

Briuselis, 2017 06 13
COM(2017) 331 final

ANNEX 1

PRIEDAS

prie pasiūlymo dėl

EUROPOS PARLAMENTO IR TARYBOS REGLAMENTO

kuriuo iš dalies keičiamos Reglamento (ES) Nr. 1095/2010, kuriuo įsteigiama Europos priežiūros institucija (Europos vertybinių popierių ir rinkų institucija), ir Reglamento (ES) Nr. 648/2012 nuostatos dėl pagrindinių sandorio šalių leidimų suteikimo procedūrų bei jose dalyvaujančių institucijų ir trečiųjų šalių pagrindinių sandorio šalių pripažinimo reikalavimų

{SWD(2017) 246 final}

{SWD(2017) 247 final}

PRIEDAS

Reglamentas (ES) Nr. 648/2012 papildomas III ir IV priedais.

„III PRIEDAS

25g straipsnio 1 dalyje nurodytų pažeidimų sąrašas

I. Pažeidimai, susiję su kapitalo reikalavimais:

- a) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 16 straipsnio 1 dalį, jei neturi nuolatinio ir prieinamo mažiausiai 7,5 mln. EUR pradinio kapitalo;
- b) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 16 straipsnio 2 dalį, jei neturi kapitalo, įskaitant nepaskirstytąjį pelną ir rezervus, kuris būtų proporcingas rizikai, atsirandančiai dėl pagrindinės sandorio šalies veiklos, ir visada pakankamas, kad būtų galima užtikrinti tinkamą laipsnišką likvidavimą arba veiklos restruktūrizavimą per tinkamą laikotarpį ir pagrindinės sandorio šalies tinkamą apsaugą nuo kredito, sandorio šalių, rinkos, likvidumo, veiklos, teisinės ir verslo rizikos, dar nepadengtos konkrečiais finansiniais ištekliais, kaip nurodyta 41, 42, 43 ir 44 straipsniuose.

II. Pažeidimai, susiję su organizaciniais reikalavimais arba interesų konfliktais:

- a) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 26 straipsnio 1 dalį, jei neturi tvirtos valdymo tvarkos, įskaitant aiškią organizacinę struktūrą su tiksliai apibrėžta, skaidria ir nuoseklia atsakomybe, veiksmingų rizikos, su kuria ji susiduria arba gali susidurti, nustatymo, valdymo, stebėjimo ir pranešimo apie tokią riziką procesų ir tinkamų vidaus kontrolės mechanizmų, įskaitant patikimas administracines ir apskaitos procedūras;
- b) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 26 straipsnio 2 dalį, jei nenustato tinkamos politikos ir procedūrų, kurios yra pakankamai veiksmingos norint užtikrinti atitiktį šiam reglamentui, įskaitant jos vadovų ir darbuotojų atitiktį visoms šio reglamento nuostatomis;
- c) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 26 straipsnio 3 dalį, jei neišlaiko ir nenaudoja organizacinės struktūros, kuria užtikrinamas tęstinumas ir sklandus veikimas teikiant paslaugas ir vykdant veiklą, ir nenaudoja tinkamų ir proporcingų sistemų, išteklių ar procedūrų;
- d) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 26 straipsnio 4 dalį, jei aiškiai neatskiria rizikos valdymo ir kitos savo veiklos atskaitomybės linijų;
- e) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 26 straipsnio 5 dalį, jei nepatvirtina, neįgyvendina ir neišlaiko atlyginimo politikos, kuria skatinamas patikimas ir veiksmingas rizikos valdymas ir kuria nesukuriamos paskatos laikytis ne tokių griežtų rizikos valdymo standartų;
- f) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 26 straipsnio 6 dalį, jei nenaudoja informacinių technologijų sistemų, kurios yra tinkamos atsižvelgiant į teikiamų paslaugų ir vykdomos veiklos sudėtingumą, įvairovę ir rūšis, siekiant užtikrinti griežtus apsaugos standartus ir saugomos informacijos vientisumą ir konfidencialumą;
- g) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 26 straipsnio 7 dalį, jei savo valdymo tvarkos ir savo veiklą reglamentuojančių taisyklių, įskaitant savo taikomus priėmimo į tarpuskaitos narius kriterijus, nemokamai neskelbia viešai;

- h) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 26 straipsnio 8 dalį, jei jos nepriklausomas auditas neatliekamas dažnai arba to audito rezultatai neperduodami jos valdybai ir jais neleidžiama naudotis EVPRI;
- i) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 27 straipsnio 1 dalį arba 27 straipsnio 2 dalies antrą pastraipą, jei nepasirūpina tuo, kad jos vyresnioji vadovybė ir valdybos nariai turėtų pakankamai gerą reputaciją ir patirtį, kad galėtų užtikrinti patikimą ir rizikos ribojimo principais pagrįstą pagrindinės sandorio šalies valdymą;
- j) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 27 straipsnio 2 dalį, jei neužtikrina, kad mažiausiai trečdalis, bet ne mažiau kaip du valdybos nariai būtų nepriklausomi, ir valdybos posėdžiuose su 38 ir 39 straipsniais susijusiais klausimais nekviečia dalyvauti tarpuskaitytos narių klientų atstovų arba nepriklausomų ir kitų ne administracijos valdybos narių atlyginimą sieja su savo veiklos rezultatais;
- k) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 27 straipsnio 3 dalį, jei aiškiai neapibrėžia valdybos vaidmenų ir atsakomybės ir EVPRI ar auditoriams neleidžia naudotis valdybos susitikimų protokolais;
- l) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 28 straipsnio 1 dalį, jei neįsteigia rizikos valdymo komiteto arba jo nesudaro jos tarpuskaitytos narių atstovai, nepriklausomi valdybos nariai bei jos klientų atstovai, jei įsteigia rizikos valdymo komitetą taip, kad viena iš atstovų grupių turi jame daugumą, arba deramai neinformuoja EVPRI apie rizikos valdymo komiteto veiklą ir sprendimus, kai EVPRI pareikalavo būti deramai informuota;
- m) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 28 straipsnio 2 dalį, jei aiškiai neapibrėžia rizikos valdymo komiteto įgaliojimų ir jo valdymo tvarkos, siekdama užtikrinti jo nepriklausomumą, veiklos procedūrų, komiteto narių priėmimo kriterijų ar atrankos mechanizmo arba viešai neskelbia tos valdymo tvarkos ar nenustato, kad rizikos valdymo komitetui pirmininkauja nepriklausomas valdybos narys ir kad rizikos komitetas tiesiogiai valdybai teikia ataskaitas ir rengia reguliarius susitikimus;
- n) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 28 straipsnio 3 dalį, jei rizikos valdymo komitetui nesuteikia galimybės valdybai patarti klausimais, kurie gali turėti poveikį pagrindinės sandorio šalies rizikos valdymui, arba susidarius kritinei padėčiai nededa deramų pastangų siekdama konsultuotis su rizikos valdymo komitetu dėl įvykių, turinčių poveikio pagrindinės sandorio šalies rizikos valdymui ypatingais atvejais;
- o) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 28 straipsnio 5 dalį, jei nedelsdama neinformuoja EVPRI apie bet kokią sprendimą, kai valdyba nusprendžia nesivadovauti rizikos valdymo komiteto patarimu;
- p) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 29 straipsnio 1 dalį, jei mažiausiai dešimt metų nesaugo visų įrašų apie suteiktas paslaugas ir vykdytą veiklą, kad EVPRI galėtų tikrinti pagrindinės sandorio šalies atitiktį šiam reglamentui;
- q) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 29 straipsnio 2 dalį, jei mažiausiai dešimt metų po sutarties nutraukimo nesaugo visos informacijos apie visas savo tvarkytas sutartis taip, kad ši informacija leistų nustatyti pirmines sandorio sąlygas, buvusias prieš tai pagrindinei sandorio šaliai atliekant tarpuskaitytą;

- r) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 29 straipsnio 3 dalį, jei EVPRI arba atitinkamiems ECBS nariams paprašius, neleidžia naudotis visais 29 straipsnio 1 ir 2 dalyse nurodytais įrašais ir informacija arba visa informacija apie sutarčių, kurių tarpuskaitą ji atliko, pozicijas, neatsižvelgiant į tai, kur atlikti tie sandoriai;
- s) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 30 straipsnio 1 dalį, jei nepateikia EVPRI teisingos ar išsamios informacijos apie akcininkų arba narių, kurie gali būti fiziniai ar juridiniai asmenys ir kurie tiesiogiai arba netiesiogiai turi akcijų paketą, tapatybę ir apie tų paketų dydžius;
- t) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 30 straipsnio 4 dalį, jei 30 straipsnio 1 dalyje nurodytiems asmenims leidžia turėti įtakos, kuri gali daryti neigiamą poveikį rizikos ribojimo principais pagrįstam ir patikimam pagrindinės sandorio šalies valdymui;
- u) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 31 straipsnio 1 dalį, jei teisingai ar išsamiai nepraneša EVPRI apie bet kokius jos vadovybės pasikeitimus ir kartu nepateikia visos informacijos, reikalingos siekiant įvertinti atitiktį 27 straipsnio 1 daliai ar 27 straipsnio 2 dalies antrai pastraipai;
- v) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 33 straipsnio 1 dalį, jei nenustato ar netaiko veiksmingų rašytinių organizacinių ir administracinių priemonių siekiant nustatyti ir valdyti galimus interesų konfliktus, kylančius tarp jos pačios (įskaitant jos vadovus, darbuotojus arba bet kuriuos asmenis, kurie su ja tiesiogiai ar netiesiogiai susiję kontrolės arba glaudžiais ryšiais) ir jos tarpuskaitos narių arba pagrindinei sandorio šaliai žinomų jų klientų, arba jei nenustato ir netaiko galimų interesų konfliktų tinkamų sprendimo procedūrų;
- w) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 33 straipsnio 2 dalį, jei tuo atveju, kai tos pagrindinės sandorio šalies organizacinių arba administracinių priemonių, skirtų interesų konfliktams valdyti, nepakanka patikimai užtikrinti, kad būtų išvengta rizikos padaryti žalą tarpuskaitos nario arba kliento interesams, prieš priimdama naujus to tarpuskaitos nario sandorius, tarpuskaitos nario arba to tarpuskaitos nario suinteresuoto kliento, jei jis žinomas pagrindinei sandorio šaliai, aiškiai neinformuoja apie bendrąjį interesų konflikto pobūdį ir priežastis;
- x) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 33 straipsnio 3 dalį, jei rašytinėse priemonėse neatsižvelgia į visas aplinkybes, apie kurias žino arba turėtų žinoti pagrindinė sandorio šalis ir kurios gali sukelti interesų konfliktą dėl kitų įmonių, su kuriomis ją sieja patronuojančiosios įmonės arba dukterinės įmonės ryšiai, struktūros ir veiklos;
- y) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 33 straipsnio 5 dalį, jei nesiima visų pagrįstų veiksmų, kad užkirstų kelią piktnaudžiavimui jos sistemose esančia informacija ir naudojimuisi ta informacija kitai verslo veiklai vykdyti, arba jei fizinis asmuo, kuris susijęs glaudžiais ryšiais su pagrindine sandorio šalimi, arba juridinis asmuo, kuris susijęs su pagrindine sandorio šalimi patronuojančiosios arba patronuojamosios įmonės ryšiais, naudoja toje pagrindinėje sandorio šalyje saugomą konfidencialią informaciją komerciniais tikslais, iš anksto negavęs raštiško kliento, kuriam tokia konfidenciali informacija priklauso, sutikimo;

- z) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 36 straipsnio 1 dalį, jei neveikia sąžiningai ir profesionaliai, nepažeisdama savo tarpuskaityto narių ir jų klientų interesų;
- aa) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 36 straipsnio 2 dalį, jei nenusistato prieinamų, aiškių ir teisingų skubaus skundų nagrinėjimo taisyklių;
- bb) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 37 straipsnio 1 ar 2 dalį, jei nuolat laikosi diskriminacinių, neskaidrių ar subjektyvių narių priėmimo kriterijų arba kitaip neužtikrina sąžiningos ir atviros prieigos prie savo paslaugų, arba nuolat neužtikrina, kad jos tarpuskaityto nariai turėtų pakankamai finansinių išteklių ir veiklos pajėgumų, kad galėtų vykdyti įsipareigojimus, atsirandančius dėl dalyvavimo jos veikloje, arba bent kartą per metus neatlieka išsamios peržiūros, kuria siekiama patikrinti, ar jos tarpuskaityto nariai laikosi šio straipsnio;
- cc) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 37 straipsnio 4 dalį, jei nenustato objektyvių ir skaidrių tarpuskaityto narių dalyvavimo sustabdymo ir 37 straipsnio 1 dalyje nustatytų kriterijų nebeatitinkančių tarpuskaityto narių tinkamo pasitraukimo procedūrų;
- dd) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 37 straipsnio 5 dalį, jei atsisako suteikti prieigą 37 straipsnio 1 dalyje nurodytus kriterijus atitinkantiems tarpuskaityto nariams, jeigu toks atsisakymas nėra tinkamai pagrindžiamas raštu ir paremiamas išsamia rizikos analize;
- ee) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 38 straipsnio 1 dalį, jei savo tarpuskaityto nariams nesuteikia atskiros prieigos prie konkrečių teikiamų paslaugų;
- ff) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 39 straipsnio 7 dalį, jei nesiūlo skirtingų toje dalyje nurodytų atskyrimo lygių pagrįstomis komercinėmis sąlygomis.

III. Pažeidimai, susiję su veiklos reikalavimais:

- a) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 34 straipsnio 1 dalį, jei neparengia, neįdiegia ar netaiko tinkamos veiklos testavimo politikos ir veiklos atkūrimo plano, kurių tikslas – užtikrinti, kad būtų išsaugotos pagrindinės sandorio šalies funkcijos, laiku atkurta veikla ir kad būtų vykdomi pagrindinės sandorio šalies įsipareigojimai, kad esant sutrikimams bent būtų suteikta galimybė atkurti visus duomenis apie sandorius, kad pagrindinė sandorio šalis galėtų patikimai tęsti savo veiklą ir numatytą datą atlikti atsiskaitymus;
- b) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 34 straipsnio 2 dalį, jei neparengia, neįgyvendina ar nuolat netaiko tinkamos procedūros, kuria užtikrinama, jog tuo atveju, kai panaikinamas pripažinimas remiantis pagal 25 straipsnį priimtu sprendimu, būtų laiku ir tvarkingai atsiskaitoma už klientų ir tarpuskaityto narių turtą ir pozicijas ar tas turtas ir pozicijos būtų laiku ir tvarkingai perduoti;
- c) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 35 straipsnio 1 dalies antrą pastraipą, jei perduoda savo pagrindinės veiklos, susijusios su rizikos valdymu, funkciją;
- d) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 39 straipsnio 1 dalį, jei atskirai neregistruoja duomenų ir netvarko apskaitos, kad bet kuriuo metu ir

nedelsdama savo sąskaitose galėtų atskirti vieno tarpuskaitos nario vardu laikomą turtą ir pozicijas nuo bet kurio kito tarpuskaitos nario vardu laikomo turto ir pozicijų ir nuo savo pačios turto;

e) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 39 straipsnio 2 dalį, jei nesiūlo atskirai registruoti duomenų ir tvarkyti apskaitos, kad kiekvienas tarpuskaitos narys pagrindinės sandorio šalies sąskaitose galėtų atskirti savo turtą ir pozicijas nuo savo tarpuskaitos narių vardu laikomo turto ir pozicijų;

f) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 39 straipsnio 3 dalį, jei nesiūlo paprašius atskirai registruoti duomenų ir tvarkyti apskaitos, kad kiekvienas tarpuskaitos narys pagrindinės sandorio šalies sąskaitose galėtų atskirti tam tikro kliento vardu laikomą turtą ir pozicijas nuo kitų klientų vardu laikomo turto ir pozicijų, arba, gavusi tarpuskaitos narių prašymą, nesuteikia jiems galimybės atidaryti daugiau sąskaitų jų arba jų klientų vardu;

g) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 40 straipsnį, jei beveik realiu laiku nenustato ir neįvertina savo likvidumo ir kredito rizikos kiekvieno tarpuskaitos nario ir, kai taikoma, kitos pagrindinės sandorio šalies, su kuria ji sudarė sąveikos susitarimą, atžvilgiu arba negali naudotis svarbiais informacijos apie kainas šaltiniais, kad galėtų veiksmingai įvertinti turimas pozicijas, už pagrįstą kainą;

h) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 41 straipsnio 1 dalį, jei nenustato, nereikalauja pateikti ir iš savo tarpuskaitos narių bei, kai tinka, iš pagrindinių sandorio šalių, su kuriomis ji yra sudariusi sąveikos susitarimus, nesurenka garantinių įmokų, kuriomis siekia riboti savo kredito riziką, arba nustato, reikalauja pateikti ir surenka tokias garantines įmokas, kurių nepakanka galimai rizikai, kuri pagrindinės sandorio šalies apskaičiavimais kils iki susijusių pozicijų likvidavimo, arba nuostoliams, kurie per atitinkamą laikotarpį patiriami mažiausiai 99 proc. rizikos kitimo atveju, padengti arba kurių nepakanka siekiant užtikrinti, kad pagrindinė sandorio šalis bent kartą per dieną visiškai užtikrintų savo pozicijas visiems savo tarpuskaitos nariams ir, kai tinka, pagrindinėms sandorio šalims, su kuriomis ji yra sudariusi sąveikos susitarimus, arba prireikus atsižvelgti į tokios peržiūros galimą prociklinį poveikį;

i) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 41 straipsnio 2 dalį, jei, nustatydamą garantinės įmokos reikalavimus, netaiko modelių ir parametrų, kuriais atsižvelgiama į priemonių, kurių tarpuskaita atliekama, rizikos ypatybes ir į laikotarpį tarp garantinių įmokų surinkimo, rinkos likvidumą ir galimybę daryti pakeitimus sandorio laikotarpiu;

j) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 41 straipsnio 3 dalį, jei kasdien nereikalauja garantinių įmokų ir jų nesurenka, bent jau kai viršijamos iš anksto nustatytos ribos;

k) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 42 straipsnio 3 dalį, jei neturi įsipareigojimų neįvykdymo fondo, kuris bent jau suteiktų galimybę pagrindinei sandorio šaliai ekstremaliomis, bet tikėtinomis rinkos sąlygomis apsaugoti nuo tarpuskaitos nario, kurio pozicijos didžiausios, arba antro ir trečio pagal dydį tarpuskaitos narių, jeigu jų pozicijų suma didesnė, įsipareigojimų neįvykdymo, arba parengia tokiems atvejams scenarijus, kurie neapima pačių nestabiliausių laikotarpių, kada nors buvusių rinkose, kuriose pagrindinė sandorio šalis teikia savo paslaugas, ir keleto ateityje galimų scenarijų,

kuriuose būtų atsižvelgiama į staigius finansinių išteklių išpardavimus ir staigų rinkos likvidumo sumažėjimą;

l) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 43 straipsnio 2 dalį, jei 42 straipsnyje nurodytas įsipareigojimų neįvykdymo fondas ir 43 straipsnio 1 dalyje nurodyti kiti finansiniai ištekliai neleidžia jai apsisaugoti nuo bent dviejų tarpuskaityto narių, kurių pozicijos didžiausios, įsipareigojimų neįvykdymo susidarius ekstremalioms, bet tikėtinoms rinkos sąlygoms;

m) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 44 straipsnio 1 dalį, jei visada neturi pakankamų likvidumo galimybių, kad galėtų teikti savo paslaugas ir vykdyti veiklą, arba kasdien neįvertina savo galimų likvidumo poreikių;

o) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 45 straipsnio 1, 2 ir 3 dalis, jei, prieš panaudodama kitus finansinius išteklius nuostoliams padengti, nenaudoja įsipareigojimų neįvykdžiusio tarpuskaityto nario garantinių įmokų;

p) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 45 straipsnio 4 dalį, jei nenaudoja savo pačios skiriamų išteklių prieš panaudodama įsipareigojimus vykdančių tarpuskaityto narių įmokas į įsipareigojimų neįvykdymo fondą;

q) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 46 straipsnio 1 dalį, jei priima įkaitus, kurie nėra labai likvidūs įkaičiai su minimalia kredito ir rinkos rizika, kad galėtų apdrausti savo pradinę ir nuolatinę poziciją tarpuskaityto narių atžvilgiu, jeigu kitoks įkaitas neleidžiamas pagal deleguotąjį aktą, Komisijos priimtą pagal 46 straipsnio 3 dalį;

r) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 47 straipsnio 1 dalį, jei savo finansinius išteklius investuoja ne tik į grynuosius pinigus arba į labai likvidžias finansines priemones, kurių rinkos ir kredito rizika labai maža, ir negali greitai likviduoti šių investicijų, patirdama minimalų neigiamą kainos poveikį;

s) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 47 straipsnio 3 dalį, jei finansinių priemonių, pateiktų kaip garantinės įmokos arba įmokos į įsipareigojimų neįvykdymo fondą, jei jų yra, neatiduoda saugoti tiems vertybinių popierių atsiskaitymų sistemų operatoriams, kurie užtikrina visišką minėtų finansinių priemonių apsaugą, arba netaiko kito labai saugaus būdo pagal susitarimus su leidimą gavusiomis finansų įstaigomis;

t) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 47 straipsnio 4 dalį, jei grynųjų pinigų deponavimas neatliekamas taikant labai saugius būdus pagal susitarimus su leidimą gavusiomis finansų įstaigomis arba naudojant centrinių bankų nuolatinių indėlių priemones arba kitas palyginamas centrinių bankų priemones;

u) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 47 straipsnio 5 dalį, jei deponuoja turtą trečiajame subjekte ir neužtikrina, kad tarpuskaityto nariams priklausantis turtas būtų identifikuojamas atskirai nuo pagrindinės sandorio šalies turto ir to trečiojo subjekto turto, trečiojo subjekto apskaitos knygose sąskaitas nurodant skirtingais pavadinimais arba kitomis lygiavertėmis priemonėmis, kuriomis užtikrinamas toks pat apsaugos lygis, arba, kai reikia, neturi galimybės greitai pasinaudoti minėtomis finansinėmis priemonėmis;

v) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 47 straipsnio 6 dalį, jei investuoja savo kapitalą arba sumas, sukauptas dėl 41, 42, 43 ar 44 straipsnyje

nustatytų reikalavimų vykdymo, į savo arba savo patronuojančiosios arba patronuojamosios įmonės vertybinius popierius;

w) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 48 straipsnio 1 dalį, jei nenustato išsamių procedūrų, kurių reikia laikytis, kai tarpuskaityto narys neįvykdo 37 straipsnyje nustatytų pagrindinės sandorio šalies taikomų dalyvavimo reikalavimų per nurodytą laikotarpį ir jos nustatyta tvarka, arba išsamiai nenustato, kokių procedūrų reikia imtis, jeigu pagrindinė sandorio šalis nepaskelbia apie tarpuskaityto nario įsipareigojimų neįvykdymą, arba jei kasmet neperžiūri tų procedūrų;

x) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 48 straipsnio 2 dalį, jei nedelsdama nesiima veiksmų, kad suvaldytų nuostolius ir likvidumo problemas dėl tarpuskaityto narių įsipareigojimų neįvykdymo, ir užtikrintų, kad kurio nors tarpuskaityto nario pozicijų panaikinimas nenutrauktų jos veiklos ir įsipareigojimus vykdančioms tarpuskaityto nariams nesukeltų pavojaus patirti nenumatytų ir nekontroliuojamų nuostolių;

y) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 48 straipsnio 3 dalį, jei skubiai neinformuoja EVPRI prieš įsipareigojimų neįvykdymo procedūrų paskelbimą ar pradėjimą;

z) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 48 straipsnio 4 dalį, jei nepatikrina, ar jos įsipareigojimų neįvykdymo atveju taikomos procedūros gali būti įvykdytos, ir nesiima visų pagrįstų veiksmų, kad užtikrintų, jog ji turėtų teisinius įgaliojimus panaikinti įsipareigojimų neįvykdžiusio tarpuskaityto nario nuosavas pozicijas, o jo klientų pozicijas perduoti arba panaikinti;

aa) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 49 straipsnio 1 dalį, jei reguliariai neperžiūri modelių ir parametrų, taikomų apskaičiuojant garantinės įmokos reikalavimus, įmokas į įsipareigojimų neįvykdymo fondą, įkaito reikalavimus ar kitas rizikos valdymo priemones, ir tiems modeliams netaiko griežtų ir dažnų testavimų nepalankiausiomis sąlygomis, siekdamas įvertinti jų tvirtumą ekstremalioms, bet tikėtinioms rinkos sąlygoms, arba neatlieka grįžamojo patikrinimo, kad įvertintų taikomos metodikos patikimumą, negauna nepriklausomo patvirtinimo, neinformuoja EVPRI apie atliktų testų rezultatus arba prieš modelių arba parametrų reikšmingą pakeitimą negauna EVPRI patvirtinimo;

bb) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 49 straipsnio 2 dalį, jei reguliariai netestuoja savo įsipareigojimų neįvykdymo procedūrų pagrindinių aspektų ar nesiima visų pagrįstų veiksmų siekdama užtikrinti, kad visi tarpuskaityto nariai juos suprastų ir būtų tinkamai pasirengę reaguoti į įsipareigojimų neįvykdymą;

cc) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 49 straipsnio 1a dalį, jei atlieka reikšmingus 49 straipsnio 1 dalyje nurodytų modelių ir parametrų pakeitimus prieš tai negavusi EVPRI patvirtinimo;

dd) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 50 straipsnio 1 dalį, jei, kai praktiškai tikslinga ir įmanoma, sandoriams apmokėti nenaudoja centrinio banko lėšų arba, kai centrinio banko lėšos nenaudojamos, nesiima veiksmų, siekdama griežtai apriboti atsiskaitymo grynaisiais pinigais riziką;

ee) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 50 straipsnio 3 dalį, jei tuo atveju, kai ta pagrindinė sandorio šalis įpareigota pristatyti finansines

priemonės ar jas gauti, nepašalina svarbiausios rizikos kuo dažniau taikydama vienalaikio pristatymo ir apmokėjimo mechanizmą;

ff) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 50a ar 50b straipsnį, jei neapskaičiuoja K_{CCP} , kaip nurodyta tame straipsnyje, arba nesilaiko 50a straipsnio 2 dalyje, 50b ir 50d straipsniuose nustatytų K_{CCP} apskaičiavimo taisyklių;

gg) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 50a straipsnio 3 dalį, jei apskaičiuoja K_{CCP} rečiau nei kas ketvirtį arba rečiau, nei reikalauja EVPRI pagal 50a straipsnio 3 dalį;

hh) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 51 straipsnio 2 dalį, jei negali nediskriminuojama naudotis duomenimis, kurių jai reikia savo funkcijoms atlikti konkrečioje prekybos vietoje, jei pagrindinė sandorio šalis laikosi tos prekybos vietos nustatytų veiklos ir techninių reikalavimų, ir susijusia atsiskaitymo sistema;

ii) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 52 straipsnio 1 dalį, jei sudaro sąveikos susitarimą nesilaikydama tos dalies a, b, c ir d punktuose nustatytų reikalavimų;

jj) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 53 straipsnio 1 dalį, jei sąskaitose neatskiria kitos pagrindinės sandorio šalies, su kuria ji yra sudariusi sąveikos susitarimą, vardu laikomo turto ir pozicijų;

kk) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 54 straipsnio 1 dalį, jei sudaro sąveikos susitarimą negavusi išankstinio EVPRI patvirtinimo.

IV. Pažeidimai, susiję su skaidrumu ir galimybe gauti informaciją:

a) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 38 straipsnio 1 dalį, jei neatskleidžia kiekvienos teikiamos paslaugos atskirai kainų ir mokesčių, įskaitant nuolaidas ir permokos grąžinimą bei sąlygas, kuriomis jos taikomos;

b) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 38 straipsnio 1 dalį, jei EVPRI neatskleidžia informacijos apie savo sąnaudas ir įplaukas, susijusias su teikiamomis paslaugomis;

c) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 38 straipsnio 2 dalį, jei tarpuskaitos nariams ir jų klientams neatskleidžia su teikiamomis paslaugomis susijusios rizikos;

d) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 38 straipsnio 3 dalį, jei neatskleidžia savo tarpuskaitos nariams ar EVPRI kainų informacijos, naudojamos apskaičiuojant jos tarpuskaitos narių pozicijas dienos pabaigoje, arba viešai neatskleidžia apibendrinto kiekvienos klasės priemonių sandorių, kurių tarpuskaitą ji atliko, skaičiaus;

f) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 38 straipsnio 4 dalį, jei viešai neatskleidžia veiklos ir techninių reikalavimų, susijusių su ryšių protokolais, aprėpiančiais turinį ir pranešimo formatus, kuriuos ji naudoja bendraudama su trečiaisiais subjektais, įskaitant 7 straipsnyje nurodytus veiklos ir techninius reikalavimus;

g) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 38 straipsnio 5 dalį, jei viešai neatskleidžia informacijos apie bet kokius tarpuskaitos narių atliktus kriterijų, nurodytų 37 straipsnio 1 dalyje, ar reikalavimų, nustatytų 38 straipsnio 5 dalyje, pažeidimus, išskyrus atvejus, kai EVPRI nusprendžia, kad atskleidus

šià informacijà kiltų grėsmė finansiniam stabilumui arba pasitikėjimui rinka arba būtų sukelta rimta grėsmė finansų rinkoms ar neproporcinga žala susijusioms šalims;

h) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 39 straipsnio 7 dalį, jei viešai neatskleidžia informacijos apie apsaugos lygius ir išlaidas, susijusias su skirtingais jų teikiamo atskyrimo lygiais;

i) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 49 straipsnio 3 dalį, jei viešai nepaskelbia pagrindinės informacijos apie savo taikomą rizikos valdymo modelį ar prielaidas, kurių laikomasi atliekant 49 straipsnio 1 dalyje nurodytą testavimą nepalankiausiomis sąlygomis;

j) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 50 straipsnio 2 dalį, jei aiškiai neišdėsto savo įsipareigojimų, susijusių su finansinių priemonių pristatymu, įskaitant tai, ar ji įsipareigojusi pristatyti finansinę priemonę ar ją gauti, ir ar ji dalyviams kompensuoja nuostolius, patirtus pristatymo metu;

k) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 50c straipsnio 1 dalį, jei nepateikia 50c straipsnio 1 dalies a, b, c, d ir e punktuose nurodytos informacijos tiems savo tarpuskaitys nariams, kurie yra įstaigos, arba jų kompetentingoms institucijoms;

l) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 50c straipsnio 2 dalį, jei savo tarpuskaitys nariams, kurie yra įstaigos, teikia informacijà rečiau nei kas ketvirtà arba rečiau, nei reikalauja EVPRI pagal 50c straipsnio 2 dalį.

V. Pažeidimai, susiję su priežiūros veiklos kliūtimis:

a) pagrindinė sandorio šalis pažeidžia 25c straipsnį, jei pateikia neteisingà arba klaidinančią informacijà, gavusi paprastà EVPRI prašymà pateikti informacijà pagal 25c straipsnį arba reaguodama į EVPRI sprendimà, kuriuo reikalaujama pateikti informacijà pagal 25n straipsnį;

b) pagrindinė sandorio šalis pateikia neteisingus arba klaidinančius atsakymus į klausimus, pateiktus pagal 25d straipsnio 1 dalies d punktà;

c) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis laiku neįgyvendina priežiūros priemonės, kurios reikalaujama EVPRI pagal 25n straipsnį priimtu sprendimu;

d) 2 lygio pagrindinė sandorio šalis nesuteikia galimybės atlikti patikrinimą vietoje, kaip reikalaujama sprendimu dėl tyrimo, kurį EVPRI priėmė pagal 25e straipsnį.“

1. Įterpiamas IV priedas:

„IV PRIEDAS

Koeficientų, susijusių su sunkinančiomis ir lengvinančiomis aplinkybėmis taikant 25g straipsnio 3 dalį, sąrašas

25g straipsnio 2 dalyje nurodytiems baziniams dydžiams sumuojant taikomi šie koeficientai:

I. Korekciniai koeficientai, susiję su sunkinančiomis aplinkybėmis:

a) jei pažeidimas padarytas pakartotinai, už kiekvienà jo pakartojimą taikomas papildomas koeficientas yra 1,1;

- b) jei pažeidimas buvo vykdomas ilgiau nei šešis mėnesius, taikomas koeficientas yra 1,5;
- c) jei pažeidimas atskleidė sisteminius pagrindinės sandorio šalies organizavimo, ypač procedūrų, valdymo sistemų ar vidaus kontrolės, trūkumus, taikomas koeficientas yra 2,2;
- d) jei dėl pažeidimo kenkiama pagrindinės sandorio šalies veiklos ir paslaugų kokybei, taikomas koeficientas yra 1,5;
- e) jei pažeidimas padarytas tyčia, taikomas koeficientas yra 2;
- f) jei nustačius pažeidimą nesiimta veiksmų jam ištaisyti, taikomas koeficientas yra 1,7;
- g) jei pagrindinės sandorio šalies vyresnioji vadovybė nebendradarbiavo su EVPRI atliekant tyrimus, taikomas koeficientas yra 1,5.

II. Korekciniai koeficientai, susiję su lengvinančiomis aplinkybėmis:

- a) jei pažeidimas truko mažiau nei 10 darbo dienų, taikomas koeficientas yra 0,9;
- b) jei pagrindinės sandorio šalies vyresnioji vadovybė gali įrodyti, jog ėmėsi visų būtinų priemonių, kad pažeidimui būtų užkirstas kelias, taikomas koeficientas yra 0,7;
- c) jei pagrindinė sandorio šalis skubiai, veiksmingai ir visapusiškai informavo EVPRI apie pažeidimą, taikomas koeficientas yra 0,4;
- d) jei pagrindinė sandorio šalis savanoriškai ėmėsi priemonių, kad užtikrintų, jog ateityje nebebūtų galima padaryti panašių pažeidimų, taikomas koeficientas yra 0,6.“