Den här texten är endast avsedd som ett dokumentationshjälpmedel och har ingen rättslig verkan. EU-institutionerna tar inget ansvar för innehållet. De autentiska versionerna av motsvarande rättsakter, inklusive ingresserna, publiceras i Europeiska unionens officiella tidning och finns i EUR-Lex. De officiella texterna är direkt tillgängliga via länkarna i det här dokumentet

►**B**

KOMMISSIONENS DELEGERADE FÖRORDNING (EU) 2016/1178

av den 10 juni 2016

om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 648/2012 vad gäller tekniska tillsynsstandarder avseende clearingkravet

(Text av betydelse för EES)

(EUT L 195, 20.7.2016, s. 3)

Ändrad genom:

		Officiella tidningen		
		nr	sida	datum
►**M1**	Kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/751 av den 16 mars 2017	L 113	15	29.4.2017
►**M2**	Kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/667 av den 19 december 2018	L 113	1	29.4.2019
►**M3**	Kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/447 av den 16 december 2019	L 94	5	27.3.2020

Rättad genom:

►**C1** Rättelse, EUT L 196, 21.7.2016, s. 56 (2016/1178)

▼B

KOMMISSIONENS DELEGERADE FÖRORDNING (EU) 2016/1178

av den 10 juni 2016

om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 648/2012 vad gäller tekniska tillsynsstandarder avseende clearingkravet

(Text av betydelse för EES)

Artikel 1

Klasser av OTC-derivat som omfattas av clearingkravet

1. De klasser av OTC-derivat som anges i bilaga I ska omfattas av clearingkravet.

▼M3

_____

▼B

Artikel 2

Kategorier av motparter

1. Vid tillämpningen av artiklarna 3 och 4 ska de motparter som omfattas av clearingkravet delas upp i följande kategorier:

a) Kategori 1 utgörs av motparter som den dag då denna förordning träder i kraft, avseende minst en av de klasser av OTC-derivat som anges i bilaga I till den här förordningen eller i bilaga I till kommissionens delegerade förordning (EU) 2015/2205 ([1]), är clearingmedlemmar i den mening som avses i artikel 2.14 i förordning (EU) nr 648/2012 i minst en av de centrala motparter som har auktoriserats eller godkänts för att cleara minst en av dessa klasser före ovan nämnda dag.

b) Kategori 2 utgörs av motparter som faller utanför kategori 1, som ingår i en företagsgrupp vars aggregerade genomsnittliga utestående teoretiska bruttobelopp för derivat som inte clearas centralt per månadssluten för januari, februari och mars 2016 överstiger 8 miljarder euro, och som är något av följande:

i) Finansiella motparter.

ii) Alternativa investeringsfonder enligt definitionen i artikel 4.1 a i Europaparlamentets och rådets direktiv 2011/61/EU ([2]) som är icke-finansiella motparter.

([1]) Kommissionens delegerade förordning (EU) 2015/2205 av den 6 augusti 2015 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 648/2012 vad gäller tekniska standarder för clearingkravet (EUT L 314, 1.12.2015, s. 13).

([2]) Europaparlamentets och rådets direktiv 2011/61/EU av den 8 juni 2011 om förvaltare av alternativa investeringsfonder samt om ändring av direktiv 2003/41/EG och 2009/65/EG och förordningarna (EG) nr 1060/2009 och (EU) nr 1095/2010 (EUT L 174, 1.7.2011, s. 1).

▼B

c) Kategori 3 utgörs av motparter som inte tillhör kategori 1 eller 2, och som är något av följande:

i) Finansiella motparter.

ii) Alternativa investeringsfonder enligt definitionen i artikel 4.1 a i direktiv 2011/61/EU som är icke-finansiella motparter.

d) Kategori 4 utgörs av icke-finansiella motparter som inte tillhör kategori 1, 2 eller 3.

2. Vid beräkning av gruppens genomsnittliga aggregerade utestående teoretiska bruttobelopp per månadsslut enligt punkt 1 b ska alla gruppens derivat som inte clearas centralt, inklusive valutaterminer, swappar och valutaswappar, ingå.

3. Om motparterna är alternativa investeringsfonder enligt definitionen i artikel 4.1 a i direktiv 2011/61/EU eller företag för kollektiva investeringar i överlåtbara värdepapper enligt definitionen i artikel 1.2 i Europaparlamentets och rådets direktiv 2009/65/EG ([1]) ska det tröskelvärde på 8 miljarder euro som anges i punkt 1 b i denna artikel tillämpas enskilt för varje fond.

Artikel 3

Datum från vilket clearingkravet ska gälla

1. I fråga om kontrakt som gäller en av de OTC-derivatklasser som anges i bilaga I ska clearingkravet få verkan

a) den 9 februari 2017 för motparter i kategori 1,

▼C1

b) den 9 augusti 2017 för motparter i kategori 2,

▼M1

c) den 21 juni 2019 för motparter i kategori 3,

▼C1

d) den 9 augusti 2019 för motparter i kategori 4.

▼B

När ett kontrakt ingås mellan två motparter som ingår i olika kategorier ska det datum från vilket clearingkravet får verkan vara det senare av datumen.

▼M2

2. I fråga om kontrakt som gäller en klass av OTC-derivat som anges i bilagan och som slutits mellan motparterna som ingår i samma grupp och där en motpart är etablerad i ett tredjeland och den andra motparten i unionen, ska clearingkravet – genom undantag från punkt 1 – få verkan

([1]) Europaparlamentets och rådets direktiv 2009/65/EG av den 13 juli 2009 om samordning av lagar och andra författningar som avser företag för kollektiva investeringar i överlåtbara värdepapper (fondföretag) (EUT L 302, 17.11.2009, s. 32).

▼M2

a) den 21 december 2020, såvida inget beslut om likvärdighet enligt artikel 13.2 i förordning (EU) nr 648/2012 har antagits som grund för tillämpningen av artikel 4 i samma förordning och som täcker de OTC-derivatkontrakt som anges i bilagan till den här förordningen, med avseende på det berörda tredjelandet, eller

b) det senare av följande datum om ett beslut om likvärdighet i enlighet med artikel 13.2 i förordning (EU) nr 648/2012 har antagits som grund för tillämpningen av artikel 4 i samma förordning och som täcker de OTC-derivatkontrakt som avses i bilagan till den här förordningen, med avseende på det berörda tredjelandet:

i) 60 dagar efter ikraftträdandet av det beslut som antagits i enlighet med artikel 13.2 i förordning (EU) nr 648/2012 som grund för tillämpningen av artikel 4 i samma förordning och som täcker de OTC-derivatkontrakt som avses i bilagan till den här förordningen, med avseende på det berörda tredjelandet.

ii) Den dag då clearingkravet får verkan i enlighet med punkt 1.

▼B

Detta undantag ska endast gälla om motparterna uppfyller följande villkor:

a) Den motpart som är etablerad i ett tredjeland är antingen en finansiell motpart eller en icke-finansiell motpart.

b) Den motpart som är etablerad i unionen är

i) en finansiell motpart, en icke-finansiell motpart, ett finansiellt holdingföretag, ett finansinstitut eller ett företag för anknutna tjänster som omfattas av lämpliga tillsynskrav, och den motpart som avses i led a är en finansiell motpart,

ii) antingen en finansiell motpart eller en icke-finansiell motpart, och den motpart som avses i led a är en icke-finansiell motpart.

c) Båda motparterna omfattas helt och hållet av samma konsolidering i enlighet med artikel 3.3 i förordning (EU) nr 648/2012.

d) Båda motparterna omfattas av lämpliga centraliserade förfaranden för bedömning, mätning och kontroll av risker.

e) Den motpart som är etablerad i unionen har skriftligt underrättat sin behöriga myndighet om att villkoren i leden a, b, c och d är uppfyllda, och den behöriga myndigheten inom 30 dagar efter att ha mottagit denna underrättelse har bekräftat att dessa villkor är uppfyllda.

▼B

Artikel 4

Minimikrav på återstående löptid

1. För finansiella motparter i kategori 1 ska följande minimigränser gälla med avseende på regeln om återstående löptid enligt artikel 4.1 b ii i förordning (EU) nr 648/2012 på den dag då clearingkravet får verkan:

a) 15 år för kontrakt som ingåtts eller förnyats före den 9 oktober 2016, och som hör till en av de klasser som anges i tabell 1 i bilaga I.

b) 3 år för kontrakt som ingåtts eller förnyats före den 9 oktober 2016, och som hör till en av de klasser som anges i tabell 2 i bilaga I.

c) 6 månader för kontrakt som ingåtts eller förnyats den 9 oktober 2016 eller senare, och som hör till en av de klasser som anges i tabell 1 eller 2 i bilaga I.

2. För finansiella motparter i kategori 2 ska följande minimigränser gälla med avseende på regeln om återstående löptid enligt artikel 4.1 b ii i förordning (EU) nr 648/2012 på den dag då clearingkravet får verkan:

a) 15 år för kontrakt som ingåtts eller förnyats före den 9 oktober 2016, och som hör till en av de klasser som anges i tabell 1 i bilaga I.

b) 3 år för kontrakt som ingåtts eller förnyats före den 9 oktober 2016, och som hör till en av de klasser som anges i tabell 2 i bilaga I.

c) 6 månader för kontrakt som ingåtts eller förnyats den 9 oktober 2016 eller senare, och som hör till en av de klasser som anges i tabell 1 eller 2 i bilaga I.

3. För finansiella motparter i kategori 3 och för transaktioner enligt artikel 3.2 i denna förordning som ingås mellan finansiella motparter ska följande minimigränser gälla med avseende på regeln om återstående löptid enligt artikel 4.1 b ii) i förordning (EU) nr 648/2012 på den dag då clearingkravet får verkan:

a) 15 år för kontrakt som hör till en av de klasser som anges i tabell 1 i bilaga I.

b) 3 år för kontrakt som hör till en av de klasser som anges i tabell 2 i bilaga I.

4. När ett kontrakt ingås mellan två finansiella motparter som tillhör olika kategorier eller mellan två finansiella motparter som deltar i transaktioner som avses i artikel 3.2 ska det minimikrav på återstående löptid som ska beaktas vid tillämpning av den här artikeln vara den längre av de återstående löptider som skulle vara tillämplig enskilt.

▼B

Artikel 5

Ikraftträdande

Denna förordning träder i kraft den tjugonde dagen efter det att den har offentliggjorts i *Europeiska unionens officiella tidning*.

Denna förordning är till alla delar bindande och direkt tillämplig i alla medlemsstater.

▼B

BILAGA

Klasser av OTC-räntederivat som omfattas av clearingkravet

Tabell 1

Klasser av ränteswappar för fast kontra rörlig ränta (fixed-to-float)

ID	Typ	Referensindex	Avvecklingsvaluta	Löptid	Avvecklingsvaluta Typ	Valfrihet	Teoretiskt värde – typ
C.1.1	Fixed-to float	NIBOR	NOK	28D-10Y	En enda valuta	Nej	Konstant eller rörlig
C.1.2	Fixed-to float	WIBOR	PLN	28D-10Y	En enda valuta	Nej	Konstant eller rörlig
C.1.3	Fixed-to float	STIBOR	SEK	28D-15Y	En enda valuta	Nej	Konstant eller rörlig

Tabell 2

Klasser av ränteterminskontrakt (FRA)

ID	Typ	Referensindex	Avvecklingsvaluta	Löptid	Avvecklingsvaluta Typ	Valfrihet	Teoretiskt värde – Typ
C.2.1	FRA	NIBOR	NOK	3D-2Y	En enda valuta	Nej	Konstant eller rörlig
C.2.2	FRA	WIBOR	PLN	3D-2Y	En enda valuta	Nej	Konstant eller rörlig
C.2.3	FRA	STIBOR	SEK	3D-3Y	En enda valuta	Nej	Konstant eller rörlig