

Briselē, 13.6.2017.
COM(2017) 331 final

ANNEX 1

PIELIKUMS

Priekšlikumam

EIROPAS PARLAMENTA UN PADOMES REGULA,

ar kuru Regulu (ES) Nr. 1095/2010, ar ko izveido Eiropas Uzraudzības iestādi (Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestādi), un Regulu (ES) Nr. 648/2012 groza attiecībā uz CCP atļauju piešķiršanā iesaistītajām procedūrām un iestādēm un trešo valstu CCP atzīšanas prasībām

{SWD(2017) 246 final}

{SWD(2017) 247 final}

PIELIKUMS

Turpmāko tekstu pievieno kā Regulas (ES) Nr. 648/2012 III un IV pielikumu.

“III PIELIKUMS

Regulas 25.g panta 1. punktā minēto pārkāpumu saraksts

I. Pārkāpumi, kas saistīti ar kapitāla prasībām:

- a) 2. līmeņa CCP pārkāpj 16. panta 1. punktu, jo tam nav pastāvīga un pieejama sākumkapitāla vismaz EUR 7,5 miljonu apmērā;
- b) 2. līmeņa CCP pārkāpj 16. panta 2. punktu, jo tam nav kapitāla, ieskaitot nesadalīto peļņu un rezerves, kas būtu samērīgs ar risku, kurš izriet no CCP darbībām, un kas katrā laikā būtu pietiekams, lai nodrošinātu organizētu attiecīgo darbību izbeigšanu vai pārstrukturēšanu piemērotā laikposmā un CCP pienācīgu aizsardzību pret kredītrisku, darījumu partnera risku, tirgus risku, darbības risku, juridisko un uzņēmējdarbības risku, kuru vēl nesedz 41., 42., 43. līdz 44. pantā minētie speciālie finanšu resursi.

II. Pārkāpumi, kas saistīti ar organizatoriskām prasībām vai interešu konfliktu:

- a) 2. līmeņa CCP pārkāpj 26. panta 1. punktu, jo tam nav stingru pārvaldības mehānismu, kas ietvertu skaidras organizatoriskās struktūras ar precīzi definētu, pārredzamu un konsekventu atbildības sadalījumu, efektīvām procedūrām esošo vai varbūtējo risku identificēšanai, pārvaldībai, uzraudzībai un ziņošanai un atbilstīgu iekšējās kontroles mehānismu, tostarp pareizas administratīvās un grāmatvedības procedūras;
- b) 2. līmeņa CCP pārkāpj 26. panta 2. punktu, jo nav pieņemis atbilstošu politiku un procedūras, kas būtu pietiekami efektīvas, lai nodrošinātu tā atbilstību – cita starpā tā vadītāju un darbinieku atbilstību – visiem šīs regulas noteikumiem;
- c) 2. līmeņa CCP pārkāpj 26. panta 3. punktu, jo tas neuztur un neizmanto organizatorisko struktūru, kas nodrošinātu tā pakalpojumu un darbību veikšanas nepārtrauktību un pareizu funkcionēšanu, vai neizmanto piemērotas un samērīgas sistēmas, resursus un procedūras;
- d) 2. līmeņa CCP pārkāpj 26. panta 4. punktu, jo tas skaidri nenošķir riska pārvaldības un citu CCP darbību ziņošanas kārtību;
- e) 2. līmeņa CCP pārkāpj 26. panta 5. punktu, jo tas nepieņem, neīsteno vai neuztur atlīdzības politiku, kas sekmētu stabilu un efektīvu riska pārvaldību un neradītu stimulus vājināt riska standartus;
- f) 2. līmeņa CCP pārkāpj 26. panta 6. punktu, jo tas neuztur informācijas tehnoloģijas sistēmas, kas būtu piemērotas tam, lai tiktu galā ar dažādiem sarežģītiem un daudzveidīgiem pakalpojumiem un darbībām, ko veic, lai nodrošinātu augstus drošības standartus un uzturētās informācijas neskartību un slepenumu;
- g) 2. līmeņa CCP pārkāpj 26. panta 7. punktu, jo tas nepublicē bez maksas savu pārvaldības kārtību, CCP vadības noteikumus un savus pieņemšanas kritērijus tīrvērtēs dalībai;
- h) 2. līmeņa CCP pārkāpj 26. panta 8. punktu, jo tam netiek piemērotas biežas un neatkarīgas revīzijas vai tas šo revīziju rezultātus nepaziņo valdei, vai nedara pieejamus EVTI;

- i) 2. līmeņa *CCP* pārkāpj 27. panta 1. punktu vai 27. panta 2. punkta otro daļu, jo tas nenodrošina, lai tā augstākajai vadībai un valdes locekļiem būtu pietiekami laba reputācija un pieredze *CCP* stabilas un pārdomātas vadības nodrošināšanai;
- j) 2. līmeņa *CCP* pārkāpj 27. panta 2. punktu, jo tas nenodrošina, ka vismaz viena trešdaļa, bet ne mazāk par diviem minētās valdes locekļiem ir neatkarīgi, vai neaicina tīrvērtes dalībnieku pārstāvjus piedalīties valdes sanāksmēs, kurās apspriež ar 38. un 39. pantu saistītos jautājumus, vai arī neatkarīgo un citu valdes locekļu, kas nav izpildlocekļi, atbildību sasaista ar *CCP* darbījumdarbības rezultātiem;
- k) 2. līmeņa *CCP* pārkāpj 27. panta 3. punktu, jo tas skaidri nenosaka valdes lomu un pienākumus vai nedara EVTI vai revidentiem pieejamus valdes sēžu protokolus;
- l) 2. līmeņa *CCP* pārkāpj 28. panta 1. punktu, jo tas neizveido riska komiteju vai neveido šo riska komiteju no tā tīrvērtes dalībniekiem, neatkarīgiem valdes locekļiem un tā klientu pārstāvjiem, vai veido riska komiteju tā, ka vienai pārstāvju grupai ir balsu vairākums riska komitejā, vai pienācīgi neinformē EVTI par riska komitejas darbībām un lēmumiem, pat ja EVTI to ir pieprasījusi;
- m) 2. līmeņa *CCP* pārkāpj 28. panta 2. punktu, jo tas skaidri nenosaka riska komitejas locekļu darba uzdevumu, pārvaldības kārtību, lai nodrošinātu tās neatkarību, darbības procedūras, pieņemšanas kritērijus vai iecelšanas mehānismu vai nedara šo pārvaldības kārtību publiski pieejamu, vai nenosaka, ka riska komitejas priekšsēdētājs ir neatkarīgs valdes loceklis un ka riska komiteja tieši atbild valdes priekšā un rīko regulāras sanāksmes;
- n) 2. līmeņa *CCP* pārkāpj 28. panta 3. punktu, jo neļauj riska komitejai konsultēt valdi par jebkādiem pasākumiem, kas var ietekmēt *CCP* riska pārvaldību, vai nemēģina darīt visu iespējamo, lai ar riska komiteju apspriestos par norisēm, kas ietekmē *CCP* riska pārvaldību ārkārtas apstākļos;
- o) 2. līmeņa *CCP* pārkāpj 28. panta 5. punktu, jo tas nekavējoties neinformē EVTI par katru lēmumu, kurā valde nolemj neievērot riska komitejas atzinumus;
- p) 2. līmeņa *CCP* pārkāpj 29. panta 1. punktu, jo neglabā vismaz desmit gadus visu dokumentāciju par attiecīgā *CCP* darbību un sniegtajiem pakalpojumiem, kura ir vajadzīga, lai EVTI būtu iespējams pārraudzīt *CCP* atbilstību šai regulai;
- q) 2. līmeņa *CCP* pārkāpj 29. panta 2. punktu, jo vismaz desmit gadus pēc līguma izbeigšanas neglabā visu informāciju par visiem līgumiem, ko tas apstrādājis, tādā veidā, lai šī informācija ļautu konstatēt darījumu sākotnējos noteikumus pirms tā tīrvērtes ar attiecīgā *CCP* starpniecību;
- r) 2. līmeņa *CCP* pārkāpj 29. panta 3. punktu, jo, neraugoties uz EVTI un attiecīgo ECBS dalībnieku pieprasījumu, nedara pieejamus 29. panta 1. un 2. punktā minētos uzskaites datus un informāciju vai visu informāciju par pozīcijām tīrvērtētos līgumos, neatkarīgi no vietas, kur darījumi izpildīti;
- s) 2. līmeņa *CCP* pārkāpj 30. panta 1. punktu, jo neinformē EVTI vai sniedz tai nepatiesu vai nepilnīgu informāciju par tā tiešo vai netiešo akcionāru

vai biedru ar būtisku līdzdalību (fizisku vai juridisku personu) identitāti vai par šīs līdzdalības apjomu;

t) 2. līmeņa *CCP* pārkāpj 30. panta 4. punktu, pieļaujot, ka 30. panta 1. punktā minētajām personām ir ietekme, kas varētu kaitēt stabilai un pārdomātai *CCP* pārvaldībai;

u) 2. līmeņa *CCP* pārkāpj 31. panta 1. punktu, nepaziņojot EVTI vai sniedzot tai nepatiesu vai nepilnīgu informāciju par jebkādam izmaiņām tā pārvaldībā, vai nesniedzot EVTI visu informāciju, kas nepieciešama, lai novērtētu atbilstību 27. panta 1. punktam vai 27. panta 2. punkta otrajai daļai;

v) 2. līmeņa *CCP* pārkāpj 33. panta 1. punktu, neuzturot spēkā vai neīstenojot efektīvus, rakstiskus organizatoriskos un administratīvos noteikumus, lai atklātu un novērstu potenciālus interešu konfliktus starp pašu *CCP* – tostarp starp tā vadītājiem, darbiniekiem vai jebkuru personu, kam ir tieša vai netieša kontrole pār tiem vai cieša saikne ar tiem, – un tā tīrvērtes dalībniekiem vai klientiem, kuri ir zināmi *CCP*, vai neuzturot spēkā vai neīstenojot piemērotas procedūras ar mērķi novērst varbūtējus interešu konfliktus;

w) 2. līmeņa *CCP* pārkāpj 33. panta 2. punktu, jo tas tīrvērtes dalībniekam vai šā tīrvērtes dalībnieka, kas centrālajam darījumu partnerim ir zināms, attiecīgajam klientam neatklāj nepārprotamā veidā interešu konfliktu vispārējo raksturu vai avotus, pirms pieņemt jaunus darījumus no attiecīgā tīrvērtes dalībnieka gadījumos, kad *CCP* organizatoriskie vai administratīvie noteikumi par interešu konflikta pārvaldību nav pietiekami, lai ticami nodrošinātu, ka tiek novērsts risks nodarīt kaitējumu tīrvērtes dalībnieka vai klienta interesēm;

x) 2. līmeņa *CCP* pārkāpj 33. panta 3. punktu, jo tā rakstiskajos noteikumos nav ņemti vērā visi apstākļi, kas *CCP* ir zināmi vai būtu jāzina un kas var citu uzņēmumu, ar kuriem tam ir mātesuzņēmuma vai meitasuzņēmuma attiecības, struktūras vai darbības veidu rezultātā radīt interešu konfliktu.;

y) 2. līmeņa *CCP* pārkāpj 33. panta 5. punktu, jo nedara visu praktiski iespējamo, lai novērstu tā sistēmās glabātās informācijas ļaunprātīgu izmantošanu vai nenovērstu minētās informācijas izmantošanu citā darījumdarbībā vai to, ka to var izmantot fiziska persona, kurai ir cieša saikne ar *CCP*, vai juridiska persona, kam ir mātesuzņēmuma vai meitasuzņēmuma attiecības ar *CCP*, un izmanto minētā *CCP* reģistrēto konfidenciālo informāciju komerciālām vajadzībām bez iepriekšējas piekrišanas no klienta, kuram šāda konfidenciālā informācija pieder;

z) 2. līmeņa *CCP* pārkāpj 36. panta 1. punktu, jo tas nerīkojas taisnīgi un profesionāli, maksimāli ievērojot savu tīrvērtes dalībnieku un to klientu intereses;

aa) 2. līmeņa *CCP* pārkāpj 36. panta 2. punktu, jo tam nav viegli pieejamu, pārredzamu un taisnīgu noteikumu par sūdzību ātru izskatīšanu;

bb) 2. līmeņa *CCP* pārkāpj 37. panta 1. vai 2. punktu, pastāvīgi izmantojot diskriminējošus, nepārredzamus vai subjektīvus pielaišanas kritērijus vai citādi pastāvīgi nenodrošinot taisnīgu un atklātu piekļuvi *CCP* vai pastāvīgi nenodrošinot, ka tīrvērtes dalībniekiem ir pietiekami finanšu resursi un operacionālā spēja, lai izpildītu pienākumus, ko uzliek dalība attiecīgajā *CCP*, vai reizi gadā neveicot vispārēju pārbaudi par tā tīrvērtes dalībnieku atbilstību;

cc) 2. līmeņa CCP pārkāpj 37. panta 4. punktu, jo tam nav objektīvu un pārredzamu procedūru, lai tādi tīrvērtes dalībnieki, kas vairs neatbilst 37. panta 1. punktā minētajiem kritērijiem, varētu tikt atstādināti un lai tie varētu izstāties pareizā veidā;

dd) 2. līmeņa CCP pārkāpj 37. panta 5. punktu, liedzot piekļuvi tīrvērtes dalībniekiem, kuri atbilst 37. panta 1. punktā minētajiem kritērijiem, ja šāda piekļuves liegšana nav pietiekami rakstiski pamatota un balstīta uz vispārēju riska analīzi;

ee) 2. līmeņa CCP pārkāpj 38. panta 1. punktu, neļaujot tā tīrvērtes dalībnieku klientiem atsevišķi piekļūt konkrētiem sniegtajiem pakalpojumiem;

ff) 2. līmeņa CCP pārkāpj 39. panta 7. punktu, jo nepiedāvā minētajā punktā minētos atšķirīgos nošķīruma līmeņus, pamatojoties uz saprātīgiem komerciāliem nosacījumiem.

III. Pārkāpumi, kas saistīti ar operacionālām prasībām:

a) 2. līmeņa CCP pārkāpj 34. panta 1. punktu, jo neiedibina, neīsteno vai neuztur piemērotu darījumdarbības nepārtrauktības politiku un negadījuma seku novēršanas plānu, kura mērķis ir nodrošināt tā funkciju saglabāšanu, darbību savlaicīgu atjaunošanu un CCP pienākumu izpildi, kas vismaz ļautu atjaunot visus darījumus kopš pārtraukšanas brīža, lai CCP varētu turpināt droši darboties un pabeigt norēķinus paredzētajā dienā;

b) 2. līmeņa CCP pārkāpj 34. panta 2. punktu, jo neiedibina, neīsteno vai neuztur piemērotu procedūru, kuras mērķis ir laikus nodrošināt pienācīgus norēķinus vai klienta un tīrvērtes dalībnieku aktīvu un pozīciju pārvedumu veikšanu, ja atzīšana ir anulēta ar lēmumu, kas pieņemts atbilstīgi 25. pantam;

c) 2. līmeņa CCP pārkāpj 35. panta 1. punkta otro daļu, nododot ārpalpojumu sniedzējiem svarīgas darbības, kas saistītas ar šā CCP riska pārvaldību;

d) 2. līmeņa CCP pārkāpj 39. panta 1. punktu, jo tam nav atsevišķas uzskaites un kontu, kas tam ļautu savos kontos katrā laikā nekavējoties nodalīt viena tīrvērtes dalībnieka vārdā turētos aktīvus un pozīcijas no aktīviem un pozīcijām, kas turēti cita tīrvērtes dalībnieka vārdā, un no saviem aktīviem;

e) 2. līmeņa CCP pārkāpj 39. panta 2. punktu, nepiedāvājot un pat pēc pieprasījuma neuzturot atsevišķu uzskaiti un kontus, kas katram tīrvērtes dalībniekam ļautu CCP kontos nodalīt minētā tīrvērtes dalībnieka aktīvus un pozīcijas no aktīviem un pozīcijām, kas tiek turēti tā tīrvērtes dalībnieku vārdā;

f) 2. līmeņa CCP pārkāpj 39. panta 3. punktu, nepiedāvājot un pat pēc pieprasījuma neuzturot atsevišķu uzskaiti un kontus, kas katram tīrvērtes dalībniekam ļautu CCP kontos nodalīt klienta vārdā turētus aktīvus un pozīcijas no aktīviem un pozīcijām, kas turēti citu klientu vārdā, vai pēc pieprasījuma nepiedāvājot saviem tīrvērtes dalībniekiem iespēju savā vārdā vai to klientu vārdā atvērt citus kontus;

g) 2. līmeņa CCP pārkāpj 40. pantu, jo tas pēc iespējas reālā laikā nemēra un nenovērtē savu likviditāti un kredītriskus ar katru tīrvērtes dalībnieku un attiecīgā gadījumā ar citu CCP, ar kuru tam ir izveidots sadarbības mehānisms, vai arī laikus un nediskriminējot nav darījis pieejamus attiecīgos

cenu noteikšanas avotus, lai efektīvāk novērtētu tā riska pozīcijas, ievērojot izmaksu pamatotības principu;

h) 2. līmeņa CCP pārkāpj 41. panta 1. punktu, jo nenosaka, nepieprasa un neiekasē maržas no tīrvērtes dalībniekiem un attiecīgā gadījumā arī no tiem CCP, ar kuriem ir izveidots sadarbības mehānisms, lai ierobežotu savu kredītrisku, vai nosaka, pieprasa un iekasē tādas maržas, kas nav pietiekamas, lai nodrošinātos pret potenciālo risku, kurš pēc CCP novērtējuma ir sagaidāms līdz attiecīgo pozīciju likvidācijai, vai lai segtu zaudējumus, kas pēc CCP novērtējuma rodas no vismaz 99 % riska darījumu attiecīgā laikposmā, vai nav pietiekamas, lai nodrošinātu, ka CCP vismaz reizi dienā pilnībā nodrošina savus riska darījumus ar visiem tā tīrvērtes dalībniekiem un attiecīgā gadījumā ar tiem CCP, ar kuriem tam ir izveidots sadarbības mehānisms, vai neņem vērā jebkādu varbūtējo prociklisko iedarbību;

i) 2. līmeņa CCP pārkāpj 41. panta 2. punktu, jo nepieņem modeļus un parametrus, nosakot tā maržas prasības, kas ietver to produktu riska rādītājus, kuriem veikta tīrvērtē, ņemot vērā intervālu starp maržas iekasēšanu, tirgus likviditāti un iespējamām izmaiņām darījuma veikšanas laikā;

j) 2. līmeņa CCP pārkāpj 41. panta 3. punktu, jo nepieprasa un neiekasē maržas dienas laikā, vismaz tad, kad ir pārkāpti iepriekš noteiktie sliekšņi;

k) 2. līmeņa CCP pārkāpj 42. panta 3. punktu, jo tas neuztur fondu saistību neizpildes gadījumiem, kas vismaz ļauj CCP ārkārtējos, taču iespējamajos tirgus apstākļos izturēt tā tīrvērtes dalībnieka, ar ko tam ir lielākais kredītrisks, vai arī otrā un trešā lielākā riska darījuma tīrvērtes dalībnieka saistību neizpildes sekas, ja to veikto riska darījumu summa ir lielāka, vai arī tas izstrādā scenārijus, kas neietver visnepastāvīgākos periodus, ko piedzīvojuši tie tirgi, kam CCP sniedz pakalpojumus, un iespējamo nākotnes scenāriju virkni, kuros ņem vērā finanšu resursu pēkšņu pārdošanu un tirgus likviditātes strauju pazemināšanos;

l) 2. līmeņa CCP pārkāpj 43. panta 2. punktu, jo tā fonds saistību neizpildes gadījumiem, kas minēti 42. pantā, un citi finanšu resursi, kas minēti 43. panta 1. punktā, neļauj tam ārkārtējos, taču iespējamajos tirgus apstākļos izturēt tā divu tīrvērtes dalībnieku, ar kuriem tam ir lielākais kredītrisks, saistību neizpildes sekas;

m) 2. līmeņa CCP pārkāpj 44. panta 1. punktu, jo tam katrā laikā nav pieejama atbilstīga likviditāte, lai sniegtu pakalpojumus un veiktu darbības, vai tas katru dienu nenosaka savas iespējamās likviditātes vajadzības;

o) 2. līmeņa CCP pārkāpj 45. panta 1., 2. un 3. punktu, jo pirms citu finanšu resursu izmantošanas zaudējumu segšanai neizmanto saistības nepildījušā tīrvērtes dalībnieka maržas;

p) 2. līmeņa CCP pārkāpj 45. panta 4. punktu, jo neizmanto īpašos paša resursus, pirms tiek izmantotas saistības pildījušo tīrvērtes dalībnieku iemaksas fondā saistību neizpildes gadījumiem;

q) 2. līmeņa CCP pārkāpj 46. panta 1. punktu, jo, lai nodrošinātu savas sākotnējās un esošās riska pozīcijas ar tā tīrvērtes dalībniekiem, tas pieņem nodrošinājumu, kas nav augsti likvīds nodrošinājums, ar kuru saistīts minimāls kredītrisks un tirgus risks, gadījumā, kad cits nodrošinājums nav atļauts saskaņā ar deleģēto aktu, ko Komisija pieņēmusi atbilstīgi 46. panta 3. punktam;

- r) 2. līmeņa CCP pārkāpj 47. panta 1. punktu, neieguldot savus finanšu resursus vienīgi skaidrā naudā vai augsti likvīdos finanšu instrumentos ar minimālu tirgus risku un kredītrisku, kas ir ātri likvidējami ar minimālu iespējamo negatīvo ietekmi uz cenu;
- s) 2. līmeņa CCP pārkāpj 47. panta 3. punktu, jo nenogulda finanšu instrumentus, kas izvietoti kā maržas vai kā iemaksas fondā saistību neizpildes gadījumiem, vērtspapīru norēķinu sistēmu operatoriem, kas nodrošina šo finanšu instrumentu pilnīgu aizsardzību (ja tādi pieejami), vai neizmanto citus augstas drošības pakāpes mehānismus ar atļauju saņēmušām finanšu iestādēm;
- t) 2. līmeņa CCP pārkāpj 47. panta 4. punktu, jo veic skaidras naudas noguldījumus, neizmantojot augstas drošības pakāpes mehānismus ar atļauju saņēmušām finanšu iestādēm vai centrālo banku pastāvīgo noguldījumu mehānismus, vai citus līdzvērtīgus paņēmienus, ko piedāvā centrālās bankas;
- u) 2. līmeņa CCP pārkāpj 47. panta 5. punktu, jo nogulda aktīvus, izmantojot trešo personu, bet nenodrošina to, lai tīrvērtes dalībnieku aktīvi būtu nosakāmi atsevišķi no CCP piederošiem aktīviem un no trešās personas aktīviem, izmantojot kontus ar citu nosaukumu trešās personas grāmatvedības dokumentos vai citus līdzvērtīgus pasākumus, kas nodrošina tādu pašu aizsardzības pakāpi, vai arī tam vajadzības gadījumā nav tūlītējas piekļuves finanšu instrumentiem;
- v) 2. līmeņa CCP pārkāpj 47. panta 6. punktu, ieguldot savu kapitālu vai summas, kas saistītas ar 41., 42., 43. vai 44. pantā noteiktajām prasībām, savos vērtspapīros vai sava mātesuzņēmuma vai meitasuzņēmuma vērtspapīros;
- w) 2. līmeņa CCP pārkāpj 48. panta 1. punktu, jo tas nenosaka sīki izstrādātas procedūras, kas jāievēro, ja tīrvērtes dalībnieks laikus nerīkojas saskaņā ar 37. pantā noteiktajām dalības prasībām un saskaņā ar CCP noteiktajām procedūrām, vai arī tas sīki neizklāsta procedūras, kas jāievēro, ja CCP nav paziņojis par tīrvērtes dalībnieka saistību neizpildi, vai arī ik gadu nepārskata šīs procedūras;
- x) 2. līmeņa CCP pārkāpj 48. panta 2. punktu, jo tūlīt atbilstoši nerīkojas, lai ierobežotu zaudējumus un novērstu likviditātes problēmas, kas izriet no tīrvērtes dalībnieka saistību neizpildes, un nenodrošina, lai kāda tīrvērtes dalībnieka pozīciju slēgšana netraucētu tā darbību un neradītu saistības pildījušajiem tīrvērtes dalībniekiem tādos zaudējumus, ko tie nevar paredzēt vai kontrolēt;
- y) 2. līmeņa CCP pārkāpj 48. panta 3. punktu, jo nekavējoties neinformē EVTI, pirms tiek izziņota vai uzsākta saistību neizpildes procedūra;
- z) 2. līmeņa CCP pārkāpj 48. panta 4. punktu, jo nepārliecinās, ka tā procedūras saistību neizpildes gadījumā ir izpildāmas, un neveic visus vajadzīgos pasākumus, lai nodrošinātu, ka tam ir nepieciešamās juridiskās pilnvaras, lai likvidētu saistības nepildījušajam tīrvērtes dalībniekam piederošās pozīcijas un nodotu vai likvidētu saistības nepildījušā tīrvērtes dalībnieka klienta pozīcijas;
- aa) 2. līmeņa CCP pārkāpj 49. panta 1. punktu, jo regulāri nepārskata modeļus un parametrus, kas pieņemti, lai noteiktu tā prasības attiecībā uz maržām, ieguldījumiem fondā saistību neizpildes gadījumiem, nodrošinājumu un citiem riska kontroles mehānismiem, un neveic šiem modeļiem stingru un biežu stresa testēšanu, lai novērtētu to izturību ārkārtējos, taču iespējamajos tirgus apstākļos,

vai neveic atpakaļejošas pārbaudes, lai novērtētu pieņemtās metodoloģijas ticamību, vai nesaņem neatkarīgu apstiprinājumu, vai neinformē EVTI par veikto testu rezultātiem, vai nesaņem no EVTI apstiprinājumu, pirms izdarīt jebkādas būtiskas izmaiņas modeļos un parametros;

bb) 2. līmeņa CCP pārkāpj 49. panta 2. punktu, jo regulāri nepārbauda saistību neizpildes gadījumā piemērojamo procedūru galvenos aspektus un neveic visus vajadzīgos pasākumus, lai nodrošinātu, ka visi tīrvērtes dalībnieki tos saprot un var veikt atbilstošus pasākumus, lai attiecīgi rīkotos saistību neizpildes gadījumā;

cc) 2. līmeņa CCP pārkāpj 49. panta 1.a punktu, pieņemot jebkādas būtiskas izmaiņas 49. panta 1. punktā minētajos modeļos un parametros, nesaņemis EVTI apstiprinājumu attiecīgajām izmaiņām;

dd) 2. līmeņa CCP pārkāpj 50. panta 1. punktu, jo neizmanto – ja tas ir praktiski izdarāms – centrālās bankas naudu, lai norēķinātos par saviem darījumiem, vai neveic pasākumus, lai stingri ierobežotu skaidras naudas norēķinu risku, ja centrālās bankas nauda netiek izmantota;

ee) 2. līmeņa CCP pārkāpj 50. panta 3. punktu, jo tas nenovērš pamatrisku, pēc iespējas izmantojot principu “piegāde pret samaksu”, ja CCP ir pienākums nosūtīt vai saņemt finanšu instrumentu piegādes;

ff) 2. līmeņa CCP pārkāpj 50.a pantu vai 50.b pantu, jo neapreķina K_{CCP} , kā norādīts minētajā pantā, vai nerīkojas saskaņā ar 50.a panta 2. punktā, 50.b pantā un 50.d pantā izklāstītajiem noteikumiem K_{CCP} aprēķināšanai;

gg) 2. līmeņa CCP pārkāpj 50.a panta 3. punktu, aprēķinot K_{CCP} retāk nekā reizi ceturksnī vai retāk, nekā to pieprasa EVTI, saskaņā ar 50.a panta 3. punktu;

hh) 2. līmeņa CCP pārkāpj 51. panta 2. punktu, jo tam nav nediskriminējošas piekļuves ne datiem, kas tam nepieciešami tā funkciju pildīšanai tirdzniecības vietā, ciktāl CCP atbilst šīs tirdzniecības vietas operacionālajām un tehniskajām prasībām, ne attiecīgajai norēķinu sistēmai;

ii) 2. līmeņa CCP pārkāpj 52. panta 1. punktu, izveidojot sadarbības mehānismu, bet neizpildot kādu no minētā punkta a), b), c) un d) apakšpunktā izklāstītajām prasībām;

jj) 2. līmeņa CCP pārkāpj 53. panta 1. punktu, jo nenodala kontos aktīvus un pozīcijas, kas tiek turētas uz cita CCP rēķina, ar kuru tam ir izveidots sadarbības mehānisms;

kk) 2. līmeņa CCP pārkāpj 54. panta 1. punktu, izveidojot sadarbības mehānismu bez EVTI iepriekšēja apstiprinājuma.

IV. Pārkāpumi, kas saistīti ar pārredzamību un datu pieejamību:

a) 2. līmeņa CCP pārkāpj 38. panta 1. punktu, publiski neizpaužot cenas un maksu par katru sniegto pakalpojumu atsevišķi, tostarp atlaides un rabat, kā arī nosacījumus šo atlaizņu saņemšanai;

b) 2. līmeņa CCP pārkāpj 38. panta 1. punktu, nedarot zināmu EVTI informāciju par izdevumiem un ieņēmumiem saistībā ar tā pakalpojumiem;

c) 2. līmeņa CCP pārkāpj 38. panta 2. punktu, nedarot zināmus saviem tīrvērtes dalībniekiem un to klientiem riskus, kas saistīti ar sniedzamajiem pakalpojumiem;

- d) 2. līmeņa CCP pārkāpj 38. panta 3. punktu, nedarot zināmu saviem tīrvērtes dalībniekiem vai EVTI cenu informāciju, ko izmanto, lai aprēķinātu dienas noslēguma riska pozīcijas tā tīrvērtes dalībniekiem, vai nepubliskojot informāciju par darījumu, kam CCP veicis tīrvērti, kopējiem apjomiem attiecībā uz katru instrumentu;
- f) 2. līmeņa CCP pārkāpj 38. panta 4. punktu, jo nepublisko darbības un tehniskās prasības attiecībā uz saziņas protokoliem, kuros būtu norādīts saturs un ziņojumu formāts, ko tas izmanto saziņai ar trešām personām, tostarp darbības un tehniskās prasības, kas minētas 7. pantā;
- g) 2. līmeņa CCP pārkāpj 38. panta 5. punktu, jo nepublisko informāciju par ikvienu 37. panta 1. punktā minēto kritēriju vai 38. panta 5. punktā noteikto prasību pārkāpumu, ko izdara tīrvērtes dalībnieki, izņemot gadījumus, kad EVTI uzskata, ka šādas informācijas publiskošana apdraudētu finanšu stabilitāti vai uzticību tirgum vai nopietni apdraudētu finanšu tirgus, vai radītu nesamērīgu kaitējumu iesaistītajām personām;
- h) 2. līmeņa CCP pārkāpj 39. panta 7. punktu, nepubliskojot aizsardzības līmeņus un izmaksas, kas saistītas ar tā nodrošinātajiem atšķirīgajiem nošķiruma līmeņiem;
- i) 2. līmeņa CCP pārkāpj 49. panta 3. punktu, nepubliskojot galvenos aspektus tā riska pārvaldības modeļos vai pieņēmumos 49. panta 1. punktā minēto stresa testu veikšanai;
- j) 2. līmeņa CCP pārkāpj 50. panta 2. punktu, jo skaidri nenorāda savas saistības attiecībā uz finanšu instrumentu piegādēm, tostarp to, vai tam ir pienākums nosūtīt vai saņemt finanšu instrumentu piegādes, vai arī tas atlīdzina dalībniekiem piegādes procesā radušos zaudējumus;
- k) 2. līmeņa CCP pārkāpj 50.c panta 1. punktu, nepaziņojot 50.c panta 1. punkta a), b), c), d) un e) apakšpunktā minēto informāciju tiem saviem tīrvērtes dalībniekiem, kuri ir iestādes, vai to kompetentajām iestādēm;
- l) 2. līmeņa CCP pārkāpj 50.c panta 2. punktu, informējot tos savus tīrvērtes dalībniekus, kuri ir iestādes, retāk nekā reizi ceturksnī vai retāk, nekā to pieprasa EVTI, saskaņā ar 50.a panta 2. punktu.

V. Pārkāpumi, kas saistīti ar šķēršļiem uzraudzības darbībām:

- a) CCP pārkāpj 25.c pantu, jo tas sniedz nepareizu vai maldinošu informāciju, atbildot uz vienkāršu EVTI pieprasījumu sniegt informāciju saskaņā ar 25.c pantu vai uz EVTI lēmumu, ar kuru tiek pieprasīta informācija saskaņā ar 25.n pantu;
- b) CCP sniedz nepareizas vai maldinošas atbildes uz jautājumiem, kas uzdoti saskaņā ar 25. panta 1. punkta d) apakšpunktu;
- c) 2. līmeņa CCP laikus nerīkojas saskaņā ar uzraudzības pasākumu, kas veicams saskaņā ar lēmumu, ko EVTI pieņēmusi atbilstīgi 25.n pantam;
- d) 2. līmeņa CCP nesadarbojas pārbaudē uz vietas, kas veicama saskaņā ar lēmumu, ko EVTI pieņēmusi atbilstīgi 25.e pantam”.

1. Iekļauj šādu IV pielikumu:

“IV PIELIKUMS

Ar atbildību pastiprinošiem vai mīkstinošiem apstākļiem saistītie koeficienti, kas izmantojami, piemērojot 25.g panta 3. punktu

Turpmāk izklāstītos koeficientus kumulatīvi piemēro pamatsummām, kas minētas 25.g panta 2. punktā.

- I. Pielāgojuma koeficienti, kas saistīti ar atbildību pastiprinošiem apstākļiem:
 - a) ja pārkāpums izdarīts atkārtoti, par katru atkārtotu pārkāpumu piemēro papildu koeficientu 1,1;
 - b) ja pārkāpums ir noticis ilgāk nekā sešus mēnešus, piemēro koeficientu 1,5;
 - c) ja pārkāpums ir atklājis sistēmiskus trūkumus *CCP* organizatoriskajā struktūrā, jo īpaši tā procedūrās, pārvaldības sistēmās vai iekšējā kontrolē, piemēro koeficientu 2,2;
 - d) ja pārkāpumam ir negatīva ietekme uz *CCP* darbību un pakalpojumu kvalitāti, piemēro koeficientu 1,5;
 - e) ja pārkāpums ir izdarīts tīši, piemēro koeficientu 2;
 - f) ja kopš pārkāpuma konstatēšanas nav veikti nekādi koriģējoši pasākumi, piemēro koeficientu 1,7;
 - g) ja *CCP* augstākā vadība nav sadarbojusies ar EVTI, tai veicot izmeklēšanu, piemēro koeficientu 1,5.
- II. Pielāgojuma koeficienti, kas saistīti ar atbildību mīkstinošiem apstākļiem:
 - a) ja pārkāpuma ilgums ir īsāks par 10 darbdienām, piemēro koeficientu 0,9;
 - b) ja *CCP* augstākā vadība var pierādīt, ka tā ir veikusi visus pārkāpuma novēršanai nepieciešamos pasākumus, piemēro koeficientu 0,7;
 - c) ja *CCP* ir ātri, efektīvi un pilnībā informējis EVTI par pārkāpumu, piemēro koeficientu 0,4;
 - d) ja *CCP* ir brīvprātīgi veicis pasākumus, lai nodrošinātu, ka turpmāk nebūs iespējams izdarīt līdzīgu pārkāpumu, piemēro koeficientu 0,6.