Ovaj je tekst namijenjen isključivo dokumentiranju i nema pravni učinak. Institucije Unije nisu odgovorne za njegov sadržaj. Vjerodostojne inačice relevantnih akata, uključujući njihove preambule, one su koje su objavljene u Službenom listu Europske unije i dostupne u EUR-Lexu. Tim službenim tekstovima može se izravno pristupiti putem poveznica sadržanih u ovom dokumentu.

►B

DELEGIRANA UREDBA KOMISIJE (EU) 2016/592

od 1. ožujka 2016.

o dopuni Uredbe (EU) br. 648/2012 Europskog parlamenta i Vijeća u pogledu regulatornih tehničkih standarda za obvezu poravnanja

(Tekst značajan za EGP)

(SL L 103, 19.4.2016., str. 5.)

Koju je izmijenila:

		Službeni list		
		br.	stranica	datum
►M1	Delegirana uredba Komisije (EU) 2017/751 od 16. ožujka 2017.	L 113	15	29.4.2017.
►M2	Delegirana uredba Komisije (EU) 2019/667 od 19. prosinca 2018.	L 113	1	29.4.2019.

▼B

DELEGIRANA UREDBA KOMISIJE (EU) 2016/592

od 1. ožujka 2016.

o dopuni Uredbe (EU) br. 648/2012 Europskog parlamenta i Vijeća u pogledu regulatornih tehničkih standarda za obvezu poravnanja

(Tekst značajan za EGP)

Članak 1.

Vrste OTC izvedenica koje podliježu obvezi poravnanja

Vrste OTC izvedenica navedene u Prilogu podliježu obvezi poravnanja.

Članak 2.

Kategorije drugih ugovornih strana

1. Za potrebe članaka 3. i 4. druge ugovorne strane koje podliježu obvezi poravnanja podijeljene su na sljedeće kategorije:

(a) prva kategorija, koja obuhvaća druge ugovorne strane koje su na dan stupanja na snagu ove Uredbe klirinški članovi, u smislu članka 2. stavka 14. Uredbe (EU) br. 648/2012, za najmanje jednu vrstu OTC izvedenica navedenih u Prilogu ovoj Uredbi, najmanje jedne središnje druge ugovorne strane odobrene za rad ili priznate prije datuma poravnanja najmanje jedne od tih vrsta OTC izvedenica;

(b) druga kategorija, koja obuhvaća druge ugovorne strane koje ne pripadaju 1. kategoriji, a pripadaju grupi čiji skupni prosjek na kraju mjeseca preostalog bruto zamišljenog iznosa izvedenica koje nisu centralno poravnane za siječanj, veljaču i ožujak 2016. iznosi više od 8 milijardi EUR i koje su jedno od sljedećeg:

   i. financijske druge ugovorne strane;

   ii. alternativni investicijski fondovi, kako su definirani u članku 4. stavku 1. točki (a) Direktive 2011/61/EU Europskog parlamenta i Vijeća ([1]), koji su nefinancijske druge ugovorne strane;

(c) treća kategorija, koja obuhvaća druge ugovorne strane koje ne pripadaju prvoj ili drugoj kategoriji i koje su jedno od sljedećeg:

   i. financijske druge ugovorne strane;

   ii. alternativni investicijski fondovi, kako su definirani u članku 4. stavku 1. točki (a) Direktive 2011/61/EU, koji su nefinancijske druge ugovorne strane;

(d) četvrta kategorija, koja obuhvaća nefinancijske druge ugovorne strane koje ne pripadaju prvoj, drugoj ili trećoj kategoriji.

([1]) Direktiva 2011/61/EU Europskog parlamenta i Vijeća od 8. lipnja 2011. o upraviteljima alternativnih investicijskih fondova i o izmjeni direktiva 2003/41/EZ i 2009/65/EZ te uredbi (EZ) br. 1060/2009 i (EU) br. 1095/2010 (SL L 174, 1.7.2011., str. 1.).

▼B

2. Kako bi se za grupu izračunao skupni prosjek na kraju mjeseca preostalog bruto zamišljenog iznosa iz stavka 1. točke (b), u izračun se uključuju sve izvedenice te grupe koje nisu centralno poravnane, uključujući valutne terminske ugovore, ugovore o razmjeni i valutne ugovore o razmjeni.

3. Ako su druge ugovorne strane alternativni investicijski fondovi, kako su definirani u članku 4. stavku 1. točki (a) Direktive 2011/61/EU, ili subjekti za zajednička ulaganja u prenosive vrijednosne papire, kako su definirani u članku 1. stavku 2. Direktive 2009/65/EZ Europskog parlamenta i Vijeća ([1]), prag od 8 milijardi EUR iz ovog članka stavka 1. točke (b) primjenjuje se pojedinačno na razini fonda.

Članak 3.

Datumi od kojih obveza poravnanja proizvodi učinke

1. U pogledu ugovora koji pripadaju vrsti OTC izvedenica navedenoj u Prilogu, obveza poravnanja proizvodi učinke:

(a) 9. veljače 2017. za druge ugovorne strane u prvoj kategoriji;

(b) 9. kolovoza 2017. za druge ugovorne strane u drugoj kategoriji;

▼M1

(c) 21. lipnja 2019. za druge ugovorne strane u trećoj kategoriji;

▼B

(d) 9. svibnja 2019. za druge ugovorne strane u četvrtoj kategoriji.

Ako se ugovor sklapa između dviju drugih ugovornih strana koje pripadaju različitim kategorijama drugih ugovornih strana, datum od kojeg obveza poravnanja proizvodi učinke za taj ugovor jest kasniji datum.

▼M2

2. Odstupajući od stavka 1., u pogledu ugovora koji pripadaju vrsti OTC izvedenica navedenoj u Prilogu i koji su sklopljeni između drugih ugovornih strana koje su dio iste grupe i kada jedna druga ugovorna strana ima poslovni nastan u trećoj zemlji, a druga u Uniji, obveza poravnanja proizvodi učinke:

(a) 21. prosinca 2020. ako nije donesena odluka o istovrijednosti na temelju članka 13. stavka 2. Uredbe (EU) br. 648/2012 za potrebe članka 4. te Uredbe kojom su obuhvaćeni ugovori o OTC izvedenicama iz Priloga ovoj Uredbi u pogledu relevantne treće zemlje; ili

(b) kasnijeg od sljedećih datuma ako je donesena odluka o istovrijednosti na temelju članka 13. stavka 2. Uredbe (EU) br. 648/2012 za potrebe članka 4. te Uredbe kojom su obuhvaćeni ugovori o OTC izvedenicama iz Priloga ovoj Uredbi u pogledu relevantne treće zemlje:

([1]) Direktiva 2009/65/EZ Europskog parlamenta i Vijeća od 13. srpnja 2009. o usklađivanju zakona i drugih propisa u odnosu na subjekte za zajednička ulaganja u prenosive vrijednosne papire (UCITS) (SL L 302, 17.11.2009., str. 32.).

▼M2

i. 60 dana od dana stupanja na snagu odluke donesene na temelju članka 13. stavka 2. Uredbe (EU) br. 648/2012 za potrebe članka 4. te uredbe kojom su obuhvaćeni ugovori o OTC izvedenicama iz Priloga ovoj Uredbi u pogledu relevantne treće zemlje;

ii. datum od kojeg obveza poravnanja proizvodi učinke na temelju stavka 1.

▼B

To odstupanje primjenjuje se samo ako druge ugovorne strane ispunjuju sljedeće uvjete:

(a) druga ugovorna strana s poslovnim nastanom u trećoj zemlji jest financijska druga ugovorna strana ili nefinancijska druga ugovorna strana;

(b) druga ugovorna strana s poslovnim nastanom u Uniji jest:

i. financijska druga ugovorna strana, nefinancijska druga ugovorna strana, financijski holding, financijska institucija ili društvo za pomoćne usluge na koje se primjenjuju odgovarajući bonitetni zahtjevi, dok je druga ugovorna strana iz točke (a) financijska druga ugovorna strana;

ii. financijska druga ugovorna strana ili nefinancijska druga ugovorna strana, dok je druga ugovorna strana iz točke (a) nefinancijska druga ugovorna strana;

(c) obje druge ugovorne strane u cijelosti su obuhvaćene istom konsolidacijom u skladu s člankom 3. stavkom 3. Uredbe (EU) br. 648/2012;

(d) obje druge ugovorne strane podliježu odgovarajućim centraliziranim postupcima ocjene, mjerenja i kontrole rizika;

(e) druga ugovorna strana s poslovnim nastanom u Uniji obavijestila je u pisanom obliku svoje nadležno tijelo da su ispunjeni uvjeti utvrđeni u točkama (a), (b), (c) i (d), a nadležno tijelo potvrdilo je u roku od 30 kalendarskih dana od primitka obavijesti da su ti uvjeti ispunjeni.

Članak 4.

Minimalno preostalo dospijeće

1. Za financijske druge ugovorne strane u prvoj kategoriji minimalno preostalo dospijeće iz članka 4. stavka 1. točke (b) podtočke ii. Uredbe (EU) br. 648/2012, na dan kada obveza poravnanja proizvodi učinke, jest:

(a) pet godina i tri mjeseca za ugovore sklopljene ili obnovljene prije 9. listopada 2016. koji pripadaju vrstama u tablici iz Priloga;

(b) šest mjeseci za ugovore sklopljene ili obnovljene dana 9. listopada 2016. ili nakon tog dana koji pripadaju vrstama u tablici iz Priloga.

2. Za financijske druge ugovorne strane u drugoj kategoriji minimalno preostalo dospijeće iz članka 4. stavka 1. točke (b) podtočke ii. Uredbe (EU) br. 648/2012, na dan kada obveza poravnanja proizvodi učinke, jest:

(a) pet godina i tri mjeseca za ugovore sklopljene ili obnovljene prije 9. listopada 2016. koji pripadaju vrstama u tablici iz Priloga;

▼B

(b) šest mjeseci za ugovore sklopljene ili obnovljene dana 9. listopada 2016. ili nakon tog dana koji pripadaju vrstama u tablici iz Priloga.

3. Za financijske druge ugovorne strane u trećoj kategoriji i za transakcije navedene u članku 3. stavku 2. ove Uredbe sklopljene između financijskih drugih ugovornih strana, minimalno preostalo dospijeće iz članka 4. stavka 1. točke (b) podtočke ii. Uredbe (EU) br. 648/2012, na dan kada obveza poravnanja proizvodi učinke, jest pet godina i tri mjeseca.

4. Ako se ugovor sklapa između dviju financijskih drugih ugovornih strana koje pripadaju različitim kategorijama ili između dviju financijskih drugih ugovornih strana uključenih u transakcije navedene u članku 3. stavku 2., minimalno preostalo dospijeće koje se uzima u obzir za potrebe ovog članka jest dulje primjenjivo preostalo dospijeće.

Članak 5.

Stupanje na snagu

Ova Uredba stupa na snagu dvadesetog dana od dana objave u *Službenom listu Europske unije*.

Ova je Uredba u cijelosti obvezujuća i izravno se primjenjuje u svim državama članicama.

▼B

PRILOG

Vrste ugovora o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza OTC izvedenica koje podliježu obvezi poravnanja

Europski netranširani indeks vrsta ugovora o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza

Oznaka	Vrsta	Podvrsta	Geografska zona	Referentni indeks	Valuta namire	Serija	Rok dospijeća
B.1.1.	Indeks ugovora o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza	Netranširani indeks	Europa	iTraxx Europe Main	EUR	od 17. nadalje	5 godina
B.1.2.	Indeks ugovora o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza	Netranširani indeks	Europa	iTraxx Europe Crossover	EUR	od 17. nadalje	5 godina