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) 2016/1178 НА КОМИСИЯТА

от 10 юни 2016 година

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

(текст от значение за ЕИП)

(ОВ L 195, 20.7.2016 г., стр. 3)

Поправен със:

►**C1** Поправка, ОВ L 196, 21.7.2016 г., стр. 56 (2016/1178)

▼B

ДЕЛЕГИРАН РЕГЛАМЕНТ (ЕС) 2016/1178 НА КОМИСИЯТА

от 10 юни 2016 година

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

(текст от значение за ЕИП)

Член 1

Класове извънборсови деривати, които подлежат на задължителен клиринг

1. Класовете извънборсови деривати, определени в приложение I, подлежат на задължителен клиринг.

2. Класовете извънборсови деривати, определени в приложение I, не включват договорите, сключени с емитенти на обезпечени облигации или с гарантирани фондове за обезпечени облигации, при условие че тези договори отговарят на всяко от следните условия:

а) те се използват само за хеджиране на лихвени или валутни несъответствия на гарантирания фонд във връзка с обезпечените облигации;

б) те са регистрирани или вписани в гарантирания фонд за обезпечени облигации в съответствие с националното законодателство в тази област;

в) те не се прекратяват в случай на преструктуриране или несъстоятелност на емитента на обезпечените облигации или на гарантирания фонд за обезпечени облигации;

г) контрагентът по извънборсовите деривати, сключени с емитенти на обезпечени облигации или с гарантирани фондове за обезпечени облигации, има ранг, който е най-малкото равностоен с този на притежателите на обезпечени облигации, освен когато е в неизпълнение, е засегнатата страна или се отказва от равностойния ранг;

д) обезпечените облигации отговарят на изискванията на член 129 от Регламент (ЕС) № 575/2013 на Европейския парламент и на Съвета ([1]) и са предмет на регулаторно изискване за обезпеченост от най-малко 102 %.

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:

([1]) Регламент (ЕС) № 575/2013 на Европейския парламент и на Съвета от 26 юни 2013 година относно пруденциалните изисквания за кредитните институции и инвестиционните посредници и за изменение на Регламент (ЕС) № 648/2012 (ОВ L 176, 27.6.2013 г., стр. 1).

▼B

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 приложение I към настоящия регламент или в приложение I към Делегиран регламент (ЕС) 2015/2205 на Комисията [1], 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 остатъчна брутна условна стойност на дериватите, на които се извършва нецентрализиран клиринг, надхвърля средно 8 милиарда евро в края на месец януари, февруари и март 2016 г. и които представляват някой от следните субекти:

i) финансови контрагенти;

ii) алтернативни инвестиционни фондове, както са определени в член 4, параграф 1, буква а) от Директива 2011/61/ЕС на Европейския парламент и на Съвета [2], които са нефинансови контрагенти;

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

i) финансови контрагенти;

ii) алтернативни инвестиционни фондове, както са определени 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.

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, както са определени в член 4, параграф 1, буква а) от Директива 2011/61/ЕС, или предприятия за колективно инвестиране в прехвърлими ценни книжа, както са определени в член 1,

[1] Делегиран регламент (ЕС) 2015/2205 на Комисията от 6 август 2015 година за допълнение на Регламент (ЕС) № 648/2012 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на регулаторните технически стандарти относно задължението за клиринг (ОВ L 314, 1.12.2015 г., стр.13).

[2] Директива 2011/61/ЕС на Европейския парламент и на Съвета от 8 юни 2011 година 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

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. За договорите, принадлежащи към някой от посочените в приложение I класове извънборсови деривати, задължението за клиринг поражда действие на:

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

▼C1

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

▼B

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

▼C1

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

▼B

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), за договорите, 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) ►C1 9 август 2019 г. ◄, ако за 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 приложение I към настоящия регламент; или

б) по-късната от следните дати, ако за 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 приложение I към настоящия регламент:

i) 60 дни след датата на влизане в сила на решението за 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 приложение I към настоящия регламент,

([1]) Директива 2009/65/ЕО на Европейския парламент и на Съвета от 13 юли 2009 година 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

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, или

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 в 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) 15 години за договорите, сключени или подновени преди 9 октомври 2016 г., които принадлежат към класовете в таблица 1 от приложение I;

б) 3 години за договорите, сключени или подновени преди 9 октомври 2016 г., които принадлежат към класовете в таблица 2 от приложение I;

в) 6 месеца за договорите, сключени или подновени на или след 9 октомври 2016 г., които принадлежат към класовете в таблица 1 или таблица 2 от приложение I.

2. За финансовите контрагенти в 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) 15 години за договорите, сключени или подновени преди 9 октомври 2016 г., които принадлежат към класовете в таблица 1 от приложение I;

б) 3 години за договорите, сключени или подновени преди 9 октомври 2016 г., които принадлежат към класовете в таблица 2 от приложение I;

в) 6 месеца за договорите, сключени или подновени на или след 9 октомври 2016 г., които принадлежат към класовете в таблица 1 или таблица 2 от приложение I.

3. За финансовите контрагенти в категория 3 и за трансакциите, посочени в член 3, параграф 2 от настоящия регламент, сключени между финансови контрагенти, 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) 15 години за договорите, които принадлежат към класовете в таблица 1 от приложение I;

б) 3 години за договорите, които принадлежат към класовете в таблица 2 от приложение I.

4. Когато договорът е сключен между двама финансови контрагенти, принадлежащи към различни категории, или между двама финансови контрагенти, участващи в трансакциите по 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 лихвени извънборсови деривати, подлежащи на задължителен клиринг

Таблица 1

Класове лихвени суапове с фиксирана срещу променлива лихва

Идентификационен номер	Вид	Базов индекс	Валута на сетълмент	Матуритет	Вид валута на сетълмент	Опция	Вид условна стойност
C.1.1	С фиксирана срещу променлива лихва	NIBOR	NOK	28 дни — 10 г.	Една валута	Не	Постоянна или променлива
C.1.2	С фиксирана срещу променлива лихва	WIBOR	PLN	28 дни — 10 г.	Една валута	Не	Постоянна или променлива
C.1.3	С фиксирана срещу променлива лихва	STIBOR	SEK	28 дни — 15 г.	Една валута	Не	Постоянна или променлива

Таблица 2

Класове форуърдни лихвени споразумения

Идентификационен номер	Вид	Базов индекс	Валута на сетълмент	Матуритет	Вид валута на сетълмент	Опция	Вид условна стойност
C.2.1	FRA	NIBOR	NOK	3 дни — 2 г.	Една валута	Не	Постоянна или променлива
C.2.2	FRA	WIBOR	PLN	3 дни — 2 г.	Една валута	Не	Постоянна или променлива
C.2.3	FRA	STIBOR	SEK	3 дни — 3 г.	Една валута	Не	Постоянна или променлива