

Tämä asiakirja on ainoastaan dokumentoinnin apuväline eikä sillä ole oikeudellista vaikutusta. Unionin toimielimet eivät vastaa sen sisällöstä. Säädösten todistusvoimaiset versiot on johdanto-osineen julkaistu Euroopan unionin virallisessa lehdessä ja ne ovat saatavana EUR-Lexissä. Näihin virallisiin teksteihin pääsee suoraan tästä asiakirjasta siihen upotettujen linkkien kautta.

► B **KOMISSION DELEGOITU ASETUS (EU) 2015/2205,**
annettu 6 päivänä elokuuta 2015,
Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 648/2012 täydentämisestä
määritysvuorollisuutta koskevilla teknisillä sääntelystandardeilla
(ETA:n kannalta merkityksellinen teksti)
(EUVL L 314, 1.12.2015, s. 13)

sellaisena kuin se on muutettuna seuraavilla:

		virallinen lehti		
		N:o	sivu	päivämäärä
► <u>M1</u>	Komission delegoitu asetukset (EU) 2017/751, annettu 16 päivänä maaliskuuta 2017	L 113	15	29.4.2017
► <u>M2</u>	Komission delegoitu asetukset (EU) 2019/667, annettu 19 päivänä joulukuuta 2018	L 113	1	29.4.2019
► <u>M3</u>	Komission delegoitu asetukset (EU) 2020/447, annettu 16 päivänä joulukuuta 2019	L 94	5	27.3.2020
► <u>M4</u>	Komission delegoitu asetukset (EU) 2021/237, annettu 21 päivänä joulukuuta 2020	L 56	6	17.2.2021
► <u>M5</u>	Komission delegoitu asetukset (EU) 2022/750, annettu 8 päivänä helmikuuta 2022	L 138	6	17.5.2022
► <u>M6</u>	Komission delegoitu asetukset (EU) 2023/315, annettu 25 päivänä lokakuuta 2022	L 43	4	13.2.2023
► <u>M7</u>	Komission delegoitu asetukset (EU) 2024/363, annettu 11 päivänä lokakuuta 2023	L 363	1	22.1.2024

Oikaistu:

- C1 Oikaisu, EUVL L 202, 28.7.2016, s. 56 (2015/2205)

▼B**KOMISSION DELEGOITU ASETUS (EU) 2015/2205,****annettu 6 päivänä elokuuta 2015,****Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 648/2012 täydentämisestä määritysvollisuutta koskevilla teknisillä sääntelystandardeilla****(ETA:n kannalta merkityksellinen teksti)***1 artikla***Määritysvollisuuden piiriin kuuluvat OTC-johdannaislajit**

1. Liitteessä esitetyt OTC-johdannaislajit kuuluvat määritysvollisuuden piiriin.

▼M3**▼B***2 artikla*

1. Määritysvollisuuden piiriin kuuluvat vastapuolet jaetaan 3 ja 4 artiklaa sovellettaessa seuraaviin ryhmiin:

a) Ryhmä 1 sisältää vastapuolet, jotka ovat tämän asetuksen voimaantulopäivänä vähintään yhden tämän asetuksen liitteessä esitetyn OTC-johdannaislajin osalta asetuksen (EU) N:o 648/2012 2 artiklan 14 kohdassa tarkoitettuja määritysosapuolia vähintään yhdelle niistä keskusvastapuolista, joille on ennen kyseistä päivää myönnetty toimilupa tai tunnustus määrittää ainakin yhtä kyseisistä lajeista.

b) ►C1 Ryhmä 2 sisältää ryhmään 1 kuulumattomat vastapuolet, jotka kuuluvat konserniin, jonka muiden kuin keskusvastapuolen määrittämien liikkeessä olevien johdannaisten yhteenlaskettu kuukauden lopun keskimääräinen bruttonimellismäärä tammi-, helmi- ja maaliskuulta 2016 on yli 8 miljardia euroa ja jotka kuuluvat johonkin seuraavista alaryhmistä: ◀

i) finanssialalla toimivat vastapuolet;

ii) vaihtoehtoiset sijoitusrahastot, sellaisina kuin ne on määritelty Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivin 2011/61/EU ⁽¹⁾ 4 artiklan 1 kohdan a alakohdassa, jotka ovat finanssialan ulkopuolisia vastapuolia.

c) Ryhmä 3 sisältää ryhmään 1 tai 2 kuulumattomat vastapuolet, jotka ovat mitä tahansa seuraavista:

i) finanssialalla toimivat vastapuolet;

ii) vaihtoehtoiset sijoitusrahastot, sellaisina kuin ne on määritelty direktiivin 2011/61/EU 4 artiklan 1 kohdan a alakohdassa, jotka ovat finanssialan ulkopuolisia vastapuolia.

⁽¹⁾ Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivi 2011/61/EU, annettu 8 päivänä kesäkuuta 2011, vaihtoehtoisten sijoitusrahastojen hoitajista ja direktiivin 2003/41/EY ja 2009/65/EY sekä asetuksen (EY) N:o 1060/2009 ja (EU) N:o 1095/2010 muuttamisesta (EUVL L 174, 1.7.2011, s. 1).

▼B

d) Ryhmä 4 sisältää finanssialan ulkopuoliset vastapuolet, jotka eivät kuulu ryhmään 1, 2 tai 3.

2. Laskettaessa 1 kohdan b alakohdassa tarkoitettua konsernin liikkeessä olevien johdannaisten yhteenlaskettua kuukauden lopun keskimääräistä bruttonimellismäärää on otettava huomioon kaikki muiden kuin keskusvastapuolen määrittämät johdannaiset, myös valuuttaterminisopimukset, swap-sopimukset ja valuuttaswapit.

3. Jos vastapuolet ovat direktiivin 2011/61/EU 4 artiklan 1 kohdan a alakohdassa määriteltyjä vaihtoehtoisia sijoitusrahastoja tai Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivin 2009/65/EY ⁽¹⁾ 1 artiklan 2 kohdassa määriteltyjä siirtokelpoisiin arvopapereihin kohdistuvaa yhteistä sijoitustoimintaa harjoittavia yrityksiä, tämän artiklan 1 kohdan b alakohdassa tarkoitettua 8 miljardin euron kynnysarvoa on sovellettava rahastokohtaisesti.

*3 artikla***Määrittämisvelvollisuuden voimaantulopäivät**

1. Liitteessä esitettyä OTC-johdannaislajeja koskevien sopimusten osalta määrittämisvelvollisuus tulee voimaan seuraavasti:

a) 21 päivänä kesäkuuta 2016, kun kyseessä ovat ryhmään 1 kuuluvat vastapuolet;

b) 21 päivänä joulukuuta 2016, kun kyseessä ovat ryhmään 2 kuuluvat vastapuolet;

▼M1

c) 21 päivänä kesäkuuta 2019, kun kyseessä ovat ryhmään 3 kuuluvat vastapuolet;

▼B

d) 21 päivänä joulukuuta 2018, kun kyseessä ovat ryhmään 4 kuuluvat vastapuolet.

Jos sopimus tehdään kahden eri vastapuoliryhmään kuuluvan vastapuolen välillä, kyseistä sopimusta koskevan määrittämisvelvollisuuden voimaantulopäivä on myöhempi päivä.

▼M5

1a. Poiketen siitä, mitä 1 kohdassa säädetään, liitteessä olevan taulukon 4 riveillä D.4.1 ja D.4.2 esitettyä OTC-johdannaislajeja koskevien sopimusten osalta määrittämisvelvollisuus tulee voimaan 18 päivänä toukokuuta 2022.

1b. Poiketen siitä, mitä 1 kohdassa säädetään, liitteessä olevan taulukon 4 rivillä D.4.3 esitettyä OTC-johdannaislajeja koskevien sopimusten osalta määrittämisvelvollisuus tulee voimaan 18 päivänä elokuuta 2022.

▼M7

1c. Poiketen siitä, mitä 1 kohdassa säädetään ja 1b kohdassa tarkoitettut sopimukset pois lukien, liitteessä olevan taulukon 4 riveillä E.4.1 ja E.4.2 esitettyjä OTC-johdannaislajeja koskevien sopimusten osalta määrittämisvelvollisuus tulee voimaan 11 päivänä helmikuuta 2024.

⁽¹⁾ Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivi 2009/65/EY, annettu 13 päivänä heinäkuuta 2009, siirtokelpoisiin arvopapereihin kohdistuvaa yhteistä sijoitustoimintaa harjoittavia yrityksiä (yhteissijoitusyritykset) koskevien lakien, asetusten ja hallinnollisten määräysten yhteensovittamisesta (EUVL L 302, 17.11.2009, s. 32).

▼ M5

2. Poiketen siitä, mitä 1, 1 a ja 1 b kohdassa säädetään, sellaisten liitteessä esitettyjä OTC-johdannaislajeja koskevien sopimusten osalta, jotka on tehty saman konsernin vastapuolten välillä, joista toinen vastapuoli on sijoittautunut kolmanteen maahan ja toinen vastapuoli unioniin, määrätysevelvollisuus tulee voimaan seuraavasti:

▼ M6

a) 30 päivänä kesäkuuta 2025, jos asetuksen (EU) N:o 648/2012 4 artiklan soveltamiseksi ei ole annettu mainitun asetuksen 13 artiklan 2 kohdan nojalla vastaavuuspäätöstä, joka kattaa tämän asetuksen liitteessä tarkoitetut OTC-johdannaisopimukset kyseisen kolmannen maan osalta;

▼ M5

b) sinä päivänä, joka on seuraavista päivistä myöhäisempi, jos asetuksen (EU) N:o 648/2012 4 artiklan soveltamiseksi on annettu mainitun asetuksen 13 artiklan 2 kohdan nojalla vastaavuuspäätös, joka kattaa tämän asetuksen liitteessä tarkoitetut OTC-johdannaisopimukset kyseisen kolmannen maan osalta:

i) 60 päivän kuluttua sen vastaavuuspäätöksen voimaantulopäivästä, joka on annettu asetuksen (EU) N:o 648/2012 4 artiklan soveltamiseksi mainitun asetuksen 13 artiklan 2 kohdan nojalla ja joka kattaa tämän asetuksen liitteessä tarkoitetut OTC-johdannaisopimukset kyseisen kolmannen maan osalta;

ii) päivä, jona määrätysevelvollisuus tulee voimaan 1 kohdan mukaisesti.

▼ B

Tätä poikkeusta sovelletaan vain silloin, kun vastapuolet täyttävät seuraavat edellytykset:

a) kolmanteen maahan sijoittautunut vastapuoli on joko finanssialalla toimiva vastapuoli tai finanssialan ulkopuolinen vastapuoli;

b) unioniin sijoittautunut vastapuoli on:

i) finanssialalla toimiva vastapuoli, finanssialan ulkopuolinen vastapuoli, rahoitusalan omistusyhteisö, rahoituslaitos tai oheispalveluyritys, johon sovelletaan asianmukaisia vakavaraisuusvaatimuksia, ja a alakohdassa tarkoitettu vastapuoli on finanssialalla toimiva vastapuoli; tai

ii) joko finanssialalla toimiva vastapuoli tai finanssialan ulkopuolinen vastapuoli, ja a alakohdassa tarkoitettu vastapuoli on finanssialan ulkopuolinen vastapuoli;

c) molemmat vastapuolet sisältyvät kokonaisuudessaan samaan konsolidointiin asetuksen (EU) N:o 648/2012 3 artiklan 3 kohdan mukaisesti;

d) molempiin vastapuoliin sovelletaan asianmukaisia keskitettyjä riskien arviointi-, mittaamis- ja valvontamenettelyjä;

▼ B

- e) unioniin sijoittautunut vastapuoli on ilmoittanut omalle toimivaltaiselle viranomaiselleen kirjallisesti, että a, b, c ja d alakohdassa säädetyt edellytykset täyttyvät, ja toimivaltainen viranomainen on vahvistanut 30 kalenteripäivän kuluessa ilmoituksen vastaanottamisesta, että kyseiset edellytykset täyttyvät.

▼ M5

3. Poiketen siitä, mitä 1, 1 a, 1 b ja 2 kohdassa säädetään, liitteessä esitettyjä OTC-johdannaislajeja koskevien sopimusten osalta määritysvelvollisuus tulee voimaan 18 päivänä helmikuuta 2022, kun seuraavat edellytykset täyttyvät:

- a) määritysvelvollisuutta ei ole otettu käyttöön 18 päivään helmikuuta 2021 mennessä;
- b) sopimukset on uusittu ainoana tarkoituksena korvata Yhdistyneeseen kuningaskuntaan sijoittautunut vastapuoli johonkin jäsenvaltioon sijoittautuneella vastapuolella.

▼ M4**▼ B**

*5 artikla***Voimaantulo**

Tämä asetus tulee voimaan kahdentenakymmenentenä päivänä sen jälkeen, kun se on julkaistu *Euroopan unionin virallisessa lehdessä*.

Tämä asetus on kaikilta osiltaan velvoittava, ja sitä sovelletaan sellaiseen kaikissa jäsenvaltioissa.

▼ **M5**

LIITE

Määrittelyvelvollisuuden piiriin kuuluvat OTC-korkojohdannaislajit

Taulukko 1

Viitekoronvaihtosopimukset

Tunniste	Tyyppi	Viiteindeksi	Selvitysvaluutta	Maturiteetti	Selvitysvaluutan tyyppi	Valinnaisuus	Nimellismäärän tyyppi
A.1.1	Viitekorko	Euribor	EUR	28PV–50V	Sama valuutta	Ei	Kiinteä tai vaihtuva

Taulukko 2

Koronvaihtosopimukset, joissa kiinteä korko vaihdetaan vaihtuvaan korkoon

Tunniste	Tyyppi	Viiteindeksi	Selvitysvaluutta	Maturiteetti	Selvitysvaluutan tyyppi	Valinnaisuus	Nimellismäärän tyyppi
A.2.1	Kiinteästä korosta vaihtuvaan	Euribor	EUR	28PV–50V	Sama valuutta	Ei	Kiinteä tai vaihtuva

Taulukko 3

Korkotermiinit

Tunniste	Tyyppi	Viiteindeksi	Selvitysvaluutta	Maturiteetti	Selvitysvaluutan tyyppi	Valinnaisuus	Nimellismäärän tyyppi
A.3.1	FRA	Euribor	EUR	3PV–3V	Sama valuutta	Ei	Kiinteä tai vaihtuva

Taulukko 4

Yön yli indeksiswapit

Tunniste	Tyyppi	Viiteindeksi	Selvitysvaluutta	Maturiteetti	Selvitysvaluutan tyyppi	Valinnaisuus	Nimellismäärän tyyppi
A.4.2	OIS	FedFunds	USD	7PV–3V	Sama valuutta	Ei	Kiinteä tai vaihtuva
D.4.1	OIS	€STR (Euro short term rate)	EUR	7PV–3V	Sama valuutta	Ei	Kiinteä tai vaihtuva
D.4.2	OIS	SONIA (Sterling Over Night Index Average)	GBP	7PV–50V	Sama valuutta	Ei	Kiinteä tai vaihtuva

E.4.1	OIS	SOFR (Secured Overnight Financing Rate)	USD	7D-50Y	Sama valuutta	Ei	Kiinteä tai vaihtuva
E.4.2	OIS	TONA	JPY	7D-30Y	Sama valuutta	Ei	Kiinteä tai vaihtuva

▼ **M7**