Käesolev tekst on üksnes dokumenteerimisvahend ning sel ei ole mingit õiguslikku mõju. Liidu institutsioonid ei vastuta selle teksti sisu eest. Asjakohaste õigusaktide autentsed versioonid, sealhulgas nende preambulid, on avaldatud Euroopa Liidu Teatajas ning on kättesaadavad EUR-Lexi veebisaidil. Need ametlikud tekstid on vahetult kättesaadavad käesolevasse dokumenti lisatud linkide kaudu

►**B** **KOMISJONI DELEGEERITUD MÄÄRUS (EL) 2016/1178,**

10. juuni 2016,

millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 648/2012 kliiringukohustust käsitlevate regulatiivsete tehniliste standarditega

(EMPs kohaldatav tekst)

(ELT L 195, 20.7.2016, lk 3)

Muudetud:

		Euroopa Liidu Teataja		
		nr	lehekülg	kuupäev
►**M1**	Komisjoni delegeeritud määrus (EL) 2017/751, 16. märts 2017	L 113	15	29.4.2017

Parandatud:

►**C1** Parandus, ELT L 196, 21.7.2016, lk 56 (2016/1178)

▼B

KOMISJONI DELEGEERITUD MÄÄRUS (EL) 2016/1178,

10. juuni 2016,

millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 648/2012 kliiringukohustust käsitlevate regulatiivsete tehniliste standarditega

(EMPs kohaldatav tekst)

Artikkel 1

Börsiväliste tuletisinstrumentide liigid, mille suhtes kohaldatakse kliiringukohustust

1. I lisas sätestatud börsiväliste tuletisinstrumentide liikide suhtes kohaldatakse kliiringukohustust.

2. I lisas sätestatud börsiväliste tuletisinstrumentide liigid ei hõlma lepinguid, mis on sõlmitud pandikirjade emitentidega või pandikirjade tagatiste kogumitega, eeldusel et need lepingud vastavad kõigile järgmistele kriteeriumidele:

a) neid kasutatakse ainult tagatiste kogumi intressimäärade või valuutade mittevastavuse maandamiseks seoses pandikirjaga;

b) need on pandikirjade tagatiste kogumis registreeritud või kajastatud vastavalt pandikirju käsitlevatele riiklikele õigusaktidele;

c) pandikirjade emitendi või tagatiste kogumi kriisilahenduse või maksejõuetuse korral neid ei lõpetata;

d) pandikirjade emitentidega või pandikirjade tagatiste kogumitega sõlmitud börsivälise tuletislepingu vastaspool kuulub vähemalt samasse nõudeõiguse järku kui pandikirja omanik, välja arvatud juhul, kui pandikirjade emitentidega või pandikirjade tagatiste kogumitega sõlmitud börsivälise tuletislepingu vastaspool on lepingulised kohustused täitmata jätnud või mõjutatud pool või kui ta loobub samasse nõudeõiguse järku kuulumise õigusest;

e) pandikiri vastab Euroopa Parlamendi ja nõukogu määruse (EL) nr 575/2013 ([1]) artikli 129 nõuetele ja selle suhtes kohaldatav regulatiivne tagatusnõue on vähemalt 102 %.

Artikkel 2

Vastaspoolte kategooriad

1. Artiklite 3 ja 4 kohaldamisel jagatakse vastaspooled, kelle suhtes kohaldatakse kliiringukohustust, järgmistesse kategooriatesse:

([1]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 26. juuni 2013. aasta määrus (EL) nr 575/2013 krediidiasutuste ja investeerimisühingute suhtes kohaldatavate usaldatavusnõuete kohta ja määruse (EL) nr 648/2012 muutmise kohta (ELT L 176, 27.6.2013, lk 1).

▼B

a) 1. kategooria hõlmab vastaspooli, kes käesoleva määruse jõustumise kuupäeval on kliirivad liikmed määruse (EL) nr 648/2012 artikli 2 punkti 14 tähenduses vähemalt ühe käesoleva määruse I lisas või komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2015/2205 ([1]) I lisas sätestatud börsiväliste intressimäära tuletisinstrumentide liigi puhul vähemalt ühe sellise vastaspoole jaoks, kellele on antud tegevusluba või keda on tunnustatud enne seda kuupäeva, andes talle õiguse kliirida vähemalt üht kõnealust liiki;

b) 2. kategooria hõlmab järgmisi 1. kategooriasse mittekuuluvaid vastaspooli, kes kuuluvad gruppi, mille mittekeskselt kliiritavate tuletisinstrumentide tinglike väärtuste tagasimaksmata brutosummade summeeritud kuulõpu keskmine perioodil jaanuar, veebruar ja märts 2016 on suurem kui 8 miljardit eurot:

   i) finantssektori vastaspooled;

   ii) Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2011/61/EL ([2]) artikli 4 lõike 1 punkti a määratluse kohased alternatiivsed investeerimisfondid, kes kujutavad endast finantssektoriväliseid vastaspooli;

c) 3. kategooria hõlmab järgmisi 1. ja 2. kategooriasse mittekuuluvaid vastaspooli:

   i) finantssektori vastaspooled;

   ii) direktiivi 2011/61/EL artikli 4 lõike 1 punkti a määratluse kohased alternatiivsed investeerimisfondid, kes kujutavad endast finantssektoriväliseid vastaspooli;

d) 4. kategooria hõlmab 1., 2. ja 3. kategooriasse mittekuuluvaid finantssektoriväliseid vastaspooli.

2. Lõike 1 punktis b osutatud grupi tinglike väärtuste tagasimaksmata brutosummade summeeritud kuulõpu keskmise arvutamisel võetakse arvesse grupi kõiki mittekeskselt kliiritavaid tuletisinstrumente, sh valuutaforvardid, vahetustehingud ja valuutavahetustehingud.

3. Kui vastaspoolteks on direktiivi 2011/61/EL artikli 4 lõike 1 punkti a määratluse kohased alternatiivsed investeerimisfondid või

([1]) Komisjoni 6. augusti 2015. aasta delegeeritud määrus (EL) 2015/2205, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 648/2012 kliiringukohustust käsitlevate regulatiivsete tehniliste standarditega (ELT L 314, 1.12.2015, lk 13).

([2]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 8. juuni 2011. aasta direktiiv 2011/61/EL alternatiivsete investeerimisfondide valitsejate kohta, millega muudetakse direktiive 2003/41/EÜ ja 2009/65/EÜ ning määruseid (EÜ) nr 1060/2009 ja (EL) nr 1095/2010 (ELT L 174, 1.7.2011, lk 1).

▼B

Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2009/65/EÜ ([1]) artikli 1 lõike 2 määratluse kohased vabalt võõrandatavatesse väärtpaberitesse ühiseks investeerimiseks loodud ettevõtjad, kohaldatakse käesoleva artikli lõike 1 punktis b osutatud künnist (8 miljardit eurot) individuaalselt fondi tasandil.

Artikkel 3

Kliiringukohustuse jõustumise kuupäevad

1. I lisas sätestatud börsiväliste tuletisinstrumentide liikidesse kuuluvate lepingute puhul jõustub kliiringukohustus järgmistel kuupäevadel:

a) 9. veebruaril 2017, kui vastaspool kuulub 1. kategooriasse;

▼C1

b) 9. augustil 2017, kui vastaspool kuulub 2. kategooriasse;

▼M1

c) 21. juunil 2019, kui vastaspool kuulub 3. kategooriasse;

▼C1

d) 9. augustil 2019, kui vastaspool kuulub 4. kategooriasse.

▼B

Kui lepingu sõlmivad kaks erinevatesse vastaspoolte kategooriatesse kuuluvat vastaspoolt, jõustub kliiringukohustus selle lepingu puhul hilisemal kuupäeval.

2. Erandina lõike 1 punktidest a, b ja c jõustuvad I lisas sätestatud tuletisinstrumentide liikidesse kuuluvad lepingud, mille on sõlminud muud kui 4. kategooriasse kuuluvad vastaspooled, kes kuuluvad samasse gruppi ning kellest üks on asutatud kolmandas riigis ja teine liidus, järgmistel kuupäevadel:

a) ►C1 9. august 2019 ◄, kui määruse (EL) nr 648/2012 artikli 4 kohaldamise eesmärgil ei ole asjaomase kolmanda riigiga seoses võetud vastu nimetatud määruse artikli 13 lõike 2 kohast samaväärsust kinnitavat otsust, mis hõlmab käesoleva määruse I lisas osutatud börsiväliseid tuletislepinguid, või

b) järgmistest kuupäevadest hilisem, kui määruse (EL) nr 648/2012 artikli 4 kohaldamise eesmärgil on võetud asjaomase kolmanda riigiga seoses vastu nimetatud määruse artikli 13 lõike 2 kohane samaväärsust kinnitav otsus, mis hõlmab käesoleva määruse I lisas osutatud börsiväliseid tuletislepinguid:

i) 60 päeva pärast seda, kui jõustub määruse (EL) nr 648/2012 artikli 4 kohaldamise eesmärgil nimetatud määruse artikli 13 lõike 2 kohaselt asjaomase kolmanda riigiga seoses vastu võetud otsus, mis hõlmab käesoleva määruse I lisas osutatud börsiväliseid tuletislepinguid,

([1]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 13. juuli 2009. aasta direktiiv 2009/65/EÜ vabalt võõrandatavatesse väärtpaberitesse ühiseks investeeringuks loodud ettevõtjaid (eurofondid) käsitlevate õigus- ja haldusnormide kooskõlastamise kohta (ELT L 302, 17.11.2009, lk 32).

▼B

ii) kuupäev, mil lõike 1 kohaselt jõustub kliiringukohustus.

Seda erandit kohaldatakse ainult juhul, kui vastaspooled vastavad järgmistele tingimustele:

a) kolmandas riigis asutatud vastaspool on kas finantssektori vastaspool või finantssektoriväline vastaspool;

b) liidus asutatud vastaspool on

i) finantssektori vastaspool, finantssektoriväline vastaspool, finantsvaldusettevõtja, finantsasutus või abiettevõtja, kelle suhtes kohaldatakse asjakohaseid usaldatavusnõudeid, ja punktis a osutatud vastaspool on finantssektori vastaspool; või

ii) kas finantssektori vastaspool või finantssektoriväline vastaspool ja punktis a osutatud vastaspool on finantssektoriväline vastaspool;

c) mõlemad vastaspooled on täielikult hõlmatud sama konsolideeritud aruandlusega vastavalt määruse (EL) nr 648/2012 artikli 3 lõikele 3;

d) mõlema vastaspoole suhtes kohaldatakse sobivaid keskseid riski hindamise, mõõtmise ja kontrollimise protseduure;

e) liidus asutatud vastaspool on teatanud asjaomasele pädevale asutusele kirjalikult, et punktides a, b, c ja d sätestatud tingimused on täidetud, ning pädev asutus on kinnitanud 30 päeva jooksul pärast teate saamist, et kõnealused tingimused on täidetud.

Artikkel 4

Minimaalne järelejäänud tähtaeg

1. 1. kategooriasse kuuluvate finantssektori vastaspoolte puhul peab määruse (EL) nr 648/2012 artikli 4 lõike 1 punkti b alapunktis ii osutatud minimaalne järelejäänud tähtaeg olema kliiringukohustuse jõustumise kuupäeva seisuga järgmine:

a) 15 aastat lepingute puhul, mis on sõlmitud või uuendatud enne 9. oktoobrit 2016 ja mis on I lisa tabelis 1 esitatud liiki;

b) 3 aastat lepingute puhul, mis on sõlmitud või uuendatud enne 9. oktoobrit 2016 on I lisa tabelis 2 esitatud liiki;

c) kuus kuud lepingute puhul, mis on sõlmitud või uuendatud 9. oktoobril 2016 või pärast seda ja mis on I lisa tabelis 1 või 2 esitatud liiki.

2. 2. kategooriasse kuuluvate finantssektori vastaspoolte puhul peab määruse (EL) nr 648/2012 artikli 4 lõike 1 punkti b alapunktis ii osutatud minimaalne järelejäänud tähtaeg olema kliiringukohustuse jõustumise kuupäeva seisuga järgmine:

▼B

a) 15 aastat lepingute puhul, mis on sõlmitud või uuendatud enne 9. oktoobrit 2016 ja mis on I lisa tabelis 1 esitatud liiki;

b) 3 aastat lepingute puhul, mis on sõlmitud või uuendatud enne 9. oktoobrit 2016 ja mis on I lisa tabelis 2 esitatud liiki;

c) kuus kuud lepingute puhul, mis on sõlmitud või uuendatud 9. oktoobril 2016 või pärast seda ja mis on I lisa tabelis 1 või 2 esitatud liiki.

3. 3. kategooriasse kuuluvate finantssektori vastaspoolte ja käesoleva määruse artikli 3 lõikes 2 osutatud finantssektori vastaspoolte vaheliste tehingute puhul peab määruse (EL) nr 648/2012 artikli 4 lõike 1 punkti b alapunktis ii osutatud minimaalne järelejäänud tähtaeg olema kliiringukohustuse jõustumise kuupäeva seisuga järgmine:

a) I lisa tabelis 1 esitatud lepingute liikide korral 15 aastat;

b) I lisa tabelis 2 esitatud lepingute liikide korral 3 aastat.

4. Kui lepingu sõlmivad kaks erinevatesse vastaspoolte kategooriatesse kuuluvat finantssektori vastaspoolt või kaks finantssektori vastaspoolt, kes on seotud artikli 3 lõikes 2 osutatud tehingutega, võetakse käesoleva artikli kohaldamisel arvesse minimaalset järelejäänud tähtaega, mis on järelejäänud tähtaegadest pikem.

Artikkel 5

jõustumine

Käesolev määrus jõustub kahekümnendal päeval pärast selle avaldamist *Euroopa Liidu Teatajas*.

Käesolev määrus on tervikuna siduv ja vahetult kohaldatav kõikides liikmesriikides.

▼B

LISA

Börsiväliste intressimäära tuletisinstrumentide liigid, mille suhtes kohaldatakse kliiringukohustust

Tabel 1

Intressimäärade vahetustehingute liigid, mille puhul fikseeritud intressimäär asendatakse ujuva intressimääraga (Fixed-to-Float)

Tunnus	Liik	Võrdlus-indeks	Arveldus-valuuta	Tähtaeg	Arveldus-valuuta liik	Vaba valik	Tingliku väär-tuse liik
C.1.1	Fixed- to-Float	NIBOR	NOK	28P–10 A	üks valuuta	ei	konstantne või muutuv
C.1.2	Fixed- to-Float	WIBOR	PLN	28P–10 A	üks valuuta	ei	konstantne või muutuv
C.1.3	Fixed- to-Float	STIBOR	SEK	28P–15 A	üks valuuta	ei	konstantne või muutuv

Tabel 2

Intressiforvardite liigid

Tunnus	Liik	Võrdlus-indeks	Arveldus-valuuta	Tähtaeg	Arveldus-valuuta liik	Vaba valik	Tingliku väär-tuse liik
C.2.1	FRA	NIBOR	NOK	3P–2 A	üks valuuta	ei	konstantne või muutuv
C.2.2	FRA	WIBOR	PLN	3P–2 A	üks valuuta	ei	konstantne või muutuv
C.2.3	FRA	STIBOR	SEK	3P–3 A	üks valuuta	ei	konstantne või muutuv