Tämä asiakirja on ainoastaan dokumentoinnin apuväline eikä sillä ole oikeudellista vaikutusta. Unionin toimielimet eivät vastaa sen sisällöstä. Säädösten todistusvoimaiset versiot on johdanto-osineen julkaistu Euroopan unionin virallisessa lehdessä ja ne ovat saatavana EUR-Lexissä. Näihin virallisiin teksteihin pääsee suoraan tästä asiakirjasta siihen upotettujen linkkien kautta.

►B

KOMISSION DELEGOITU ASETUS (EU) 2016/592,

annettu 1 päivänä maaliskuuta 2016,

Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 648/2012 täydentämisestä määritysvelvollisuutta koskevilla teknisillä sääntelystandardeilla

(ETA:n kannalta merkityksellinen teksti)

(EUVL L 103, 19.4.2016, s. 5)

Oikaistu:

►C1 Oikaisu, EUVL L 183, 8.7.2016, s. 72 (2016/592)

►C2 Oikaisu, EUVL L 306, 15.11.2016, s. 43 (2016/592)

▼B

KOMISSION DELEGOITU ASETUS (EU) 2016/592,

annettu 1 päivänä maaliskuuta 2016,

Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 648/2012 täydentämisestä määritysvelvollisuutta koskevilla teknisillä sääntelystandardeilla

(ETA:n kannalta merkityksellinen teksti)

1 artikla

Määritysvelvollisuuden piiriin kuuluvat OTC-johdannaislajit

Liitteessä esitetyt OTC-johdannaislajit kuuluvat *määritysvelvollisuuden* piiriin.

2 artikla

Vastapuoliryhmät

1. Määritysvelvollisuuden piiriin kuuluvat vastapuolet jaetaan 3 ja 4 artiklaa sovellettaessa seuraaviin ryhmiin:

a) Ryhmä 1 sisältää vastapuolet, jotka ovat tämän asetuksen voimaantulopäivänä vähintään yhden tämän asetuksen liitteessä esitetyn OTC-johdannaislajin osalta asetuksen (EU) N:o 648/2012 2 artiklan 14 kohdassa tarkoitettuja määritysosapuolia vähintään yhdelle niistä keskusvastapuolista, joille on ennen kyseistä päivää myönnetty toimilupa tai tunnustus määrittää ainakin yhtä kyseisistä lajeista.

b) Ryhmä 2 sisältää ryhmään 1 kuulumattomat vastapuolet, jotka kuuluvat konserniin, jonka muiden kuin keskusvastapuolen määrittämien liikkeessä olevien johdannaisten yhteenlaskettu kuukauden lopun keskimääräinen bruttonimellismäärä vuoden 2016 tammi-, helmi- ja maaliskuulta on yli 8 miljardia euroa ja jotka kuuluvat johonkin seuraavista alaryhmistä:

   i) finanssialalla toimivat vastapuolet;

   ii) vaihtoehtoiset sijoitusrahastot, sellaisina kuin ne on määritelty Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivin 2011/61/EU ([1]) 4 artiklan 1 kohdan a alakohdassa, jotka ovat finanssialan ulkopuolisia vastapuolia.

c) Ryhmä 3 sisältää ryhmään 1 tai 2 kuulumattomat vastapuolet, jotka ovat mitä tahansa seuraavista:

   i) finanssialalla toimivat vastapuolet;

   ii) vaihtoehtoiset sijoitusrahastot, sellaisina kuin ne on määritelty direktiivin 2011/61/EU 4 artiklan 1 kohdan a alakohdassa, jotka ovat finanssialan ulkopuolisia vastapuolia.

d) Ryhmä 4 sisältää finanssialan ulkopuoliset vastapuolet, jotka eivät kuulu ryhmään 1, 2 tai 3.

([1]) Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivi 2011/61/EU, annettu 8 päivänä kesäkuuta 2011, vaihtoehtoisten sijoitusrahastojen hoitajista ja direktiivin 2003/41/EY ja 2009/65/EY sekä asetuksen (EY) N:o 1060/2009 ja (EU) N:o 1095/2010 muuttamisesta (EUVL L 174, 1.7.2011, s. 1).

▼B

2. Laskettaessa 1 kohdan b alakohdassa tarkoitettua konsernin liikkeessä olevien johdannaisten yhteenlaskettua kuukauden lopun keskimääräistä bruttonimellismäärää on otettava huomioon kaikki muiden kuin keskusvastapuolen määrittämät johdannaiset, myös valuuttatermiinisopimukset, swap-sopimukset ja valuuttaswapit.

3. Jos vastapuolet ovat direktiivin 2011/61/EU 4 artiklan 1 kohdan a alakohdassa määriteltyjä vaihtoehtoisia sijoitusrahastoja tai Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivin 2009/65/EY ([1]) 1 artiklan 2 kohdassa määriteltyjä siirtokelpoisiin arvopapereihin kohdistuvaa yhteistä sijoitustoimintaa harjoittavia yrityksiä, tämän artiklan 1 kohdan b alakohdassa tarkoitettua 8 miljardin euron kynnysarvoa on sovellettava rahastokohtaisesti.

3 artikla

Määritysvelvollisuuden voimaantulopäivät

1. Liitteessä esitettyä OTC-johdannaislajia koskevien sopimusten osalta määritysvelvollisuus tulee voimaan seuraavasti:

a) 9 päivänä helmikuuta 2017, kun kyseessä ovat ryhmään 1 kuuluvat vastapuolet;

b) 9 päivänä elokuuta 2017, kun kyseessä ovat ryhmään 2 kuuluvat vastapuolet;

c) 9 päivänä helmikuuta 2018, kun kyseessä ovat ryhmään 3 kuuluvat vastapuolet;

d) 9 päivänä toukokuuta 2019, kun kyseessä ovat ryhmään 4 kuuluvat vastapuolet.

Jos sopimus tehdään kahden eri vastapuoliryhmään kuuluvan vastapuolen välillä, kyseistä sopimusta koskevan määritysvelvollisuuden voimaantulopäivä on myöhempi päivä.

2. Poiketen siitä, mitä 1 kohdan a, b ja c alakohdassa säädetään, sellaisten liitteessä esitettyä OTC-johdannaislajia koskevien sopimusten osalta, jotka on tehty muiden kuin ryhmään 4 kuuluvien saman konsernin vastapuolten välillä, joista toinen vastapuoli on sijoittautunut kolmanteen maahan ja toinen vastapuoli unioniin, määritysvelvollisuus tulee voimaan seuraavasti:

a) 9 päivänä toukokuuta 2019, jos asetuksen (EU) N:o 648/2012 4 artiklan soveltamiseksi ei ole annettu mainitun asetuksen 13 artiklan 2 kohdan nojalla vastaavuuspäätöstä, joka kattaa tämän asetuksen liitteessä tarkoitetut OTC-johdannaissopimukset kyseisen kolmannen maan osalta; tai

b) sinä päivänä, joka on seuraavista päivistä myöhäisempi, jos asetuksen (EU) N:o 648/2012 4 artiklan soveltamiseksi on annettu mainitun asetuksen 13 artiklan 2 kohdan nojalla vastaavuuspäätös, joka kattaa tämän asetuksen liitteessä tarkoitetut OTC-johdannaissopimukset kyseisen kolmannen maan osalta:

([1]) Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivi 2009/65/EY, annettu 13 päivänä heinäkuuta 2009, siirtokelpoisiin arvopapereihin kohdistuvaa yhteistä sijoitustoimintaa harjoittavia yrityksiä (yhteissijoitusyritykset) koskevien lakien, asetusten ja hallinnollisten määräysten yhteensovittamisesta (EUVL L 302, 17.11.2009, s. 32).

▼B

i) 60 päivän kuluttua sen päätöksen voimaantulopäivästä, joka on annettu asetuksen (EU) N:o 648/2012 4 artiklan soveltamiseksi mainitun asetuksen 13 artiklan 2 kohdan nojalla ja joka kattaa tämän asetuksen liitteessä tarkoitetut OTC-johdannaissopimukset kyseisen kolmannen maan osalta;

ii) päivä, jona määritysvelvollisuus tulee voimaan 1 kohdan mukaisesti.

Tätä poikkeusta sovelletaan vain silloin, kun vastapuolet täyttävät seuraavat edellytykset:

a) kolmanteen maahan sijoittautunut vastapuoli on joko finanssialalla toimiva vastapuoli tai finanssialan ulkopuolinen vastapuoli;

b) unioniin sijoittautunut vastapuoli on:

i) finanssialalla toimiva vastapuoli, finanssialan ulkopuolinen vastapuoli, rahoitusalan omistusyhteisö, rahoituslaitos tai oheispalveluyritys, johon sovelletaan asianmukaisia vakavaraisuusvaatimuksia, ja a alakohdassa tarkoitettu vastapuoli on finanssialalla toimiva vastapuoli;

ii) joko finanssialalla toimiva vastapuoli tai finanssialan ulkopuolinen vastapuoli, ja a alakohdassa tarkoitettu vastapuoli on finanssialan ulkopuolinen vastapuoli;

c) molemmat vastapuolet sisältyvät kokonaisuudessaan samaan konsolidointiin asetuksen (EU) N:o 648/2012 3 artiklan 3 kohdan mukaisesti;

d) molempiin vastapuoliin sovelletaan asianmukaisia keskitettyjä riskien arviointi-, mittaamis- ja valvontamenettelyjä;

e) unioniin sijoittautunut vastapuoli on ilmoittanut omalle toimivaltaiselle viranomaiselleen kirjallisesti, että a, b, c ja d alakohdassa säädetyt edellytykset täyttyvät, ja toimivaltainen viranomainen on vahvistanut 30 kalenteripäivän kuluessa ilmoituksen vastaanottamisesta, että kyseiset edellytykset täyttyvät.

4 artikla

Lyhin mahdollinen jäljellä oleva voimassaoloaika

1. Kun kyseessä ovat ryhmään 1 kuuluvat finanssialalla toimivat vastapuolet, asetuksen (EU) N:o 648/2012 4 artiklan 1 kohdan b alakohdan ii alakohdassa tarkoitettu lyhin mahdollinen jäljellä oleva voimassaoloaika määritysvelvollisuuden voimaantulopäivänä on:

a) 5 vuotta ja 3 kuukautta sopimuksille, jotka on tehty tai uusittu ennen 9 päivää lokakuuta 2016 ja jotka kuuluvat liitteessä olevan taulukon sisältämiin lajeihin;

b) ►C1 6 kuukautta sopimuksille, jotka on tehty tai uusittu 9 päivänä lokakuuta 2016 tai sen jälkeen ja jotka kuuluvat liitteessä olevan taulukon sisältämiin lajeihin. ◄

2. Kun kyseessä ovat ryhmään 2 kuuluvat finanssialalla toimivat vastapuolet, asetuksen (EU) N:o 648/2012 4 artiklan 1 kohdan b alakohdan ii alakohdassa tarkoitettu lyhin mahdollinen jäljellä oleva voimassaoloaika määritysvelvollisuuden voimaantulopäivänä on:

▼B

a) 5 vuotta ja 3 kuukautta sopimuksille, jotka on tehty tai uusittu ennen 9 päivää lokakuuta 2016 ja jotka kuuluvat liitteessä olevan taulukon sisältämiin lajeihin;

b) ►C1 6 kuukautta sopimuksille, jotka on tehty tai uusittu 9 päivänä lokakuuta 2016 tai sen jälkeen ja jotka kuuluvat liitteessä olevan taulukon sisältämiin lajeihin. ◄

3. Kun kyseessä ovat ryhmään 3 kuuluvat finanssialalla toimivat vastapuolet ja tämän asetuksen 3 artiklan 2 kohdassa tarkoitetut transaktiot rahoitusalalla toimivien vastapuolten välillä, asetuksen (EU) N:o 648/2012 4 artiklan 1 kohdan b alakohdan ii alakohdassa tarkoitettu lyhin mahdollinen jäljellä oleva voimassaoloaika määritysvelvollisuuden voimaantulopäivänä on 5 vuotta ja 3 kuukautta.

4. Jos sopimus on tehty kahden eri ryhmään kuuluvan finanssialalla toimivan vastapuolen välillä tai kahden 3 artiklan 2 kohdassa tarkoitettuihin transaktioihin osallistuvan finanssialalla toimivan vastapuolen välillä, tätä artiklaa sovellettaessa on otettava huomioon pidempi jäljellä oleva voimassaoloaika.

5 artikla

Voimaantulo

Tämä asetus tulee voimaan kahdentenakymmenentenä päivänä sen jälkeen, kun se on julkaistu *Euroopan unionin virallisessa lehdessä*.

Tämä asetus on kaikilta osiltaan velvoittava, ja sitä sovelletaan sellaisenaan kaikissa jäsenvaltioissa.

▼B

LIITE

Määritysvelvollisuuden piiriin kuuluvien luottoriskinvaihtoon perustuvien OTC-johdannaissopimusten lajit

Eurooppalaiset luokkiin jakamattomien indeksiin liitettyjen luottoriskinvaihtosopimusten luokat

Tunniste	Tyyppi	Alatyyppi	Maantieteellinen alue	Viiteindeksi	Selvitysvaluutta	Sarja	Maturiteetti
B.1.1	Indeksiin liitetyt luottoriskinvaihtosopimukset	Luokkiin jakamaton indeksi	Eurooppa	iTraxx Europe Main	euro	►C2 17:stä lähtien ◄	5 vuotta
B.1.2	Indeksiin liitetyt luottoriskinvaihtosopimukset	Luokkiin jakamaton indeksi	Eurooppa	iTraxx Europe Crossover	euro	►C2 17:stä lähtien ◄	5 vuotta