Käesolev tekst on üksnes dokumenteerimisvahend ning sel ei ole mingit õiguslikku mõju. Liidu institutsioonid ei vastuta selle teksti sisu eest. Asjakohaste õigusaktide autentsed versioonid, sealhulgas nende preambulid, on avaldatud Euroopa Liidu Teatajas ning on kättesaadavad EUR-Lexi veebisaidil. Need ametlikud tekstid on vahetult kättesaadavad käesolevasse dokumenti lisatud linkide kaudu

►B

KOMISJONI DELEGEERITUD MÄÄRUS (EL) 2015/2205,

6. august 2015,

millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 648/2012 kliiringukohustust käsitlevate regulatiivsete tehniliste standarditega

(EMPs kohaldatav tekst)

(ELT L 314, 1.12.2015, lk 13)

Muudetud:

		Euroopa Liidu Teataja		
		nr	lehekülg	kuupäev
►M1	Komisjoni delegeeritud määrus (EL) 2017/751, 16. märts 2017	L 113	15	29.4.2017
►M2	Komisjoni delegeeritud määrus (EL) 2019/667, 19. detsember 2018	L 113	1	29.4.2019
►M3	Komisjoni delegeeritud määrus (EL) 2020/447, 16. detsember 2019	L 94	5	27.3.2020

▼B

KOMISJONI DELEGEERITUD MÄÄRUS (EL) 2015/2205,

6. august 2015,

millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 648/2012 kliiringukohustust käsitlevate regulatiivsete tehniliste standarditega

(EMPs kohaldatav tekst)

Artikkel 1

Börsiväliste tuletisinstrumentide liigid, mille suhtes kohaldatakse kliiringukohustust

1. Lisas sätestatud börsiväliste tuletisinstrumentide liikide suhtes kohaldatakse kliiringukohustust.

▼M3

_____

▼B

Artikkel 2

1. Artiklite 3 ja 4 kohaldamisel jagatakse vastaspooled, kelle suhtes kohaldatakse kliiringukohustust, järgmistesse kategooriatesse:

a) 1. kategooria hõlmab vastaspooli, kes käesoleva määruse jõustumise kuupäeval on kliirivad liikmed määruse (EL) nr 648/2012 artikli 2 punkti 14 tähenduses vähemalt ühe käesoleva määruse lisas sätestatud börsiväliste intressimäära tuletisinstrumentide liigi puhul vähemalt ühe sellise vastaspoole jaoks, kellele on antud tegevusluba või keda on tunnustatud enne seda kuupäeva, andes talle õiguse kliirida vähemalt üht kõnealust liiki;

b) 2. kategooria hõlmab järgmiseid 1. kategooriasse mittekuuluvaid vastaspooli, kes kuuluvad gruppi, mille mittekeskselt kliiritavate tuletisinstrumentide tinglike väärtuste tagasi maksmata brutosummade summeeritud kuulõpu keskmine perioodil jaanuar, veebruar ja märts 2016 on suurem kui 8 miljardit eurot:

   i) finantssektori vastaspooled;

   ii) Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2011/61/EL ([1]) artikli 4 lõike 1 punkti a määratluse kohased alternatiivsed investeerimisfondid, kes kujutavad endast finantssektoriväliseid vastaspooli;

c) 3. kategooria hõlmab järgmisi 1. ja 2. kategooriasse mittekuuluvaid vastaspooli:

   i) finantssektori vastaspooled;

   ii) direktiivi 2011/61/EL artikli 4 lõike 1 punkti a määratluse kohased alternatiivsed investeerimisfondid, kes kujutavad endast finantssektoriväliseid vastaspooli;

([1]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiiv 2011/61/EL, 8. juuni 2011, alternatiivsete investeerimisfondide valitsejate kohta, millega muudetakse direktiive 2003/41/EÜ ja 2009/65/EÜ ning määruseid (EÜ) nr 1060/2009 ja (EL) nr 1095/2010 (ELT L 174, 1.7.2011, lk 1).

▼B

d) 4. kategooria hõlmab 1., 2. ja 3. kategooriasse mittekuuluvaid finantssektoriväliseid vastaspooli.

2. Lõike 1 punktis b osutatud grupi tinglike väärtuste tagasi maksmata brutosummade summeeritud kuulõpu keskmise arvutamisel võetakse arvesse grupi kõiki mittekeskselt kliiritavaid tuletisinstrumente, sh valuutaforvardid, vahetustehingud ja valuutavahetustehingud.

3. Kui vastaspoolteks on direktiivi 2011/61/EL artikli 4 lõike 1 punkti a määratluse kohased alternatiivsed investeerimisfondid või Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2009/65/EÜ ([1]) artikli 1 lõike 2 määratluse kohased vabalt võõrandatavatesse väärtpaberitesse ühiseks investeerimiseks loodud ettevõtjad, kohaldatakse käesoleva artikli lõike 1 punktis b osutatud künnist (8 miljardit eurot) individuaalselt fondi tasandil.

Artikkel 3

Kliiringukohustuse jõustumise kuupäevad

1. Lisas sätestatud börsiväliste tuletisinstrumentide liikidesse kuuluvate lepingute puhul jõustub kliiringukohustus järgmistel kuupäevadel:

a) 21. juunil 2016, kui vastaspool kuulub 1. kategooriasse;

b) 21. detsembril 2016, kui vastaspool kuulub 2. kategooriasse;

▼M1

c) 21. juunil 2019, kui vastaspool kuulub 3. kategooriasse;

▼B

d) 21. detsembril 2018, kui vastaspool kuulub 4. kategooriasse.

Kui lepingu sõlmivad kaks erinevatesse vastaspoolte kategooriatesse kuuluvat vastaspoolt, jõustub kliiringukohustus selle lepingu puhul hilisemal kuupäeval.

▼M2

2. Lisas sätestatud börsiväliste tuletisinstrumentide liikidesse kuuluvate lepingute puhul, mille on sõlminud samasse gruppi kuuluvad vastaspooled, kellest üks on asutatud kolmandas riigis ja teine liidus, jõustub kliiringukohustus erandina lõikest 1 järgmistel kuupäevadel:

a) 21. detsember 2020, kui määruse (EL) nr 648/2012 artikli 4 kohaldamise eesmärgil ei ole asjaomase kolmanda riigi suhtes võetud kõnealuse määruse artikli 13 lõike 2 alusel vastu samaväärsust kinnitavat otsust, mis hõlmab käesoleva määruse lisas osutatud börsiväliseid tuletislepinguid, või

([1]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiiv 2009/65/EÜ, 13. juuli 2009, vabalt võõrandatavatesse väärtpaberitesse ühiseks investeeringuks loodud ettevõtjaid (eurofondid) käsitlevate õigus- ja haldusnormide kooskõlastamise kohta (ELT L 302, 17.11.2009, lk 32).

▼M2

b) järgmistest kuupäevadest hilisem, kui määruse (EL) nr 648/2012 artikli 4 kohaldamise eesmärgil on võetud asjaomase kolmanda riigi suhtes kõnealuse määruse artikli 13 lõike 2 alusel vastu samaväärsust kinnitav otsus, mis hõlmab käesoleva määruse lisas osutatud börsiväliseid tuletislepinguid:

i) 60 päeva pärast seda, kui jõustub määruse (EL) nr 648/2012 artikli 4 kohaldamise eesmärgil kõnealuse määruse artikli 13 lõike 2 alusel asjaomase kolmanda riigi suhtes vastu võetud otsus, mis hõlmab käesoleva määruse lisas osutatud börsiväliseid tuletislepinguid;

ii) kuupäev, mil lõike 1 kohaselt jõustub kliiringukohustus.

▼B

Seda erandit kohaldatakse ainult juhul, kui vastaspooled vastavad järgmistele tingimustele:

a) kolmandas riigis asutatud vastaspool on kas finantssektori vastaspool või finantssektoriväline vastaspool;

b) liidus asutatud vastaspool on

i) finantssektori vastaspool, finantssektoriväline vastaspool, finantsvaldusettevõtja, finantsasutus või abiettevõtja, kelle suhtes kohaldatakse asjakohaseid usaldatavusnõudeid, ja punktis a osutatud vastaspool on finantssektori vastaspool või

ii) kas finantssektori vastaspool või finantssektoriväline vastaspool ja punktis a osutatud vastaspool on finantssektoriväline vastaspool;

c) mõlemad vastaspooled on täielikult hõlmatud sama konsolideeritud aruandlusega vastavalt määruse (EL) nr 648/2012 artikli 3 lõikele 3;

d) mõlema vastaspoole suhtes kohaldatakse sobivaid keskseid riski hindamise, mõõtmise ja kontrollimise protseduure;

e) liidus asutatud vastaspool on teatanud asjaomasele pädevale asutusele kirjalikult, et punktides a, b, c ja d sätestatud tingimused on täidetud, ning pädev asutus on kinnitanud 30 päeva jooksul pärast teate saamist, et kõnealused tingimused on täidetud.

Artikkel 4

Minimaalne järelejäänud tähtaeg

1. 1. kategooriasse kuuluvate finantssektori vastaspoolte puhul peab määruse (EL) nr 648/2012 artikli 4 lõike 1 punkti b alapunktis ii osutatud minimaalne järelejäänud tähtaeg olema kliiringukohustuse jõustumise kuupäeva seisuga järgmine:

a) 50 aastat lepingute puhul, mis on sõlmitud või uuendatud enne 21. veebruari 2016 ja mis on lisa tabelis 1 või 2 esitatud liiki;

▼B

b) 3 aastat lepingute puhul, mis on sõlmitud või uuendatud enne 21. veebruari 2016 ja mis on lisa tabelis 3 või 4 esitatud liiki;

c) 6 kuud lepingute puhul, mis on sõlmitud või uuendatud pärast 21. veebruari 2016 või nimetatud kuupäeval ja mis on lisa tabelites 1–4 esitatud liiki.

2. 2. kategooriasse kuuluvate finantssektori vastaspoolte puhul peab määruse (EL) nr 648/2012 artikli 4 lõike 1 punkti b alapunktis ii osutatud minimaalne järelejäänud tähtaeg olema kliiringukohustuse jõustumise kuupäeva seisuga järgmine:

a) 50 aastat lepingute puhul, mis on sõlmitud või uuendatud enne 21. maid 2016 ja mis on lisa tabelis 1 või 2 esitatud liiki;

b) 3 aastat lepingute puhul, mis on sõlmitud või uuendatud enne 21. maid 2016 ja mis on lisa tabelis 3 või 4 esitatud liiki;

c) 6 kuud lepingute puhul, mis on sõlmitud või uuendatud pärast 21. maid 2016 või nimetatud kuupäeval ja mis on lisa tabelites 1–4 esitatud liiki.

3. 3. kategooriasse kuuluvate finantssektori vastaspoolte ja käesoleva määruse artikli 3 lõikes 2 osutatud finantssektori vastaspoolte vaheliste tehingute puhul peab määruse (EL) nr 648/2012 artikli 4 lõike 1 punkti b alapunktis ii osutatud minimaalne järelejäänud tähtaeg olema kliiringukohustuse jõustumise kuupäeva seisuga järgmine:

a) lisa tabelis 1 või 2 esitatud lepingute liikide korral 50 aastat;

b) lisa tabelis 3 või 4 esitatud lepingute liikide korral 3 aastat.

4. Kui lepingu sõlmivad kaks erinevatesse vastaspoolte kategooriatesse kuuluvat finantssektori vastaspoolt või kaks finantssektori vastaspoolt, kes on seotud artikli 3 lõikes 2 osutatud tehingutega, võetakse käesoleva artikli kohaldamisel arvesse minimaalset järelejäänud tähtaega, mis on järelejäänud tähtaegadest pikem.

Artikkel 5

Jõustumine

Käesolev määrus jõustub kahekümnendal päeval pärast selle avaldamist *Euroopa Liidu Teatajas*.

Käesolev määrus on tervikuna siduv ja vahetult kohaldatav kõikides liikmesriikides.

▼B

LISA

Börsiväliste intressimäära tuletisinstrumentide liigid, mille suhtes kohaldatakse kliiringukohustust

Tabel 1

Baasvahetustehingute liigid

Tunnus	Liik	Võrdlusindeks	Arveldusvaluuta	Tähtaeg	Arveldusvaluuta liik	Vaba valik	Tingliku väärtuse liik
A.1.1	baas	EURIBOR	EUR	28P–50A	üks valuuta	ei	konstantne või muutuv
A.1.2	baas	LIBOR	GBP	28P–50A	üks valuuta	ei	konstantne või muutuv
A.1.3	baas	LIBOR	JPY	28P–30A	üks valuuta	ei	konstantne või muutuv
A.1.4	baas	LIBOR	USD	28P–50A	üks valuuta	ei	konstantne või muutuv

Tabel 2

Intressimäärade vahetustehingute liigid, mille puhul fikseeritud intressimäär asendatakse ujuva intressimääraga (*Fixed-to-Float*)

Tunnus	Liik	Võrdlusindeks	Arveldusvaluuta	Tähtaeg	Arveldusvaluuta liik	Vaba valik	Tingliku väärtuse liik
A.2.1	Fixed-to-Float	EURIBOR	EUR	28P–50A	üks valuuta	ei	konstantne või muutuv
A.2.2	Fixed-to-Float	LIBOR	GBP	28P–50A	üks valuuta	ei	konstantne või muutuv
A.2.3	Fixed-to-Float	LIBOR	JPY	28P–30A	üks valuuta	ei	konstantne või muutuv
A.2.4	Fixed-to-Float	LIBOR	USD	28P–50A	üks valuuta	ei	konstantne või muutuv

Tabel 3

Intressiforvardite liigid

Tunnus	Liik	Võrdlusindeks	Arveldusvaluuta	Tähtaeg	Arveldusvaluuta liik	Vaba valik	Tingliku väärtuse liik
A.3.1	FRA	EURIBOR	EUR	3P–3A	üks valuuta	ei	konstantne või muutuv
A.3.2	FRA	LIBOR	GBP	3P–3A	üks valuuta	ei	konstantne või muutuv
A.3.3	FRA	LIBOR	USD	3P–3A	üks valuuta	ei	konstantne või muutuv

▼B

Tabel 4

Üleööintressi-vahetustehingute liigid

Tunnus	Liik	Võrdlusind-eks	Arveldusvalu-uta	Tähtaeg	Arveldusvaluuta liik	Vaba valik	Tingliku väärtuse liik
A.4.1	OIS	EONIA	EUR	7P–3A	üks valuuta	ei	konstantne või muutuv
A.4.2	OIS	FedFunds	USD	7P–3A	üks valuuta	ei	konstantne või muutuv
A.4.3	OIS	SONIA	GBP	7P–3A	üks valuuta	ei	konstantne või muutuv