiměřenou škodu zúčastněným subjektům;

h) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 39 odst. 7 tím, že nezveřejňuje úrovně ochrany a náklady spojené s jednotlivými úrovněmi oddělení, jež poskytuje;

i) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 49 odst. 3 tím, že nezveřejňuje klíčové informace o svém modelu řízení rizik a předpoklady k provádění stresových testů uvedených v čl. 49 odst. 1;

j) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 50 odst. 2 tím, že zřetelně neuvádí své povinnosti v souvislosti s dodáním finančních nástrojů, včetně toho, zda je povinna provést či přijmout dodání finančního nástroje, nebo zda účastníky odškodňuje za ztráty vzniklé v průběhu dodání;

k) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 50c odst. 1 tím, že informace uvedené v čl. 50c odst. 1 písm. a), b) c), d) a e) neoznamuje těm členům svého clearingového systému, kteří jsou institucemi, nebo jejich příslušným orgánům;

l) ústřední protistrana tier 2 porušuje čl. 50c odst. 2 tím, že členům svého clearingového systému, kteří jsou institucemi, podává zprávy méně často než jednou za čtvrtletí nebo méně často, než to vyžaduje orgán ESMA v souladu s čl. 50c odst. 2.

V. Porušení povinnosti týkající se překážek, jež brání výkonu dohledu:

a) ústřední protistrana porušuje článek 25c tím, že v reakci na prostou žádost orgánu ESMA o informace podle článku 25c nebo na rozhodnutí orgánu ESMA týkající se žádosti o informace podle článku 25n poskytne nepravdivé nebo zavádějící informace;

b) ústřední protistrana poskytne nepravdivé nebo zavádějící odpovědi na otázky položené podle čl. 25d odst. 1 písm. d);

c) ústřední protistrana tier 2 nesplní včas požadavky opatření, které v oblasti dohledu přijme orgán ESMA podle článku 25n;

d) ústřední protistrana tier 2 se nepodrobí kontrole na místě nařízené rozhodnutím o šetření, které přijal orgán ESMA podle článku 25e.“

1. Vkládá se nová příloha IV, která zní:

„PŘÍLOHA IV

Seznam koeficientů spojených s přitěžujícími nebo polehčujícími okolnostmi pro účely použití čl. 25g odst. 3

Na základní výši pokuty podle čl. 25g odst. 2 se kumulativně použijí níže uvedené koeficienty:

- I. Korekční koeficienty spojené s přitěžujícími okolnostmi:
- a) pokud se jedná o opakované porušování povinnosti, za každý další případ tohoto porušení se použije dodatečný koeficient ve výši 1,1;
 - b) pokud docházelo k porušování povinnosti po dobu delší než šest měsíců, použije se koeficient ve výši 1,5;
 - c) pokud byly na základě porušování povinnosti zjištěny systémové nedostatky v organizaci ústřední protistrany, zejména v jejích postupech, systémech řízení či interní kontrole, použije se koeficient ve výši 2,2;
 - d) pokud má porušení povinnosti negativní vliv na kvalitu činností a služeb ústřední protistrany, použije se koeficient ve výši 1,5;
 - e) pokud k porušení povinnosti došlo úmyslně, použije se koeficient ve výši 2;
 - f) pokud nebyla od okamžiku, kdy bylo porušení povinností zjištěno, přijata nápravná opatření, použije se koeficient ve výši 1,7;
 - g) pokud vrcholné vedení ústřední protistrany nespolupracuje s orgánem ESMA při jeho šetření, použije se koeficient ve výši 1,5.
- II. Korekční koeficienty spojené s polehčujícími okolnostmi:
- a) pokud k porušení povinnosti docházelo po dobu kratší než deset pracovních dnů, použije se koeficient ve výši 0,9;
 - b) pokud může vrcholné vedení ústřední protistrany prokázat, že přijalo veškerá nezbytná opatření k tomu, aby porušení povinnosti zabránilo, použije se koeficient ve výši 0,7;
 - c) pokud ústřední protistrana na porušení povinnosti rychle, účinně a v plném rozsahu upozornila orgán ESMA, použije se koeficient ve výši 0,4;
 - d) pokud ústřední protistrana přijala dobrovolně opatření k zajištění toho, aby k obdobnému porušování povinnosti v budoucnu již nemohlo dojít, použije se koeficient ve výši 0,6.“