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) 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

(текст от значение за ЕИП)

(ОВ L 314, 1.12.2015 г., стр. 13)

Изменен със:

		Официален вестник		
		№	страница	дата
►**M1**	Делегиран регламент (ЕС) 2017/751 на Комисията от 16 март 2017 година	L 113	15	29.4.2017 г.
►**M2**	Делегиран регламент (ЕС) 2019/667 на Комисията от 19 декември 2018 година	L 113	1	29.4.2019 г.
►**M3**	Делегиран регламент (ЕС) 2020/447 на Комисията от 16 декември 2019 година	L 94	5	27.3.2020 г.

▼B

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

(текст от значение за ЕИП)

Член 1

Класове извънборсови деривати, които подлежат на задължителен клиринг

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

▼M3

_____

▼B

Член 2

1. За целите на членове 3 и 4 контрагентите, за които се прилага задължението за клиринг, се разделят на следните категории:

а) категория 1, включваща контрагенти, които към датата на влизане в сила на настоящия регламент са клирингови членове по смисъла на член 2, точка 14 от Регламент (ЕС) № 648/2012, за поне един от класовете извънборсови деривати, посочени в приложението към настоящия регламент, на поне един от централните контрагенти, 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, които принадлежат към група, чиято обща остатъчна брутна условна стойност на дериватите, на които се извършва нецентрализиран клиринг, в края на месеца надхвърля средно 8 милиарда евро през януари, февруари и март 2016 г., и които попадат в някоя от следните категории:

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 ([1]), които са нефинансови контрагенти;

в) категория 3, включваща контрагенти, които не принадлежат към категория 1 или категория 2, които попадат в някоя от следните категории:

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;

([1]) Директива 2011/61/ЕС на Европейския парламент и на Съвета от 8 юни 2011 г. 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

г) категория 4, включваща нефинансови контрагенти, които не принадлежат към категория 1, категория 2 или категория 3.

2. За целите на изчисляване на груповата обща средна стойност на остатъчната брутна условна стойност в края на месеца, посочена в параграф 1, буква б), са включени всички групови деривати, на които се извършва нецентрализиран клиринг, включително и 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, 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, на които влиза в сила задължението за клиринг

1. По отношение на договорите, принадлежащи към клас извънборсови деривати, посочен в приложението, задължението за клиринг влиза в сила на:

а) 21 юни 2016 г. за контрагентите от категория 1;

б) 21 декември 2016 г. за контрагентите в категория 2;

▼M1

в) 21 юни 2019 г. за контрагентите от категория 3;

▼B

г) 21 декември 2018 г. за контрагентите в категория 4.

В случаите, когато договорът е сключен между двама контрагенти, попадащи в различни категории контрагенти, задължението за клиринг на този договор влиза в сила на по-късната дата.

▼M2

2. Чрез дерогация от параграф 1, по отношение на договорите, отнасящи се до клас извънборсови деривати, посочен в приложението, и сключени между контрагенти, които 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 влиза в сила на:

а) 21 декември 2020 г., в случай че по отношение на 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 приложението към настоящия регламент; или

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

▼M2

б) по-късната от следните дати, в случай че по отношение на 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 приложението към настоящия регламент:

i) 60 дни след датата на влизане в сила на решението по отношение на 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 приложението към настоящия регламент;

ii) датата, на която задължението за клиринг влиза в сила в съответствие с параграф 1.

▼B

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, финансов холдинг, 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 влиза в сила, е:

а) 50 години за договори, сключени или подновени преди 21 февруари 2016 г., които принадлежат към класовете в таблица 1 или таблица 2, изложени в приложението;

▼B

б) 3 години за договори, сключени или подновени преди 21 февруари 2016 г., които принадлежат към класовете в таблица 3 или таблица 4, изложени в приложението;

в) 6 месеца за договори, сключени или подновени на или след 21 февруари 2016 г., които принадлежат към класовете в таблици 1, 2, 3 и 4, изложени в приложението.

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 влиза в сила, е:

а) 50 години за договори, сключени или подновени преди 21 май 2016 г., които принадлежат към класовете в таблица 1 или таблица 2, изложени в приложението;

б) 3 години за договори, сключени или подновени преди 21 май 2016 г., които принадлежат към класовете в таблица 3 или таблица 4, изложени в приложението;

в) 6 месеца за договори, сключени или подновени на или след 21 май 2016 г., които принадлежат към класовете в таблици 1, 2, 3 и 4, изложени в приложението.

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 влиза в сила, е:

а) 50 години за договори, които принадлежат към класовете от таблица 1 или таблица 2, изложени в приложението;

б) 3 години за договори, които принадлежат към класовете от таблица 3 или таблица 4, изложени в приложението.

4. В случаите, когато договорът е сключен между двама финансови контрагенти, принадлежащи към различни категории, или между двама финансови контрагенти, участващи в трансакциите, посочени в 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, които са предмет на задължението за клиринг

Таблица 1

Класове базови суапове

Номер	Вид	Референтен индекс	Валута на сетълмента	Срок до падежа	Вид валута на сетълмента	Опция	Вид условна стойност
A.1.1	Basis	EURIB-OR	EUR	28Д—50Г	Единична валута	Не	Постоянна или променлива
A.1.2	Basis	LIBOR	GBP	28Д—50Г	Единична валута	Не	Постоянна или променлива
A.1.3	Basis	LIBOR	JPY	28Д—30Г	Единична валута	Не	Постоянна или променлива
A.1.4	Basis	LIBOR	USD	28Д—50Г	Единична валута	Не	Постоянна или променлива

Таблица 2

Класове лихвени суапове с фиксирана и променлива лихва (fixed-to-float swaps)

Номер	Вид	Референтен индекс	Валута на сетълмента	Срок до падежа	Вид валута на сетълмента	Опция	Вид условна стойност
A.2.1	Fixed-to-Float	EURIB-OR	EUR	28Д—5-0Г	Единична валута	Не	Постоянна или променлива
A.2.2	Fixed-to-Float	LIBOR	GBP	28Д—5-0Г	Единична валута	Не	Постоянна или променлива
A.2.3	Fixed-to-Float	LIBOR	JPY	28Д—3-0Г	Единична валута	Не	Постоянна или променлива
A.2.4	Fixed-to-Float	LIBOR	USD	28Д—5-0Г	Единична валута	Не	Постоянна или променлива

Таблица 3

Класове форуърдни лихвени споразумения (forward rate agreement)

Номер	Вид	Референтен индекс	Валута на сетълмента	Срок до падежа	Вид валута на сетълмента	Опция	Вид условна стойност
A.3.1	FRA	EURIB-OR	EUR	3Д—3Г	Единична валута	Не	Постоянна или променлива
A.3.2	FRA	LIBOR	GBP	3Д—3Г	Единична валута	Не	Постоянна или променлива
A.3.3	FRA	LIBOR	USD	3Д—3Г	Единична валута	Не	Постоянна или променлива

▼B

Таблица 4

Класове овърнайт индекс суапове (overnight index swaps)

Номер	Вид	Референтен индекс	Валута на сетълмента	Срок до падежа	Вид валута на сетълмента	Опция	Вид условна стойност
A.4.1	OIS	EONIA	EUR	7Д—3Г	Единична валута	Не	Постоянна или променлива
A.4.2	OIS	Fedfunds	USD	7Д—3Г	Единична валута	Не	Постоянна или променлива
A.4.3	OIS	SONIA	GBP	7Д—3Г	Единична валута	Не	Постоянна или променлива