Το κείμενο αυτό αποτελεί απλώς εργαλείο τεκμηρίωσης και δεν έχει καμία νομική ισχύ. Τα θεσμικά όργανα της Ένωσης δεν φέρουν καμία ευθύνη για το περιεχόμενό του. Τα αυθεντικά κείμενα των σχετικών πράξεων, συμπεριλαμβανομένων των προοιμίων τους, είναι εκείνα που δημοσιεύονται στην Επίσημη Εφημερίδα της Ευρωπαϊκής Ένωσης και είναι διαθέσιμα στο EUR-Lex. Αυτά τα επίσημα κείμενα είναι άμεσα προσβάσιμα μέσω των συνδέσμων που περιέχονται στο παρόν έγγραφο

►**B** **ΚΑΤ' ΕΞΟΥΣΙΟΔΟΤΗΣΗ ΚΑΝΟΝΙΣΜΟΣ (ΕΕ) 2015/2205 ΤΗΣ ΕΠΙΤΡΟΠΗΣ**

της 6ης Αυγούστου 2015

για τη συμπλήρωση του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου όσον αφορά ρυθμιστικά τεχνικά πρότυπα για την υποχρέωση εκκαθάρισης

(Κείμενο που παρουσιάζει ενδιαφέρον για τον ΕΟΧ)

(ΕΕ L 314 της 1.12.2015, σ. 13)

Τροποποιείται από:

		Επίσημη Εφημερίδα		
		αριθ.	σελίδα	ημερομηνία
►**M1**	Κατ' εξουσιοδότηση κανονισμός (ΕΕ) 2017/751 της Επιτροπής της 16ης Μαρτίου 2017	L 113	15	29.4.2017
►**M2**	Κατ' εξουσιοδότηση κανονισμός (ΕΕ) 2019/667 της Επιτροπής της 19ης Δεκεμβρίου 2018	L 113	1	29.4.2019
►**M3**	Κατ' εξουσιοδότηση κανονισμός (ΕΕ) 2020/447 της Επιτροπής της 16ης Δεκεμβρίου 2019	L 94	5	27.3.2020

Διορθώνεται από:

►**C1** Διορθωτικό ΕΕ L 202 της 28.7.2016, σ. 56 (2015/2205)

▼B

ΚΑΤ' ΕΞΟΥΣΙΟΔΟΤΗΣΗ ΚΑΝΟΝΙΣΜΟΣ (ΕΕ) 2015/2205 ΤΗΣ ΕΠΙΤΡΟΠΗΣ

της 6ης Αυγούστου 2015

για τη συμπλήρωση του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου όσον αφορά ρυθμιστικά τεχνικά πρότυπα για την υποχρέωση εκκαθάρισης

(Κείμενο που παρουσιάζει ενδιαφέρον για τον ΕΟΧ)

Άρθρο 1

Κατηγορίες εξωχρηματιστηριακών παραγώγων που υπόκεινται στην υποχρέωση εκκαθάρισης

1. Οι κατηγορίες εξωχρηματιστηριακών παραγώγων που ορίζονται στο παράρτημα Ι υπόκεινται στην υποχρέωση εκκαθάρισης.

▼M3

_____

▼B

Άρθρο 2

1. Για τους σκοπούς των άρθρων 3 και 4, οι αντισυμβαλλόμενοι που υπόκεινται στην υποχρέωση εκκαθάρισης υποδιαιρούνται στις κατωτέρω κατηγορίες:

α) κατηγορία 1, η οποία περιλαμβάνει τους αντισυμβαλλομένους οι οποίοι, κατά την ημερομηνία έναρξης ισχύος του παρόντος κανονισμού, είναι εκκαθαριστικά μέλη, κατά την έννοια του άρθρου 2 σημείο 14 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012, για μία τουλάχιστον από τις κατηγορίες εξωχρηματιστηριακών παραγώγων που αναφέρονται στο παράρτημα του παρόντος κανονισμού, τουλάχιστον ενός από τους CCP που έχουν λάβει άδεια ή αναγνωριστεί πριν από την εν λόγω ημερομηνία για την εκκαθάριση μιας τουλάχιστον από αυτές τις κατηγορίες·

β) κατηγορία 2, η οποία περιλαμβάνει τους αντισυμβαλλομένους που δεν ανήκουν στην κατηγορία 1 και ανήκουν σε όμιλο του οποίου ο αθροιστικός μέσος όρος, του τέλους του μήνα, του εκκρεμούς ακαθάριστου ονομαστικού ποσού των μη κεντρικώς εκκαθαριζόμενων παραγώγων για τον Ιανουάριο, Φεβρουάριο και Μάρτιο 2016 είναι πάνω από 8 δισεκατ. ευρώ και συγκαταλέγονται στους εξής:

   i) χρηματοοικονομικοί αντισυμβαλλόμενοι·

   ii) οργανισμοί εναλλακτικών επενδύσεων, όπως ορίζονται στο άρθρο 4 σημείο 1 στοιχείο α) της οδηγίας 2011/61/ΕΕ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου ([1]), οι οποίοι είναι μη χρηματοοικονομικοί αντισυμβαλλόμενοι·

γ) κατηγορία 3, η οποία περιλαμβάνει τους αντισυμβαλλομένους που δεν ανήκουν στην κατηγορία 1 ή την κατηγορία 2 και συγκαταλέγονται στους εξής:

   i) χρηματοοικονομικοί αντισυμβαλλόμενοι·

   ii) οργανισμοί εναλλακτικών επενδύσεων, όπως ορίζονται στο άρθρο 4 σημείο 1) στοιχείο α) της οδηγίας 2011/61/ΕΕ, οι οποίοι είναι μη χρηματοοικονομικοί αντισυμβαλλόμενοι·

([1]) Οδηγία 2011/61/ΕΕ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 8ης Ιουνίου 2011, σχετικά με τους διαχειριστές οργανισμών εναλλακτικών επενδύσεων και για την τροποποίηση των οδηγιών 2003/41/ΕΚ και 2009/65/ΕΚ και των κανονισμών (ΕΚ) αριθ. 1060/2009 και (ΕΕ) αριθ. 1095/2010 (ΕΕ L 174 της 1.7.2011, σ. 1).

▼B

δ) Κατηγορία 4, η οποία περιλαμβάνει μη χρηματοοικονομικούς αντισυμβαλλομένους που δεν ανήκουν στην κατηγορία 1, την κατηγορία 2 ή την κατηγορία 3.

2. Για τους σκοπούς του υπολογισμού του αθροιστικού μέσου όρου, του τέλους του μήνα, του εκκρεμούς ακαθάριστου ονομαστικού ποσού του ομίλου, που αναφέρεται στην παράγραφο 1 στοιχείο β), λαμβάνονται υπόψη όλα τα μη κεντρικά εκκαθαριζόμενα παράγωγα του ομίλου, συμπεριλαμβανομένων των προθεσμιακών πράξεων συναλλάγματος, των συμφωνιών ανταλλαγής και των συμφωνιών ανταλλαγής συναλλάγματος.

3. Σε περίπτωση που οι αντισυμβαλλόμενοι είναι οργανισμοί εναλλακτικών επενδύσεων, όπως ορίζονται στο άρθρο 4 παράγραφος 1 στοιχείο α) της οδηγίας 2011/61/ΕΕ ή οργανισμοί συλλογικών επενδύσεων σε κινητές αξίες, όπως ορίζονται στο άρθρο 1 παράγραφος 2 της οδηγίας 2009/65/ΕΚ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου ([1]), το όριο των 8 δισεκατ. ευρώ που αναφέρεται στην παράγραφο 1 στοιχείο β) του παρόντος άρθρου εφαρμόζεται εξατομικευμένα σε επίπεδο κεφαλαίου.

Άρθρο 3

Ημερομηνίες από τις οποίες παράγει αποτελέσματα η υποχρέωση εκκαθάρισης

1. Σε σχέση με τις συμβάσεις που ανήκουν σε κατηγορία εξωχρηματιστηριακών παραγώγων που αναφέρονται στο παράρτημα Ι, η υποχρέωση εκκαθάρισης παράγει αποτελέσματα στις:

α) 21 Ιουνίου 2016 για τους αντισυμβαλλομένους κατηγορίας 1·

β) 21 Δεκεμβρίου 2016 για τους αντισυμβαλλομένους κατηγορίας 2·

▼M1

γ) 21 Ιουνίου 2019 για τους αντισυμβαλλομένους κατηγορίας 3·

▼B

δ) 21 Δεκεμβρίου 2018 για τους αντισυμβαλλομένους κατηγορίας 4.

Όταν συνάπτεται σύμβαση μεταξύ δύο αντισυμβαλλομένων που περιλαμβάνονται σε διαφορετικές κατηγορίες αντισυμβαλλομένων, η ημερομηνία από την οποία αρχίζει να παράγει αποτελέσματα η υποχρέωση εκκαθάρισης για την εν λόγω σύμβαση είναι η μεταγενέστερη ημερομηνία.

▼M2

2. Κατά παρέκκλιση από την παράγραφο 1, όσον αφορά τις συμβάσεις που αφορούν κατηγορία εξωχρηματιστηριακών παραγώγων που αναφέρεται στο παράρτημα και έχουν συναφθεί μεταξύ αντισυμβαλλομένων οι οποίοι αποτελούν μέρος του ιδίου ομίλου αλλά ο ένας αντισυμβαλλόμενος είναι εγκατεστημένος σε τρίτη χώρα και ο άλλος αντισυμβαλλόμενος είναι εγκατεστημένος στην Ένωση, η υποχρέωση εκκαθάρισης παράγει αποτελέσματα από:

α) τις 21 Δεκεμβρίου 2020, σε περίπτωση που δεν εκδόθηκε απόφαση ισοδυναμίας, σύμφωνα με το άρθρο 13 παράγραφος 2 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012 για τους σκοπούς του άρθρου 4 του εν λόγω κανονισμού, η οποία καλύπτει τις συμβάσεις εξωχρηματιστηριακών παραγώγων που περιλαμβάνονται στο παράρτημα του παρόντος κανονισμού όσον αφορά τη σχετική τρίτη χώρα· ή

([1]) Οδηγία 2009/65/ΕΚ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 13ης Ιουλίου 2009, για τον συντονισμό των νομοθετικών, κανονιστικών και διοικητικών διατάξεων σχετικά με ορισμένους οργανισμούς συλλογικών επενδύσεων σε κινητές αξίες (ΟΣΕΚΑ) (ΕΕ L 302 της 17.11.2009, σ. 32).

▼M2

β) τη μεταγενέστερη από τις κατωτέρω ημερομηνίες, σε περίπτωση που εκδόθηκε απόφαση ισοδυναμίας, σύμφωνα με το άρθρο 13 παράγραφος 2 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012 για τους σκοπούς του άρθρου 4 του εν λόγω κανονισμού, η οποία καλύπτει τις συμβάσεις εξωχρηματιστηριακών παραγώγων που αναφέρονται στο παράρτημα του παρόντος κανονισμού όσον αφορά τη σχετική τρίτη χώρα:

i) 60 ημέρες μετά την ημερομηνία έναρξης ισχύος της απόφασης που εκδόθηκε σύμφωνα με το άρθρο 13 παράγραφος 2 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012 για τους σκοπούς του άρθρου 4 του εν λόγω κανονισμού, η οποία καλύπτει τις συμβάσεις εξωχρηματιστηριακών παραγώγων που αναφέρονται στο παράρτημα του παρόντος κανονισμού όσον αφορά τη σχετική τρίτη χώρα·

ii) την ημερομηνία από την οποία παράγει αποτελέσματα η υποχρέωση εκκαθάρισης, σύμφωνα με την παράγραφο 1.

▼B

Αυτή η παρέκκλιση εφαρμόζεται μόνο σε περίπτωση που οι αντισυμβαλλόμενοι πληρούν τις κατωτέρω προϋποθέσεις:

α) ο αντισυμβαλλόμενος που είναι εγκατεστημένος σε τρίτη χώρα είναι είτε χρηματοοικονομικός αντισυμβαλλόμενος είτε μη χρηματοοικονομικός αντισυμβαλλόμενος·

β) ο αντισυμβαλλόμενος που είναι εγκατεστημένος στην Ένωση είναι:

i) χρηματοοικονομικός αντισυμβαλλόμενος, μη χρηματοοικονομικός αντισυμβαλλόμενος, εταιρεία χρηματοπιστωτικών συμμετοχών, χρηματοοικονομικό ίδρυμα ή επιχείρηση παροχής επικουρικών υπηρεσιών που υπόκειται σε ενδεδειγμένες απαιτήσεις προληπτικής εποπτείας και ο αντισυμβαλλόμενος που αναφέρεται στο στοιχείο α) είναι χρηματοοικονομικός αντισυμβαλλόμενος, ή

ii) είτε χρηματοοικονομικός αντισυμβαλλόμενος είτε μη χρηματοοικονομικός αντισυμβαλλόμενος και ο αντισυμβαλλόμενος που αναφέρεται στο στοιχείο α) είναι μη χρηματοοικονομικός αντισυμβαλλόμενος·

γ) αμφότεροι οι αντισυμβαλλόμενοι περιλαμβάνονται στην ίδια ενοποίηση σε πλήρη βάση, σύμφωνα με το άρθρο 3 παράγραφος 3 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012·

δ) αμφότεροι οι αντισυμβαλλόμενοι υπόκεινται σε διαδικασίες ενδεδειγμένης κεντρικής αξιολόγησης κινδύνων, μέτρησης και ελέγχου·

ε) ο αντισυμβαλλόμενος που είναι εγκατεστημένος στην Ένωση έχει κοινοποιήσει εγγράφως στην αρμόδια αρχή του ότι πληρούνται οι προϋποθέσεις που ορίζονται στα στοιχεία α), β), γ) και δ) και, εντός 30 ημερολογιακών ημερών από την παραλαβή της κοινοποίησης, η αρμόδια αρχή έχει επιβεβαιώσει ότι πληρούνται οι εν λόγω προϋποθέσεις.

Άρθρο 4

Ελάχιστη εναπομένουσα διάρκεια

1. Για τους χρηματοοικονομικούς αντισυμβαλλομένους κατηγορίας 1, η ελάχιστη εναπομένουσα διάρκεια που αναφέρεται στο άρθρο 4 παράγραφος 1 στοιχείο β) σημείο ii) του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012, κατά την ημερομηνία από την οποία παράγει αποτελέσματα η υποχρέωση εκκαθάρισης, είναι:

α) 50 έτη για τις συμβάσεις που έχουν συναφθεί ή ανανεωθεί πριν από τις 21 Φεβρουαρίου 2016 και ανήκουν στις κατηγορίες του πίνακα 1 ή του πίνακα 2, που παρατίθεται στο παράρτημα·

▼B

β) 3 έτη για τις συμβάσεις που έχουν συναφθεί ή ανανεωθεί πριν από τις 21 Φεβρουαρίου 2016 και ανήκουν στις κατηγορίες του πίνακα 3 ή του πίνακα 4, που παρατίθεται στο παράρτημα·

γ) ►C1 6 μήνες για τις συμβάσεις που έχουν συναφθεί ή ανανεωθεί από τις 21 Φεβρουαρίου 2016 και μετά και ανήκουν στις κατηγορίες των πινάκων 1 έως 4 του παραρτήματος. ◄

2. Για τους χρηματοοικονομικούς αντισυμβαλλομένους κατηγορίας 2, η ελάχιστη εναπομένουσα διάρκεια που αναφέρεται στο άρθρο 4 παράγραφος 1 στοιχείο β) σημείο ii) του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012, κατά την ημερομηνία από την οποία παράγει αποτελέσματα η υποχρέωση εκκαθάρισης, είναι:

α) 50 έτη για τις συμβάσεις που έχουν συναφθεί ή ανανεωθεί πριν από τις 21 Μαΐου 2016 και ανήκουν στις κατηγορίες του πίνακα 1 ή του πίνακα 2, που παρατίθεται στο παράρτημα·

β) 3 έτη για τις συμβάσεις που έχουν συναφθεί ή ανανεωθεί πριν από τις 21 Μαΐου 2016 και ανήκουν στις κατηγορίες του πίνακα 3 ή του πίνακα 4 του παραρτήματος·

γ) ►C1 6 μήνες για τις συμβάσεις που έχουν συναφθεί ή ανανεωθεί από τις 21 Μαΐου 2016 και μετά και ανήκουν στις κατηγορίες των πινάκων 1 έως 4 του παραρτήματος. ◄

3. Για τους χρηματοοικονομικούς αντισυμβαλλομένους κατηγορίας 3, και για τις συναλλαγές που αναφέρονται στο άρθρο 3 παράγραφος 2 του παρόντος κανονισμού και έχουν συναφθεί μεταξύ χρηματοοικονομικών αντισυμβαλλομένων, η ελάχιστη εναπομένουσα διάρκεια που αναφέρεται στο άρθρο 4 παράγραφος 1 στοιχείο β) σημείο ii) του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012, κατά την ημερομηνία από την οποία παράγει αποτελέσματα η υποχρέωση εκκαθάρισης, είναι:

α) 50 έτη για τις συμβάσεις που ανήκουν στις κατηγορίες του πίνακα 1 ή του πίνακα 2 του παραρτήματος·

β) 3 έτη για τις συμβάσεις που ανήκουν στις κατηγορίες του πίνακα 3 ή του πίνακα 4 του παραρτήματος.

4. Σε περίπτωση που μια σύμβαση συνάπτεται μεταξύ δύο χρηματοοικονομικών αντισυμβαλλομένων που ανήκουν σε διαφορετικές κατηγορίες ή μεταξύ δύο χρηματοοικονομικών αντισυμβαλλομένων που συμμετέχουν σε συναλλαγές που αναφέρονται στο άρθρο 3 παράγραφος 2, η ελάχιστη εναπομένουσα διάρκεια που πρέπει να λαμβάνεται υπόψη για τους σκοπούς του παρόντος άρθρου είναι η μεγαλύτερη εναπομένουσα διάρκεια που ισχύει.

Άρθρο 5

Έναρξη ισχύος

Ο παρών κανονισμός αρχίζει να ισχύει την εικοστή ημέρα από τη δημοσίευσή του στην *Επίσημη Εφημερίδα της Ευρωπαϊκής Ένωσης*.

Ο παρών κανονισμός είναι δεσμευτικός ως προς όλα τα μέρη του και ισχύει άμεσα σε κάθε κράτος μέλος.

▼B

ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ

Κατηγορίες εξωχρηματιστηριακών παραγώγων επιτοκίων που υπόκεινται στην υποχρέωση εκκαθάρισης

Πίνακας 1

κατηγορίες βασικών συμφωνιών ανταλλαγής

Αριθμός	Τύπος	Δείκτης αναφοράς	Νόμισμα εκκαθάρισης	Ληκτότητα	Τύπος νομίσματος εκκαθάρισης	Δυνατότητα επιλογής	Τύπος ονομαστικής αξίας
A.1.1	Βασικός	Euribor	EUR	28H-50E	Ενιαίο νόμισμα	Όχι	Σταθερός ή μεταβλητός
A.1.2	Βασικός	LIBOR	GBP	28H-50E	Ενιαίο νόμισμα	Όχι	Σταθερός ή μεταβλητός
A.1.3	Βασικός	LIBOR	JPY	28H-30E	Ενιαίο νόμισμα	Όχι	Σταθερός ή μεταβλητός
A.1.4	Βασικός	LIBOR	USD	28H-50E	Ενιαίο νόμισμα	Όχι	Σταθερός ή μεταβλητός

Πίνακας 2

Κατηγορίες βασικών συμφωνιών ανταλλαγής επιτοκίων σταθερά προς κυμαινόμενα

Αριθμός	Τύπος	Δείκτης αναφοράς	Νόμισμα εκκαθάρισης	Ληκτότητα	Τύπος νομίσματος εκκαθάρισης	Δυνατότητα επιλογής	Τύπος ονομαστικής αξίας
A.2.1	Σταθερό προς κυμαινόμενο	Euribor	EUR	28H-50E	Ενιαίο νόμισμα	Όχι	Σταθερός ή μεταβλητός
A.2.2	Σταθερό προς κυμαινόμενο	LIBOR	GBP	28H-50E	Ενιαίο νόμισμα	Όχι	Σταθερός ή μεταβλητός
A.2.3	Σταθερό προς κυμαινόμενο	LIBOR	JPY	28H-30E	Ενιαίο νόμισμα	Όχι	Σταθερός ή μεταβλητός
A.2.4	Σταθερό προς κυμαινόμενο	LIBOR	USD	28H-50E	Ενιαίο νόμισμα	Όχι	Σταθερός ή μεταβλητός

Πίνακας 3

κατηγορίες προθεσμιακών συμφωνιών επιτοκίου

Αριθμός	Τύπος	Δείκτης αναφοράς	Νόμισμα εκκαθάρισης	Ληκτότητα	Τύπος νομίσματος εκκαθάρισης	Δυνατότητα επιλογής	Τύπος ονομαστικής αξίας
A.3.1	FRA	Euribor	EUR	3H-3E	Ενιαίο νόμισμα	Όχι	Σταθερός ή μεταβλητός
A.3.2	FRA	LIBOR	GBP	3H-3E	Ενιαίο νόμισμα	Όχι	Σταθερός ή μεταβλητός
A.3.3	FRA	LIBOR	USD	3H-3E	Ενιαίο νόμισμα	Όχι	Σταθερός ή μεταβλητός

▼B

Πίνακας 4

Κατηγορίες συμφωνιών ανταλλαγής δείκτη για μία νύκτα

Αριθμός	Τύπος	Δείκτης αναφοράς	Νόμισμα εκκαθάρισης	Ληκτότητα	Τύπος νομίσματος εκκαθάρισης	Δυνατότητα επιλογής	Τύπος ονομαστικής αξίας
A.4.1	OIS	EONIA	EUR	7H-3E	Ενιαίο νόμισμα	Όχι	Σταθερός ή μεταβλητός
A.4.2.	OIS	FedFunds	USD	7H-3E	Ενιαίο νόμισμα	Όχι	Σταθερός ή μεταβλητός
A.4.3	OIS	SONIA	GBP	7H-3E	Ενιαίο νόμισμα	Όχι	Σταθερός ή μεταβλητός