Този текст служи само за информационни цели и няма правно действие. Институциите на Съюза не носят отговорност за неговото съдържание. Автентичните версии на съответните актове, включително техните преамбюли, са версиите, публикувани в Официален вестник на Европейския съюз и налични в EUR-Lex. Тези официални текстове са пряко достъпни чрез връзките, публикувани в настоящия документ

►**B**

ДЕЛЕГИРАН РЕГЛАМЕНТ (ЕС) 2016/592 НА КОМИСИЯТА

от 1 март 2016 година

за допълване на Регламент (ЕС) № 648/2012 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на регулаторните технически стандарти относно задължението за клиринг

(текст от значение за ЕИП)

(ОВ L 103, 19.4.2016 г., стр. 5)

Поправен със:

►**C1** Поправка, ОВ L 183, 8.7.2016 г., стр. 72 (2016/592)

▼B

ДЕЛЕГИРАН РЕГЛАМЕНТ (ЕС) 2016/592 НА КОМИСИЯТА

от 1 март 2016 година

за допълване на Регламент (ЕС) № 648/2012 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на регулаторните технически стандарти относно задължението за клиринг

(текст от значение за ЕИП)

Член 1

Класове извънборсови деривати, които подлежат на задължителен клиринг

Посочените в приложението класове извънборсови деривати подлежат на задължителен клиринг.

Член 2

Категории контрагенти

1. За целите на членове 3 и 4 контрагентите, за които се прилага задължението за клиринг, се разделят на следните категории:

а) категория 1, включваща контрагенти, които към датата на влизане в сила на настоящия регламент са клирингови членове по смисъла на член 2, параграф 14 от Регламент (ЕС) № 648/2012, за поне един от класовете извънборсови деривати, посочени в приложението към настоящия регламент, на поне един от ЦК, получили разрешение или признати преди тази дата да извършват клиринг на най-малко един от тези класове;

б) категория 2, включваща контрагенти, които не принадлежат към категория 1, а към група, чиято обща средна стойност на остатъчната брутна условна стойност в края на месеца на дериватите, на които се извършва нецентрализиран клиринг, надхвърля 8 милиарда евро за месеците януари, февруари и март 2016 г., и които представляват някой от следните видове субекти:

i) финансови контрагенти,

ii) алтернативни инвестиционни фондове в съответствие с определението в член 4, параграф 1, буква а) от Директива 2011/61/ЕС на Европейския парламент и на Съвета ([1]), които са нефинансови контрагенти;

в) категория 3, включваща контрагенти, които не принадлежат към категория 1 или категория 2 и които представляват някой от следните видове субекти:

i) финансови контрагенти,

ii) алтернативни инвестиционни фондове в съответствие с определението в член 4, параграф 1, буква а) от Директива 2011/61/ЕС, които са нефинансови контрагенти;

г) категория 4, включваща нефинансови контрагенти, които не принадлежат към категория 1, категория 2 или категория 3.

([1]) Директива 2011/61/ЕС на Европейския парламент и на Съвета от 8 юни 2011 г. относно лицата, управляващи алтернативни инвестиционни фондове, и за изменение на директиви 2003/41/ЕО и 2009/65/ЕО и на регламенти (ЕО) № 1060/2009 и (ЕС) № 1095/2010 (ОВ L 174, 1.7.2011 г., стр. 1).

▼B

2. За целите на изчисляването на груповата обща средна стойност на остатъчната брутна условна стойност в края на месеца, посочена в параграф 1, буква б), се включват всички групови деривати, на които се извършва нецентрализиран клиринг, включително валутни форуърди, суапове и валутни суапове.

3. Когато контрагентите са алтернативни инвестиционни фондове по определението в член 4, параграф 1, буква а) от Директива 2011/61/ЕС или предприятия за колективно инвестиране в прехвърлими ценни книжа по определението в член 1, параграф 2 от Директива 2009/65/ЕО на Европейския парламент и на Съвета ([1]), прагът от 8 милиарда евро, посочен в параграф 1, буква б) от настоящия член, се прилага индивидуално на равнище фонд.

Член 3

Дати, от които задължението за клиринг поражда действие

1. По отношение на договори, принадлежащи към посочен в приложението клас извънборсови деривати, задължението за клиринг поражда действие на:

а) 9 февруари 2017 г. за контрагентите от категория 1;

б) 9 август 2017 г. за контрагентите от категория 2;

в) 9 февруари 2018 г. за контрагентите от категория 3;

г) 9 май 2019 г. за контрагентите от категория 4.

Когато договорът е сключен между двама контрагенти, попадащи в различни категории контрагенти, задължението за клиринг на този договор поражда действие на по-късната дата.

2. Чрез дерогация от параграф 1, букви а), б) и в) по отношение на договори, отнасящи се до посочен в приложението клас извънборсови деривати и сключени между контрагенти, които са различни от контрагентите от категория 4 и са част от една и съща група, като единият контрагент е установен в трета държава, а другият контрагент е установен в Съюза, задължението за клиринг поражда действие на:

а) 9 май 2019 г. в случай че по отношение на съответната трета държава не е прието решение относно еквивалентността в съответствие с член 13, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 648/2012 за целите на прилагането на член 4 от същия регламент, отнасящо се до договорите за извънборсови деривати, посочени в приложението към настоящия регламент; или

б) по-късната от следните дати, в случай че по отношение на съответната трета държава е прието решение относно еквивалентността в съответствие с член 13, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 648/2012 за целите на прилагането на член 4 от същия регламент, отнасящо се до договорите за извънборсови деривати, посочени в приложението към настоящия регламент:

([1]) Директива 2009/65/ЕО на Европейския парламент и на Съвета от 13 юли 2009 г. относно координирането на законовите, подзаконовите и административните разпоредби относно предприятията за колективно инвестиране в прехвърлими ценни книжа (ПКИПЦК) (ОВ L 302, 17.11.2009 г., стр. 32).

▼B

i) 60 дни след датата на влизане в сила на решението по отношение на съответната трета държава, прието в съответствие с член 13, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 648/2012 за целите на прилагането на член 4 от същия регламент, отнасящо се до договорите за извънборсови деривати, посочени в приложението към настоящия регламент,

ii) датата, на която задължението за клиринг поражда действие в съответствие с параграф 1.

Тази дерогация се прилага само когато контрагентите отговарят на следните условия:

а) установеният в трета държава контрагент е финансов контрагент или нефинансов контрагент;

б) установеният в Съюза контрагент е:

i) финансов контрагент, нефинансов контрагент, финансово холдингово дружество, финансова институция или предприятие за спомагателни услуги, подлежащо на подходящи пруденциални изисквания, а контрагентът, посочен в буква а), е финансов контрагент,

ii) финансов контрагент или нефинансов контрагент, а контрагентът, посочен в буква а), е нефинансов контрагент;

в) и двамата контрагенти са включени в една и съща пълна консолидация в съответствие с член 3, параграф 3 от Регламент (ЕС) № 648/2012;

г) по отношение на двамата контрагенти се прилагат подходящи централизирани процедури за оценка, измерване и контрол на риска;

д) контрагентът, установен в Съюза, е уведомил своя компетентен орган в писмена форма, че условията, определени в букви а), б), в) и г), са изпълнени, и в рамките на 30 календарни дни след получаване на уведомлението компетентният орган е потвърдил, че тези условия са изпълнени.

Член 4

Минимален остатъчен срок до падежа

1. За финансовите контрагенти от категория 1 минималният остатъчен срок до падежа, посочен в член 4, параграф 1, буква б), подточка ii) от Регламент (ЕС) № 648/2012, към датата, на която задължението за клиринг поражда действие, е:

а) 5 години и 3 месеца за договорите, сключени или подновени преди 9 октомври 2016 г., които принадлежат към класовете, посочени в таблицата от приложението;

▼C1

б) 6 месеца за договорите, сключени или подновени на 9 октомври 2016 г. или след тази дата, които принадлежат към класовете, посочени в таблицата от приложението.

▼B

2. За финансовите контрагенти от категория 2 минималният остатъчен срок до падежа, посочен в член 4, параграф 1, буква б), подточка ii) от Регламент (ЕС) № 648/2012, към датата, на която задължението за клиринг поражда действие, е:

▼B

а) 5 години и 3 месеца за договорите, сключени или подновени преди 9 октомври 2016 г., които принадлежат към класовете, посочени в таблицата от приложението;

▼C1

б) 6 месеца за договорите, сключени или подновени на 9 октомври 2016 г. или след тази дата, които принадлежат към класовете, посочени в таблицата от приложението.

▼B

3. За финансовите контрагенти от категория 3 и за сключените между финансови контрагенти трансакции, посочени в член 3, параграф 2 от настоящия регламент, минималният остатъчен срок до падежа, посочен в член 4, параграф 1, буква б), подточка ii) от Регламент (ЕС) № 648/2012, към датата, на която задължението за клиринг поражда действие, е 5 години и 3 месеца.

4. Когато договорът е сключен между двама финансови контрагенти, принадлежащи към различни категории, или между двама финансови контрагенти, участващи в трансакции, посочени в член 3, параграф 2, минималният остатъчен срок до падежа, който трябва да се вземе предвид за целите на настоящия член, е по-дългият остатъчен срок до падежа.

Член 5

Влизане в сила

Настоящият регламент влиза в сила на двадесетия ден след деня на публикуването му в *Официален вестник на Европейския съюз*.

Настоящият регламент е задължителен в своята цялост и се прилага пряко във всички държави членки.

▼B

ПРИЛОЖЕНИЕ

Класове извънборсови деривати за кредитно неизпълнение, които са предмет на задължението за клиринг

Класове неразделени на траншове европейски индексни суапове за кредитно неизпълнение

Идентификатор	Вид	Подвид	Географска зона	Референтен индекс	Валута на сетълмента	Серии	Срок до падежа
B.1.1	Индексни суапове за кредитно неизпълнение	Неразделени на траншове индексни деривати	Европа	iTraxx Europe Main	EUR	От 17 нататък	5Г
B.1.2	Индексни суапове за кредитно неизпълнение	Неразделени на траншове индексни деривати	Европа	iTraxx Europe Crossover	EUR	От 17 нататък	5Г