

Brüssel, 13.6.2017
COM(2017) 331 final

ANNEX 1

LISA

järgmise dokumendi juurde: Ettepanek:

EUROOPA PARLAMENDI JA NÕUKOGU MÄÄRUS,

millega muudetakse määrust (EL) nr 1095/2010, millega asutatakse Euroopa Järelevalveasutus (Euroopa Väärtpaberiturujärelevalve), ja muudetakse määrust (EL) nr 648/2012 seoses kesksetele vastaspooltele tegevusloa andmise korra ja sellega seotud asutustega ning kolmandate riikide kesksete vastaspoolte tunnustamise nõuetega

{ SWD(2017) 246 final }

{ SWD(2017) 247 final }

LISA

Määrusele (EL) nr 648/2012 lisatakse III ja IV lisa.

„III LISA

Artikli 25g lõikes 1 osutatud rikkumiste loetelu

I. Kapitalinõuetega seotud rikkumised:

- a) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 16 lõiget 1, kui tal ei ole vähemalt 7,5 miljoni euro suurust püsivat ja olemasolevat kapitali;
- b) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 16 lõiget 2, kui tal ei ole koos jaotamata kasumi ja reservidega kapitali, mis on proportsionaalne tema tegevusriskiga ja kogu aeg piisav, et tagada tegevuste korra kohane likvideerimine või restruktureerimine ettenähtud aja jooksul ning keske vastaspoole adekvaatne kaitse selliste krediidi-, vastaspoole, turu-, operatsiooni-, õiguslike ja äririskide vastu, mis ei ole artiklites 41, 42, 43 ja 44 osutatud rahaliste vahenditega juba hõlmatud.

II. Organisatsiooniliste nõuete või huvide konfliktidega seotud rikkumised:

- a) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 26 lõiget 1, kui tal ei ole kindlat juhtimiskorda, mis hõlmab täpselt määratletud, läbipaistvate ja sidusate vastutusaladega selget organisatsioonilist struktuuri, tõhusaid protseduure riskide või võimalike riskide tuvastamiseks, juhtimiseks, jälgimiseks ja nendest teatamiseks ning piisavaid sisekontrollimeetmeid, sealhulgas usaldusväärset juhtimis- ja raamatupidamiskorda;
- b) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 26 lõiget 2, kui ta ei võta vastu piisavalt tõhusaid põhimõtteid ja protseduure, millega tagatakse, et keskne vastaspool (sh tema juhid ja töötajad) täidab käesoleva määruse kõiki sätteid;
- c) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 26 lõiget 3, kui ta organisatsiooniline struktuur ei ole selline, millega tagatakse, et teenuseid osutatakse ja tegevusi sooritatakse järjepidevalt ja korrektselt, või kui ta ei kasuta asjakohaseid ja proportsionaalseid süsteeme, ressursse ja protseduure;
- d) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 26 lõiget 4, kui ta ei eralda selgelt riskijuhtimisega seotud aruandluskohustust keske vastaspoole muude tehingutega seotud aruandluskohustusest;
- e) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 26 lõiget 5, kui ta ei võta vastu või ei rakenda tasustamispoliitikat, millega edendatakse usaldusväärset ja tõhusat riskijuhtimist ega looda stiimuleid riskistandardite lõdvendamiseks;
- f) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 26 lõiget 6, kui ta IT-süsteemid ei ole sellised, mis sobivad keeruliste eri liiki teenuste osutamiseks ja tegevuste sooritamiseks selliselt, et tagatakse turvalisuse kõrge tase ja säilitatava teabe terviklikkus ja konfidentsiaalsus;
- g) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 26 lõiget 7, kui ta ei tee oma juhtimiskorda, eeskirju ning kliiriva liikme staatuse andmise kriteeriume avalikkusele tasuta kättesaadavaks;
- h) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 26 lõiget 8, kui teda ei auditeerita sageli ja sõltumatult või kui selliste auditite tulemusi ei edastata juhtorganile või ei tehta ESMA-le kättesaadavaks;

- i) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 27 lõiget 1 või artikli 27 lõiget 2, kui ta ei taga, et tema kõrgemal juhtkonnal ja juhtorgani liikmetel on piisavalt hea reputatsioon ja piisavad kogemused, et tagada keskse vastaspoole kindel ja usaldusväärne juhtimine;
- j) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 27 lõiget 2, kui ta ei taga, et tema juhtorgani liikmetest vähemalt üks kolmandik (kuid mitte vähem kui kaks liiget) on sõltumatud liikmed või kui ta ei kutsu kliirivate liikmete klientide esindajaid juhtorgani koosolekutele, kus arutatakse artiklite 38 ja 39 kohaldamisalasse kuuluvaid küsimusi, või kui ta seob juhtorgani sõltumatute ja juhtkonda mittekuuluvate liikmete tasustamise keskse vastaspoole majandustulemustega;
- k) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 27 lõiget 3, kui ta ei määra kindlaks juhtorgani ülesandeid ja kohustusi või ei tee ESMA-le või audiitoritele kättesaadavaks juhtorgani koosolekute protokolle;
- l) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 28 lõiget 1, kui ta ei moodusta riskikomiteed või see ei koosne tema kliirivate liikmete esindajatest, juhtorgani sõltumatutest liikmetest ja tema klientide esindajatest või moodustab riskikomitee selliselt, et ühel nendest esindajate rühmadest on riskikomitees arvuline ülekaal, või ei esita ESMA-le nõudmise korral nõuetekohast teavet riskikomitee tegevuse ja otsuste kohta;
- m) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 28 lõiget 2, kui ta ei määra selgelt kindlaks riskikomitee pädevust, sõltumatust tagavat juhtimiskorda, riskikomitee tegevuskorda, riskikomitee liikmeks sobivuse kriteeriume ja liikmete valimise korda või ei avalikusta kõnealust juhtimiskorda või ei määra kindlaks, et riskikomitee eesistuja on juhtorgani sõltumatu liige, kes annab juhtorganile vahetult aru ja korraldab korrapäraselt koosolekuid;
- n) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 28 lõiget 3, kui ta ei luba riskikomiteel anda juhtorganile nõu keskse vastaspoole riskijuhtimist mõjutada võiva mis tahes tegevuse kohta või kui keskse vastaspoole riskijuhtimist eriolukorras mõjutavate sündmuste puhul ei tehta mõistlikke jõupingutusi riskikomiteega konsulteerimiseks;
- o) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 28 lõiget 5, kui ta ei teavita ESMA-t juhtorgani mis tahes otsustest mitte järgida riskikomitee nõuannet;
- p) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 29 lõiget 1, kui ta ei säilita vähemalt kümme aastat kõiki nõutavaid dokumente osutatud teenuste ja sooritatud tegevuste kohta, et ESMA saaks jälgida, kas keskne vastaspool täidab käesolevat määrust;
- q) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 29 lõiget 2, kui ta ei säilita vähemalt kümme aastat pärast lepingu lõpetamist kogu teavet kõikide tema töödeldud lepingute kohta sellisel viisil, et on võimalik teha kindlaks tehingu algtingimused enne keskse vastaspoolega kliirimist;
- r) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 29 lõiget 3, kui ta ei tee taotluse korral ESMA-le ja EKPSi asjaomastele liikmetele kättesaadavaks artikli 29 lõigetes 1 ja 2 osutatud dokumente ja kogu teavet kliiritud lepingute positsioonide kohta, olenemata kauplemiskohast, kus tehingud tehti;
- s) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 30 lõiget 1, kui ta ei teata ESMA-le olulist osalust omavate aktsionäride või liikmete nimesid või nende

osaluse suurust, olenemata sellest, kas nende osalus on otsene või kaudne või kas nad on füüsilised või juriidilised isikud, või esitab selle kohta ebaõige või ebatäieliku teabe;

t) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 30 lõiget 4, kui ta ei välista artikli 30 lõikes 1 osutatud isikute tõenäoliselt keskse vastaspoole kindla ja usaldusväärse juhtimisega vastuolus olevat mõju;

u) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 31 lõiget 1, kui ta ei teavita ESMA-t juhtimises tehtavatest muudatustest või esitab ebaõiget või ebatäielikku teavet ega esita ESMA-le kogu teavet, mis on vajalik, et hinnata, kas artikli 27 lõike 1 või artikli 27 lõike 2 teise lõigu nõuded on täidetud;

v) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 33 lõiget 1, kui tal ei ole kirjalikke ning tõhusaid organisatsioonilist ja halduskorda käsitlevaid eeskirju, et tuvastada ja lahendada võimalikud huvide sisekonfliktid, sealhulgas konfliktid, millesse on ühelt poolt kaasatud juhid, töötajad või mis tahes sellised isikud, kellel on nende üle otseselt või kaudselt kontroll või nendega märkimisväärne seos, ning teiselt poolt kliirivad liikmed või nende kliendid, kellest keskne vastaspool on teadlik, või kui ta ei rakenda võimalike huvide konfliktide lahendamiseks nõuetekohast konfliktide lahendamise menetlust;

w) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 33 lõiget 2, kui ta olgugi, et tema organisatsiooniline või halduskord ei ole piisav, et küllaldase kindlusega tagada kliiriva liikme või kliendi huvide kahjustamise ohu vältimine, ei avalikusta kliirivale liikmele või (kui keskne vastaspool tunneb kliiriva liikme klienti) tema kliendile, enne asjaomase kliiriva liikme tehtavate uute tehingute aktsepteerimist, selgel kujul huvide konfliktide üldist laadi või allikat;

x) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 33 lõiget 3, kui ta ei käsitle kirjalikes eeskirjades mis tahes olukorda, millest ta on teadlik või peaks teadlik olema ja mis võib tekitada huvide konflikti tingituna teiste selliste ettevõtjate struktuurist ja äritegevusest, kellega tal on ema- või tütarettevõtja suhe;

y) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 33 lõiget 5, kui ta ei võta kõiki mõistlikke abinõusid, et hoida ära tema süsteemides hoitava teabe kuritarvitamine või ei hoia ära kõnealuse teabe kasutamist muul äriotstarbel või keskse vastaspoole juures säilitatava konfidentsiaalse teabe äriotstarbel kasutamist sellise füüsilise isiku poolt, kellel on keskse vastaspoolega märkimisväärne seos või sellise juriidilise isiku poolt, kellel on keskse vastaspoolega ema- või tütarettevõtja suhe, v.a juhul, kui klient, kellele see konfidentsiaalne teave kuulub, on eelnevalt andnud oma kirjaliku nõusoleku;

z) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 36 lõiget 1, kui ta ei käitu ausalt ja professionaalselt kooskõlas oma kliirivate liikmete ja nende klientide parimate huvidega;

aa) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 36 lõiget 2, kui ta ei kasuta kaebuste kiireks lahendamiseks arusaadavaid, läbipaistvaid ja õiglaseid eeskirju;

bb) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 37 lõiget 1 või lõiget 2, kui ta pidevalt kohaldab diskrimineerivaid, mitteläbipaistvaid ja subjektiivseid kriteeriume või muul moel ei suuda tagada ausat ja avatud juurdepääsu või ei suuda pidevalt tagada, et kliirivatel liikmetel on piisavalt rahalisi vahendeid ja nende tegevussuutlikkus on piisav, et täita keskses vastaspooles osalemisega

kaasnevad kohustused, või ei kontrolli korra aastas põhjalikult, kas tema kliirivad liikmed nõudeid täidavad;

cc) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 37 lõiget 4, kui ta ei kehtesta objektiivset ja läbipaistvat korda, mille kohaselt peatatakse artikli 37 lõike 1 kohastele kriteeriumidele mittevastavate kliirivate liikmete liikmesus ja lõpetatakse see nõuetekohaselt;

dd) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 37 lõiget 5, kui ta keeldub lõikes 1 osutatud tingimusi täitvatele kliirivatele liikmetele juurdepääsu andmisest siis, kui keeldumine ei ole põhjalikust riskianalüüsist lähtudes kirjalikult ja nõuetekohaselt põhjendatud;

ee) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 38 lõiget 1, kui ta ei võimalda oma kliirivate liikmete klientidele eraldi juurdepääsu konkreetsetele osutatavatele teenustele;

ff) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 39 lõiget 7, kui ta ei paku nimetatud lõikes osutatud eristamise eri tasemeid äris tavalistel tingimustel;

III. Tegevusnõuetega seotud rikkumised:

a) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 34 lõiget 1, kui ta ei kehtesta, rakenda ega säilita asjakohast talitluspidevuse kava ja avariitaastekava, mille eesmärk on tagada keskse vastaspoole funktsioonide säilitamine, tema tegevuse kiire taastamine ja kohustuste täitmine, võimaldades vähemalt taastada katkestuse korral kõik tehingud, et keskne vastaspool saaks jätkata toimimist kindlalt ja viia arveldamise lõpule kavandatud kuupäeval;

b) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 34 lõiget 2, kui ta ei kehtesta, rakenda ega säilita asjakohaseid protseduure, mis tagavad õigeaegselt ja nõuetekohaselt kliendi ja kliirivate liikmete vara ja positsioonidega arveldamise või vara ja positsioonide ülekandmise artikli 25 kohase otsuse alusel tunnustuse tühistamise korral;

c) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 35 lõiget 1, kui ta ostab allhankena oma riskijuhtimisega seotud peamisi tegevusi;

d) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 39 lõiget 1, kui ta ei säilita eraldi andmeid ega pea eraldi kontosid, mis võimaldavad tal igal ajal ja viivitamata eristada keskse vastaspoole kontodel ühe kliiriva liikme nimel ja arvel hoitavaid varasid ja positsioone teise kliiriva liikme nimel ja arvel hoitavatest varadest ja positsioonidest ning tema enda varadest;

e) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 39 lõiget 2, kui ta ei paku või vastava soovi korral ei võimalda eraldi andmete säilitamist ja eraldi kontode pidamist, et iga kliiriv liige saaks eristada keskse vastaspoole kontodel hoitavaid asjaomase kliiriva liikme varasid ja positsioone tema kliirivate liikmete nimel ja arvel hoitavatest varadest ja positsioonidest;

f) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 39 lõiget 3, kui ta ei paku või vastava soovi korral ei võimalda eraldi andmete säilitamist ja eraldi kontode pidamist, et iga kliiriv liige saaks keskse vastaspoole kontodel eristada ühe kliendi nimel ja arvel hoitavaid varasid ja positsioone teiste klientide nimel ja arvel hoitavatest varadest ja positsioonidest, või kui ta taotluse korral ei paku kliirivatele liikmetele võimalust avada rohkem kontosid oma nimel või nende klientide nimel ja arvel;

g) teise taseme keskne vastaspool rikub artiklit 40, kui ta ei mõõda ega hinda iga kliiriva liikme ja vajaduse korral teise sellise keskse vastaspoole, kellega ta on sõlminud koostalitluskokkuleppe, likviidsusrisi ja krediidiriski positsiooni peaaegu reaalajas, või kui tal ei ole juurdepääsu hinnakujunduse allikatele, et tõhusalt mõõta oma riskipositsioone;

h) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 41 lõiget 1, kui ta oma krediidiriski positsioonide piiramiseks ei näe kliirivatele liikmetele või vajaduse korral koostalitluskokkulepetega hõlmatud kesksetele vastaspooltele ette võimendustagatise ega nõua nende seadmist või kui ettenähtud või nõutud tagatised ei ole piisavad, et katta võimalikke riske, mis keskse vastaspoole hinnangul võivad asjaomaste positsioonide likvideerimiseni ilmnedada või katta vähemalt 99 % kahjustest, mis on tingitud riskipositsioonide muutusest teatava aja jooksul või tagada, et keskne vastaspool hangiks kliirivatelt liikmetelt ja vajaduse korral teistelt kesksetelt vastaspooltelt, kellega on sõlmitud koostalitluskokkulepped, vähemalt kord päevas tagatised, et täies ulatuses katta oma riskipositsioonid, või ei arvesta vajaduse korral mis tahes võimalikku protsüklilist mõju;

i) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 41 lõiget 2, kui ta ei võta tagatisnõuete kehtestamiseks vastu mudeleid ja parameetreid, mis kajastavad kliiritavate toodete riskitunnuseid ja mille puhul võetakse arvesse tagatiste seadmise nõudmise intervalli, turulikviidsust ning muutuste võimalikkust tehingu kestuse jooksul;

j) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 41 lõiget 3, kui ta ei näe ette võimendustagatist ega nõua selle seadmist päevasiseselt, ent hiljemalt siis, kui ületatakse eelnevalt kindlaksmääratud künnis;

k) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 42 lõiget 3, kui ta ei moodusta tagatisfondi, mis võimaldab kesksel vastaspoolel ekstreemsetes, kuid usutavates turutingimustes tulla toime vähemalt siis, kui kliiriv liige, kelle krediidiriskile ta on kõige rohkem avatud, või suuruselt teise või kolmanda riskipositsiooniga kliirivad liikmed, kui nendega seotud krediidiriskide summa on suurem, ei täida oma lepingulisi kohustusi, või kui ta ei tööta välja ekstreemsete, kuid usutavate turutingimuste stsenaariume, mis hõlmavad selle turu kõige suurema volatiilsusega perioode, kus keskne vastaspool teenuseid osutab, ning mitut võimalikku tulevast stsenaariumi, milles võetakse arvesse finantsinstrumentide ootamatut müüki ja turu likviidsuse kiiret vähenemist;

l) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 43 lõiget 2, kui artiklis 42 osutatud tagatisfond ja artikli 43 lõikes 1 osutatud muud rahalised vahendid ei võimalda tal igal ajal toime tulla kahe kõige suurema riskipositsiooniga kliiriva liikme kohustuste mittetäitmisega ekstreemsetes, kuid usutavates turutingimustes;

m) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 44 lõiget 1, kui tal ei ole igal ajal juurdepääsu piisavale likviidsusele, et pakkuda oma teenuseid ja sooritada tegevusi, või kui ta ei mõõda oma võimalikku likviidsusvajadust iga päev;

o) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 45 lõikeid 1, 2 ja 3, kui ta ei kasuta kahju katmiseks kõigepealt selle kliiriva liikme antud tagatise, kes ei täida oma lepingulisi kohustusi, ja alles siis muid rahalisi vahendeid;

- p) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 45 lõiget 4, kui ta ei kasuta selleks otstarbeks määratud omavahendeid enne kohustusi täitvate kliirivate liikmete poolt tagatisfondi tehtud maksete kasutamist;
- q) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 46 lõiget 1, kui ta aktsepteerib kliirivate liikmete esialgse ja püsiva riskipositsiooni katmiseks muid tagatise peale väga likviidsete tagatiste, mille krediidi- ja tururisk on minimaalne, kui sellised muud tagatised ei ole artikli 46 lõike 3 alusel komisjoni vastu võetud delegeeritud õigusakti kohaselt lubatud;
- r) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 47 lõiget 1, kui ta ei investeeeri oma rahalisi vahendeid üksnes rahasse või väga likviidsetesse finantsinstrumentidesse, mille turu- ja krediidirisk on minimaalne ning mida on võimalik minimaalse ebasoodsa hinnaefektiga kiiresti likvideerida;
- s) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 47 lõiget 3, kui ta ei anna tagatisvarana või tagatisfondi maksetena esitatud finantsinstrumente võimaluse korral hoiule väärtpaberiarveldussüsteemide korraldajatele, kes tagavad kõnealuste finantsinstrumentide täieliku kaitse, või kui ta ei kasuta muid volitatud finantseerimisasutustega sõlmitud kõrge turvalisusega kokkuleppeid;
- t) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 47 lõiget 4, kui ta ei hoiusta raha volitatud finantseerimisasutustes kõrge turvalisusega kokkulepete kaudu või ei kasuta keskpankades hoiustamise püsivõimalust või muud sarnast keskpankade poolt pakutavat võimalust;
- u) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 47 lõiget 5, kui ta hoiustab varasid kolmanda isiku juures, kuid ei taga, et kliirivatele liikmetele kuuluvad varad hoitakse eraldi kesksele vastaspoolele kuuluvatest varadest ja asjaomasele kolmandale isikule kuuluvatest varadest kolmanda isiku raamatupidamisarvestuses eri kontodele kirjendamise abil või mis tahes muude samaväärsete meetmete abil, millega tagatakse samatasemeline kaitse, või kui tal ei ole vajaduse korral võimalik finantsinstrumente kohe kasutada;
- v) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 47 lõiget 6, kui ta investeerib oma kapitali või artiklites 41, 42, 43 või 44 sätestatud nõuetest tulenevad summad oma väärtpaberitesse või oma ema- või tütarettevõtja väärtpaberitesse;
- w) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 48 lõiget 1, kui ta ei näe ette üksikasjalikku menetlust, mida järgitakse, kui kliiriv liige ei täida artiklis 37 sätestatud keskse vastaspoole osalusnõudeid keskse vastaspoole kehtestatud tähtaja jooksul kooskõlas keskse vastaspoole kehtestatud protseduuridega, või kui ta ei kirjelda üksikasjalikult menetlust, mida järgitakse, kui keskne vastaspool ei ole kliiriva liikme poolt kohustuste mittetäitmisest teatanud, või kui ta ei vaata kõnealust menetlust kord aastas läbi;
- x) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 48 lõiget 2, kui ta ei tegutse kohe, et piirata kliiriva liikme kohustuste mittetäitmisest tulenevat kahju ja likviidsussurvet, ning tagada, et mis tahes kliiriva liikme positsioonide sulgemine ei häiri kohustusi täitvate kliirivate liikmete tehinguid ega tekita neile kahju, mida neil ei olnud võimalik ette näha ega kontrollida;
- y) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 48 lõiget 3, kui ta ei teavita ESMA-t veel enne, kui rikkumismenetluse algatamine on välja kuulutatud või selline menetlus on käivitunud;

z) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 48 lõiget 4, kui ta ei tee kindlaks, et rikkumismenetlus on rakendatav ega võta kõiki mõistlikke samme tagamaks, et tal on õiguslik võim likvideerida kohustusi mittetäitva kliiriva liikme omandipositsioonid ja kanda kohustusi mittetäitva kliiriva liikme klientide positsioonid üle või need likvideerida;

aa) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 49 lõiget 1, kui ta ei vaata korrapäraselt läbi tagatisnõuete arvutamiseks kasutatavaid mudeleid ja parameetreid, tagatisfondi makseid, tagatisnõudeid ja muid riskikontrollimehhanisme ega kohalda mudelite suhtes rangeid ja sagedasi stressiteste, et hinnata nende vastupanuvõimet ekstreemsetes, kuid usutavates turutingimustes, ning ei korralda järelteste, et hinnata kasutatavate meetodite usaldusväärsust, või ei hangi sõltumatut hinnangut või ei teavita ESMA-t tehtud testide tulemustest või ei hangi enne mudelite või parameetrite olulist muutmist ESMA hinnangut;

bb) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 49 lõiget 2, kui ta ei testi rikkumismenetluse põhiaspekte korrapäraselt või ei võta mõistlikke meetmeid tagamaks, et kliirivad liikmed saavad menetlusest aru ja et nad on kehtestanud asjaomase korra, mida rakendatakse kohustuste mittetäitmisel;

cc) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 49 lõiget 1a, kui ta muudab artikli 49 lõikes 1 osutatud mudeleid oluliselt enne ESMA-lt sellise muutmise kohta hinnangu saamist;

dd) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 50 lõiget 1, kui ta ei kasuta, kuigi see on praktiline ja võimalik, oma tehingute arveldamiseks keskpanga raha, ega võta keskpanga raha mittekasutamise korral meetmeid rahaga arveldamise riskide rangeks piiramiseks;

ee) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 50 lõiget 3, kui ta ei välista põhiriski, kasutades võimalikult suures ulatuses väärtpaberiülekanne makse vastu, kui kesksel vastaspoolel on kohustus kanda finantsinstrumendid üle või ta saab ise finantsinstrumentide ülekandeid;

ff) teise taseme keskne vastaspool rikub artiklit 50a või 50b, kui ta ei arvuta K_{CCP} väärtust kõnealuse artikli järgi või ei järgi K_{CCP} arvutamiseks artikli 50a lõikes 2, artiklites 50b ja 50d sätestatud eeskirju;

gg) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 50a lõiget 3, kui ta arvutab K_{CCP} -d harvem kui kord kvartalis või harvem kui seda nõuab ESMA koosõlas artikli 50a lõikega 3;

hh) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 51 lõiget 2, kui tal ei ole mittediskrimineerivat juurdepääsu nii andmetele, mida ta vajab kauplemiskohalt saadud ülesannete täitmiseks, kuni see keskne vastaspool täidab kauplemiskoha poolseid tegevus- ja tehnilisi nõudeid, kui ka vastavale arveldussüsteemile;

ii) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 52 lõiget 1, kui tal ei ole koostalitluskokkuleppe sõlmimisel täidetud ükski kõnealuse lõike punktides a, b, c ja d sätestatud nõue;

jj) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 53 lõiget 1, kui ta ei erista oma kontodel teise keskse vastaspoole arvel hoitavaid varasid ja positsioone, kellega ta on sõlminud koostalitluskokkuleppe;

kk) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 54 lõiget 1, kui ta sõlmib koostalitluskokkuleppe ilma ESMA eelneva heakskiiduta;

IV. Läbipaistvuse ja teabe kättesaadavusega seotud rikkumised:

a) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 38 lõiget 1, kui ta ei avalikusta iga osutatava teenuse hinda eraldi, sealhulgas hinna alandamise või vähendamise ning sellise hinnaalanduse või -vähendamise tingimusi;

b) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 38 lõiget 1, kui ta ei avalda ESMA-le teavet oma teenuste kulude ja tulude kohta;

c) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 38 lõiget 2, kui ta ei avalda kliirivatele liikmetele ja nende klientidele osutatavate teenustega seotud riske;

d) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 38 lõiget 3, kui ta ei avalda oma kliirivatele liikmetele või ESMA-le hinnateavet, mida kasutatakse selleks, et arvutada päevalõpupositsioonid kliirivate liikmete suhtes, või ei avalda iga instrumendi kohta tema poolt kliiritud tehingute koondmahtu;

f) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 38 lõiget 4, kui ta ei avalda sideprotokollide talitus- ja tehnilised nõudeid, mis hõlmavad kolmandate isikutega suhtlemisel kasutatavaid sisu- ja sõnumivorminguid, sh artiklis 7 osutatud tegevus- ja tehnilisi nõudeid;

g) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 38 lõiget 5, kui ta ei avalikusta kõik juhud, mil kliiriv liige on artikli 37 lõikes 1 osutatud kriteeriume või artikli 38 lõike 5 nõudeid rikkunud, välja arvatud juhul, kui ESMA on seisukohal, et sellise rikkumise avalikustamine seaks ohtu finantsstabiilsuse või usalduse turu vastu või ohustaks tõsiselt finantsturge või tekitaks asjaomastele isikutele ebaproportsionaalset kahju;

h) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 39 lõiget 7, kui ta ei avalikusta tema poolt pakutava eristamise kaitstuse tasemeid ja eristamise eri tasemetega seotud kulusid;

i) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 49 lõiget 3, kui ta ei avalikusta põhiteavet riskijuhtimismudeli kohta või artikli 49 lõikes 1 osutatud stressitestide korraldamisel kasutatavate eelduste kohta;

j) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 50 lõiget 2, kui ta ei esita selgelt oma kohustusi seoses finantsinstrumentide ülekandmisega, sealhulgas märkides, kas tal on kohustus finantsinstrumendid üle kanda või ta saab ise finantsinstrumentide ülekande või kas ta korvab ülekandmisel tekkiva kahju osalistele;

k) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 50c lõiget 1, kui ta ei edasta oma kliirivatest liikmetest nendele, kes on krediidasutused ja investeerimisühingud, või nende pädevatele asutusele artikli 50c lõike 1 punktides a, b, c, d ja e osutatud teavet;

l) teise taseme keskne vastaspool rikub artikli 50c lõiget 2, kui ta teavitab oma neid kliirivaid liikmeid, kes on krediidasutused ja investeerimisühingud, harvem kui kord kvartalis või harvem kui seda nõuab ESMA kooskõlas artikli 50c lõikega 2.

V. Järelevalvetegevuse takistamisega seotud rikkumised:

- a) keskne vastaspool rikub artiklit 25c, kui ta annab ebaõiget või eksitavat teavet vastuseks artikli 25c alusel ESMA esitatud lihtteabenõudele või artikli 25n alusel ESMA koostatud otsusele teabe nõudmise kohta;
- b) keskne vastaspool annab ebaõigeid või eksitavaid vastuseid artikli 25d lõike 1 punkti d kohaselt esitatud küsimustele;
- c) teise taseme keskne vastaspool ei võta õigel ajal artikli 25n kohaselt ESMA otsusega nõutud järelevalvemeedet;
- d) teise taseme keskne vastaspool ei allu artikli 25e alusel ESMA võetud uurimisotsuses nõutud kohapealsele kontrollimisele“.

1. Lisatakse IV lisa:

„IV LISA

Artikli 25g lõike 3 kohaldamisel kasutatavate raskendavaid ja kergendavaid asjaolusid kajastavate koefitsientide loetelu

Artikli 25g lõikes 2 osutatud põhisummade suhtes kohaldatakse kumulatiivselt järgmisi koefitsiente.

I. Raskendavaid asjaolusid kajastavad kohandamiskoefitsiendid:

- a) kui rikkumine on toime pandud korduvalt, siis kohaldatakse iga korduva rikkumise puhul koefitsienti 1,1;
- b) kui rikkumise kestus on pikem kui kuus kuud, kohaldatakse koefitsienti 1,5;
- c) kui rikkumine on paljastanud süsteemseid puudusi keskse vastaspoole töö korralduses, eriti selle protseduurides, juhtimissüsteemides või sisekontrollis, kohaldatakse koefitsienti 2,2;
- d) kui rikkumine avaldab negatiivset mõju keskse vastaspoole tegevuse ja teenuste kvaliteedile, kohaldatakse koefitsienti 1,5;
- e) kui rikkumine on toime pandud tahtlikult, kohaldatakse koefitsienti 2;
- f) kui rikkumise tuvastamisest alates ei ole võetud parandusmeetmeid, kohaldatakse koefitsienti 1,7;
- g) kui keskse vastaspoole kõrgem juhtkond ei ole ESMA poolt läbiviidava uurimise käigus teinud ESMAga koostööd, kohaldatakse koefitsienti 1,5.

II. Kergendavaid asjaolusid kajastavad kohandamiskoefitsiendid:

- a) kui rikkumise kestus on lühem kui 10 tööpäeva, kohaldatakse koefitsienti 0,9;
- b) kui keskse vastaspoole kõrgem juhtkond suudab tõendada, et ta on võtnud kõik vajalikud meetmed rikkumise ärahoidmiseks, kohaldatakse koefitsienti 0,7;
- c) kui keskne vastaspool on ESMAt rikkumisest teavitanud kiiresti, tõhusalt ja täielikult, kohaldatakse koefitsienti 0,4;
- d) kui keskne vastaspool on vabatahtlikult võtnud meetmeid eesmärgiga tagada, et sarnast rikkumist ei oleks tulevikus võimalik toime panna, kohaldatakse koefitsienti 0,6.“