Šis tekstas yra skirtas tik informacijai ir teisinės galios neturi. Europos Sąjungos institucijos nėra teisiškai atsakingos už jo turinį. Autentiškos atitinkamų teisės aktų, įskaitant jų preambules, versijos skelbiamos Europos Sąjungos oficialiajame leidinyje ir pateikiamos svetainėje „EUR-Lex“. Oficialūs tekstai tiesiogiai prieinami naudojantis šiame dokumente pateikiamomis nuorodomis

►**B**

KOMISIJOS DELEGUOTASIS REGLAMENTAS (ES) 2016/592

2016 m. kovo 1 d.

kuriuo papildomos Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 648/2012 nuostatos dėl tarpuskaitos prievolės techninių reguliavimo standartų

(Tekstas svarbus EEE)

(OL L 103, 2016 4 19, p. 5)

iš dalies keičiamas:

		Oficialusis leidinys		
		Nr.	puslapis	data
►**M1**	2017 m. kovo 16 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2017/751	L 113	15	2017 4 29
►**M2**	2018 m. gruodžio 19 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2019/667	L 113	1	2019 4 29

▼B

KOMISIJOS DELEGUOTASIS REGLAMENTAS (ES) 2016/592

2016 m. kovo 1 d.

kuriuo papildomos Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 648/2012 nuostatos dėl tarpuskaitos prievolės techninių reguliavimo standartų

(Tekstas svarbus EEE)

1 straipsnis

Ne biržos išvestinių finansinių priemonių, kurioms taikoma tarpuskaitos prievolė, klasės

Priede nustatytų klasių ne biržos išvestinėms finansinėms priemonėms taikoma *tarpuskaitos* prievolė.

2 straipsnis

Sandorio šalių kategorijos

1. Taikant 3 ir 4 straipsnius, sandorio šalys, kurioms taikoma tarpuskaitos prievolė, skirstomos į šias kategorijas:

a) 1 kategorija apima sandorio šalis, kurios šio reglamento įsigaliojimo datą dėl bent vienos iš šio reglamento priede nurodytų ne biržos išvestinių finansinių priemonių klasių yra bent vienos pagrindinės sandorio šalies, kuriai iki tos datos suteiktas leidimas arba kuri yra pripažinta atlikti bent vienos iš tų klasių tarpuskaitą, tarpuskaitos narės, kaip apibrėžta Reglamento (ES) Nr. 648/2012 2 straipsnio 14 punkte;

b) 2 kategorija apima 1 kategorijai nepriklausančias sandorio šalis, priklausančias grupei, kurios agreguota vidutinė išvestinių finansinių priemonių, kurioms netaikoma pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita, mėnesio pabaigos neapmokėta bendroji tariamoji suma 2016 m. sausio, vasario ir kovo mėnesiais yra didesnė nei 8 mlrd. EUR, ir kurios yra:

   i) finansų sandorio šalys arba

   ii) alternatyvaus investavimo fondai, kaip apibrėžta Europos Parlamento ir Tarybos direktyvos 2011/61/ES [1] 4 straipsnio 1 dalies a punkte, kurie nėra finansų sandorio šalys;

c) 3 kategorijai priklauso 1 arba 2 kategorijoms nepriklausančios sandorio šalys, kurios yra:

   i) finansų sandorio šalys arba

   ii) alternatyvaus investavimo fondai, kaip apibrėžta Direktyvos 2011/61/ES 4 straipsnio 1 dalies a punkte, kurie nėra finansų sandorio šalys;

d) 4 kategorijai priklauso ne finansų sandorio šalys, nepriklausančios 1, 2 arba 3 kategorijai.

[1] 2011 m. birželio 8 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2011/61/ES dėl alternatyvaus investavimo fondų valdytojų, kuria iš dalies keičiami direktyvos 2003/41/EB ir 2009/65/EB bei reglamentai (EB) Nr. 1060/2009 ir (ES) Nr. 1095/2010 (OL L 174, 2011 7 1, p. 1).

▼B

2. Siekiant apskaičiuoti grupės agreguotą vidutinę mėnesio pabaigos neapmokėtą bendrąją tariamąją sumą, nurodytą 1 dalies b punkte, įtraukiamos grupės visos išvestinės finansinės priemonės, kurioms netaikoma pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita, įskaitant išankstinius valiutos keitimo sandorius, apsikeitimo sandorius ir valiutos apsikeitimo sandorius.

3. Jei sandorio šalys yra alternatyvaus investavimo fondai, kaip apibrėžta Direktyvos 2011/61/ES 4 straipsnio 1 dalies a punkte, arba kolektyvinio investavimo į perleidžiamus vertybinius popierius subjektai, kaip apibrėžta Europos Parlamento ir Tarybos direktyvos 2009/65/EB ([1]) 1 straipsnio 2 dalyje, šio straipsnio 1 dalies b punkte nurodyta 8 mlrd. EUR riba taikoma individualiai fondo lygmeniu.

3 straipsnis

Tarpuskaitos prievolės įsigaliojimo datos

1. Sutarčių, priklausančių vienai iš priede nustatytų ne biržos išvestinių finansinių priemonių klasių, atžvilgiu tarpuskaitos prievolė įsigalioja:

a) 2017 m. vasario 9 d. 1 kategorijos sandorio šalims;

b) 2017 m. rugpjūčio 9 d. 2 kategorijos sandorio šalims;

▼M1

c) 2019 m. birželio 21 d. 3 kategorijos sandorio šalims;

▼B

d) 2019 m. gegužės 9 d. 4 kategorijos sandorio šalims.

Jeigu sutartį sudaro dvi sandorio šalys, priklausančios skirtingoms sandorio šalių kategorijoms, data, kurią tos sutarties atžvilgiu įsigalioja tarpuskaitos prievolė, yra vėlesnioji data.

▼M2

2. Nukrypstant nuo 1 dalies, jei sutartys priklauso vienai iš priede nustatytų ne biržos išvestinių finansinių priemonių klasių ir jas sudaro tai pačiai grupei priklausančios sandorio šalys, kai viena sandorio šalis yra įsteigta trečiojoje valstybėje, o kita – Sąjungoje, tų sutarčių atžvilgiu tarpuskaitos prievolė įsigalioja:

a) 2020 m. gruodžio 21 d., jeigu pagal Reglamento (ES) Nr. 648/2012 13 straipsnio 2 dalį atitinkamos trečiosios valstybės atžvilgiu nepriimtas sprendimas dėl lygiavertiškumo to reglamento 4 straipsnio tikslais, taikomas šio reglamento priede nurodytoms ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutartims, arba

b) vėlesnę iš toliau nurodytų datų, jeigu pagal Reglamento (ES) Nr. 648/2012 13 straipsnio 2 dalį atitinkamos trečiosios valstybės atžvilgiu priimtas sprendimas dėl lygiavertiškumo to reglamento 4 straipsnio tikslais, taikomas šio reglamento priede nurodytoms ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutartims:

([1]) 2009 m. liepos 13 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2009/65/EB dėl įstatymų ir kitų teisės aktų, susijusių su kolektyvinio investavimo į perleidžiamus vertybinius popierius subjektais (KIPVPS), derinimo (OL L 302, 2009 11 17, p. 32).

▼M2

i) praėjus 60 dienų nuo sprendimo dėl lygiavertiškumo, priimto pagal Reglamento (ES) Nr. 648/2012 13 straipsnio 2 dalį atitinkamos trečiosios valstybės atžvilgiu to reglamento 4 straipsnio tikslais ir taikomo šio reglamento priede nurodytoms ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutartims, įsigaliojimo;

ii) tarpuskaitos prievolės įsigaliojimo datą pagal 1 dalį.

▼B

Ši nukrypti leidžianti nuostata taikoma tik jei sandorio šalys atitinka šias sąlygas:

a) trečiojoje valstybėje įsteigta sandorio šalis yra finansų sandorio šalis arba ne finansų sandorio šalis;

b) Sąjungoje įsteigta sandorio šalis yra:

i) finansų sandorio šalis, ne finansų sandorio šalis, finansų kontroliuojančioji bendrovė, finansų įstaiga arba papildomas paslaugas teikianti įmonė, kuriai taikomi atitinkami rizikos ribojimo reikalavimai, o a punkte nurodyta sandorio šalis yra finansų sandorio šalis;

ii) finansų sandorio šalis arba ne finansų sandorio šalis, o a punkte nurodyta sandorio šalis yra ne finansų sandorio šalis;

c) abi sandorio šalys yra visiškai įtrauktos į tą patį konsolidavimo procesą pagal Reglamento (ES) Nr. 648/2012 3 straipsnio 3 dalį;

d) abiem sandorio šalims taikomos atitinkamos centralizuotos rizikos vertinimo, nustatymo ir kontrolės procedūros;

e) Sąjungoje įsteigta sandorio šalis raštu pranešė savo kompetentingai institucijai, kad a, b, c ir d punktuose nustatytos sąlygos yra tenkinamos, ir per 30 kalendorinių dienų nuo pranešimo gavimo datos kompetentinga institucija patvirtino, kad sąlygos tenkinamos.

4 straipsnis

Minimalus likęs terminas

1. 1 kategorijos finansų sandorio šalių atveju minimalus likęs terminas, nurodytas Reglamento (ES) Nr. 648/2012 4 straipsnio 1 dalies b punkto ii papunktyje, tarpuskaitos prievolės įsigaliojimo datą yra:

a) 5 metai ir 3 mėnesiai sutartims, kurios yra sudarytos arba pakeistos iki 2016 m. spalio 9 d. ir kurios priklauso priedo lentelėje nurodytoms klasėms;

b) 6 mėnesiai sutartims, kurios yra sudarytos arba pakeistos 2016 m. spalio 9 d. arba vėliau ir kurios priklauso priedo lentelėje nurodytoms klasėms.

2. 2 kategorijos finansų sandorio šalių atveju minimalus likęs terminas, nurodytas Reglamento (ES) Nr. 648/2012 4 straipsnio 1 dalies b punkto ii papunktyje, tarpuskaitos prievolės įsigaliojimo datą yra:

a) 5 metai ir 3 mėnesiai sutartims, kurios yra sudarytos arba pakeistos iki 2016 m. spalio 9 d. ir kurios priklauso priedo lentelėje nurodytoms klasėms;

▼B

b) 6 mėnesiai sutartims, kurios yra sudarytos arba pakeistos 2016 m. spalio 9 d. arba vėliau ir kurios priklauso priedo lentelėje nurodytoms klasėms.

3. 3 kategorijos finansų sandorio šalių ir finansų sandorio šalių sudarytų sandorių, nurodytų šio reglamento 3 straipsnio 2 dalyje, minimalus likęs terminas, nurodytas Reglamento (ES) Nr. 648/2012 4 straipsnio 1 dalies b punkto ii papunktyje, tarpuskaitos prievolės įsigaliojimo datą yra 5 metai ir 3 mėnesiai.

4. Jeigu sutartį sudarė dvi finansų sandorio šalys, priklausančios skirtingoms kategorijoms, arba dvi finansų sandorio šalys, dalyvaujančios 3 straipsnio 2 dalyje nurodytuose sandoriuose, minimalus likęs terminas, į kurį reikia atsižvelgti taikant šį straipsnį, yra ilgesnysis taikomas likęs terminas.

5 straipsnis

Įsigaliojimas

Šis reglamentas įsigalioja dvidešimtą dieną po jo paskelbimo *Europos Sąjungos oficialiajame leidinyje*.

Šis reglamentas privalomas visas ir tiesiogiai taikomas visose valstybėse narėse.

▼B

PRIEDAS

Kredito įsipareigojimų neįvykdymo ne biržos išvestinių finansinių priemonių, kurioms taikoma tarpuskaitos prievolė, klasės

Europos nesegmentuotų indeksų kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių (CDS) klasės

id	Rūšis	Porūšis	Geografinė zona	Bazinis indeksas	Atsiskaitymo valiuta	Serija	Terminas
B.1.1	Indeksų CDS	Nesegmentuotas indeksas	Europa	iTraxx Europe Main	EUR	Nuo 17	5 metai
B.1.2	Indeksų CDS	Nesegmentuotas indeksas	Europa	iTraxx Europe Crossover	EUR	Nuo 17	5 metai