Tento dokument slouží výhradně k informačním účelům a nemá žádný právní účinek. Orgány a instituce Evropské unie nenesou za jeho obsah žádnou odpovědnost. Závazná znění příslušných právních předpisů, včetně jejich právních východisek a odůvodnění, jsou zveřejněna v Úředním věstníku Evropské unie a jsou k dispozici v databázi EUR-Lex. Tato úřední znění jsou přímo dostupná přes odkazy uvedené v tomto dokumentu

►B

NAŘÍZENÍ KOMISE V PŘENESENÉ PRAVOMOCI (EU) 2015/2205

ze dne 6. srpna 2015,

kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 648/2012, pokud jde o regulační technické normy pro povinnost clearingu

(Text s významem pro EHP)

(Úř. věst. L 314, 1.12.2015, s. 13)

Ve znění:

		Úřední věstník		
		Č.	Strana	Datum
►M1	Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/751 ze dne 16. března 2017	L 113	15	29.4.2017
►M2	Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2019/667 ze dne 19. prosince 2018	L 113	1	29.4.2019
►M3	Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2020/447 ze dne 16. prosince 2019	L 94	5	27.3.2020

▼B

NAŘÍZENÍ KOMISE V PŘENESENÉ PRAVOMOCI (EU) 2015/2205

ze dne 6. srpna 2015,

kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 648/2012, pokud jde o regulační technické normy pro povinnost clearingu

(Text s významem pro EHP)

Článek 1

Kategorie OTC derivátů, které podléhají povinnosti clearingu

1. Povinnosti clearingu podléhají kategorie mimoburzovních (OTC) derivátů uvedené v příloze.

▼M3

_____

▼B

Článek 2

1. Pro účely článků 3 a 4 se smluvní strany podléhající povinnosti clearingu dělí do těchto kategorií:

a) kategorie 1 zahrnuje smluvní strany, které jsou ke dni, kdy toto nařízení vstoupí v platnost, pro alespoň jednu kategorii OTC derivátů uvedenou v příloze tohoto nařízení členy clearingového systému ve smyslu čl. 2 bodu 14 nařízení (EU) č. 648/2012 alespoň jedné ústřední protistrany, jež byla před tímto dnem povolena nebo uznána pro provádění clearingu nejméně jedné z těchto kategorií;

b) kategorie 2 zahrnuje smluvní strany, které nespadají do kategorie 1 a patří ke skupině, jejíž celková průměrná hrubá pomyslná hodnota nevypořádaných derivátů, u nichž se neprovádí centrální clearing, na konci měsíce ledna, února a března 2016 přesahuje 8 miliard EUR, a které jsou:

   i) finančními smluvními stranami; nebo

   ii) alternativními investičními fondy definovanými v čl. 4 odst. 1 písm. a) směrnice Evropského parlamentu a Rady 2011/61/EU ([1]), jež jsou nefinančními smluvními stranami;

c) kategorie 3 zahrnuje smluvní strany, které nepatří do kategorie 1 nebo kategorie 2 a jsou:

   i) finančními smluvními stranami;

   ii) alternativními investičními fondy definovanými v čl. 4 odst. 1 písm. a) směrnice 2011/61/EU, jež jsou nefinančními smluvními stranami;

([1]) Směrnice Evropského parlamentu a Rady 2011/61/EU ze dne 8. června 2011 o správcích alternativních investičních fondů a o změně směrnic 2003/41/ES a 2009/65/ES a nařízení (ES) č. 1060/2009 a (EU) č. 1095/2010 (Úř. věst. L 174, 1.7.2011, s. 1).

▼B

d) kategorie 4 zahrnuje nefinanční smluvní strany, které nepatří do kategorie 1, kategorie 2 nebo kategorie 3.

2. Pro účely výpočtu celkového skupinového průměru nevypořádaných hrubých pomyslných hodnot na konci měsíce, který je uveden v odst. 1 písm. b), by měly být uvažovány všechny deriváty skupiny, u nichž se neprovádí centrální clearing, včetně měnových forwardů, swapů a měnových swapů.

3. Pokud jsou smluvními stranami alternativní investiční fondy definované v čl. 4 odst. 1 písm. a) směrnice 2011/61/EU nebo subjekty kolektivního investování do převoditelných cenných papírů definované v čl. 1 odst. 2 směrnice Evropského parlamentu a Rady 2009/65/ES ([1]), použije se práh ve výši 8 miliard EUR stanovený v odst. 1 písm. b) tohoto článku jednotlivě na úrovni fondů.

Článek 3

Data, kdy povinnost clearingu nabývá účinnosti

1. Pokud jde o smlouvy patřící do určité kategorie OTC derivátů uvedené v příloze, nabývá povinnost clearingu účinnosti:

a) 21. června 2016 u smluvních stran z kategorie 1;

b) 21. prosince 2016 u smluvních stran z kategorie 2;

▼M1

c) 21. června 2019 u smluvních stran z kategorie 3;

▼B

d) 21. prosince 2018 u smluvních stran z kategorie 4.

Pokud je smlouva uzavřena mezi dvěma smluvními stranami, které patří do různých kategorií smluvních stran, nabývá u této smlouvy povinnost clearingu účinnosti pozdějším z uvedených dní.

▼M2

2. Pokud se jedná o smlouvy, jež náleží do určité kategorie OTC derivátů uvedené v příloze a jsou uzavřeny mezi smluvními stranami, které jsou součástí téže skupiny, přičemž jedna smluvní strana je usazena ve třetí zemi a druhá smluvní strana je usazena v Unii, nabývá odchylně od odstavce 1 povinnost clearingu účinnosti:

a) 21. prosince 2020, pokud v souvislosti s příslušnou třetí zemí nebylo přijato žádné rozhodnutí o rovnocennosti podle čl. 13 odst. 2 nařízení (EU) č. 648/2012 pro účely článku 4 téhož nařízení týkající se OTC derivátových smluv uvedených v příloze tohoto nařízení; nebo

([1]) Směrnice Evropského parlamentu a Rady 2009/65/ES ze dne 13. července 2009 o koordinaci právních a správních předpisů týkajících se subjektů kolektivního investování do převoditelných cenných papírů (SKIPCP) (Úř. věst. L 302, 17.11.2009, s. 32).

▼M2

b) pozdějším z níže uvedených dní, pokud bylo v souvislosti s příslušnou třetí zemí přijato rozhodnutí o rovnocennosti podle čl. 13 odst. 2 nařízení (EU) č. 648/2012 pro účely článku 4 téhož nařízení týkající se OTC derivátových smluv uvedených v příloze tohoto nařízení:

i) 60 dní ode dne, kdy rozhodnutí přijaté v souvislosti s příslušnou třetí zemí podle čl. 13 odst. 2 nařízení (EU) č. 648/2012 pro účely článku 4 téhož nařízení týkající se OTC derivátových smluv uvedených v příloze tohoto nařízení vstoupí v platnost;

ii) dnem, kdy povinnost clearingu nabývá účinnosti podle odstavce 1.

▼B

Tato odchylka se použije pouze tehdy, pokud smluvní strany splňují tyto podmínky:

a) smluvní strana usazená ve třetí zemi je buď finanční smluvní stranou, nebo nefinanční smluvní stranou;

b) smluvní strana usazená v Unii je:

i) finanční smluvní stranou, nefinanční smluvní stranou, finanční holdingovou společností, finanční institucí nebo podnikem pomocných služeb podléhajícím vhodným obezřetnostním požadavkům, a smluvní strana podle písmene a) je finanční smluvní stranou; nebo

ii) buď finanční smluvní stranou, nebo nefinanční smluvní stranou a smluvní strana podle písmene a) je nefinanční smluvní stranou;

c) obě smluvní strany jsou plně zahrnuty do stejné konsolidace v souladu s čl. 3 odst. 3 nařízení (EU) č. 648/2012;

d) obě smluvní strany podléhají vhodným centralizovaným postupům pro hodnocení, měření a kontrolu rizik;

e) smluvní strana usazená v Unii písemně oznámila příslušnému orgánu, že podmínky stanovené v písmenech a), b), c) a d) jsou splněny, a tento příslušný orgán ve lhůtě 30 kalendářních dnů poté, co oznámení obdržel, potvrdil, že uvedené podmínky jsou splněny.

Článek 4

Minimální zbývající doba splatnosti

1. Minimální zbývající doba splatnosti uvedená v čl. 4 odst. 1 písm. b) bodě ii) nařízení (EU) č. 648/2012 ke dni, kdy povinnost clearingu nabývá účinnosti, v případě finančních smluvních stran z kategorie 1 činí:

a) 50 let u smluv uzavřených nebo obnovených před dnem 21. února 2016, které patří do kategorií uvedených v tabulce 1 nebo tabulce 2 v příloze;

▼B

b) 3 roky u smluv uzavřených nebo obnovených před dnem 21. února 2016, které patří do kategorií uvedených v tabulce 3 nebo tabulce 4 v příloze;

c) 6 měsíců u smluv uzavřených nebo obnovených dne 21. února 2016 nebo později, které patří do kategorií uvedených v některé z tabulek 1 až 4 v příloze.

2. Minimální zbývající doba splatnosti uvedená v čl. 4 odst. 1 písm. b) bodě ii) nařízení (EU) č. 648/2012 ke dni, kdy povinnost clearingu nabývá účinnosti, v případě finančních smluvních stran z kategorie 2 činí:

a) 50 let u smluv uzavřených nebo obnovených před dnem 21. května 2016, které patří do kategorií uvedených v tabulce 1 nebo tabulce 2 v příloze;

b) 3 roky u smluv uzavřených nebo obnovených před dnem 21. května 2016, které patří do kategorií uvedených v tabulce 3 nebo tabulce 4 v příloze;

c) 6 měsíců u smluv uzavřených nebo obnovených dne 21. května 2016 nebo později, které patří do kategorií uvedených v některé z tabulek 1 až 4 v příloze.

3. Minimální zbývající doba splatnosti uvedená v čl. 4 odst. 1 písm. b) bodě ii) nařízení (EU) č. 648/2012 ke dni, kdy povinnost clearingu nabývá účinnosti, v případě finančních smluvních stran z kategorie 3 a v případě obchodů uvedených v čl. 3 odst. 2 tohoto nařízení uzavřených mezi finančními smluvními stranami činí:

a) 50 let u smluv, které patří do kategorií uvedených v tabulce 1 nebo tabulce 2 v příloze;

b) 3 roky u smluv, které patří do kategorií uvedených v tabulce 3 nebo tabulce 4 v příloze.

4. Pokud je smlouva uzavřena mezi dvěma finančními smluvními stranami patřícími do různých kategorií nebo mezi dvěma finančními smluvními stranami, které jsou zapojeny do obchodů uvedených v čl. 3 odst. 2, je třeba pro účely tohoto článku vzít v úvahu delší použitelnou minimální zbývající dobu splatnosti.

Článek 5

Vstup v platnost

Toto nařízení vstupuje v platnost dvacátým dnem po vyhlášení v *Úředním věstníku Evropské unie*.

Toto nařízení je závazné v celém rozsahu a přímo použitelné ve všech členských státech.

▼B

PŘÍLOHA

Kategorie OTC úrokových derivátů, které podléhají povinnosti clearingu

Tabulka 1

Kategorie bazických swapů

id	Druh	Referenční sazba	Vypořádací měna	Splatnost	Typ vypořádací měny	S opcí	Typ nominální hodnoty
A.1.1	Bazický	EURIB-OR	EUR	28D–50R	Jedna měna	Ne	Konstantní nebo variabilní
A.1.2	Bazický	LIBOR	GBP	28D–50R	Jedna měna	Ne	Konstantní nebo variabilní
A.1.3	Bazický	LIBOR	JPY	28D–30R	Jedna měna	Ne	Konstantní nebo variabilní
A.1.4	Bazický	LIBOR	USD	28D–50R	Jedna měna	Ne	Konstantní nebo variabilní

Tabulka 2

Kategorie kuponových swapů

id	Druh	Referenční sazba	Vypořádací měna	Splatnost	Typ vypořádací měny	S opcí	Typ nominální hodnoty
A.2.1	Kuponový	EURIB-OR	EUR	28D–50R	Jedna měna	Ne	Konstantníneboabilní
A.2.2	Kuponový	LIBOR	GBP	28D–50R	Jedna měna	Ne	Konstantníneboabilní
A.2.3	Kuponový	LIBOR	JPY	28D–30R	Jedna měna	Ne	Konstantníneboabilní
A.2.4	Kuponový	LIBOR	USD	28D–50R	Jedna měna	Ne	Konstantní neboabilní

Tabulka 3

Kategorie dohod o budoucí úrokové míře

id	Druh	Referenční sazba	Vypořádací měna	Splatnost	Typ vypořádací měny	S opcí	Typ nominální hodnoty
A.3.1	FRA	EURIB-OR	EUR	3D–3R	Jedna měna	Ne	Konstantní nebo variabilní
A.3.2	FRA	LIBOR	GBP	3D–3R	Jedna měna	Ne	Konstantní nebo variabilní
A.3.3	FRA	LIBOR	USD	3D–3R	Jedna měna	Ne	Konstantní nebo variabilní

▼B

Tabulka 4

Kategorie swapů s jednodenní sazbou („overnight index swap“)

id	Druh	Referenční sazba	Vypořádací měna	Splatnost	Typ vypořádací měny	S opcí	Typ nominální hodnoty
A.4.1	OIS	EONIA	EUR	7D–3R	Jedna měna	Ne	Konstantní nebo variabilní
A.4.2	OIS	FedFunds	USD	7D–3R	Jedna měna	Ne	Konstantní nebo variabilní
A.4.3	OIS	SONIA	GBP	7D–3R	Jedna měna	Ne	Konstantní nebo variabilní