Europeiska unionens
officiella tidning

SV
L-serien

2026/1000

17.8.2026

KOMMISSIONENS DELEGERADE FÖRORDNING (EU) 2026/1000

av den 5 maj 2026

om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 648/2012 genom specificering av metoden för att fastställa de avgifter som Europeiska bankmyndigheten tar ut för validering av de proformamodeller som avses i artikel 11.3 fjärde stycket i den förordningen och specificering av villkoren för betalning av dessa avgifter

(Text av betydelse för EES)

EUROPEISKA KOMMISSIONEN HAR ANTAGIT DENNA FÖRORDNING

med beaktande av fördraget om Europeiska unionens funktionssätt,

med beaktande av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 648/2012 av den 4 juli 2012 om OTC-derivat, centrala motparter och transaktionsregister ([1]), särskilt artikel 11.12a sjunde stycket, och

av följande skäl:

(1) Den årliga avgift som avses i artikel 11.12a femte stycket i förordning (EU) nr 648/2012 bör vara tillräckligt hög för att täcka alla direkta och indirekta kostnader som Europeiska bankmyndigheten (*EBA*) ådrar sig för validering av de proformamodeller som avses i artikel 11.3 fjärde stycket i den förordningen. Alla avgifter som tas ut bör fastställas på en sådan nivå att ett underskott eller en betydande ackumulering av överskott undviks. Om ett betydande positivt eller negativt budgetutfall blir återkommande bör avgiftsnivån ses över.

(2) Kravet på att EBA måste validera de proformamodeller som avses i artikel 11.3 fjärde stycket i förordning (EU) nr 648/2012 infördes genom Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2024/2987 ([2]). Vissa av de motparter som har ingått OTC-derivatkontrakt som inte clearats av en central motpart har dock använt proformamodeller innan den förordningen trädde i kraft. Det är därför lämpligt att utarbeta en särskild metod för beräkning av de avgifter som ska betalas för valideringen av dessa proformamodeller.

(3) Enligt artikel 11.12a femte stycket i förordning (EU) nr 648/2012 ska den årliga avgift som ska betalas till EBA stå i proportion till det månatliga genomsnittliga utestående nominella beloppet av OTC-derivat som inte clearats centralt under de senaste tolv månaderna för de berörda motparterna. Motparter bör använda metoden med en likvärdig nominell portfölj för att fastställa det genomsnittliga nominella beloppet. Motparter bör tillåtas att använda en alternativ metod, förutsatt att de kan motivera valet av denna alternativa metod för sin behöriga myndighet.

(4) För nya proformamodeller finns det ännu inte något månatligt genomsnittligt utestående nominellt belopp som kan användas för att fördela kostnaden proportionellt över alla motparter som använder en ny proformamodell. För det första året som en ny proformamodell används bör därför dessa motparter debiteras en lika stor och fast avgift per ny proformamodell. Enligt artikel 11.12a andra stycket i förordning (EU) nr 648/2012 har dock EBA efter mottagandet av en ansökan om validering av en sådan ny proformamodell sex månader på sig att validera den modellen, vilket innebär att det är möjligt att en proformamodell valideras först året efter ansökan om validering. EBA bör därför kunna ta ut den fasta avgiften även för det år då proformamodellen faktiskt valideras. För åren efter det år då den första valideringen beviljas bör en oföränderlig metod för fastställande av de avgifter som ska betalas fastställas.

([1]) EUT L 201, 27.7.2012, s. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2012/648/oj.

([2]) Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2024/2987 av den 27 november 2024 om ändring av förordningarna (EU) nr 648/2012, (EU) nr 575/2013 och (EU) 2017/1131 vad gäller åtgärder för att minska alltför stora exponeringar mot centrala motparter i tredjeland och effektivisera unionens clearingmarknader (EUT L, 2024/2987, 4.12.2024, s. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2024/2987/oj).

(5) För att EBA ska kunna beräkna den årliga avgiften korrekt bör motparter som använder proformamodeller som ska valideras av EBA i god tid skicka all information som EBA behöver för en sådan beräkning till EBA.

HÄRIGENOM FÖRESKRIVS FÖLJANDE.

Artikel 1

Årlig avgift baserad på full kostnadstäckning och enligt en verksamhetsbaserad förvaltningsmodell

Den årliga avgift som avses i artikel 11.12a femte stycket i förordning (EU) nr 648/2012 ska baseras på båda av följande:

a) Principen om full kostnadstäckning.

b) Det genomsnittliga nominella belopp som beräknas i enlighet med artikel 3.

Artikel 2

Uppskattning av de årliga totala kostnader som EBA ådrar sig till följd av valideringen av proformamodeller

För att fastställa det totala avgiftsbelopp som EBA ska ta ut enligt artikel 11.12a femte stycket i förordning (EU) nr 648/2012 ska EBA varje år beakta de direkta och indirekta utgifter som EBA kommer att ådra sig det året för

a) validering av proformamodeller, inbegripet ändringar av dem,

b) utveckling och underhåll av statistiska verktyg och it-verktyg som stöder valideringsfunktionen för proformamodeller,

c) beräkning, fakturering och uppbörd av den årliga avgiften,

d) all annan verksamhet som stöder valideringsfunktionen för proformamodeller.

Artikel 3

Genomsnittligt nominellt belopp

1. För beräkningen av den årliga avgift som ska betalas till EBA av varje motpart som omfattas av skyldigheten att få sina proformamodeller validerade ska varje motpart som använder, eller i tillämpliga fall ansöker om validering för att använda, en proformamodell beräkna det genomsnittliga nominella beloppet genom att beräkna ett genomsnitt av det månatliga nominella beloppet av derivat som inte clearas centralt med hjälp av en given proformamodell för den berörda referensperioden. Dessa motparter ska beräkna varje månatligt nominellt belopp per den sista bankdagen i den aktuella månaden med hjälp av den metod med en likvärdig nominell portfölj som anges i punkt 4 eller, i tillämpliga fall, de alternativa metoder som anges i punkt 5 eller 7. En motpart får från beräkningarna av de genomsnittliga nominella beloppen undanta portföljer för vilka den inte samlar in initiala marginalsäkerheter till följd av tillämpningen av det undantag som anges i artikel 29.1 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2016/2251 ([3]). En motpart som väljer att undanta sådana portföljer ska ange antalet undantagna portföljer som en del av den information som avses i artikel 8.1 i denna förordning.

2. Vid tillämpning av artikel 4 ska referensperioden vara perioden 1 januari–31 december året före året för faktureringsdagen i enlighet med artikel 7.

3. Vid tillämpning av artikel 5 ska referensperioden vara de tolv månader som föregår den dag då EBA offentligt har meddelat att den har inrättat sin centrala valideringsfunktion (*EBA:s beredskapsdag*).

([3]) Kommissionens delegerade förordning (EU) 2016/2251 av den 4 oktober 2016 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 648/2012 om OTC-derivat, centrala motparter och transaktionsregister med avseende på tekniska tillsynsstandarder för riskreduceringstekniker för OTC-derivatkontrakt som inte clearas av en central motpart (EUT L 340, 15.12.2016, s. 9, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2016/2251/oj).

4. För varje månad av referensperioden som avses i punkt 1 ska motparterna beräkna det månatliga nominella beloppet genom att omvandla det belopp av initial marginalsäkerhet som beräknats med proformamodellen för den relevanta portföljen till ett likvärdigt nominellt belopp för portföljen i enlighet med följande formel:

$$Nominellt\ belopp_m = \frac{IM(Räntor,\ inflation,\ FX)}{6\%} + \frac{IM(Kredit)}{10\%} + \frac{IM(Aktier)}{15\%} + \frac{IM(Råvaror)}{15\%} + \frac{IM(Övriga)}{15\%}$$

där

— m = index som anger referensperiodens månad,

— *C* = index som anger klassen eller klasserna av derivatkontrakt,

— *IM(C)* = det totala beloppet av initial marginalsäkerhet, beräknat med användning av proformamodellen, för OTC-derivattransaktioner i klass *C* som inte clearas centralt, beräknat den sista bankdagen i den månad för vilken det månatliga nominella beloppet beräknas, omräknat till euro.

5. Som ett alternativ får motparter, för varje månad av referensperioden som avses i punkt 1, besluta att använda följande formel för att omvandla det totala belopp av initial marginalsäkerhet som beräknats per tillgångsklass för den relevanta portföljen till ett likvärdigt nominellt belopp för portföljen:

$$Nominellt\ belopp_månad'_m = \frac{IM'(Räntor,\ inflation,\ FX)}{6\%} + \frac{IM'(Kredit)}{10\%} + \frac{IM'(Aktier)}{15\%} + \frac{IM'(Råvaror)}{15\%} + \frac{IM'(Övriga)}{15\%}$$

där

— *m* = index som anger referensperiodens månad,

— *C* = index som anger klassen eller klasserna av derivatkontrakt,

— *IM'(C)* = det totala beloppet av initial marginalsäkerhet för OTC-derivattransaktioner i klass *C* som inte clearas centralt, beräknat den sista bankdagen i den månad för vilken det månatliga nominella beloppet beräknas, omräknat till euro.

Motparter får välja att använda denna formel förutsatt att de kan motivera valet för sin behöriga myndighet.

6. Vid tillämpning av punkterna 4 och 5 ska motparterna vid omräkning av belopp till euro använda den referensväxelkurs för euron som offentliggörs av Europeiska centralbanken den sista bankdagen i den månad för vilken det månatliga nominella beloppet beräknas.

7. Genom undantag från punkterna 4 och 5 får en motpart som har ett tolvmånaders genomsnittligt nominellt belopp under 3 000 miljarder euro uppskatta varje månatligt nominellt belopp till ett av de belopp som anges i tabellen nedan, förutsatt att den kan visa för sin behöriga myndighet att det faktiska nominellt beloppet är lägre än det valda beloppet:

Lagstadgad tröskel	Nominellt belopp
1	3 000 miljarder euro
2	2 250 miljarder euro
3	1 500 miljarder euro
4	750 miljarder euro
5	50 miljarder euro
6	8 miljarder euro

Artikel 4

Årliga valideringsavgifter

1. För varje proformamodell som är validerad per den 1 januari ett år och som en motpart använder eller ansöker om validering av i enlighet med artikel 11.3 fjärde stycket i förordning (EU) nr 648/2012 under det året ska motparten betala följande avgift till EBA:

$$Avgift_{n,y,p} = EUR\ 200 + max\left(\frac{EBA{:}s\ kostnader_y}{Antal\ modeller_y} * \frac{Genomsnittligt\ nominellt\ belopp_{n,\,p}}{Genomsnittligt\ nominellt\ belopp_{Totalt,p}} - EUR\ 200; 0\right)$$

där

— *n* = index som anger den motpart som använder, eller i tillämpliga fall ansöker om validering för att använda, proformamodell *p*,

— *y* = index som anger referensåret,

— *p* = index som anger den proformamodell som är validerad av EBA per den 1 januari år *y*,

— *EBA* : *skostnader*$_y$ = det belopp som uppskattats i enlighet med artikel 2 för år *y* för proformamodeller som är validerade av EBA per den 1 januari det året,

— *Antal modeller*$_y$ = det antal proformamodeller som är validerade av EBA per den 1 januari år y, med en undre gräns på 1,

— *Genomsnittligt nominellt belopp*$_{n,p}$ det belopp som beräknats av motpart n för proformamodellen *p*, i enlighet med artikel 3,

— $Genomsnittligt\ nominellt\ belopp_{Totalt,p} = \sum_n Genomsnittligt\ nominellt\ belopp_{n,p}$.

2. Proformamodeller som trots att de validerats omfattas av den avgift som avses i artikel 6 ska inte beaktas vid den beräkning som anges i punkt 1.

3. Genom undantag från punkt 1 ska en motpart som börjar omfattas av kravet på att ansöka om validering av en proformamodell efter den 31 mars ett visst år inte betala någon avgift för det året för den proformamodellen.

Artikel 5

Årlig avgift för validering av en proformamodell som redan användes före den 24 december 2024

1. Genom undantag från artikel 4 och i fråga om en proformamodell som redan användes före den 24 december 2024, för perioden från EBA:s beredskapsdag till utgången av året för EBA:s beredskapsdag, ska en motpart som senast på EBA:s beredskapsdag omfattas av kravet på att ansöka om validering för att använda, eller anta en ändring av, den proformamodellen i enlighet med artikel 11.3 fjärde stycket i förordning (EU) nr 648/2012 betala följande årliga avgift till EBA:

$$Avgift_n = EUR\ 200 + max\left(EBA : s\ kostnader * \frac{Genomsnittligt\ nominellt\ belopp_n}{Genomsnittligt\ nominellt\ belopp_{Totalt}} - EUR\ 200; 0\right)$$

där

— *n* = index som anger den motpart som senast på EBA:s beredskapsdag omfattas av kravet på att ansöka om validering för att använda, eller anta en ändring av, den proformamodellen i enlighet med artikel 11.3 fjärde stycket i förordning (EU) nr 648/2012,

— *EBA* : *s kostnader* = det belopp, uttryckt i euro, som uppskattats i enlighet med artikel 2 från EBA:s beredskapsdag till utgången av året för EBA:s beredskapsdag,

— *Genomsnittligt nominellt belopp*$_n$ = det belopp som beräknats av motpart n i enlighet med artikel 3,

— *Genomsnittligt nominellt belopp*$_{Totalt} = \sum_n$ *Genomsnittligt nominellt belopp*$_n$.

2. En motpart som efter EBA:s beredskapsdag börjar omfattas av kravet på att ansöka om validering för att använda en proformamodell som redan användes före den 24 december 2024 ska inte betala någon avgift för det aktuella året.

Artikel 6

Årlig avgift för validering av en proformamodell som inte redan användes före den 24 december 2024

1. Varje motpart som i enlighet med artikel 11.3 fjärde stycket i förordning (EU) nr 648/2012 ansöker om validering av en proformamodell som inte redan användes före den 24 december 2024 ska betala följande avgift till EBA:

$$Avgift_n = \frac{EUR\ 500\ 000}{Totalt\ antal\ motparter}$$

där

— *n* = index som anger den motpart som ansöker om validering för att använda proformamodellen,

— *Totalt antal motparter* = det antal motparter som ansöker om att få använda en ny proformamodell senast den 31 juli det aktuella året.

2. Om den valideringsperiod på sex månader som anges i artikel 11.12a andra stycket i förordning (EU) nr 648/2012 löper ut året efter det år då den första ansökan om en första validering av den nya proformamodellen mottogs (*påföljande år*), får EBA välja att fortsätta att tillämpa den formel som anges i punkt 1 för beräkningen av avgifterna för det påföljande året.

Om EBA utnyttjar alternativet enligt första stycket ska den använda det antal motparter som använder, eller har ansökt om validering för att använda, proformamodellen senast den 31 juli påföljande år som ”Totalt antal motparter” i formeln enligt punkt 1.

3. EBA får besluta att inte ta ut den avgift som avses i punkt 1 i denna artikel för det år då den första ansökan om validering av proformamodellen tas emot, om det inte skulle vara operativt genomförbart att uppbära avgifterna på det sätt som anges i artikel 7.

4. Om en motpart använder flera proformamodeller ska den avgift som beräknas i enlighet med punkterna 1 och 2 i denna artikel för den proformamodell som är föremål för en första validering betalas utöver den avgift som beräknas i enlighet med artikel 4 för alla andra proformamodeller som används av motparten.

5. Genom undantag från punkt 1 i denna artikel får EBA, för den avgift som beräknas i enlighet med denna artikel, höja det belopp på 500 000 euro i formeln som anges i den punkten upp till ett belopp som motsvarar de totala kostnader som uppskattats i enlighet med artikel 2 för en proformamodell.

Artikel 7

Betalning av årliga valideringsavgifter

1. Motparter som omfattas av skyldigheten att få sina proformamodeller validerade för ett visst år ska faktureras av EBA för de avgifter som avses i artiklarna 4, 5 och 6, beroende på vad som är tillämpligt, under det kalenderåret.

2. Betalningsfristen ska vara 45 kalenderdagar från registreringen av fordran i EBA:s räkenskaper. Avgifterna ska betalas i euro.

3. Varje försenad betalning ska ge upphov till den dröjsmålsränta som anges i artikel 99 i Europaparlamentets och rådets förordning (EU, Euratom) 2024/2509 ([4]).

4. Kommunikationen mellan EBA och de motparter som avses i punkt 1 i denna artikel ska ske via den centrala databas som inrättats av Esma i enlighet med artikel 17c i förordning (EU) nr 648/2012 eller på något annat elektroniskt sätt om den centrala databasen inte är tillgänglig.

Artikel 8

Information som ska lämnas till EBA

1. Motparter som använder en validerad proformamodell eller ansöker om validering av en proformamodell ska varje år till EBA lämna alla uppgifter som behövs för att beräkna de avgifter som avses i artiklarna 4, 5 och 6, beroende på vad som är tillämpligt, inbegripet information om det genomsnittliga nominella belopp som avses i artikel 3 och de finansiella uppgifter om motparten som krävs för faktureringsprocessen.

2. Vid tillämpning av punkt 1 gäller följande:

a) För det år då EBA:s beredskapsdag infaller ska EBA samla in de uppgifter som behövs för att

   i) beräkna de avgifter som avses i artikel 5,

   ii) utfärda fakturor senast den 31 oktober det året.

b) För åren efter EBA:s beredskapsdag ska de motparter som avses i punkt 1 i denna artikel senast den 31 mars meddela EBA de uppgifter som behövs för att beräkna de avgifter som avses i artiklarna 4 och 5, beroende på vad som är tillämpligt.

c) För de avgifter som avses i artikel 6 ska EBA samla in information för att beräkna dessa avgifter och utfärda motsvarande fakturor senast en dag som är lämplig med hänsyn till bestämmelserna i artikel 7.

Artikel 9

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.

Utfärdad i Bryssel den 5 maj 2026.

På kommissionens vägnar
Ursula VON DER LEYEN
Ordförande

([4]) Europaparlamentets och rådets förordning (EU, Euratom) 2024/2509 av den 23 september 2024 om finansiella regler för unionens allmänna budget (omarbetning) (EUT L, 2024/2509, 26.9.2024, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2024/2509/oj).