



Βρυξέλλες, 15 Ιουνίου 2017  
(OR. en)

---

---

Διοργανικός φάκελος:  
2017/0136 (COD)

---

---

10363/17  
ADD 1

EF 129  
ECOFIN 544  
SURE 21  
CODEC 1070

## ΠΡΟΤΑΣΗ

---

Αποστολέας:	Για τον Γενικό Γραμματέα της Ευρωπαϊκής Επιτροπής, ο κ. Jordi AYET PUIGARNAU, Διευθυντής
Ημερομηνία Παραλαβής:	15 Ιουνίου 2017
Αποδέκτης:	κ. Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, Γενικός Γραμματέας του Συμβουλίου της Ευρωπαϊκής Ένωσης
Αριθ. εγγρ. Επιτρ.:	COM(2017) 331 final ANNEX 1
Θέμα:	ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ της πρότασης ΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ ΤΟΥ ΕΥΡΩΠΑΪΚΟΥ ΚΟΙΝΟΒΟΥΛΙΟΥ ΚΑΙ ΤΟΥ ΣΥΜΒΟΥΛΙΟΥ για την τροποποίηση του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 1095/2010 σχετικά με τη σύσταση Ευρωπαϊκής Εποπτικής Αρχής (Ευρωπαϊκή Αρχή Κινητών Αξιών και Αγορών) και την τροποποίηση του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012 όσον αφορά τις διαδικασίες για την αδειοδότηση κεντρικών αντισυμβαλλομένων και τις αρχές που συμμετέχουν καθώς και τις απαιτήσεις για την αναγνώριση κεντρικών αντισυμβαλλομένων τρίτων χωρών

---

Διαβιβάζεται συνημμένως στις αντιπροσωπίες το έγγραφο - COM(2017) 331 final ANNEX 1.

---

σνημμ.: COM(2017) 331 final ANNEX 1

Βρυξέλλες, 13.6.2017  
COM(2017) 331 final

ANNEX 1

## ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ

*της πρότασης*

### **ΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ ΤΟΥ ΕΥΡΩΠΑΪΚΟΥ ΚΟΙΝΟΒΟΥΛΙΟΥ ΚΑΙ ΤΟΥ ΣΥΜΒΟΥΛΙΟΥ**

**για την τροποποίηση του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 1095/2010 σχετικά με τη σύσταση Ευρωπαϊκής Εποπτικής Αρχής (Ευρωπαϊκή Αρχή Κινητών Αξιών και Αγορών) και την τροποποίηση του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012 όσον αφορά τις διαδικασίες για την αδειοδότηση κεντρικών αντισυμβαλλομένων και τις αρχές που συμμετέχουν καθώς και τις απαιτήσεις για την αναγνώριση κεντρικών αντισυμβαλλομένων τρίτων χωρών**

{SWD(2017) 246 final}

{SWD(2017) 247 final}

## ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ

Τα ακόλουθα προστίθενται ως παραρτήματα III και IV του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012.

### «ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ III

Κατάλογος των παραβάσεων που αναφέρονται στο άρθρο 25ζ παράγραφος 1

#### I. Παραβάσεις που αφορούν κεφαλαιακές απαιτήσεις:

α) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 16 παράγραφος 1 εάν δεν κατέχει πάγιο και διαθέσιμο αρχικό κεφάλαιο ύψους τουλάχιστον 7,5 εκατομμυρίων ευρώ·

β) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 16 παράγραφος 2 εάν δεν διαθέτει κεφάλαιο, περιλαμβανομένων των αδιανέμητων κερδών και των αποθεματικών, το οποίο είναι ανάλογο του κινδύνου που απορρέει από τις δραστηριότητές του και επαρκεί ανά πάσα στιγμή για τη διασφάλιση εύτακτου τερματισμού της λειτουργίας ή αναδιάρθρωσης των δραστηριοτήτων, εντός εύλογου χρονικού διαστήματος, όπως και για την επαρκή προστασία του κεντρικού αντισυμβαλλομένου έναντι πιστωτικών κινδύνων, κινδύνων αντισυμβαλλομένου, κινδύνων αγοράς, λειτουργικών κινδύνων, νομικών κινδύνων και επιχειρηματικών κινδύνων που δεν καλύπτονται ήδη από συγκεκριμένους χρηματοοικονομικούς πόρους, όπως αναφέρεται στα άρθρα 41, 42, 43 και 44.

#### II. Παραβάσεις που αφορούν οργανωτικές απαιτήσεις ή συγκρούσεις συμφερόντων:

α) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 26 παράγραφος 1 εάν δεν διαθέτει άρτιο πλαίσιο διακυβέρνησης, που περιλαμβάνει σαφή οργανωτική δομή με ευκρινείς, διαφανείς και συνεπείς γραμμές ευθύνης, αποτελεσματικές διαδικασίες εντοπισμού, διαχείρισης, παρακολούθησης και αναφοράς των κινδύνων στους οποίους εκτίθεται ή ενδέχεται να εκτεθεί, καθώς και επαρκείς μηχανισμούς εσωτερικού ελέγχου, περιλαμβανομένων ορθών διοικητικών και λογιστικών διαδικασιών·

β) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 26 παράγραφος 2 εάν δεν εφαρμόζει πολιτικές και διαδικασίες οι οποίες είναι επαρκώς αποτελεσματικές ώστε να εξασφαλίζεται συμμόρφωση, συμπεριλαμβανομένης της συμμόρφωσης των διοικητικών στελεχών και των υπαλλήλων του με όλες τις διατάξεις του παρόντος κανονισμού·

γ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 26 παράγραφος 3 εάν δεν διατηρεί ή εφαρμόζει οργανωτική δομή η οποία διασφαλίζει τη συνέχεια και την εύρυθμη λειτουργία κατά την παροχή των υπηρεσιών και την άσκηση των δραστηριοτήτων του ή εάν δεν χρησιμοποιεί κατάλληλα και ανάλογα συστήματα, πόρους ή διαδικασίες·

δ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 26 παράγραφος 4 εάν δεν διατηρεί σαφή διαχωρισμό μεταξύ των γραμμών

αναφοράς σε σχέση με τη διαχείριση κινδύνου, αφενός, και όσον αφορά άλλες εργασίες του κεντρικού αντισυμβαλλομένου, αφετέρου·

ε) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 26 παράγραφος 5 εάν δεν υιοθετεί, εφαρμόζει και διατηρεί πολιτική αποδοχών η οποία προωθεί την ορθή και αποτελεσματική διαχείριση κινδύνων και η οποία δεν δημιουργεί κίνητρα χαλάρωσης των προτύπων κινδύνου·

στ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 26 παράγραφος 6 εάν δεν διατηρεί συστήματα τεχνολογίας των πληροφοριών κατάλληλα για τη διαχείριση της πολυπλοκότητας, της ποικιλίας και των ειδών των παρεχόμενων υπηρεσιών και των ασκούμενων δραστηριοτήτων, ώστε να κατοχυρώνονται υψηλά επίπεδα ασφαλείας, καθώς και η ακεραιότητα και η εμπιστευτικότητα των διατηρούμενων πληροφοριών·

ζ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 26 παράγραφος 7 εάν δεν θέτει δωρεάν στη διάθεση του κοινού τις ρυθμίσεις διακυβέρνησής του, τους κανόνες που διέπουν τον κεντρικό αντισυμβαλλόμενο και τα κριτήρια αποδοχής εκκαθαριστικών μελών·

η) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 26 παράγραφος 8 εάν δεν υπόκειται σε συχνούς και ανεξάρτητους ελέγχους ή εάν δεν γνωστοποιεί τα αποτελέσματα των εν λόγω ελέγχων στο συμβούλιο ή δεν θέτει τα αποτελέσματα αυτά στη διάθεση της ΕΑΚΑΑ·

θ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 27 παράγραφος 1 ή το άρθρο 27 παράγραφος 2 δεύτερο εδάφιο εάν δεν μεριμνά ώστε τα ανώτατα διοικητικά στελέχη του και τα μέλη του συμβουλίου να διαθέτουν επαρκή καλή φήμη και πείρα ώστε να διασφαλίζεται η χρηστή και συνετή διαχείριση του κεντρικού αντισυμβαλλομένου·

ι) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 27 παράγραφος 2 εάν δεν διασφαλίζει ότι τουλάχιστον το ένα τρίτο, και όχι λιγότερα από δύο, από τα μέλη του συμβουλίου κεντρικού αντισυμβαλλομένου είναι ανεξάρτητα, ή εάν δεν προσκαλούνται οι εκπρόσωποι των πελατών των εκκαθαριστικών μελών στις συνεδριάσεις του συμβουλίου για ζητήματα που σχετίζονται με τα άρθρα 38 και 39, ή εάν η αμοιβή των ανεξάρτητων και των λοιπών μη εκτελεστικών μελών του συμβουλίου συνδέεται με τις επιχειρηματικές επιδόσεις του κεντρικού αντισυμβαλλομένου·

ια) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 27 παράγραφος 3 εάν δεν καθορίζει σαφώς τους ρόλους και τις αρμοδιότητες του συμβουλίου ή εάν δεν θέτει στη διάθεση της ΕΑΚΑΑ ή των ελεγκτών τα πρακτικά των συνεδριάσεων του συμβουλίου·

ιβ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 28 παράγραφος 1 εάν δεν συγκροτεί επιτροπή κινδύνου, ή εάν η εν λόγω επιτροπή κινδύνου δεν απαρτίζεται από εκπροσώπους των εκκαθαριστικών μελών του, από ανεξάρτητα μέλη του συμβουλίου και από εκπροσώπους των πελατών του, ή εάν η επιτροπή κινδύνου συγκροτείται κατά τρόπο ώστε μια από αυτές τις ομάδες εκπροσώπων να διαθέτει πλειοψηφία στην επιτροπή κινδύνου, ή εάν δεν ενημερώνει δεόντως την ΕΑΚΑΑ για τις δραστηριότητες και αποφάσεις

της επιτροπής κινδύνου, σε περίπτωση που η ΕΑΚΑΑ έχει ζητήσει να της παρέχεται η δέουσα ενημέρωση·

ιγ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 28 παράγραφος 2 εάν δεν καθορίζει σαφώς την εντολή, τις ρυθμίσεις διακυβέρνησης για την κατοχύρωση της ανεξαρτησίας της, τις λειτουργικές διαδικασίες, τα κριτήρια αποδοχής των μελών ή τον μηχανισμό εκλογής των μελών της επιτροπής κινδύνου, ή εάν δεν δημοσιοποιεί τις ρυθμίσεις διακυβέρνησης, ή εάν δεν προβλέπει ότι στην επιτροπή κινδύνου προεδρεύει ανεξάρτητο μέλος του συμβουλίου και ότι η επιτροπή κινδύνου αναφέρεται απ' ευθείας στο συμβούλιο και πραγματοποιεί τακτικές συνεδριάσεις·

ιδ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 28 παράγραφος 3 εάν δεν παρέχει τη δυνατότητα στην επιτροπή κινδύνου να συμβουλευεί το συμβούλιο όσον αφορά κάθε ρύθμιση η οποία ενδέχεται να έχει επιπτώσεις στη διαχείριση κινδύνου του κεντρικού αντισυμβαλλομένου, ή εάν δεν καταβάλλει εύλογες προσπάθειες για διαβούλευση με την επιτροπή κινδύνου όσον αφορά εξελίξεις που επιδρούν στη διαχείριση κινδύνου σε καταστάσεις έκτακτης ανάγκης·

ιε) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 28 παράγραφος 5 εάν δεν ενημερώνει πάραυτα την ΕΑΚΑΑ σχετικά με κάθε απόφαση όπου το συμβούλιο αποφασίζει να μην ακολουθήσει τις συμβουλές της επιτροπής κινδύνου·

ιστ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 29 παράγραφος 1 εάν δεν διατηρεί όλα τα αρχεία που αφορούν τις παρασχεθείσες υπηρεσίες και τις ασκηθείσες δραστηριότητες από τον εν λόγω κεντρικό αντισυμβαλλόμενο, για χρονικό διάστημα τουλάχιστον δέκα ετών, τα οποία απαιτούνται ώστε να είναι σε θέση η ΕΑΚΑΑ να παρακολουθεί τη συμμόρφωση του κεντρικού αντισυμβαλλομένου προς τον παρόντα κανονισμό·

ιζ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 29 παράγραφος 2 εάν δεν διατηρεί, για χρονικό διάστημα τουλάχιστον δέκα ετών από τη λήξη μιας σύμβασης, όλες τις πληροφορίες για όλες τις συμβάσεις που έχει διεκπεραιώσει, κατά τρόπο που να καθιστά δυνατό τον προσδιορισμό των αρχικών όρων μιας συναλλαγής, πριν αυτή εκκαθαριστεί από τον σχετικό κεντρικό αντισυμβαλλόμενο·

ιη) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 29 παράγραφος 3 εάν δεν θέτει στη διάθεση της ΕΑΚΑΑ και των σχετικών μελών του ΕΣΚΤ, κατόπιν αιτήματος, τα αρχεία και τις πληροφορίες που αναφέρονται στο άρθρο 29 παράγραφοι 1 και 2, ή όλες τις πληροφορίες σχετικά με τις θέσεις των συμβάσεων που εκκαθαρίστηκαν, ανεξαρτήτως του τύπου όπου εκτελέστηκαν οι συναλλαγές·

ιθ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 30 παράγραφος 1 εάν δεν γνωστοποιηθεί στην ΕΑΚΑΑ – ή η γνωστοποίηση είναι ψευδής ή ελλιπής – η ταυτότητα των μετόχων ή των μελών του, ανεξαρτήτως του αν πρόκειται για άμεσους ή έμμεσους, φυσικά ή νομικά πρόσωπα, που κατέχουν ειδικές συμμετοχές, ή το ύψος των εν λόγω ειδικών συμμετοχών·

κ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 30 παράγραφος 4 εάν επιτρέπει στα πρόσωπα που αναφέρονται στο άρθρο 30 παράγραφος 1 να ασκούν επιρροή η οποία είναι δυνατόν να αποβεί εις βάρος της χρηστής και συνετής διαχείρισης του κεντρικού αντισυμβαλλομένου·

κα) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 31 παράγραφος 1 εάν δεν κοινοποιεί στην ΕΑΚΑΑ – ή η κοινοποίηση είναι ψευδής ή ελλιπής – κάθε μεταβολή στη διοίκησή του ή δεν παρέχει στην ΕΑΚΑΑ όλες τις πληροφορίες που είναι αναγκαίες για να εκτιμήσει τη συμμόρφωση με το άρθρο 27 παράγραφος 1 ή με το άρθρο 27 παράγραφος 2 δεύτερο εδάφιο·

κβ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 33 παράγραφος 1 εάν δεν διατηρεί ή εφαρμόζει αποτελεσματικές γραπτές οργανωτικές και διοικητικές ρυθμίσεις, προκειμένου να εντοπίζει ή να διαχειρίζεται πιθανή σύγκρουση συμφερόντων μεταξύ του ιδίου, συμπεριλαμβανομένων των διοικητικών στελεχών και των υπαλλήλων του ή κάθε προσώπου που συνδέεται μαζί τους με σχέση άμεσου ή έμμεσου ελέγχου ή με άμεσους ή έμμεσους στενούς δεσμούς, και των εκκαθαριστικών μελών του ή των πελατών τους που είναι γνωστοί στον κεντρικό αντισυμβαλλόμενο, ή εάν δεν διατηρεί ή εφαρμόζει κατάλληλες διαδικασίες με σκοπό την επίλυση πιθανών συγκρούσεων συμφερόντων·

κγ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 33 παράγραφος 2 εάν δεν γνωστοποιεί σαφώς, στο εκκαθαριστικό μέλος ή σε ενδιαφερόμενο πελάτη του εν λόγω εκκαθαριστικού μέλους ο οποίος είναι γνωστός στον κεντρικό αντισυμβαλλόμενο, τη γενική φύση ή τις πηγές συγκρούσεων συμφερόντων, προτού δεχτεί νέες συναλλαγές από το εν λόγω εκκαθαριστικό μέλος, εάν οι οργανωτικές ή διοικητικές ρυθμίσεις του κεντρικού αντισυμβαλλομένου για τη διαχείριση των συγκρούσεων συμφερόντων δεν επαρκούν για να εξασφαλιστεί, με εύλογη βεβαιότητα, η πρόληψη των κινδύνων να επηρεαστούν αρνητικά τα συμφέροντα εκκαθαριστικού μέλους ή πελάτη·

κδ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 33 παράγραφος 3 εάν οι γραπτές ρυθμίσεις του δεν λαμβάνουν υπόψη οποιεσδήποτε περιστάσεις, τις οποίες γνωρίζει ή θα έπρεπε να γνωρίζει, και οι οποίες μπορεί να προκαλέσουν σύγκρουση συμφερόντων ως αποτέλεσμα της δομής και των επιχειρηματικών δραστηριοτήτων άλλων επιχειρήσεων με τις οποίες έχει σχέση μητρικής ή θυγατρικής επιχείρησης·

κε) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 33 παράγραφος 5 εάν δεν λαμβάνει κάθε εύλογο μέτρο, προκειμένου να αποφευχθεί η κατάχρηση των πληροφοριών που διατηρούνται στα συστήματά του, ή δεν αποφεύγει τη χρήση των εν λόγω πληροφοριών για άλλες επιχειρηματικές δραστηριότητες, ή τη χρήση για εμπορικούς σκοπούς, από φυσικό πρόσωπο που έχει στενή σχέση με έναν κεντρικό αντισυμβαλλόμενο ή νομικό πρόσωπο που έχει σχέση μητρικής ή θυγατρικής επιχείρησης με τον κεντρικό αντισυμβαλλόμενο, εμπιστευτικών πληροφοριών που καταγράφηκαν στον εν λόγω κεντρικό αντισυμβαλλόμενο, χωρίς την προηγούμενη συγκατάθεση από τον πελάτη στον οποίο ανήκουν οι εμπιστευτικές πληροφορίες αυτές·

κστ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 36 παράγραφος 1 εάν δεν ενεργεί με εντιμότητα και επαγγελματισμό, ώστε να εξυπηρετεί με τον καλύτερο τρόπο τα συμφέροντα των εκκαθαριστικών μελών του και των πελατών τους·

κζ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 36 παράγραφος 2 εάν δεν διαθέτει προσιτούς, διαφανείς και δίκαιους κανόνες για τον γρήγορο χειρισμό των παραπόνων·

κη) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 37 παράγραφος 1 ή 2 εάν χρησιμοποιεί, σε συνεχή βάση, μεροληπτικά, αδιαφανή ή υποκειμενικά κριτήρια αποδοχής, ή εάν δεν διασφαλίζει διαφορετικά ισότιμη και ανοικτή πρόσβαση στον εν λόγω κεντρικό αντισυμβαλλόμενο, σε συνεχή βάση, ή εάν δεν κατοχυρώνει, σε συνεχή βάση, ότι τα εκκαθαριστικά μέλη του διαθέτουν επαρκείς χρηματοοικονομικούς πόρους και επιχειρησιακή ικανότητα για να ανταποκρίνονται στις υποχρεώσεις που απορρέουν από τη συμμετοχή στον συγκεκριμένο κεντρικό αντισυμβαλλόμενο, ή εάν δεν προβαίνει σε συνολική επανεξέταση της συμμόρφωσης των εκκαθαριστικών μελών του, σε ετήσια βάση·

κθ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 37 παράγραφος 4 εάν δεν διαθέτει αντικειμενικές και διαφανείς διαδικασίες για την αναστολή και την ομαλή αποχώρηση των εκκαθαριστικών μελών τα οποία δεν πληρούν πλέον τα κριτήρια που αναφέρονται στο άρθρο 37 παράγραφος 1·

λ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 37 παράγραφος 5 εάν αρνηθεί την πρόσβαση εκκαθαριστικού μέλους, το οποίο πληροί τα κριτήρια που αναφέρονται στο άρθρο 37 παράγραφος 1, χωρίς δέουσα γραπτή αιτιολόγηση της άρνησης και βάσει συνολικής ανάλυσης κινδύνου·

λα) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 38 παράγραφος 1 εάν δεν επιτρέπει στους πελάτες των εκκαθαριστικών μελών του χωριστή πρόσβαση στις διάφορες παρεχόμενες υπηρεσίες·

λβ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 39 παράγραφος 7 εάν δεν προσφέρει τα διάφορα επίπεδα διαχωρισμού, που αναφέρονται στην εν λόγω παράγραφο, υπό εύλογους εμπορικούς όρους.

### III. Παραβάσεις που αφορούν λειτουργικές απαιτήσεις:

α) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 34 παράγραφος 1 εάν δεν διαμορφώνει, εφαρμόζει και διατηρεί κατάλληλη πολιτική αδιάλειπτης λειτουργίας και σχέδιο αποκατάστασης λειτουργίας μετά από καταστροφή, με σκοπό να διασφαλίσει τη διατήρηση των λειτουργιών του, την έγκαιρη αποκατάσταση των εργασιών και την εκπλήρωση των υποχρεώσεων του κεντρικού αντισυμβαλλομένου, η οποία επιτρέπει τουλάχιστον την αποκατάσταση όλων των συναλλαγών κατά τη στιγμή της διακοπής, ώστε να είναι σε θέση ο κεντρικός αντισυμβαλλόμενος να εξακολουθήσει να λειτουργεί με ασφάλεια και να ολοκληρώσει τον διακανονισμό στην καθορισμένη ημερομηνία·

β) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 34 παράγραφος 2 εάν δεν θεσπίζει, εφαρμόζει και διατηρεί μια κατάλληλη διαδικασία με σκοπό να εξασφαλίζει τον έγκαιρο και εύρυθμο διακανονισμό ή τη μεταφορά των περιουσιακών στοιχείων και των θέσεων των πελατών και των εκκαθαριστικών μελών, σε περίπτωση ανάκλησης της αναγνώρισης λόγω απόφασης δυνάμει του άρθρου 25·

γ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 35 παράγραφος 1 δεύτερο εδάφιο εάν αναθέτει εξωτερικά μείζονες δραστηριότητες που συνδέονται με τη διαχείριση κινδύνων του εν λόγω κεντρικού αντισυμβαλλομένου·

δ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 39 παράγραφος 1 εάν δεν τηρεί χωριστά αρχεία και λογαριασμούς που του επιτρέπουν, ανά πάσα στιγμή και χωρίς καθυστέρηση, να διακρίνει στους λογαριασμούς που τηρούνται σε αυτόν τα περιουσιακά στοιχεία και τις θέσεις που κρατούνται για λογαριασμό εκκαθαριστικού μέλους από τα περιουσιακά στοιχεία και τις θέσεις που κρατούνται για λογαριασμό οποιουδήποτε άλλου εκκαθαριστικού μέλους, καθώς και από τα δικά του περιουσιακά στοιχεία·

ε) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 39 παράγραφος 2 εάν δεν προσφέρεται να τηρεί, ή δεν τηρεί όταν του έχει ζητηθεί, χωριστά αρχεία και λογαριασμούς που δίνουν τη δυνατότητα σε κάθε εκκαθαριστικό μέλος να διακρίνει, σε λογαριασμούς στον κεντρικό αντισυμβαλλόμενο, τα περιουσιακά στοιχεία και τις θέσεις του εν λόγω εκκαθαριστικού μέλους από εκείνα που κρατούνται για λογαριασμό των εκκαθαριστικών μελών του·

στ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 39 παράγραφος 3 εάν δεν προσφέρεται να τηρεί, ή δεν τηρεί όταν του έχει ζητηθεί, χωριστά αρχεία και λογαριασμούς που δίνουν τη δυνατότητα σε κάθε εκκαθαριστικό μέλος να διακρίνει, σε λογαριασμούς με τον κεντρικό αντισυμβαλλόμενο, τα περιουσιακά στοιχεία και τις θέσεις που κρατούνται για λογαριασμό ενός πελάτη από εκείνα που κρατούνται για λογαριασμό άλλων πελατών, ή εάν δεν προσφέρει στα εκκαθαριστικά μέλη τη δυνατότητα να ανοίγουν περισσότερους λογαριασμούς στο όνομά τους για τους πελάτες τους, κατόπιν αιτήματος·

ζ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 40 εάν δεν προβαίνει σε μέτρηση και εκτίμηση της έκθεσής του σε κίνδυνο ρευστότητας και της πιστωτικής έκθεσής του έναντι κάθε εκκαθαριστικού μέλους και, ενδεχομένως, άλλου κεντρικού αντισυμβαλλομένου με τον οποίο έχει προβεί σε ρυθμίσεις διαλειτουργικότητας, σε σχεδόν πραγματικό χρόνο, ή εάν δεν διαθέτει πρόσβαση σε σχετικές πηγές καθορισμού τιμών, ώστε να είναι σε θέση να μετρά αποτελεσματικά τα ανοίγματά του, σε βάση εύλογου κόστους·

η) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 41 παράγραφος 1 εάν, προκειμένου να περιορίσει την πιστωτική του έκθεση, δεν επιβάλλει, ζητεί ή συγκεντρώνει περιθώρια ασφαλείας από τα εκκαθαριστικά μέλη του ή, ενδεχομένως, από τους κεντρικούς αντισυμβαλλομένους με τους οποίους έχει προβεί σε ρυθμίσεις διαλειτουργικότητας, ή εάν επιβάλλει, ζητεί ή συγκεντρώνει περιθώρια ασφαλείας που δεν επαρκούν για την κάλυψη

δυνητικών ανοιγμάτων τα οποία ο κεντρικός αντισυμβαλλόμενος, υπολογίζει να παρουσιαστούν μέχρι τη ρευστοποίηση των σχετικών θέσεων, ή για την κάλυψη των ζημιών που προκύπτουν από τουλάχιστον 99 % των μεταβολών των ανοιγμάτων, σε κατάλληλο χρονικό ορίζοντα, ή δεν επαρκούν για να διασφαλιστεί ότι ο κεντρικός αντισυμβαλλόμενος καλύπτει πλήρως τα ανοίγματά του με όλα τα εκκαθαριστικά μέλη του και, ενδεχομένως, με τους κεντρικούς αντισυμβαλλομένους με τους οποίους έχει προβεί σε ρυθμίσεις διαλειτουργικότητας, τουλάχιστον επί καθημερινής βάσεως, ή, εφόσον απαιτείται, για να ληφθούν υπόψη ενδεχόμενες φιλοκυκλικές επιπτώσεις·

θ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 41 παράγραφος 2 εάν, κατά τον καθορισμό των απαιτήσεων του για περιθώρια ασφαλείας, ο κεντρικός αντισυμβαλλόμενος δεν εφαρμόζει μοντέλα και παραμέτρους που συλλαμβάνουν τα χαρακτηριστικά κινδύνου των προϊόντων που εκκαθαρίζονται, λαμβάνοντας υπόψη το διάστημα που μεσολαβεί μεταξύ της συλλογής των περιθωρίων ασφαλείας, την ρευστότητα της αγοράς και την πιθανότητα αλλαγών καθ' όλη τη διάρκεια της συναλλαγής·

ι) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 41 παράγραφος 3 εάν δεν ζητεί και συγκεντρώνει περιθώρια ασφαλείας, σε ενδοημερήσια βάση, τουλάχιστον όταν σημειώνεται υπέρβαση προκαθορισμένων κατωφλίων·

ια) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 42 παράγραφος 3 εάν δεν διατηρεί τουλάχιστον κεφάλαιο εκκαθάρισης το οποίο του επιτρέπει να αντιμετωπίσει, υπό ακραίες αλλά εύλογες συνθήκες αγοράς, την αθέτηση υποχρέωσης από το εκκαθαριστικό μέλος έναντι του οποίου έχει τα μεγαλύτερα ανοίγματα ή από το δεύτερο και το τρίτο μεγαλύτερο εκκαθαριστικό μέλος, εάν το άθροισμα των ανοιγμάτων τους είναι μεγαλύτερο, ή εάν καταρτίζει σενάρια που δεν περιλαμβάνουν τις περιόδους με τις μεγαλύτερες διακυμάνσεις που έχουν σημειωθεί στις αγορές στις οποίες παρέχει τις υπηρεσίες του ο κεντρικός αντισυμβαλλόμενος, και μια σειρά πιθανών μελλοντικών σεναρίων, τα οποία να λαμβάνουν υπόψη αιφνίδιες πωλήσεις χρηματοοικονομικών πόρων και γρήγορες μειώσεις της ρευστότητας της αγοράς·

ιβ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 43 παράγραφος 2 εάν το κεφάλαιο εκκαθάρισής του, που αναφέρεται στο άρθρο 42, και οι άλλοι χρηματοοικονομικοί του πόροι, που αναφέρονται στο άρθρο 43 παράγραφος 1, δεν του παρέχουν τη δυνατότητα να αντιμετωπίσει την αθέτηση υποχρέωσης από τα δύο εκκαθαριστικά μέλη έναντι των οποίων έχει τα μεγαλύτερα ανοίγματα, υπό ακραίες αλλά εύλογες συνθήκες αγοράς·

ιγ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 44 παράγραφος 1 εάν δεν διαθέτει ανά πάσα στιγμή πρόσβαση σε επαρκή ρευστότητα, προκειμένου να παρέχει τις υπηρεσίες του και να ασκεί δραστηριότητες, ή εάν δεν υπολογίζει σε καθημερινή βάση τις δυνητικές του ανάγκες σε ρευστότητα·

ιδ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 45 παράγραφοι 1, 2 και 3 εάν δεν χρησιμοποιεί, για την κάλυψη των ζημιών, τα περιθώρια ασφαλείας που έχουν παρασχεθεί από το υπερήμερο εκκαθαριστικό μέλος, πριν από άλλους χρηματοοικονομικούς πόρους·

ιε) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 45 παράγραφος 4 εάν δεν χρησιμοποιεί ειδικούς ίδιους πόρους πριν χρησιμοποιήσει τις εισφορές των εκκαθαριστικών μελών, που δεν έχουν αθετήσει υποχρέωση, στο κεφάλαιο εκκαθάρισης·

ιστ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 46 παράγραφος 1 εάν δέχεται οτιδήποτε άλλο εκτός από άκρως ρευστοποιήσιμες ασφάλειες, με ελάχιστο πιστωτικό κίνδυνο και κίνδυνο αγοράς, για την κάλυψη του αρχικού και συνεχιζόμενου ανοίγματός του έναντι των εκκαθαριστικών μελών του, όπου δεν επιτρέπονται άλλες ασφάλειες, σύμφωνα με την κατ' εξουσιοδότηση πράξη που εκδίδεται από την Επιτροπή σύμφωνα με το άρθρο 46 παράγραφος 3·

ιζ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 47 παράγραφος 1 εάν επενδύει τους χρηματοοικονομικούς πόρους του σε άλλα μέσα εκτός από μετρητά ή άκρως ρευστοποιήσιμα χρηματοπιστωτικά μέσα, με ελάχιστο κίνδυνο αγοράς και πιστωτικό κίνδυνο, και ταχέως ρευστοποιήσιμες επενδύσεις, με ελάχιστες δυσμενείς επιπτώσεις στις τιμές·

ιη) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 47 παράγραφος 3 εάν δεν καταθέτει τα χρηματοπιστωτικά μέσα που παρέχονται ως περιθώρια ασφαλείας ή ως εισφορές στο κεφάλαιο εκκαθάρισης σε διαχειριστές συστημάτων διακανονισμού αξιογράφων που διασφαλίζουν την πλήρη προστασία των εν λόγω χρηματοπιστωτικών μέσων, εφόσον είναι διαθέσιμα, ή εάν δεν χρησιμοποιεί άλλες ρυθμίσεις υψηλής ασφάλειας σε εγκεκριμένα χρηματοπιστωτικά ιδρύματα·

ιθ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 47 παράγραφος 4 εάν τα ταμειακά διαθέσιμά του τηρούνται με άλλον τρόπο πλην μέσω άκρως ασφαλών διευθετήσεων με εγκεκριμένα χρηματοπιστωτικά ιδρύματα ή μέσω της χρησιμοποίησης άγιων καταθετικών διευκολύνσεων των κεντρικών τραπεζών ή μέσω άλλων συγκρίσιμων τρόπων που παρέχονται από τις κεντρικές τράπεζες·

κ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 47 παράγραφος 5 εάν καταθέτει περιουσιακά στοιχεία σε τρίτο πρόσωπο, χωρίς να εξασφαλίζει ότι τα περιουσιακά στοιχεία που ανήκουν στα εκκαθαριστικά μέλη ταυτοποιούνται χωριστά από τα περιουσιακά στοιχεία που ανήκουν στον κεντρικό αντισυμβαλλόμενο και από τα περιουσιακά στοιχεία που ανήκουν στο εν λόγω τρίτο πρόσωπο, μέσω λογαριασμών με διακριτές ονομασίες στα βιβλία του τρίτου προσώπου ή μέσω άλλων ισοδύναμων μέτρων που επιτυγχάνουν το ίδιο επίπεδο προστασίας, ή εάν δεν διαθέτει άμεση πρόσβαση στα χρηματοπιστωτικά μέσα, όταν απαιτείται·

κα) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 47 παράγραφος 6 εάν επενδύει το κεφάλαιό του ή τα ποσά που προκύπτουν από τις απαιτήσεις που αναφέρονται στο άρθρο 41, 42, 43 ή 44 σε δικές του κινητές αξίες ή σε κινητές αξίες της μητρικής επιχείρησης ή της θυγατρικής του·

κβ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 48 παράγραφος 1 εάν δεν προβλέπει λεπτομερείς διαδικασίες που πρέπει να ακολουθούνται σε περίπτωση που ένα εκκαθαριστικό μέλος δεν

συμμορφώνεται προς τις απαιτήσεις συμμετοχής που προβλέπονται στο άρθρο 37, εντός των προθεσμιών και σύμφωνα με τις διαδικασίες που έχουν καθοριστεί από τον κεντρικό αντισυμβαλλόμενο, ή εάν δεν καθορίζει λεπτομερώς τις διαδικασίες που πρέπει να ακολουθούνται σε περίπτωση που η αθέτηση υποχρέωσης εκκαθαριστικού μέλους δεν κηρύσσεται από τον κεντρικό αντισυμβαλλόμενο, ή εάν δεν επανεξετάζει τις εν λόγω διαδικασίες ετησίως·

κγ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 48 παράγραφος 2 εάν δεν προβαίνει σε άμεσες ενέργειες για τον περιορισμό των ζημιών και των πιέσεων στη ρευστότητα που προκύπτουν από αθετήσεις υποχρεώσεων από εκκαθαριστικό μέλος, και δεν διασφαλίζει ότι το κλείσιμο των θέσεων οποιουδήποτε εκκαθαριστικού μέλους δεν προκαλεί αναστάτωση στις εργασίες του, ούτε εκθέτει τα μη υπερήμερα εκκαθαριστικά μέλη σε ζημιές τις οποίες δεν μπορούν να προβλέψουν ή να ελέγξουν·

κδ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 48 παράγραφος 3 εάν δεν ενημερώσει πάραυτα την ΕΑΚΑΑ, πριν κηρυχθούν ή εκκινήσουν οι διαδικασίες που προβλέπονται σε περίπτωση αθέτησης υποχρέωσης·

κε) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 48 παράγραφος 4 εάν δεν εξασφαλίζει ότι οι διαδικασίες που προβλέπονται σε περίπτωση αθέτησης υποχρέωσης είναι εκτελεστές, και δεν λαμβάνει κάθε εύλογο μέτρο, προκειμένου να διασφαλίσει ότι διαθέτει εξουσία εκ του νόμου για τη ρευστοποίηση των κατά κυριότητα κατεχόμενων θέσεων του εκκαθαριστικού μέλους που αθετεί υποχρέωση και για τη μεταφορά ή ρευστοποίηση των θέσεων των πελατών του εκκαθαριστικού μέλους που αθετεί υποχρέωση·

κε) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 49 παράγραφος 1 εάν δεν επανεξετάζει τακτικά τα μοντέλα και τις παραμέτρους που εφαρμόζονται για τον υπολογισμό των απαιτήσεών του για περιθώρια ασφαλείας, των εισφορών στο κεφάλαιο εκκαθάρισης, των απαιτήσεων παροχής ασφαλείας ή άλλων μηχανισμών ελέγχου κινδύνων, και εάν δεν υποβάλλει τα μοντέλα σε αυστηρές και συχνές προσομοιώσεις ακραίων καταστάσεων, προκειμένου να αξιολογήσει την ανθεκτικότητά τους σε ακραίες, αλλά εύλογες συνθήκες αγοράς ή δεν εκτελεί απολογιστικούς ελέγχους, προκειμένου να αξιολογήσει την αξιοπιστία της μεθοδολογίας που εφαρμόστηκε, ή εάν δεν λαμβάνει ανεξάρτητη επικύρωση, ή εάν δεν ενημερώνει την ΕΑΚΑΑ για τα αποτελέσματα των δοκιμών που πραγματοποιήθηκαν ή δεν λαμβάνει την επικύρωση της ΕΑΚΑΑ, πριν προβεί σε οποιαδήποτε σημαντική αλλαγή των μοντέλων και των παραμέτρων·

κστ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 49 παράγραφος 2 εάν δεν ελέγχει τακτικά τις βασικές πτυχές των διαδικασιών του σε περίπτωση αθέτησης υποχρεώσεων, ή εάν δεν λαμβάνει κάθε εύλογο μέτρο, προκειμένου να διασφαλίσει ότι όλα τα εκκαθαριστικά μέλη τις κατανοούν και έχουν προβλέψει κατάλληλες ρυθμίσεις για να αντιμετωπίσουν γεγονότα αθέτησης υποχρεώσεων·

κζ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 49 παράγραφος 1α εάν υιοθετήσει οποιαδήποτε σημαντική αλλαγή στα μοντέλα

και τις παραμέτρους που αναφέρονται στο άρθρο 49 παράγραφος 1, πριν λάβει την επικύρωση αυτής της αλλαγής από την ΕΑΚΑΑ·

κη) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 50 παράγραφος 1 εάν δεν χρησιμοποιεί, εφόσον είναι πραγματοποιήσιμο και διαθέσιμο, χρήμα κεντρικής τράπεζας για τον διακανονισμό των συναλλαγών του, ή εάν δεν λαμβάνει μέτρα για τον αυστηρό περιορισμό των κινδύνων ταμειακού διακανονισμού, εάν δεν χρησιμοποιείται χρήμα κεντρικής τράπεζας·

κθ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 50 παράγραφος 3 εάν δεν εξαλείφει τους κινδύνους κεφαλαίου, με την προσφυγή, όσο το δυνατόν, σε μηχανισμούς «παράδοσης με την πληρωμή», σε περίπτωση που ο κεντρικός αντισυμβαλλόμενος έχει υποχρέωση να προβεί σε παραδόσεις ή παραλαβές χρηματοπιστωτικών μέσων·

λ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 50α ή το άρθρο 50β εάν δεν υπολογίζει το  $K_{CCP}$  ως ορίζεται στο εν λόγω άρθρο ή εάν δεν τηρεί τους κανόνες για τον υπολογισμό του  $K_{CCP}$ , που προβλέπονται στο άρθρο 50α παράγραφος 2 και στα άρθρα 50β και 50δ·

λα) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 50α παράγραφος 3 εάν υπολογίζει το  $K_{CCP}$  λιγότερο από μία φορά το τρίμηνο ή λιγότερο συχνά από όσο απαιτείται από την ΕΑΚΑΑ, σύμφωνα με το άρθρο 50α παράγραφος 3·

λβ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 51 παράγραφος 2 εάν δεν διαθέτει πρόσβαση χωρίς διακρίσεις, τόσο στα δεδομένα που χρειάζεται για την άσκηση των καθηκόντων του από έναν τόπο διαπραγμάτευσης, στο μέτρο που ο κεντρικός αντισυμβαλλόμενος πληροί τις λειτουργικές και τεχνικές απαιτήσεις που καθορίζονται από τον τόπο διαπραγμάτευσης, όσο και στο αντίστοιχο σύστημα διακανονισμού·

λγ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 52 παράγραφος 1 εάν προβεί σε ρυθμίσεις διαλειτουργικότητας, χωρίς να πληροί κάποια από τις απαιτήσεις που καθορίζονται στο στοιχείο α), στοιχείο β), στοιχείο γ) και στοιχείο δ) της εν λόγω παραγράφου·

λδ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 53 παράγραφος 1 εάν δεν διακρίνει στους λογαριασμούς τα περιουσιακά στοιχεία και τις θέσεις που τηρούνται για λογαριασμό άλλου κεντρικού αντισυμβαλλομένου με τον οποίο έχει προβεί σε ρυθμίσεις διαλειτουργικότητας·

λε) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 54 παράγραφος 1 εάν προβεί σε ρυθμίσεις διαλειτουργικότητας χωρίς την προηγούμενη έγκριση της ΕΑΚΑΑ.

IV. Παραβάσεις που αφορούν τη διαφάνεια και τη διαθεσιμότητα των πληροφοριών:

α) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 38 παράγραφος 1 εάν δεν δημοσιοποιεί τις τιμές και τα τέλη για κάθε υπηρεσία

χωριστά, συμπεριλαμβανομένων των εκπτώσεων και των επιστροφών, καθώς και τους όρους παροχής του οφέλους των εν λόγω μειώσεων·

β) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 38 παράγραφος 1 εάν δεν γνωστοποιεί τις πληροφορίες για τα έξοδα και τα έσοδα σχετικά με τις υπηρεσίες του στην ΕΑΚΑΑ·

γ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 38 παράγραφος 2 εάν δεν κοινοποιεί στα εκκαθαριστικά μέλη του και στους πελάτες τους τούς συναφείς κινδύνους των παρεχόμενων υπηρεσιών·

δ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 38 παράγραφος 3 εάν δεν κοινοποιεί στα εκκαθαριστικά μέλη του ή στην ΕΑΚΑΑ τις πληροφορίες για τις τιμές που χρησιμοποιούνται για τον υπολογισμό των ανοιγμάτων του έναντι των εκκαθαριστικών μελών στο τέλος της ημέρας, ή εάν δεν δημοσιοποιεί τον όγκο των συναλλαγών που εκκαθαρίστηκαν για κάθε μέσο από τον κεντρικό αντισυμβαλλόμενο σε συγκεντρωτική βάση·

στ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 38 παράγραφος 4 εάν δεν δημοσιοποιεί τις λειτουργικές και τεχνικές απαιτήσεις που αφορούν τα πρωτόκολλα επικοινωνίας, τα οποία καλύπτουν τους μορφοτύπους περιεχομένου και μηνύματος που χρησιμοποιεί στην επικοινωνία του με τρίτους, συμπεριλαμβανομένων των λειτουργικών και τεχνικών προδιαγραφών που αναφέρονται στο άρθρο 7·

ζ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 38 παράγραφος 5 εάν δεν δημοσιοποιεί τυχόν παραβιάσεις, από πλευράς των εκκαθαριστικών μελών, των κριτηρίων που αναφέρονται στο άρθρο 37 παράγραφος 1 ή των απαιτήσεων που θεσπίζονται στο άρθρο 38 παράγραφος 5, εκτός αν η ΕΑΚΑΑ θεωρήσει ότι η δημοσιοποίησή τους θα συνιστούσε απειλή για την χρηματοπιστωτική σταθερότητα ή την εμπιστοσύνη της αγοράς, ή θα έθετε σε σοβαρό κίνδυνο τις χρηματοπιστωτικές αγορές, ή θα προκαλούσε δυσανάλογη ζημία στα εμπλεκόμενα μέρη·

η) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 39 παράγραφος 7 εάν δεν δημοσιοποιεί το επίπεδο προστασίας και το κόστος που συνδέονται με τα διάφορα επίπεδα διαχωρισμού που παρέχει·

θ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 49 παράγραφος 3 εάν δεν δημοσιοποιεί βασικές πλευρές σχετικά με το μοντέλο διαχείρισης κινδύνου που εφαρμόζει ή τις υποθέσεις που δέχεται κατά την εκτέλεση των ελέγχων που αναφέρονται στο άρθρο 49 παράγραφος 1·

ι) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 50 παράγραφος 2 εάν δεν δηλώνει σαφώς τις υποχρεώσεις του όσον αφορά τις παραδόσεις χρηματοπιστωτικών μέσων, αναφέροντας συγκεκριμένα αν έχει υποχρέωση να προβεί σε παράδοση ή παραλαβή χρηματοπιστωτικού μέσου ή αν αποζημιώνει συμμετέχοντες για ζημίες που πραγματοποιήθηκαν κατά τη διαδικασία παράδοσης·

ια) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 50γ παράγραφος 1 εάν δεν κοινοποιεί τις πληροφορίες που αναφέρονται στο

άρθρο 50γ παράγραφος 1 στοιχεία α), β), γ), δ) και ε) στα εκκαθαριστικά μέλη του που είναι ιδρύματα ή στις αρμόδιες αρχές τους·

ιβ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 παραβαίνει το άρθρο 50γ παράγραφος 2 εάν γνωστοποιεί τα στοιχεία στα εκκαθαριστικά μέλη του που είναι ιδρύματα λιγότερο από μία φορά το τρίμηνο ή λιγότερο συχνά από όσο απαιτείται από την ΕΑΚΑΑ, σύμφωνα με το άρθρο 50γ παράγραφος 2.

V. Παραβάσεις που αφορούν εμπόδια στις εποπτικές δραστηριότητες:

α) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος παραβαίνει το άρθρο 25γ εάν παράσχει ανακριβείς ή παραπλανητικές πληροφορίες ως απάντηση σε απλή αίτηση πληροφοριών της ΕΑΚΑΑ, σύμφωνα με το άρθρο 25γ, ή ως απάντηση σε απόφαση της ΕΑΚΑΑ, με την οποία ζητούνται πληροφορίες σύμφωνα με το άρθρο 25ιδ·

β) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος παρέχει ανακριβείς ή παραπλανητικές απαντήσεις στις ερωτήσεις που υποβάλλονται σύμφωνα με το άρθρο 25δ παράγραφος 1 στοιχείο δ)·

γ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 δεν συμμορφώνεται εγκαίρως με εποπτικό μέτρο το οποίο απαιτείται βάσει απόφασης που έχει εκδοθεί από την ΕΑΚΑΑ σύμφωνα με το άρθρο 25ιδ·

δ) κεντρικός αντισυμβαλλόμενος κατηγορίας 2 δεν υποβάλλεται σε επιτόπια επιθεώρηση η οποία απαιτείται βάσει απόφασης έρευνας που έχει εκδοθεί από την ΕΑΚΑΑ, που έχει ληφθεί σύμφωνα με το άρθρο 25ε».

1. Παρεμβάλλεται το ακόλουθο παράρτημα IV:

#### «ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ IV

Κατάλογος των συντελεστών που συνδέονται με επιβαρυντικούς ή ελαφρυντικούς παράγοντες για την εφαρμογή του άρθρου 25ζ παράγραφος 3

Οι ακόλουθοι συντελεστές εφαρμόζονται, σωρευτικά, στα βασικά ποσά που αναφέρονται στο άρθρο 25ζ παράγραφος 2:

I. Συντελεστές προσαρμογής που συνδέονται με επιβαρυντικούς παράγοντες:

α) εάν η παράβαση έχει διαπραχθεί κατ' επανάληψη, για κάθε φορά που επαναλαμβάνεται, εφαρμόζεται πρόσθετος συντελεστής 1,1·

β) εάν η παράβαση έχει διαπραχθεί για διάστημα μεγαλύτερο των έξι μηνών, εφαρμόζεται συντελεστής 1,5·

γ) εάν η παράβαση αποκάλυψε συστημικές αδυναμίες στην οργάνωση του κεντρικού αντισυμβαλλομένου, ιδίως δε στις διαδικασίες, στα συστήματα διαχείρισης ή στους εσωτερικούς ελέγχους του, εφαρμόζεται συντελεστής 2,2·

δ) εάν η παράβαση έχει αρνητικές συνέπειες στην ποιότητα των δραστηριοτήτων και των υπηρεσιών του κεντρικού αντισυμβαλλομένου, εφαρμόζεται συντελεστής 1,5·

ε) εάν η παράβαση έχει διαπραχθεί εκ προθέσεως, εφαρμόζεται συντελεστής 2·

στ) εάν δεν έχουν ληφθεί διορθωτικά μέτρα μετά τον εντοπισμό της παράβασης, εφαρμόζεται συντελεστής 1,7·

ζ) εάν τα ανώτατα διοικητικά στελέχη του κεντρικού αντισυμβαλλομένου δεν έχουν συνεργαστεί με την ΕΑΚΑΑ στη διεξαγωγή των ερευνών της, εφαρμόζεται συντελεστής 1,5.

## II. Συντελεστές προσαρμογής που συνδέονται με ελαφρυντικούς παράγοντες:

α) εάν η παράβαση διεπράχθη για διάστημα μικρότερο των 10 εργάσιμων ημερών, εφαρμόζεται συντελεστής 0,9·

β) εάν τα ανώτατα διοικητικά στελέχη του κεντρικού αντισυμβαλλομένου μπορούν να αποδείξουν ότι έλαβαν όλα τα απαιτούμενα μέτρα για την αποφυγή της παράβασης, εφαρμόζεται συντελεστής 0,7·

γ) εάν ο κεντρικός αντισυμβαλλόμενος ενημέρωσε την ΕΑΚΑΑ για την παράβαση με ταχύτητα, αποτελεσματικότητα και πληρότητα, εφαρμόζεται συντελεστής 0,4·

δ) εάν ο κεντρικός αντισυμβαλλόμενος έλαβε εθελοντικά μέτρα ώστε να εξασφαλιστεί ότι παρόμοια παράβαση δεν θα μπορεί να διαπραχθεί στο μέλλον, εφαρμόζεται συντελεστής 0,6.»