Ez a dokumentum kizárólag tájékoztató jellegű és nem vált ki joghatást. Az EU intézményei semmiféle felelősséget nem vállalnak a tartalmáért. A jogi aktusoknak – ideértve azok bevezető hivatkozásait és preambulumbekezdéseit is – az Európai Unió Hivatalos Lapjában közzétett és az EUR-Lex portálon megtalálható változatai tekintendők hitelesnek. Az említett hivatalos szövegváltozatok közvetlenül elérhetők az ebben a dokumentumban elhelyezett linkeken keresztül

►B A BIZOTTSÁG (EU) 2015/2205 FELHATALMAZÁSON ALAPULÓ RENDELETE

(2015. augusztus 6.)

a 648/2012/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletnek az elszámolási kötelezettségre vonatkozó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről

(EGT-vonatkozású szöveg)

(HL L 314., 2015.12.1., 13. o.)

Módosította:

		Hivatalos Lap		
		Szám	Oldal	Dátum
►M1	A Bizottság (EU) 2017/751 felhatalmazáson alapuló rendelete (2017. március 16.)	L 113	15	2017.4.29.
►M2	A Bizottság (EU) 2019/667 felhatalmazáson alapuló rendelete (2018. december 19.)	L 113	1	2019.4.29.
►M3	A Bizottság (EU) 2020/447 felhatalmazáson alapuló rendelete (2019. december 16.)	L 94	5	2020.3.27.

Helyesbítette:

►C1 Helyesbítés, HL L 103., 2016.4.19., 55. o. (2015/2205)

▼B

A BIZOTTSÁG (EU) 2015/2205 FELHATALMAZÁSON ALAPULÓ RENDELETE

(2015. augusztus 6.)

a 648/2012/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletnek az elszámolási kötelezettségre vonatkozó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről

(EGT-vonatkozású szöveg)

1. cikk

Tőzsdén kívüli származtatott ügyletek elszámolási kötelezettség alá tartozó kategóriái

(1) A tőzsdén kívüli származtatott ügyletek mellékletben meghatározott kategóriái elszámolási kötelezettség alá tartoznak.

▼M3

_____

▼B

2. cikk

(1) A 3. és a 4. cikk alkalmazásában az elszámolási kötelezettség hatálya alá tartozó szerződő feleket a következő kategóriákba kell sorolni:

a) Az 1. kategóriába azok a szerződő felek tartoznak, amelyek e rendelet hatálybalépésének időpontjában a 648/2012/EU rendelet 2. cikke (14) bekezdésének értelmében vett klíringtagok az e rendelet mellékletben meghatározott tőzsdén kívüli származtatott ügyletekre vonatkozó legalább egy kategória tekintetében legalább egy olyan központi szerződő félben, amely e dátumot megelőzően legalább egy szóban forgó kategória elszámolására vonatkozóan engedéllyel vagy elismeréssel rendelkezik.

b) A 2. kategória az 1. kategórián kívüli olyan szerződő feleket tartalmazza, amelyek olyan csoporthoz tartoznak, amely esetében a nem központilag elszámolt származtatott ügyletek aggregált hónap végi átlagos névleges összege meghaladja a 8 milliárd EUR-t a következő hónapok esetében: 2016. január, február és március, és amelyek a következők lehetnek:

   i. pénzügyi szerződő felek;

   ii. a 2011/61/EU európai parlamenti és tanácsi irányelv ([1]) 4. cikke (1) bekezdése a) pontjában meghatározott olyan alternatív befektetési alapok, amelyek nem pénzügyi szerződő felek.

c) A 3. kategóriába tartoznak az 1. vagy a 2. kategóriába nem tartozó következő szerződő felek:

   i. pénzügyi szerződő felek;

   ii. a 2011/61/EU irányelv 4. cikke (1) bekezdése a) pontjában meghatározott olyan alternatív befektetési alapok, amelyek nem pénzügyi szerződő felek.

([1]) Az Európai Parlament és a Tanács 2011. június 8-i 2011/61/EU irányelve az alternatívbefektetésialap-kezelőkről, valamint a 2003/41/EK és a 2009/65/EK irányelv, továbbá az 1060/2009/EK és az 1095/2010/EU rendelet módosításáról (HL L 174., 2011.7.1., 1. o.).

▼B

d) A 4. kategóriába tartoznak az 1., a 2. vagy a 3. kategórián kívüli nem pénzügyi szerződő felek.

(2) Az (1) bekezdés b) pontjában említett, fennálló bruttó névleges összeg csoportszintű aggregált hónap végi átlagának kiszámítása során figyelembe kell venni a csoport valamennyi nem központilag elszámolt származékos termékét, beleértve a határidős devizaügyleteket, a cserеügyleteket és a devizaswapügyleteket.

(3) Amennyiben a szerződő felek a 2011/61/EU irányelv 4. cikke (1) bekezdésének a) pontjában meghatározott alternatív befektetési alapok vagy a 2009/65/EK európai parlamenti és tanácsi irányelv ([1]) 1. cikke (2) bekezdésében meghatározott átruházható értékpapírokkal foglalkozó kollektív befektetési vállalkozások, az (1) bekezdés b) pontjában említett 8 milliárd EUR összegű határérték egyedileg az alap szintjén alkalmazandó.

3. cikk

Az elszámolási kötelezettség hatálybalépésének időpontja

(1) A tőzsdén kívüli származtatott ügyletek mellékletben meghatározott kategóriái esetében az elszámolási kötelezettség a következő időpontban lép hatályba:

a) 2016. június 21. az 1. kategóriába tartozó szerződő felek esetében;

b) 2016. december 21. a 2. kategóriába tartozó szerződő felek esetében;

▼M1

c) 2019. június 21. a 3. kategóriába tartozó szerződő felek esetében;

▼B

d) 2018. december 21. a 4. kategóriába tartozó szerződő felek esetében.

A két különböző kategóriába tartozó szerződő fél között létrejött ügylet esetében a szóban forgó ügylethez kapcsolódó elszámolási kötelezettség hatálybalépésének időpontja a későbbi időpont.

▼M2

(2) Az (1) bekezdéstől eltérve a tőzsdén kívüli származtatott ügyletek mellékletben meghatározott kategóriáihoz tartozó olyan szerződések tekintetében, amelyeket ugyanazon csoporthoz tartozó szerződő felek kötöttek, és az egyik szerződő fél harmadik országban, a másik szerződő fél pedig az Unióban letelepedett, az elszámolási kötelezettség a következő időpontban lép hatályba:

a) 2020. december 21., abban az esetben, ha a releváns harmadik ország tekintetében nem fogadtak el a 648/2012/EU rendelet 13. cikkének (2) bekezdése szerinti egyenértékűségi határozatot az említett rendelet 4. cikke alkalmazásában az e rendelet mellékletében meghatározott tőzsdén kívüli származtatott ügyletekre vonatkozóan; vagy

([1]) Az Európai Parlament és a Tanács 2009. július 13-i 2009/65/EK irányelve az átruházható értékpapírokkal foglalkozó kollektív befektetési vállalkozásokra (ÁÉKBV) vonatkozó törvényi, rendeleti és közigazgatási rendelkezések összehangolásáról (HL L 302., 2009.11.17., 32. o.).

▼M2

b) abban az esetben, ha a releváns harmadik ország tekintetében elfogadtak a 648/2012/EU rendelet 13. cikkének (2) bekezdése szerinti egyenértékűségi határozatot az említett rendelet 4. cikke alkalmazásában az e rendelet mellékletében említett tőzsdén kívüli származtatott ügyletekre vonatkozóan, a következő időpontok közül a későbbi:

i. 60 nappal a 648/2012/EU rendelet 13. cikkének (2) bekezdése szerint az említett rendelet 4. cikke céljából az e rendelet mellékletében említett tőzsdén kívüli származtatott ügyletekre vonatkozóan a releváns harmadik ország tekintetében elfogadott egyenértékűségi határozat hatálybalépésének időpontját követően;

ii. az az időpont, amikor az (1) bekezdés szerinti elszámolási kötelezettség hatályba lép.

▼B

Ez az eltérés csak akkor alkalmazandó, ha a szerződő felek teljesítik a következő feltételeket:

a) a harmadik országban letelepedett szerződő fél vagy pénzügyi vagy nem pénzügyi szerződő fél;

b) az Unióban letelepedett szerződő fél:

i. pénzügyi szerződő fél, nem pénzügyi szerződő fél, pénzügyi holdingtársaság, pénzügyi intézmény vagy megfelelő prudenciális követelmények hatálya alá tartozó kiegészítő szolgáltatásokat végző vállalkozás, és az a) pontban említett szerződő fél pénzügyi szerződő fél; vagy

ii. pénzügyi vagy nem pénzügyi szerződő fél és az a) pontban említett szerződő fél nem pénzügyi szerződő fél;

c) mindkét szerződő fél a 648/2012/EU rendelet 3. cikkének (3) bekezdése szerinti egyazon konszolidált éves beszámolóba teljes körűen bevont;

d) mindkét szerződő félre megfelelő központosított kockázatértékelési, -mérési és -ellenőrzési eljárások vonatkoznak;

e) Az Unióban letelepedett szerződő fél írásban értesítette illetékes hatóságát arról, hogy az a), b), c) és d) pontban meghatározott feltételek teljesülnek és az illetékes hatóság az értesítés kézhezvételét követő 30 naptári napon belül megerősítette a szóban forgó feltételek teljesítését.

4. cikk

Minimális hátralévő futamidő

(1) Az 1. kategóriába tartozó pénzügyi szerződő felek esetében a 648/2012/EU rendelet 4. cikke (1) bekezdése b) pontjának ii. alpontjában említett minimális hátralévő futamidő az elszámolási kötelezettség hatálybalépésének időpontjában:

a) 50 év a 2016. február 21-ét megelőzően kötött vagy megújított olyan szerződések esetében, amelyek a melléklet 1. vagy 2. táblájában meghatározott kategóriákhoz tartoznak;

▼B

b) 3 év a 2016. február 21-ét megelőzően kötött vagy megújított olyan szerződések esetében, amelyek a melléklet 3. vagy 4. táblájában meghatározott kategóriákhoz tartoznak;

c) 6 hónap ►C1 a 2016. február 21-én vagy azt követően kötött vagy megújított olyan szerződések esetében, ◄ amelyek a melléklet 1–4. táblájában meghatározott kategóriákhoz tartoznak;

(2) A 2. kategóriába tartozó pénzügyi szerződő felek esetében a 648/2012/EU rendelet 4. cikke (1) bekezdése b) pontjának ii. alpontjában említett minimális hátralévő futamidő az elszámolási kötelezettség hatálybalépésének időpontjában:

a) 50 év a 2016. május 21-ét megelőzően kötött vagy megújított olyan szerződések esetében, amelyek a melléklet 1. vagy 2. táblájában meghatározott kategóriákhoz tartoznak;

b) 3 év a 2016. május 21-ét megelőzően kötött vagy megújított olyan szerződések esetében, amelyek a melléklet 3. vagy 4. táblájában meghatározott kategóriákhoz tartoznak;

c) 6 hónap ►C1 a 2016. május 21-én vagy azt követően kötött vagy megújított olyan szerződések esetében, ◄ amelyek a melléklet 1–4. táblájában meghatározott kategóriákhoz tartoznak.

(3) A 3. kategóriába tartozó pénzügyi szerződő felek és az e rendelet 3. cikkének (2) bekezdésében említett ügyletek esetében a 648/2012/EU rendelet 4. cikke (1) bekezdése b) pontjának ii. alpontjában említett minimális hátralévő futamidő az elszámolási kötelezettség hatálybalépésének időpontjában:

a) 50 év a melléklet 1. vagy 2. táblájában meghatározott kategóriákhoz tartozó ügyletek esetében;

b) 3 év a melléklet 3. vagy 4. táblájában meghatározott kategóriákhoz tartozó ügyletek esetében.

(4) Amennyiben különböző kategóriába tartozó pénzügyi szerződő felek kötnek szerződést vagy két pénzügyi szerződő fél a 3. cikk (2) bekezdésében említett ügyletben vesz részt, az e cikk alkalmazásában figyelembe veendő minimális hátralévő futamidő az alkalmazandó hátralévő futamidők közül a hosszabb.

5. cikk

Hatálybalépés

Ez a rendelet az *Európai Unió Hivatalos Lapjában* való kihirdetését követő huszadik napon lép hatályba.

Ez a rendelet teljes egészében kötelező és közvetlenül alkalmazandó valamennyi tagállamban.

▼B

MELLÉKLET

Az elszámolási kötelezettség alá tartozó tőzsdén kívüli származtatott kamatügyletek kategóriái

1. táblázat

Báziskamat-csereügyletek kategóriái

Azonosító	Típus	Referencia-kamatláb	Kiegyenlítés pénzneme	Lejárat	Kiegyenlítés pénznemének típusa	Opcionalitás	Névleges összeg típusa
A.1.1	Báziskamat	EURIBOR	EUR	28D-50Y	Egyetlen pénznem	Nem	Állandó vagy változó
A.1.2	Báziskamat	LIBOR	GBP	28D-50Y	Egyetlen pénznem	Nem	Állandó vagy változó
A.1.3	Báziskamat	LIBOR	JPY	28D-30Y	Egyetlen pénznem	Nem	Állandó vagy változó
A.1.4	Báziskamat	LIBOR	USD	28D-50Y	Egyetlen pénznem	Nem	Állandó vagy változó

2. táblázat

Fix–változó kamatcsereügyletek kategóriái

Azonosító	Típus	Referencia-kamatláb	Kiegyenlítés pénzneme	Lejárat	Kiegyenlítés pénznemének típusa	Opcionalitás	Névleges összeg Típus
A.2.1	Fix – változó	EURIBOR	EUR	28D-50Y	Egyetlen pénznem	Nem	Állandó vagy változó
A.2.2	Fix – változó	LIBOR	GBP	28D-50Y	Egyetlen pénznem	Nem	Állandó vagy változó
A.2.3	Fix – változó	LIBOR	JPY	28D-30Y	Egyetlen pénznem	Nem	Állandó vagy változó
A.2.4	Fix – változó	LIBOR	USD	28D-50Y	Egyetlen pénznem	Nem	Állandó vagy változó

3. táblázat

Határidős kamatláb-megállapodások kategóriái

Azonosító	Típus	Referencia-kamatláb	Kiegyenlítés pénzneme	Lejárat	Kiegyenlítés pénznemének típusa	Opcionalitás	Névleges összeg Típus
A.3.1	FRA	EURIBOR	EUR	3D-3Y	Egyetlen pénznem	Nem	Állandó vagy változó
A.3.2	FRA	LIBOR	GBP	3D-3Y	Egyetlen pénznem	Nem	Állandó vagy változó
A.3.3	FRA	LIBOR	USD	3D-3Y	Egyetlen pénznem	Nem	Állandó vagy változó

▼B

4. táblázat

Egynapos kamatcsereügyletek kategóriái

Azonosító	Típus	Referencia-kamatláb	Kiegyenlítés pénzneme	Lejárat	Kiegyenlítés pénznemének típusa	Opcionalitás	Névleges összeg Típus
A.4.1	OIS	EONIA	EUR	7D-3Y	Egyetlen pénznem	Nem	Állandó vagy változó
A.4.2	OIS	FedFunds	USD	7D-3Y	Egyetlen pénznem	Nem	Állandó vagy változó
A.4.3	OIS	SONIA	GBP	7D-3Y	Egyetlen pénznem	Nem	Állandó vagy változó