



Centrálny depozitár cenných papierov SR, a. s.

**Vykonávací predpis č. 6
k Prevádzkovému poriadku Centrálného depozitára
cenných papierov SR, a.s.**

**PODROBNOSTI K MONITOROVANIU ZLYHANÍ
VYROVNANIA A OPATRENÍ PRIJATÝCH NA
ZLEPŠENIE EFEKTÍVNOSTI VYROVNANIA**

Centrálny depozitár cenných papierov SR, a.s.
ul. 29. Augusta 1/A, 814 80 Bratislava I
zapísaný v Obchodnom registri Mestského súdu Bratislava III
oddiel: Sa, vložka č. 493/B
Telefón: 00421/2/59395110

IČO: 31 338 976
DIČ: 2020312833
IČ DPH: SK2020312833
www.cdcp.sk
Fax: 00421/2/ 5296 8755

Bankové spojenie
Slovenská sporiteľňa, a.s.
IBAN: SK26 0900 0000 0051 5999 9701
BIC: GIBASKBX

Obsah

Článok 1 Úvodné ustanovenia.....	3
Článok 2 Monitorovanie a ohlasovanie zlyhaní vyrovnaní	3
Článok 3 Mesačný zber informácií o opatreniach prijatých na zlepšenie efektívnosti vyrovnaní	3
Článok 4 Ročné ohlasovanie opatrení prijatých na zlepšenie efektívnosti vyrovnaní.....	4
Článok 5 Zverejňovania informácií o zlyhaniach vyrovnaní vrátane opatrení prijatých na zlepšenie efektívnosti vyrovnaní	4
Článok 6 Systematicky zlyhávajúci účastník	4
Článok 7 Záverečné a prechodné ustanovenia	5

Článok 1

Úvodné ustanovenia

- 1.1 Tento vykonávací predpis je vydaný v súlade s článkom 1 Prevádzkového poriadku Centrálného depozitára cenných papierov SR, a.s. (ďalej len „Prevádzkový poriadok“) a stanovuje podrobnosti v súvislosti s uplatňovaním ustanovení Prevádzkového poriadku, ktoré upravujú postup CDCP a účastníkov pri plnení povinností v rámci monitorovania zlyhaní vyrovnania a opatrení prijatých na zlepšenie efektívnosti vyrovnania.
- 1.2 CDCP identifikuje:
 - a) na mesačne báze, minimálne desať účastníkov s najvyššou mierou zlyhaní vyrovnania podľa počtu a/alebo hodnoty zlyhaní,
 - b) každoročne, systematicky zlyhávajúcich účastníkov.

Článok 2

Monitorovanie a ohlasovanie zlyhaní vyrovnania

- 2.1 CDCP v súlade s Delegovaným nariadením 2018/1229:
 - a) automatizovane prostredníctvom IS CDCP na dennej báze monitoruje počty a hodnoty zlyhaní vyrovnania,
 - b) každý mesiac zasiela príslušnému orgánu informácie o zlyhaniach vyrovnania a ich dôvodoch za predchádzajúci kalendárny mesiac, vrátane opatrení, ktoré CDCP a jeho účastníci plánujú prijať alebo ktoré prijali s cieľom zlepšiť efektívnosť vyrovnania,
 - c) každý rok zasiela príslušnému orgánu informácie o zlyhaniach vyrovnania a ich dôvodoch za predchádzajúci kalendárny rok, vrátane opatrení, ktoré CDCP a jeho účastníci plánujú prijať alebo ktoré prijali s cieľom zlepšiť efektívnosť vyrovnania.
- 2.2 Informácie podľa ods. 2.1 tohto článku zasiela CDCP v časti týkajúcej sa účastníkov na základe informácií dostupných z IS CDCP a na základe informácií poskytnutých zo strany účastníkov podľa čl. 3. Za týmto účelom sú účastníci povinní poskytnúť CDCP potrebnú súčinnosť. CDCP je oprávnený požadovať od účastníka údaje aj nad rámec mesačného zberu informácií podľa čl. 3 (pokiaľ ide o stanovený rozsah údajov, frekvenciu zberu údajov), a to najmä v nadväznosti na požiadavku príslušného orgánu.

Článok 3

Mesačný zber informácií o opatreniach prijatých na zlepšenie efektívnosti vyrovnania

- 3.1 CDCP zašle v prvý prevádzkový deň v mesiaci účastníkovi, ktorý patrí medzi desať účastníkov s najvyššou mierou zlyhaní vyrovnania informáciu obsahujúcu údaje týkajúce sa počtov, hodnôt a mier zlyhania a dôvodov zlyhania, ktoré sú CDCP známe.
- 3.2 CDCP zároveň požiada účastníka podľa predchádzajúceho odseku o informácie o tom, či prijal alebo plánuje prijať opatrenia na zlepšenie efektívnosti vyrovnania, resp. informácie o konkrétnych opatreniach, ktoré účastník prijal, alebo plánuje prijať.
- 3.3 Účastník je povinný poskytnúť požadované informácie podľa tohto článku v požadovanej forme a štruktúre na predpísanom formulári (viď. ods. 3.5 tohto článku) a v lehote do konca tretieho prevádzkového dňa daného mesiaca. V prípade, že účastník

neposkytne požadované informácie v stanovenej lehote, CDCP zahrnie túto skutočnosť do informácie podľa čl. 2 ods. 2.1 písm. b) tohto Vykonávacieho predpisu.

- 3.4 Na účely mesačného zberu údajov alebo na účely dodatočného poskytovania údajov na základe požiadavky príslušného orgánu, poskytuje účastník aj údaje o konkrétnych opatreniach, ak v rámci predpísaného formuláru označil tieto opatrenia ako „Iné“, a teda ktoré nie sú bližšie preddefinované. Zároveň takáto informácia netvorí automaticky súčasť mesačného a ročného zasielanie informácií podľa čl. 2 tohto Vykonávacieho predpisu.
- 3.5 Komunikácia medzi CDCP a účastníkmi v zmysle tohto článku prebieha elektronicky prostredníctvom elektronickej adresy CDCP zverejnenej na web stránke CDCP v sekcii pre účastníkov a kontaktných osôb nahlásených účastníkmi na účely komunikácie s CDCP. Tým nie je dotknuté právo CDCP kontaktovať účastníka iným spôsobom.
- 3.6 Vzor informácie zasielanej účastníkovi a požiadavky na zber informácií (predpísaný formulár) je zverejnený na web stránke CDCP v sekcii pre účastníkov.

Článok 4

Ročné ohlasovanie dôvodov zlyhaní a opatrení prijatých na zlepšenie efektívnosti vyrovnania

- 4.1 CDCP zasiela informáciu o opatreniach prijatých na zlepšenie efektívnosti vyrovnania v súlade s čl. 2 ods. 2.1 písm. c) tohto Vykonávacieho predpisu na základe informácií od účastníkov, ktoré zozbieral podľa článku 3 tohto Vykonávacieho predpisu.
- 4.2 CDCP je zároveň oprávnený požadovať od účastníka za účelom ročného ohlasovania doplnenie:
 - a) informácií poskytnutých podľa čl. 3 tohto Vykonávacieho predpisu, najmä podrobnejšie informácie o prijatých a plánovaných opatreniach a ich splnení,
 - b) informácií o dôvodoch zlyhaní, a to nad rámec informácií dostupných z IS CDCP.

Článok 5

Zverejňovania informácií o zlyhaniach vyrovnania vrátane opatrení prijatých na zlepšenie efektívnosti vyrovnania

- 5.1 CDCP v súlade s Delegovaným nariadením 2018/1229 každoročne zverejňuje informácie o zlyhaniach vyrovnania vrátane opatrení, ktoré CDCP a jeho účastníci plánujú prijať alebo ktoré prijali s cieľom zlepšiť efektívnosť vyrovnania. Údaje sú zverejňované v anonymizovanej forme.

Článok 6

Systematicky zlyhávajúci účastník

- 6.1 CDCP postupuje pri určení účastníka za systematicky zlyhávajúceho podľa čl. 39 Delegovaného nariadenia 2018/1229, pričom za deň pôsobenia daného účastníka v systéme vyrovnania CDCP považuje prevádzkový deň, v rámci ktorého mal účastník v systéme vyrovnania vyrovnaný a/alebo zlyhaný príkaz.

- 6.2 CDCP priebežne informuje účastníka o tom, že spadá pod definíciu systematicky zlyhávajúceho účastníka prostredníctvom informácie zasielanej podľa čl. 3 ods. 3.1 tohto Vykonávacieho predpisu.

Článok 7

Záverečné a prechodné ustanovenia

- 7.1 Tento vykonávací predpis k Prevádzkovému poriadku nadobúda platnosť dňom jeho schválenia predstavenstvom CDCP dňa 28.02.2024 a účinnosť dňa 15.03.2024.