Šis tekstas yra skirtas tik informacijai ir teisinės galios neturi. Europos Sąjungos institucijos nėra teisiškai atsakingos už jo turinį. Autentiškos atitinkamų teisės aktų, įskaitant jų preambules, versijos skelbiamos Europos Sąjungos oficialiajame leidinyje ir pateikiamos svetainėje „EUR-Lex“. Oficialūs tekstai tiesiogiai prieinami naudojantis šiame dokumente pateikiamomis nuorodomis

►B

KOMISIJOS DELEGUOTASIS REGLAMENTAS (ES) Nr. 149/2013

2012 m. gruodžio 19 d.

kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 648/2012 papildomas nuostatomis dėl netiesioginės tarpuskaitos susitarimų, tarpuskaitos prievolės, viešo registro, galimybės naudotis prekybos vietos paslaugomis, ne finansų sandorio šalių ir ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių, kurių tarpuskaitos pagrindinė sandorio šalis neatlieka, rizikos mažinimo būdų techninių reguliavimo standartų

(Tekstas svarbus EEE)

(OL L 52, 2013 2 23, p. 11)

iš dalies keičiamas:

		Oficialusis leidinys		
		Nr.	puslapis	data
►M1	2017 m. rugsėjo 22 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2017/2155	L 304	13	2017 11 21

▼B

KOMISIJOS DELEGUOTASIS REGLAMENTAS (ES) Nr. 149/2013

2012 m. gruodžio 19 d.

kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 648/2012 papildomas nuostatomis dėl netiesioginės tarpuskaitos susitarimų, tarpuskaitos prievolės, viešo registro, galimybės naudotis prekybos vietos paslaugomis, ne finansų sandorio šalių ir ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių, kurių tarpuskaitos pagrindinė sandorio šalis neatlieka, rizikos mažinimo būdų techninių reguliavimo standartų

(Tekstas svarbus EEE)

I SKYRIUS

BENDROSIOS NUOSTATOS

1 straipsnis

Terminų apibrėžtys

Šiame reglamente vartojamų terminų apibrėžtys:

a) netiesioginis klientas – tarpuskaitos nario kliento klientas;

▼M1

b) netiesioginės tarpuskaitos susitarimai – netiesioginės tarpuskaitos paslaugų, kurias teikia klientas, netiesioginis klientas arba antros eilės netiesioginis klientas, teikėjų ir gavėjų tarpusavio sutartinių santykių visuma;

▼B

c) patvirtinimas – dokumentai, kuriais išreiškiamas sandorio šalių susitarimas dėl visų ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarties sąlygų;

▼M1

d) antros eilės netiesioginis klientas – netiesioginio kliento klientas;

e) trečios eilės netiesioginis klientas – antros eilės netiesioginio kliento klientas.

▼B

II SKYRIUS

NETIESIOGINĖS TARPUSKAITOS SUSITARIMAI

(Reglamento (ES) Nr. 648/2012 4 straipsnio 4 dalis)

▼M1

2 straipsnis

Reikalavimai klientų teikiamoms netiesioginės tarpuskaitos paslaugoms

1. Klientas netiesioginės tarpuskaitos paslaugas netiesioginiams klientams gali teikti tik jeigu laikomasi visų toliau nurodytų sąlygų:

▼M1

a) klientas yra leidimą gavusi kredito įstaiga arba investicinė įmonė, arba trečiojoje šalyje įsteigtas subjektas, kuris būtų laikomas kredito įstaiga arba investicine įmone, jeigu būtų įsteigtas Sąjungoje;

b) klientas teikia netiesioginės tarpuskaitos paslaugas pagrįstomis komercinėmis sąlygomis ir viešai atskleidžia bendrąsias sąlygas, kuriomis tas paslaugas teikia;

c) tarpuskaitos narys pritarė šios dalies b punkte nurodytoms bendrosioms sąlygoms.

2. 1 dalyje nurodytas klientas ir netiesioginis klientas raštu sudaro netiesioginės tarpuskaitos susitarimą. Į netiesioginės tarpuskaitos susitarimą įtraukiamos bent jau šios sutartinės sąlygos:

a) 1 dalies b punkte nurodytos bendrosios sąlygos;

b) kliento įsipareigojimas dėl sandorių, kuriuos apima netiesioginės tarpuskaitos susitarimas, vykdyti visas netiesioginio kliento pareigas tarpuskaitos nariui.

Visi netiesioginės tarpuskaitos susitarimo aspektai aiškiai dokumentuojami.

3. PSŠ nedraudžia sudaryti netiesioginės tarpuskaitos susitarimų, jeigu jie sudaromi pagrįstomis komercinėmis sąlygomis.

3 straipsnis

PSŠ pareigos

1. Pagal tarpuskaitos nario prašymą PSŠ atidaro ir tvarko bet kurią iš 4 straipsnio 4 dalyje nurodytų sąskaitų.

2. PSŠ, kuri sąskaitoje, kaip nurodyta 4 straipsnio 4 dalies b punkte, laiko kelių netiesioginių klientų turtą ir pozicijas, atskirai registruoja kiekvieno netiesioginio kliento pozicijų duomenis, apskaičiuoja kiekvieno netiesioginio kliento garantines įmokas ir surenka bendrą tų garantinių įmokų sumą remdamasi 4 straipsnio 3 dalyje nurodyta informacija.

3. PSŠ nustato, stebi ir valdo visą dėl netiesioginės tarpuskaitos paslaugų teikimo atsirandančią reikšmingą riziką, galinčią turėti poveikio PSŠ atsparumui nepalankiems rinkos pokyčiams.

4 straipsnis

Tarpuskaitos narių pareigos

1. Tarpuskaitos narys, kuris teikia netiesioginės tarpuskaitos paslaugas, jas teikia pagrįstomis komercinėmis sąlygomis ir viešai atskleidžia bendrąsias sąlygas, kuriomis tas paslaugas teikia.

▼M1

Į pirmoje pastraipoje nurodytas bendrąsias sąlygas įtraukiami minimalių finansinių išteklių ir veiklos pajėgumų reikalavimai klientams, kurie teikia netiesioginės tarpuskaitos paslaugas.

2. Tarpuskaitos narys, kuris teikia netiesioginės tarpuskaitos paslaugas, pagal kliento prašymą atidaro ir tvarko bent šias sąskaitas:

a) bendrąją sąskaitą su netiesioginių klientų vardu to kliento laikomu turtu ir pozicijomis;

b) bendrąją sąskaitą su netiesioginių klientų vardu to kliento laikomu turtu ir pozicijomis, kurioje tarpuskaitos narys užtikrina, kad vieno netiesioginio kliento pozicijos nekompensuotų kito netiesioginio kliento pozicijų ir kad netiesioginio kliento turtas negalėtų būti naudojamas kito netiesioginio kliento pozicijoms padengti.

3. Tarpuskaitos narys, kuris kelių netiesioginių klientų vardu laiko turtą ir pozicijas sąskaitoje, kaip nurodyta 2 dalies b punkte, PSŠ kiekvieną dieną teikia visą PSŠ būtiną informaciją, kad ji galėtų nustatyti kiekvieno netiesioginio klientu vardu turimas pozicijas. Ta informacija grindžiama 5 straipsnio 4 dalyje nurodyta informacija.

4. Tarpuskaitos narys, kuris teikia netiesioginės tarpuskaitos paslaugas, pagal kliento prašymą PSŠ sąskaitoje atidaro ir tvarko bent šias sąskaitas:

a) atskirą sąskaitą išskirtinai tarpuskaitos nario sąskaitoje, kaip nurodyta šio straipsnio 2 dalies a punkte, turimam netiesioginių klientų turtui ir pozicijoms laikyti;

b) atskirą sąskaitą išskirtinai tarpuskaitos nario sąskaitoje, kaip nurodyta šio straipsnio 2 dalies b punkte, turimam kiekvieno kliento netiesioginių klientų turtui ir pozicijoms laikyti.

5. Tarpuskaitos narys nustato procedūras, taikomas, kai klientas, teikiantis netiesioginės tarpuskaitos paslaugas, neįvykdo savo įsipareigojimų.

6. Tarpuskaitos narys, kuris netiesioginių klientų turtą ir pozicijas laiko sąskaitoje, kaip nurodyta 2 dalies a punkte:

a) užtikrina, kad, kai klientas neįvykdo įsipareigojimų, 5 dalyje nurodytos procedūros leistų greitai likviduoti tą turtą ir pozicijas, taip pat likviduoti tą turtą ir pozicijas PSŠ lygmeniu, ir įtraukia išsamią procedūrą, kaip netiesioginiams klientams pranešti apie tai, kad klientas neįvykdo įsipareigojimų, ir per kokį laikotarpį tikimasi likviduoti tų netiesioginių klientų turtą ir pozicijas;

▼M1

b) pasibaigus įsipareigojimų neįvykdymo valdymo įsipareigojimų neįvykdančio kliento vardu procesui, greitai tam klientui netiesioginių klientų vardu grąžina bet kokį iš to turto ir pozicijų likvidavimo priklausantį likutį.

7. Tarpuskaitos narys, kuris netiesioginių klientų turtą ir pozicijas laiko sąskaitoje, kaip nurodyta 2 dalies b punkte:

a) į 5 dalyje nurodytas procedūras įtraukia:

i) netiesioginių klientų vardu įsipareigojimų neįvykdančio kliento laikomo turto ir pozicijų perkėlimo kitam klientui arba tarpuskaitos nariui etapus;

ii) iš to netiesioginio kliento turto ir pozicijų likvidavimo gautų pajamų mokėjimo kiekvienam netiesioginiam klientui etapus;

iii) išsamią procedūrą, kaip netiesioginiams klientams pranešti apie tai, kad klientas neįvykdo įsipareigojimų, ir per kokį laikotarpį tikimasi likviduoti tų netiesioginių klientų turtą ir pozicijas;

b) pagal sutartį įsipareigoja pradėti netiesioginių klientų vardu įsipareigojimų neįvykdančio kliento laikomo turto ir pozicijų perkėlimo kitam klientui arba tarpuskaitos nariui, kurį paskyrė atitinkami įsipareigojimų neįvykdančio kliento netiesioginiai klientai, procedūrą pagal tų netiesioginių klientų prašymą ir negavus įsipareigojimų neįvykdančio kliento pritarimo. Tas kitas klientas arba tarpuskaitos narys įpareigojami priimti tą turtą ir pozicijas tik tuo atveju, jeigu tas kitas klientas arba tarpuskaitos narys yra anksčiau užmezgę sutartinius santykius su tais netiesioginiais klientais, įsipareigodami tai daryti;

c) užtikrina, kad, jeigu klientas neįvykdo įsipareigojimų, 5 dalyje nurodytos procedūros leistų greitai likviduoti tą turtą ir pozicijas, taip pat likviduoti tą turtą ir pozicijas PSŠ lygmeniu, jeigu b punkte nurodytas perkėlimas neįvyksta dėl bet kokios priežasties per netiesioginės tarpuskaitos susitarime iš anksto apibrėžtą perkėlimo laikotarpį;

d) po to turto ir pozicijų likvidavimo sutartimi įsipareigoja pradėti iš likvidavimo gautų pajamų mokėjimo kiekvienam iš netiesioginių klientų procedūras;

e) jeigu tarpuskaitos nariui nepavyko nustatyti netiesioginių klientų arba užbaigti d punkte nurodyto iš likvidavimo gautų pajamų mokėjimo kiekvienam iš netiesioginių klientų, greitai klientui netiesioginių klientų vardu grąžina bet kokį iš to turto ir pozicijų likvidavimo priklausantį likutį.

▼M1

8. Tarpuskaitos narys nustato, stebi ir valdo visą dėl teikiamų netiesioginės tarpuskaitos paslaugų atsirandančią reikšmingą riziką, galinčią turėti poveikio jo atsparumui nepalankiems rinkos pokyčiams. Tarpuskaitos narys nustato vidaus procedūras, kuriomis užkertamas kelias 5 straipsnio 8 dalyje nurodytą informaciją panaudoti komerciniais tikslais.

5 straipsnis

Klientų pareigos

1. Klientas, kuris teikia, netiesioginės tarpuskaitos paslaugas, netiesioginiams klientams siūlo pasirinkti bent iš 4 straipsnio 2 dalyje nurodytų tipų sąskaitų ir užtikrina, kad tie netiesioginiai klientai būtų visiškai informuoti apie skirtingus atskyrimo lygius ir riziką, susijusią su kiekvieno tipo sąskaita.

2. 1 dalyje nurodytas klientas vieną iš 4 straipsnio 2 dalyje nurodytų tipų sąskaitų skiria per pagrįstą kliento nustatytą laikotarpį sąskaitos nepasirinkusiems netiesioginiams klientams. Klientas netiesioginiam klientui nedelsdamas praneša apie riziką, siejamą su skirto tipo sąskaita. Netiesioginis klientas gali pasirinkti kitokio tipo sąskaitą bet kuriuo metu to kliento paprašydamas raštu.

3. Klientas, teikiantis netiesioginės tarpuskaitos paslaugas, atskirai registruoja duomenis ir tvarko apskaitą, kad galėtų atskirti savo turtą ir pozicijas nuo savo netiesioginių klientų vardu laikomo turto ir pozicijų.

4. Jeigu tarpuskaitos narys kelių netiesioginių klientų vardu laiko turtą ir pozicijas sąskaitoje, kaip nurodyta 4 straipsnio 2 dalies b punkte, klientas tarpuskaitos nariui kiekvieną dieną teikia visą būtiną informaciją, kad tarpuskaitos narys galėtų nustatyti kiekvieno netiesioginio klientu vardu laikomas pozicijas.

5. Klientas, kuris teikia netiesioginės tarpuskaitos paslaugas pagal savo netiesioginių klientų pasirinkimą tarpuskaitos nario prašo PSŠ sąskaitoje atidaryti ir tvarkyti sąskaitas, nurodytas 4 straipsnio 4 dalyje.

6. Klientas savo netiesioginiams klientams teikia pakankamą informaciją, kad tie netiesioginiai klientai galėtų nustatyti PSŠ ir jų pozicijų tarpuskaitai naudojamą tarpuskaitos narį.

7. Jeigu tarpuskaitos narys vieno arba kelių netiesioginių klientų turtą ir pozicijas laiko sąskaitoje, kaip nurodyta 4 straipsnio 2 dalies b punkte, klientas į netiesioginės tarpuskaitos susitarimą su savo netiesioginiais klientais įtraukia visas reikiamas sąlygas, siekdamas užtikrinti, kad, jeigu tas klientas neįvykdo įsipareigojimų, tarpuskaitos narys galėtų greitai netiesioginiams klientams grąžinti pajamas, gautas iš netiesioginių klientų vardu laikomo turto ir pozicijų likvidavimo pagal 4 straipsnio 7 dalį.

8. Klientas tarpuskaitos nariui suteikia pakankamai informacijos nustatyti, stebėti ir valdyti visą dėl teikiamų netiesioginės tarpuskaitos paslaugų atsirandančią reikšmingą riziką, galinčią turėti poveikio tarpuskaitos nario atsparumui.

▼M1

9. Klientas sudaro susitarimus siekdamas užtikrinti, kad jam nevykdant įsipareigojimų, tarpuskaitos narys galėtų iš karto pasinaudoti visa jo turima informacija apie jo netiesioginius klientus, įskaitant netiesioginių klientų, nurodytų 5 straipsnio 4 dalyje, tapatybę.

5a straipsnis

Reikalavimai netiesioginių klientų teikiamoms netiesioginės tarpuskaitos paslaugoms

1. Netiesioginis klientas netiesioginės tarpuskaitos paslaugas antros eilės netiesioginiams klientams gali teikti tik jeigu netiesioginės tarpuskaitos susitarimų šalys laikosi vieno iš 2 dalyje nustatytų reikalavimų ir jeigu laikomasi visų toliau nurodytų sąlygų:

a) netiesioginis klientas yra leidimą gavusi kredito įstaiga arba investicinė įmonė, arba trečiojoje šalyje įsteigtas subjektas, kuris būtų laikomas kredito įstaiga arba investicine įmone, jeigu būtų įsteigtas Sąjungoje;

b) netiesioginis klientas ir antros eilės netiesioginis klientas raštu sudaro netiesioginės tarpuskaitos susitarimą. Į netiesioginės tarpuskaitos susitarimą įtraukiamos bent jau šios sutartinės sąlygos:

   i) 2 straipsnio 1 dalies b punkte nurodytos bendrosios sąlygos;

   ii) netiesioginio kliento įsipareigojimas dėl sandorių, kuriuos apima netiesioginės tarpuskaitos susitarimas, vykdyti visas antros eilės netiesioginio kliento pareigas klientui;

c) tarpuskaitos narys antros eilės netiesioginio kliento turtą ir pozicijas laiko sąskaitoje, kaip nurodyta 4 straipsnio 2 dalies a punkte.

Visi netiesioginės tarpuskaitos susitarimo aspektai, nurodyti b punkte, aiškiai dokumentuojami.

2. Laikydamosi 1 dalies, netiesioginės tarpuskaitos susitarimų šalys laikosi vieno iš šių reikalavimų:

a) tarpuskaitos narys ir klientas priklauso tai pačiai grupei, o netiesioginis klientas tai grupei nepriklauso;

b) klientas ir netiesioginis klientas priklauso tai pačiai grupei, bet nei tarpuskaitos narys, nei antros eilės netiesioginis klientas tai grupei nepriklauso.

3. Pagal šalių sudarytus netiesioginės tarpuskaitos susitarimus esant 2 straipsnio a punkte nurodytai situacijai:

a) klientui taikoma 4 straipsnio 1 dalis, 4 straipsnio 5 dalis, 4 straipsnio 6 dalis ir 4 straipsnio 8 dalis, tarsi klientas būtų tarpuskaitos narys;

b) netiesioginiam klientui taikomas 2 straipsnio 1 dalies b punktas, 5 straipsnio 2 dalis, 5 straipsnio 3 dalis, 5 straipsnio 6 dalis, 5 straipsnio 8 dalis ir 5 straipsnio 9 dalis, tarsi tas netiesioginis klientas būtų klientas.

▼M1

4. Pagal šalių sudarytus netiesioginės tarpuskaitos susitarimus esant 2 straipsnio b punkte nurodytai situacijai:

a) klientui taikoma 4 straipsnio 5 dalis ir 4 straipsnio 6 dalis, tarsi tas klientas būtų tarpuskaitos narys;

b) netiesioginiam klientui taikomas 2 straipsnio 1 dalies b punktas, 5 straipsnio 2 dalis, 5 straipsnio 3 dalis, 5 straipsnio 6 dalis, 5 straipsnio 8 dalis ir 5 straipsnio 9 dalis, tarsi tas netiesioginis klientas būtų klientas.

5b straipsnis

Reikalavimai antros eilės netiesioginių klientų teikiamoms netiesioginės tarpuskaitos paslaugoms

1. Antros eilės netiesioginis klientas netiesioginės tarpuskaitos paslaugas trečios eilės netiesioginiams klientams gali teikti tik jeigu laikomasi visų toliau nurodytų sąlygų:

a) netiesioginis klientas ir antros eilės netiesioginis klientas yra leidimą gavusios kredito įstaigos arba investicinės įmonės, arba trečiojoje šalyje įsteigti subjektai, kurie būtų laikomi kredito įstaiga arba investicine įmone, jeigu tas subjektas būtų įsteigtas Sąjungoje;

b) tarpuskaitos narys ir klientas priklauso tai pačiai grupei, o netiesioginis klientas tai grupei nepriklauso;

c) netiesioginis klientas ir antros eilės netiesioginis klientas priklauso tai pačiai grupei, bet trečios eilės netiesioginis klientas tai grupei nepriklauso;

d) antros eilės netiesioginis klientas ir trečios eilės netiesioginis klientas raštu sudaro netiesioginės tarpuskaitos susitarimą. Į netiesioginės tarpuskaitos susitarimą įtraukiamos bent jau šios sutartinės sąlygos:

   i) 2 straipsnio 1 dalies b punkte nurodytos bendrosios sąlygos;

   ii) antros eilės netiesioginio kliento įsipareigojimas dėl sandorių, kuriuos apima netiesioginės tarpuskaitos susitarimas, vykdyti visas trečios eilės netiesioginio kliento pareigas netiesioginiam klientui;

e) tarpuskaitos narys trečios eilės netiesioginio kliento turtą ir pozicijas laiko sąskaitoje, kaip nurodyta 4 straipsnio 2 dalies a punkte.

Visi netiesioginės tarpuskaitos susitarimo aspektai, nurodyti pirmos pastraipos d punkte, aiškiai dokumentuojami.

2. Jeigu antros eilės netiesioginiai klientai teikia netiesioginės tarpuskaitos paslaugas pagal 1 dalį:

a) ir klientui, ir netiesioginiam klientui taikoma 4 straipsnio 1 dalis, 4 straipsnio 5 dalis, 4 straipsnio 6 dalis ir 4 straipsnio 8 dalis, tarsi jie būtų tarpuskaitos nariai;

b) ir netiesioginiam klientui, ir antros eilės netiesioginiam klientui taikomas 2 straipsnio 1 dalies b punktas, 5 straipsnio 2 dalis, 5 straipsnio 3 dalis, 5 straipsnio 6 dalis, 5 straipsnio 8 dalis ir 5 straipsnio 9 dalis, tarsi jie būtų klientai.

▼B

III SKYRIUS

EVPRI SKIRTAS PRANEŠIMAS DĖL TARPUSKAITOS PRIEVOLĖS

(Reglamento (ES) Nr. 648/2012 5 straipsnio 1 dalis)

6 straipsnis

Pranešime pateiktini duomenys

1. Pranešime dėl tarpuskaitos prievolės pateikiama tokia informacija:

a) ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių klasės identifikavimas;

b) ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių identifikavimas ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių klasėje;

c) kita informacija, pateiktina viešame registre pagal 8 straipsnį;

d) visos papildomos savybės, pagal kurias ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutartys ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių klasėje atskiriamos nuo tai klasei nepriklausančių ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių;

e) atitinkamos klasės ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių sutartinių sąlygų ir veiklos procesų standartizacijos lygio įrodymai;

f) ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių klasės kiekio duomenys;

g) ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių klasės likvidumo duomenys;

h) įrodymai, kad rinkos dalyviai turi galimybę gauti teisingos, patikimos ir visuotinai pripažįstamos atitinkamos klasės ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių kainodaros informacijos;

i) tarpuskaitos prievolės poveikio rinkos dalyvių galimybei gauti kainodaros informacijos įrodymai.

2. Siekiant sudaryti sąlygas įvertinti tarpuskaitos prievolės įsigaliojimo datą ar datas, įskaitant laipsnišką jos taikymą ir sandorio šalių, kurioms ji taikoma, kategorijas, pranešime dėl tarpuskaitos prievolės pateikiama tokia informacija:

a) duomenys, leidžiantys įvertinti ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių klasės numatomą kiekį, jei šiai klasei bus pradėta taikyti tarpuskaitos prievolė;

b) įrodymai, kad pagrindinė sandorio šalis gali tvarkyti ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių klasės numatomą kiekį, jei šiai klasei bus pradėta taikyti tarpuskaitos prievolė, ir valdyti riziką, atsirandančią atliekant atitinkamos klasės ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių tarpuskaitą, įskaitant riziką dėl kliento arba netiesioginio kliento tarpuskaitos susitarimų;

▼B

c) sandorio šalių, kurios veikia ir kurios, kaip numatoma, veiks atitinkamos klasės ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių rinkoje, jei šiai klasei bus pradėta taikyti tarpuskaitos prievolė, rūšis ir skaičius;

d) įvairių užduočių, kurias reikia įvykdyti siekiant pradėti tarpuskaitą su pagrindine sandorio šalimi, aprašymas, nustatant kiekvienos užduoties įvykdymo laiką;

e) informacija apie atitinkamos klasės ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių rinkoje veikiančių įvairių sandorio šalių rizikos valdymo, teisinius ir veiklos pajėgumus, jei šiai klasei bus pradėta taikyti tarpuskaitos prievolė.

3. Apie kiekį ir likvidumą teikiami duomenys apima atitinkamos klasės ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių ir tos klasės kiekvienos išvestinių finansinių priemonių sutarties atitinkamą rinkos informaciją, įskaitant praeities duomenis, dabartinius duomenis ir duomenis apie visus pokyčius, numatomus tuo atveju, jei šiai ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių klasei bus pradėta taikyti tarpuskaitos prievolė, įskaitant:

a) sandorių skaičių;

b) bendrą kiekį;

c) bendrą atvirų pozicijų skaičių;

d) atvirų užsakymų lygį, įskaitant vidutinį užsakymų skaičių ir vidutinį prašymų pateikti kainą skaičių;

e) kainų skirtumo dydį;

f) likvidumo priemones, taikomas nepalankiomis rinkos sąlygomis;

g) likvidumo priemones, taikomas vykdant įsipareigojimų neįvykdymo procedūras.

4. 1 dalies e punkte nurodyta informacija, susijusi su atitinkamos klasės ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių sutartinių sąlygų ir veiklos procesų standartizacijos lygiu, apima atitinkamos klasės ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių ir tos klasės kiekvienos sutarties duomenis apie bent paskutinių dvylikos mėnesių dienos orientacinę kainą ir dienų, kurių orientacinė kaina laikoma patikima, skaičių per metus.

IV SKYRIUS

KRITERIJAI, KURIAIS VADOVAUJANTIS NUSTATOMOS NE BIRŽOS IŠVESTINIŲ FINANSINIŲ PRIEMONIŲ SUTARČIŲ KLASĖS, KURIOMS TAIKOMA TARPUSKAITOS PRIEVOLĖ

(Reglamento (ES) Nr. 648/2012 5 straipsnio 4 dalis)

7 straipsnis

EVPRI vertintini kriterijai

1. Vertindama atitinkamos klasės ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių sutartinių sąlygų ir veiklos procesų standartizacijos lygį, Europos vertybinių popierių ir rinkų institucija atsižvelgia į tai, ar:

▼B

a) į atitinkamos klasės ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių sutartines sąlygas įtraukti bendrieji teisės dokumentai, įskaitant pagrindinius užskaitos susitarimus, apibrėžtis, standartines sąlygas ir patvirtinimus, kuriais numatomos paprastai sandorio šalių naudojamos sutarties specifikacijos;

b) tos atitinkamos klasės ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių veiklos procesams taikomas automatinis apdorojimas po sandorio sudarymo ir gyvavimo ciklo įvykiai, kurie vienodai valdomi pagal sandorio šalių iš esmės suderintą tvarkaraštį.

2. Vertindama atitinkamos klasės ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių kiekį ir likvidumą, EVPRI atsižvelgia į:

a) tai, ar pagrindinės sandorio šalies garantinės įmokos arba finansiniai reikalavimai būtų proporcingi rizikai, kurią ketinama sumažinti taikant tarpuskaitos prievolę;

b) produkto rinkos dydžio ir gylio stabilumą bėgant laikui;

c) tikimybę, kad tarpuskaitos nario įsipareigojimų neįvykdymo atveju rinkos sklaida išliks pakankama;

d) sandorių skaičių ir vertę.

3. Vertindama galimybę gauti teisingą, patikimą ir visuotinai pripažįstamą atitinkamos ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių klasės kainodaros informaciją, EVPRI atsižvelgia į tai, ar rinkos dalyviams pagrįstomis komercinėmis sąlygomis lengva gauti informacijos, reikalingos sutarčių, priklausančių atitinkamai ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių klasei, tiksliai kainai nustatyti, ir ar toliau bus paprasta šios informacijos gauti, jei atitinkamai ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių klasei bus pradėta taikyti tarpuskaitos prievolė.

V SKYRIUS

VIEŠAS REGISTRAS

(Reglamento (ES) Nr. 648/2012 6 straipsnio 4 dalis)

8 straipsnis

EVPRI registrui pateiktini duomenys

1. EVPRI viešame registre apie kiekvieną ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių klasę, kuriai taikoma tarpuskaitos prievolė, pateikiami tokie duomenys:

a) ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių turto klasė;

b) ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių, priklausančių klasei, rūšis;

c) klasei priklausančių ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių pagrindinės priemonės;

▼B

d) jei pagrindinės priemonės yra finansinės priemonės, nurodoma, ar pagrindinė priemonė yra vienintelė finansinė priemonė, emitentas, indeksas ar portfelis;

e) kitokių pagrindinių priemonių atveju nurodoma pagrindinės priemonės kategorija;

f) klasei priklausančių ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių nominaliosios ir atsiskaitymo valiutos;

g) klasei priklausančių ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių terminų intervalas;

h) klasei priklausančių ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių atsiskaitymo sąlygos;

i) klasei priklausančių ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių mokėjimo periodiškumo intervalas;

j) atitinkamos klasės ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių produktų identifikatorius;

k) visos kitos savybės, pagal kurias ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių atitinkamoje klasėje vieną sutartį galima atskirti nuo kitos.

2. Apie kiekvieną pagrindinę sandorio šalį, kuriai suteiktas leidimas arba kuri pripažinta vykdyti tarpuskaitos prievolę, EVPRI viešame registre pateikiami tokie duomenys:

a) identifikacinis kodas pagal Komisijos įgyvendinimo reglamento (ES) Nr. 1247/2012 ([1]) 3 straipsnį;

b) visas pavadinimas;

c) įsisteigimo valstybė;

d) pagal Reglamento (ES) Nr. 648/2012 22 straipsnį paskirta kompetentinga institucija.

3. Apie tarpuskaitos prievolės įsigaliojimo datas, įskaitant laipsnišką jos įgyvendinimą, EVPRI viešame registre pateikiama tokia informacija:

a) nurodomos sandorio šalių, kurioms prievolė pradedama įgyvendinti laipsniškai, kategorijos;

b) nurodomos visos kitos laipsniško prievolės įgyvendinimo sąlygos, būtinos pagal techninius reguliavimo standartus, priimtus pagal Reglamento (ES) Nr. 648/2012 5 straipsnio 2 dalį.

4. EVPRI viešame registre pateikiama nuoroda į techninius reguliavimo standartus, priimtus pagal Reglamento (ES) Nr. 648/2012 5 straipsnio 2 dalį, pagal kuriuos nustatyta kiekviena tarpuskaitos prievolė.

5. Apie pagrindinę sandorio šalį, apie kurią kompetentinga institucija pranešė EVPRI, EVPRI viešame registre pateikiama bent tokia informacija:

([1]) OL L 352, 2012 12 21, p. 20.

▼B

a) pagrindinės sandorio šalies tapatybė;

b) ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių, apie kurias pranešta, turto klasė;

c) ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių rūšis;

d) pranešimo data;

e) pranešimą pateikusios kompetentingos institucijos tapatybė.

VI SKYRIUS

LIKVIDUMO SUSISKAIDYMAS

(Reglamento (ES) Nr. 648/2012 8 straipsnio 5 dalis)

9 straipsnis

Likvidumo susiskaidymo sąvokos patikslinimas

1. Likvidumo susiskaidymu laikoma situacija, kai prekybos vietos dalyviai negali sudaryti sandorio su vienu ar daugiau kitų tos prekybos vietos dalyvių, nes neegzistuoja tarpuskaitos susitarimai, kuriais visi dalyviai galėtų naudotis.

2. Atvejis, kai pagrindinė sandorio šalis naudojasi prekybos vieta, kurią jau aptarnauja kita pagrindinė sandorio šalis, nelaikomas sukeliančiu tos prekybos vietos likvidumo susiskaidymą, jeigu, neįpareigojant pirminės pagrindinės sandorio šalies tarpuskaitos narių tapti prašymą teikiančios pagrindinės sandorio šalies tarpuskaitos nariais, visi tos prekybos vietos dalyviai gali atlikti tarpuskaitą tiesiogiai arba netiesiogiai vienu iš šių būdų:

a) per bent vieną bendrą pagrindinę sandorio šalį;

b) pagal pagrindinių sandorio šalių nustatytus tarpuskaitos susitarimus.

3. Susitarimai dėl 2 dalies a arba b punkte nurodytų sąlygų vykdymo nustatomi iki tol, kol prašymą teikianti pagrindinė sandorio šalis pradeda teikti tarpuskaitos paslaugas atitinkamai prekybos vietai.

4. Galimybė naudotis bendra pagrindine sandorio šalimi, kaip nurodyta 2 dalies a punkte, gali būti nustatyta per du ar daugiau tarpuskaitos narių, du ar daugiau klientų arba per netiesioginės tarpuskaitos susitarimus.

5. 2 dalies b punkte nurodytuose tarpuskaitos susitarimuose gali būti numatytas sandorių, kuriuos vykdo tokie rinkos dalyviai, perdavimas kitų pagrindinių sandorio šalių tarpuskaitos nariams. Nors pagrindinės sandorio šalies galimybei naudotis prekybos vieta užtikrinti sąveika neturėtų būti reikalinga, siekiant vykdyti reikalavimą dėl galimybės naudotis bendrais tarpuskaitos susitarimais galima pasinaudoti sąveikos susitarimu, kurį suderino atitinkamos pagrindinės sandorio šalys ir patvirtino atitinkamos kompetentingos institucijos.

▼B

VII SKYRIUS

NE FINANSŲ SANDORIO ŠALYS

10 straipsnis

(Reglamento (ES) Nr. 648/2012 10 straipsnio 4 dalies a punktas)

Kriterijai, taikomi nustatant, kuriomis ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutartimis objektyviai mažinama rizika

1. Ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutartis objektyviai vertinama kaip mažinanti tiesiogiai su ne finansų sandorio šalies arba jos grupės komercine veikla ar iždo finansavimo veikla susijusią riziką, kai pati viena arba kartu su kitomis išvestinių finansinių priemonių sutartimis tiesiogiai arba per glaudžiai susijusias priemones ji atitinka vieną iš šių kriterijų:

a) ja draudžiama rizika, atsirandanti dėl turto, paslaugų, sąnaudų, produktų, prekių ar įsipareigojimų, kuriuos ne finansų sandorio šalis arba jos grupė turi, kuria, gamina, tvarko, teikia, perka, teikia rinkai, nuomoja, parduoda ar įgyja arba pagrįstai numato turėti, kurti, gaminti, tvarkyti, teikti, pirkti, teikti rinkai, nuomoti, parduoti ar įgyti vykdydama savo įprastinę ūkinę veiklą, galimo vertės pokyčio;

b) ja draudžiama rizika, atsirandanti dėl galimo netiesioginio palūkanų normų, infliacijos, valiutų keitimo kursų ar kredito rizikos svyravimo poveikio a punkte nurodyto turto, paslaugų, sąnaudų, produktų, prekių ar įsipareigojimų vertei;

c) ji laikoma rizikos draudimo sutartimi pagal tarptautinius finansinės atskaitomybės standartus (TFAS), priimtus pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (EB) Nr. 1606/2002 ([1]) 3 straipsnį.

11 straipsnis

(Reglamento (ES) Nr. 648/2012 10 straipsnio 4 dalies b punktas)

Tarpuskaitos ribos

Vykdant tarpuskaitos prievolę tarpuskaitos ribų vertės yra:

a) ne biržos kredito išvestinių finansinių priemonių sutarčių atveju – 1 mlrd. EUR bendros sąlyginės vertės;

b) ne biržos akcijų išvestinių finansinių priemonių sutarčių atveju – 1 mlrd. EUR bendros sąlyginės vertės;

c) ne biržos palūkanų normų išvestinių finansinių priemonių sutarčių atveju – 3 mlrd. EUR bendros sąlyginės vertės;

([1]) OL L 243, 2002 9 11, p. 1.

▼B

d) ne biržos valiutų išvestinių finansinių priemonių sutarčių atveju – 3 mlrd. EUR bendros sąlyginės vertės;

e) ne biržos prekių išvestinių finansinių priemonių sutarčių ir kitų a–d punktuose nenurodytų ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių atveju – 3 mlrd. EUR bendros sąlyginės vertės.

VIII SKYRIUS

NE BIRŽOS IŠVESTINIŲ FINANSINIŲ PRIEMONIŲ SUTARČIŲ, KURIŲ TARPUSKAITOS PAGRINDINĖ SANDORIO ŠALIS NEATLIEKA, RIZIKOS MAŽINIMO BŪDAI

12 straipsnis

(Reglamento (ES) Nr. 648/2012 11 straipsnio 14 dalies a punktas)

Patvirtinimas laiku

1. Ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutartis, kurią sudarė finansų sandorio šalys arba Reglamento (ES) Nr. 648/2012 10 straipsnyje nurodytos ne finansų sandorio šalys ir kurios tarpuskaitos pagrindinė sandorio šalis neatlieka, yra kuo greičiau patvirtinama, kai įmanoma, elektroninėmis priemonėmis ne vėliau kaip iki:

a) antros darbo dienos pabaigos po ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarties įvykdymo datos tais atvejais, kai tai yra kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriai ir palūkanų normų apsikeitimo sandoriai, sudaryti iki 2014 m. vasario 28 d. imtinai;

b) darbo dienos pabaigos po ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarties įvykdymo datos tais atvejais, kai tai yra kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriai ir palūkanų normų apsikeitimo sandoriai, sudaryti po 2014 m. vasario 28 d.;

c) trečios darbo dienos pabaigos po išvestinių finansinių priemonių sutarties įvykdymo datos tais atvejais, kai tai yra akcijų apsikeitimo sandoriai, valiutų apsikeitimo sandoriai, biržos prekių apsikeitimo sandoriai ir visos kitos a punkte nenumatytos išvestinės finansinės priemonės, sudaryti iki 2013 m. rugpjūčio 31 d. imtinai;

d) antros darbo dienos pabaigos po išvestinių finansinių priemonių sutarties įvykdymo datos tais atvejais, kai tai yra akcijų apsikeitimo sandoriai, valiutų apsikeitimo sandoriai, biržos prekių apsikeitimo sandoriai ir visos kitos a punkte nenumatytos išvestinės finansinės priemonės, sudaryti po 2013 m. rugpjūčio 31 d., bet iki 2014 m. rugpjūčio 31 d. imtinai;

e) darbo dienos pabaigos po išvestinių finansinių priemonių sutarties įvykdymo datos tais atvejais, kai tai yra akcijų apsikeitimo sandoriai, valiutų apsikeitimo sandoriai, biržos prekių apsikeitimo sandoriai ir visos kitos a punkte nenumatytos išvestinės finansinės priemonės, sudaryti po 2014 m. rugpjūčio 31 d.

▼B

2. Ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutartis, sudaryta su Reglamento (ES) Nr. 648/2012 10 straipsnyje nenurodyta ne finansų sandorio šalimi, yra kuo greičiau patvirtinama, kai įmanoma, elektroninėmis priemonėmis ne vėliau kaip iki:

a) penktos darbo dienos pabaigos po ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarties įvykdymo datos tais atvejais, kai tai yra kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriai ir palūkanų normų apsikeitimo sandoriai, sudaryti iki 2013 m. rugpjūčio 31 d. imtinai;

b) trečios darbo dienos pabaigos po ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarties įvykdymo datos tais atvejais, kai tai yra kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriai ir palūkanų normų apsikeitimo sandoriai, sudaryti po 2013 m. rugpjūčio 31 d., bet iki 2014 m. rugpjūčio 31 d. imtinai;

c) antros darbo dienos pabaigos po ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarties įvykdymo datos tais atvejais, kai tai yra kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriai ir palūkanų normų apsikeitimo sandoriai, sudaryti po 2014 m. rugpjūčio 31 d.;

d) septintos darbo dienos pabaigos po išvestinių finansinių priemonių sutarties įvykdymo datos tais atvejais, kai tai yra akcijų apsikeitimo sandoriai, valiutų apsikeitimo sandoriai, biržos prekių apsikeitimo sandoriai ir visos kitos a punkte nenumatytos išvestinės finansinės priemonės, sudaryti iki 2013 m. rugpjūčio 31 d. imtinai;

e) ketvirtos darbo dienos pabaigos po išvestinių finansinių priemonių sutarties įvykdymo datos tais atvejais, kai tai yra akcijų apsikeitimo sandoriai, valiutų apsikeitimo sandoriai, biržos prekių apsikeitimo sandoriai ir visos kitos a punkte nenumatytos išvestinės finansinės priemonės, sudarytos po 2013 m. rugpjūčio 31 d., bet iki 2014 m. rugpjūčio 31 d. imtinai;

f) antros darbo dienos pabaigos po įvykdymo datos tais atvejais, kai tai yra akcijų apsikeitimo sandoriai, valiutų apsikeitimo sandoriai, biržos prekių apsikeitimo sandoriai ir visos kitos a punkte nenumatytos išvestinės finansinės priemonės, sudaryti po 2014 m. rugpjūčio 31 d.

3. Kai 1 arba 2 dalyje nurodytas sandoris sudaromas po 16.00 val. vietos laiku arba kai viena sandorio šalis yra kitoje laiko zonoje ir dėl to negali pateikti patvirtinimo iki nurodyto termino, patvirtinimas pateikiamas kuo skubiau, bet ne vėliau kaip praėjus vienai darbo dienai po atitinkamai 1 arba 2 dalyje nustatyto termino.

4. Finansų sandorio šalys nustato reikiamą procedūrą, pagal kurią vieną kartą per mėnesį kompetentingai institucijai, paskirtai pagal Europos Parlamento ir Tarybos direktyvos 2004/39/EB ([1]) 48 straipsnį, teikiama ataskaita, kurioje nurodoma, kiek yra nepatvirtintų 1 ir 2 dalyse nurodytų ne biržos išvestinių finansinių priemonių sandorių, kurių patvirtinimas vėluoja daugiau nei penkias darbo dienas.

([1]) OL L 145, 2004 4 30, p. 1.

▼B

13 straipsnis

(Reglamento (ES) Nr. 648/2012 11 straipsnio 14 dalies a punktas)

Portfelių suderinimas

1. Ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarties finansų sandorio šalys ir ne finansų sandorio šalys raštu arba kitu lygiaverčiu elektroniniu būdu susitaria su kiekviena sandorio šalimi dėl susitarimų, pagal kuriuos suderinami portfeliai. Dėl to susitariama iki sudarant ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutartį.

2. Portfelių suderinimą vykdo ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių sandorio šalys viena su kita arba kompetentinga trečioji šalis, kurią deramai šiam tikslui įgaliojo sandorio šalis. Portfelių suderinimas apima pagrindines prekybos sąlygas, būdingas kiekvienai konkrečiai ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčiai, ir bent kiekvienos sutarties vertės įvertinimą pagal Reglamento (ES) Nr. 648/2012 11 straipsnio 2 dalį.

3. Siekiant kuo anksčiau nustatyti visus ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarties, įskaitant jos įvertinimą, esminių sąlygų neatitikimus, portfelių suderinimas atliekamas:

a) kai sandorį sudaro finansų sandorio šalis arba Reglamento (ES) Nr. 648/2012 10 straipsnyje nurodyta ne finansų sandorio šalis:

   i) kiekvieną darbo dieną, kai sandorio šalys turi 500 arba daugiau neužbaigtų tarpusavio ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių;

   ii) vieną kartą per savaitę, kai sandorio šalys bet kuriuo savaitės metu turi nuo 51 iki 499 neužbaigtų tarpusavio ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių;

   iii) vieną kartą per ketvirtį, kai sandorio šalys bet kuriuo ketvirčio metu turi 50 arba mažiau neužbaigtų tarpusavio ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių;

b) kai sandorį sudaro Reglamento (ES) Nr. 648/2012 10 straipsnyje nenurodyta ne finansų sandorio šalis:

   i) vieną kartą per ketvirtį, kai sandorio šalys bet kuriuo ketvirčio metu turi daugiau nei 100 neužbaigtų tarpusavio ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių;

   ii) vieną kartą per metus, kai sandorio šalys turi 100 arba mažiau neužbaigtų tarpusavio ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių.

▼B

14 straipsnis

(Reglamento (ES) Nr. 648/2012 11 straipsnio 14 dalies a punktas)

Portfelių sumažinimas

Finansų sandorio šalys ir ne finansų sandorio šalys, turinčios su sandorio šalimi 500 ar daugiau neužbaigtų ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių, kurių tarpuskaita centralizuotai neatliekama, nustato procedūras, pagal kurias reguliariai, ne rečiau kaip du kartus per metus, nagrinėja galimybę pasinaudoti portfelių sumažinimu, kad sumažintų savo sandorio šalies kredito riziką, ir tokį portfelių sumažinimą įvykdo.

Finansų sandorio šalys ir ne finansų sandorio šalys užtikrina, kad yra pajėgios atitinkamai kompetentingai institucijai pateikti pagrįstą ir svarų paaiškinimą, kai nusprendžia, jog portfelių sumažinimas yra netikslingas.

15 straipsnis

(Reglamento (ES) Nr. 648/2012 11 straipsnio 14 dalies a punktas)

Ginčų sprendimas

1. Sudarydamos ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutartis viena su kita finansų sandorio šalys ir ne finansų sandorio šalys susitaria dėl išsamių procedūrų ir procesų šiose srityse:

a) ginčų, susijusių su sutarties pripažinimu arba įvertinimu bei sandorio šalių apsikeitimu įkaitais, nustatymas, registravimas ir stebėjimas. Pagal šias procedūras registruojamas bent laikotarpis, kurį neišspręstas ginčas tęsiasi, sandorio šalis ir ginčijama suma;

b) ginčų sprendimas laiku, pagal specialų procesą sprendžiant tuos ginčus, kurie neišspręsti per penkias darbo dienas.

2. Finansų sandorio šalys praneša kompetentingai institucijai, paskirtai pagal Direktyvos 2004/39/EB 48 straipsnį, apie visus sandorio šalių ginčus, susijusius su ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutartimi, jos įvertinimu arba apsikeitimu įkaitais, kurių suma arba vertė viršija 15 mln. EUR ir kurie neišspręsti per bent 15 darbo dienų.

16 straipsnis

(Reglamento (ES) Nr. 648/2012 11 straipsnio 14 dalies b punktas)

Rinkos sąlygos, trukdančios koreguoti pagal rinkos vertę

1. Laikoma, kad rinkos sąlygos, trukdančios koreguoti ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutartį pagal rinkos vertę, susidarė tokiais atvejais:

▼B

a) kai rinka neaktyvi;

b) kai pagrįstų sąžiningų apskaičiavimų intervalas labai didelis ir neįmanoma pagrįstai įvertinti įvairių apskaičiavimų tikėtinumo.

2. Ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarties rinka laikoma neaktyvia, kai siūlomos kainos neįmanoma sužinoti lengvai ir reguliariai, o pateikiamos kainos neatspindi faktinių reguliariai vykstančių rinkos sandorių įprastomis rinkos sąlygomis.

17 straipsnis

(Reglamento (ES) Nr. 648/2012 11 straipsnio 14 dalies b punktas)

Koregavimo pagal modelį taikymo kriterijai

Finansų sandorio šalys ir ne finansų sandorio šalys koregavimui pagal modelį turi parengusios modelį, kuris:

a) apima visus veiksnius, kuriuos sandorio šalys svarstytų nustatydamos kainą, įskaitant kuo platesnį koregavimo pagal rinkos vertę informacijos naudojimą;

b) yra suderintas su priimtina ekonomine finansinių priemonių kainodaros metodologija;

c) yra kalibruotas, o jo tinkamumas išbandytas, naudojant visų žinomų tuometinių rinkos sandorių su ta pačia finansine priemone kainas, arba grindžiamas prieinamais žinomais rinkos duomenimis;

d) yra nepriklausomai patikrintas ir stebimas kito skyriaus nei riziką prisiimantis skyrius;

e) yra deramai įtvirtintas dokumentais ir tvirtinamas direktorių valdybos taip dažnai, kaip to reikia, po kiekvieno esminio pokyčio, bet ne rečiau kaip vieną kartą per metus. Modelio tvirtinimas gali būti perduotas komitetui.

18 straipsnis

(Reglamento (ES) Nr. 648/2012 11 straipsnio 14 dalies c punktas)

Kompetentingai institucijai teikiamame pranešime apie grupės vidaus sandorį nurodoma informacija

1. Kompetentingai institucijai teikiama paraiška arba pranešimas apie grupės vidaus sandorio duomenis yra raštiški ir juose nurodoma tokia informacija:

a) teisinės sandorio šalys, nurodant jų identifikacinius kodus pagal Įgyvendinimo reglamento (ES) Nr. 1247/2012 3 straipsnį;

b) sandorio šalių įmonių santykiai;

▼B

c) informacija apie pagrindinę sutartį, pagal kurią nustatomi šalių santykiai;

d) grupės vidaus sandorio kategorija, kaip nurodyta Reglamento (ES) Nr. 648/2012 3 straipsnio 1 dalyje ir 2 dalies a–d punktuose;

e) informacija apie sandorius, kuriems sandorio šalis siekia netaikyti reikalavimo, įskaitant:

i) ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių turto klasę;

ii) ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių rūšį;

iii) pagrindinių priemonių rūšį;

iv) nominaliąsias ir atsiskaitymo valiutas;

v) sutarčių trukmės intervalą;

vi) atsiskaitymo būdą;

vii) numatomą ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių dydį, kiekį ir periodiškumą per metus.

2. Teikdama savo paraišką arba pranešimą atitinkamai kompetentingai institucijai, sandorio šalis taip pat pateikia sąlygų, nustatytų Reglamento (ES) Nr. 648/2012 11 straipsnio 6–10 dalyse, įvykdymą patvirtinančios informacijos. Patvirtinamieji dokumentai apima rizikos valdymo procedūrų dokumentų kopijas, praeities sandorių informaciją ir šalių atitinkamų sutarčių kopijas bei gali apimti teisinę nuomonę, jei kompetentinga institucija jos paprašo.

19 straipsnis

(Reglamento (ES) Nr. 648/2012 11 straipsnio 14 dalies d punktas)

Informacija apie EVPRI skirtą pranešimą apie grupės vidaus sandorį

1. Kompetentingos institucijos pranešimas apie grupės vidaus sandorio duomenis raštiškai teikiamas Europos vertybinių popierių ir rinkų institucijai:

a) per vieną mėnesį po pranešimo apie pranešimą pagal Reglamento (ES) Nr. 648/2012 11 straipsnio 7 arba 9 dalį gavimo;

b) per vieną mėnesį po sprendimo dėl kompetentingos institucijos sprendimo pagal Reglamento (ES) Nr. 648/2012 11 straipsnio 6, 8 arba 10 dalį pateikimo sandorio šaliai.

2. EVPRI skirtame pranešime nurodoma:

a) 18 straipsnyje nustatyta informacija;

b) ar sprendimas teigiamas, ar neigiamas;

▼B

c) teigiamo sprendimo atveju:

i) Reglamento (ES) Nr. 648/2012 11 straipsnio atitinkamai 6, 7, 8, 9 arba 10 dalyje nustatytų sąlygų įvykdymą patvirtinančių argumentų santrauka;

ii) ar pranešimo, susijusio su Reglamento (ES) Nr. 648/2012 11 straipsnio 6, 8 arba 10 dalimi, atžvilgiu reikalavimas netaikomas visiškai, ar iš dalies;

d) neigiamo sprendimo atveju:

i) nurodoma, kurios Reglamento (ES) Nr. 648/2012 11 straipsnio atitinkamai 6, 7, 8, 9 arba 10 dalyje nustatytos sąlygos yra neįvykdytos;

ii) tokių sąlygų neįvykdymą patvirtinančių argumentų santrauka.

20 straipsnis

(Reglamento (ES) Nr. 648/2012 11 straipsnio 14 dalies d punktas)

Viešai skelbtina informacija apie reikalavimo netaikymą grupės vidaus sandoriui

Apie reikalavimo netaikymą grupės vidaus sandoriui viešai skelbtina ši informacija:

a) teisinės sandorio šalys, nurodant jų identifikacinius kodus pagal Įgyvendinimo reglamento (ES) Nr. 1247/2012 3 straipsnį;

b) sandorio šalių santykiai;

c) ar reikalavimas netaikomas visiškai, ar iš dalies;

d) ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutarčių sąlyginė bendra suma, kuriai netaikomas grupės vidaus sandorio reikalavimas.

21 straipsnis

Įsigaliojimas ir taikymas

Šis reglamentas įsigalioja dvidešimtą dieną po jo paskelbimo *Europos Sąjungos oficialiajame leidinyje*.

13, 14 ir 15 straipsniai įsigalioja praėjus šešiems mėnesiams po šio reglamento įsigaliojimo datos.

Šis reglamentas privalomas visas ir tiesiogiai taikomas visose valstybėse narėse.