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) 2016/1178,

annettu 10 päivänä kesäkuuta 2016,

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

(ETA:n kannalta merkityksellinen teksti)

(EUVL L 195, 20.7.2016, s. 3)

Oikaistu:

►**C1** Oikaisu, EUVL L 196, 21.7.2016, s. 56 (2016/1178)

▼B

KOMISSION DELEGOITU ASETUS (EU) 2016/1178,

annettu 10 päivänä kesäkuuta 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

1. Liitteessä I esitetyt OTC-johdannaislajit kuuluvat määritysvelvollisuuden piiriin.

2. Liitteessä I esitetyt OTC-johdannaislajit eivät sisällä sopimuksia, jotka toteutetaan katettujen joukkolainojen liikkeeseenlaskijoiden kanssa tai jotka liittyvät vakuudellisiin joukkolainoihin, edellyttäen, että kyseiset sopimukset täyttävät kaikki seuraavat edellytykset:

a) Niitä käytetään ainoastaan suojaamaan katepoolin korko- tai valuuttapoikkeamat katetun joukkolainan yhteydessä.

b) Ne on merkitty tai kirjattu katetun joukkolainan katepooliin katettuja joukkolainoja koskevan kansallisen lainsäädännön mukaisesti.

c) Niitä ei irtisanota katetun joukkolainan liikkeeseenlaskijan tai katepoolin kriisinratkaisu- tai maksukyvyttömyystilanteessa.

d) Katettujen joukkolainojen liikkeeseenlaskijoiden tai katettujen joukkolainojen katepoolien kanssa tehdyn OTC-johdannaissopimuksen vastapuolella on vähintään sama etuoikeusasema kuin katettujen joukkolainojen haltijoilla paitsi jos katettujen joukkolainojen liikkeeseenlaskijoiden tai katettujen joukkolainojen katepoolien kanssa tehdyn OTC-johdannaissopimuksen vastapuoli on maksukyvytön tai asianomainen osapuoli tai luopuu samasta etuoikeusasemasta.

e) Katettu joukkolaina täyttää Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 575/2013 ([1]) 129 artiklan vaatimukset, ja siihen sovelletaan vähintään 102 prosentin vakuuden asettamista koskevaa lakisääteistä vaatimusta.

2 artikla

Vastapuoliryhmät

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

([1]) Euroopan parlamentin ja neuvoston asetus (EU) N:o 575/2013, annettu 26 päivänä kesäkuuta 2013, luottolaitosten ja sijoituspalveluyritysten vakavaraisuusvaatimuksista ja asetuksen (EU) N:o 648/2012 muuttamisesta (EUVL L 176, 27.6.2013, s. 1).

▼B

a) Ryhmä 1 sisältää vastapuolet, jotka ovat tämän asetuksen voimaantulopäivänä vähintään yhden tämän asetuksen liitteessä I tai komission delegoidun asetuksen (EU) 2015/2205 ([1]) liitteessä I 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 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 ([2]) 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.

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

([1]) Komission delegoitu asetus (EU) 2015/2205, annettu 6 päivänä elokuuta 2015, Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 648/2012 täydentämisestä määritysvelvollisuutta koskevilla teknisillä sääntelystandardeilla (EUVL L 314, 1.12.2015, s. 13).

([2]) 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

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 I esitettyä OTC-johdannaislajia koskevien sopimusten osalta määritysvelvollisuus tulee voimaan seuraavasti:

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

▼C1

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

▼B

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

▼C1

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

▼B

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 I esitettyä OTC-johdannaislajia koskevien sopimusten osalta, jotka on tehty ryhmän 4 ulkopuolisten samaan konserniin kuuluvien vastapuolten välillä, joista toinen vastapuoli on sijoittautunut kolmanteen maahan ja toinen vastapuoli unioniin, määritysvelvollisuus tulee voimaan seuraavasti:

a) ►C1 9 päivänä elokuuta 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 I 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 I tarkoitetut OTC-johdannaissopimukset kyseisen kolmannen maan osalta:

   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 I 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

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; tai

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) 15 vuotta sopimuksille, jotka on tehty tai uusittu ennen 9 päivää lokakuuta 2016 ja jotka kuuluvat liitteessä I olevan taulukon 1 sisältämiin lajeihin;

b) 3 vuotta sopimuksille, jotka on tehty tai uusittu ennen 9 päivää lokakuuta 2016 ja jotka kuuluvat liitteessä I olevan taulukon 2 sisältämiin lajeihin;

c) 6 kuukautta sopimuksille, jotka on tehty tai uusittu 9 päivänä lokakuuta 2016 tai sen jälkeen ja jotka kuuluvat liitteessä I olevan taulukon 1 tai 2 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) 15 vuotta sopimuksille, jotka on tehty tai uusittu ennen 9 päivää lokakuuta 2016 ja jotka kuuluvat liitteessä I olevan taulukon 1 sisältämiin lajeihin;

b) 3 vuotta sopimuksille, jotka on tehty tai uusittu ennen 9 päivää lokakuuta 2016 ja jotka kuuluvat liitteessä I olevan taulukon 2 sisältämiin lajeihin;

c) 6 kuukautta sopimuksille, jotka on tehty tai uusittu 9 päivänä lokakuuta 2016 tai sen jälkeen ja jotka kuuluvat liitteessä I olevan taulukon 1 tai 2 sisältämiin lajeihin.

3. Kun kyseessä ovat ryhmään 3 kuuluvat finanssialalla toimivat vastapuolet ja tämän asetuksen 3 artiklan 2 kohdassa tarkoitetut transaktiot finanssialalla 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:

a) 15 vuotta sopimuksille, jotka kuuluvat liitteessä I olevan taulukon 1 sisältämiin lajeihin;

b) 3 vuotta sopimuksille, jotka kuuluvat liitteessä I olevan taulukon 2 sisältämiin lajeihin.

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 kuuluvat OTC-korkojohdannaislajit

Taulukko 1

Koronvaihtosopimukset, joissa kiinteä korko vaihdetaan vaihtuvaan korkoon

Tunniste	Tyyppi	Viite-indeksi	Selvitys-valuutta	Voimassaolo-aika	Selvitys-valuutan tyyppi	Valinnaisuus	Nimellismäärän tyyppi
C.1.1	Kiinteästä korosta vaihtuvaan	NIBOR	NOK	28PV-10V	Sama valuutta	Ei	Kiinteä tai vaihtuva
C.1.2	Kiinteästä korosta vaihtuvaan	WIBOR	PLN	28PV-10V	Sama valuutta	Ei	Kiinteä tai vaihtuva
C.1.3	Kiinteästä korosta vaihtuvaan	STIBOR	SEK	28PV-15V	Sama valuutta	Ei	Kiinteä tai vaihtuva

Taulukko 2

Korkotermiinit

Tunniste	Tyyppi	Viite-indeksi	Selvitys-valuutta	Voimassaolo-aika	Selvitys-valuutan tyyppi	Valinnaisuus	Nimellismäärän tyyppi
C.2.1	FRA	NIBOR	NOK	3PV-2V	Sama valuutta	Ei	Kiinteä tai vaihtuva
C.2.2	FRA	WIBOR	PLN	3PV-2V	Sama valuutta	Ei	Kiinteä tai vaihtuva
C.2.3	FRA	STIBOR	SEK	3PV-3V	Sama valuutta	Ei	Kiinteä tai vaihtuva