

Ovaj je tekst namijenjen isključivo dokumentiranju i nema pravni učinak. Institucije Unije nisu odgovorne za njegov sadržaj. Vjerodostojne inačice relevantnih akata, uključujući njihove preambule, one su koje su objavljene u Službenom listu Europske unije i dostupne u EUR-Lexu. Tim službenim tekstovima može se izravno pristupiti putem poveznica sadržanih u ovom dokumentu.

► **B****DELEGIRANA UREDBA KOMISIJE (EU) 2015/2205**

od 6. kolovoza 2015.

o dopuni Uredbe (EU) br. 648/2012 Europskog parlamenta i Vijeća u pogledu regulatornih tehničkih standarda za obvezu poravnanja

(Tekst značajan za EGP)

(SL L 314, 1.12.2015., str. 13.)

Koju je izmijenila:

		Službeni list		
		br.	stranica	datum
► <u>M1</u>	Delegirana uredba Komisije (EU) 2017/751 od 16. ožujka 2017.	L 113	15	29.4.2017.
► <u>M2</u>	Delegirana uredba Komisije (EU) 2019/667 od 19. prosinca 2018.	L 113	1	29.4.2019.
► <u>M3</u>	Delegirana uredba Komisije (EU) 2020/447 od 16. prosinca 2019.	L 94	5	27.3.2020.
► <u>M4</u>	Delegirana uredba Komisije (EU) 2021/237 od 21. prosinca 2020.	L 56	6	17.2.2021.
► <u>M5</u>	Delegirana uredba Komisije (EU) 2022/750 od 8. veljače 2022.	L 138	6	17.5.2022.

Koju je ispravio:

- **C1** Ispravak, SL L 202, 28.7.2016, str. 56 (2015/2205)

▼B**DELEGIRANA UREDBA KOMISIJE (EU) 2015/2205****od 6. kolovoza 2015.****o dopuni Uredbe (EU) br. 648/2012 Europskog parlamenta i Vijeća
u pogledu regulatornih tehničkih standarda za obvezu poravnanja****(Tekst značajan za EGP)***Članak 1.***Vrste OTC izvedenica koje podliježu obvezi poravnanja**

1. Vrste OTC izvedenica navedene u Prilogu podliježu obvezi poravnanja.

▼M3**▼B***Članak 2.*

1. Za potrebe članaka 3. i 4. druge ugovorne strane koje podliježu obvezi poravnanja podijeljene su na sljedeće kategorije:

(a) prva kategorija, koja obuhvaća druge ugovorne strane koje su na dan stupanja na snagu ove Uredbe klirinški članovi, u smislu članka 2. stavka 14. Uredbe (EU) br. 648/2012, za najmanje jednu vrstu OTC izvedenica navedenih u Prilogu ovoj Uredbi, najmanje jedne središnje druge ugovorne strane odobrene za rad ili priznate prije datuma poravnanja najmanje jedne od tih vrsta OTC izvedenica;

(b) druga kategorija, koja obuhvaća druge ugovorne strane koje ne pripadaju 1. kategoriji, a pripadaju grupi čiji skupni prosjek na kraju mjeseca preostalog bruto zamišljenog iznosa izvedenica koje nisu centralno poravnane za siječanj, veljaču i ožujak 2016. iznosi više od 8 milijardi EUR i koje su jedno od sljedećeg:

i. financijske druge ugovorne strane;

ii. alternativni investicijski fondovi, kako su definirani u članku 4. stavku 1. točki (a) Direktive 2011/61/EU Europskog parlamenta i Vijeća ⁽¹⁾, koji su nefinancijske druge ugovorne strane;

(c) treća kategorija, koja obuhvaća druge ugovorne strane koje ne pripadaju 1. ili 2. kategoriji i koje su jedno od sljedećeg:

i. financijske druge ugovorne strane;

ii. alternativni investicijski fondovi, kako su definirani u članku 4. stavku 1. točki (a) Direktive 2011/61/EU, koji su nefinancijske druge ugovorne strane;

⁽¹⁾ Direktiva 2011/61/EU Europskog parlamenta i Vijeća od 8. lipnja 2011. o upraviteljima alternativnih investicijskih fondova i o izmjeni direktiva 2003/41/EZ i 2009/65/EZ te uredbi (EZ) br. 1060/2009 i (EU) br. 1095/2010 (SL L 174, 17.2.2011., str. 1.).

▼B

(d) četvrta kategorija, koja obuhvaća nefinancijske druge ugovorne strane koje ne pripadaju 1., 2. ili 3. kategoriji.

2. Kako bi se za grupu izračunao skupni prosjek na kraju mjeseca preostalog bruto zamišljenog iznosa iz točke (b) stavka 1., u izračun se uključuju sve izvedenice te grupe koje nisu centralno poravnane, uključujući valutne termenske ugovore, ugovore o razmjeni i valutne ugovore o razmjeni.

3. Ako su druge ugovorne strane alternativni investicijski fondovi, kako su definirani u članku 4. stavku 1. točki (a) Direktive 2011/61/EU, ili subjekti za zajednička ulaganja u prenosive vrijednosne papire, kako su definirani u članku 1. stavku 2. Direktive 2009/65/EZ Europskog parlamenta i Vijeća ⁽¹⁾, prag od 8 milijardi EUR iz točke (b) stavka 1. ovog članka primjenjuje se pojedinačno na razini fonda.

*Članak 3.***Datumi od kojih obveza poravnanja proizvodi učinke**

1. U pogledu ugovora koji pripadaju vrsti OTC izvedenica navedenoj u Prilogu, obveza poravnanja proizvodi učinke:

(a) 21. lipnja 2016. za druge ugovorne strane u 1. kategoriji;

(b) 21. prosinca 2016. za druge ugovorne strane u 2. kategoriji;

▼M1

(c) 21. lipnja 2019. za druge ugovorne strane u trećoj kategoriji;

▼B

(d) 21. prosinca 2018. za druge ugovorne strane u 4. kategoriji.

Ako se ugovor sklapa između dviju ugovornih strana koje potpadaju pod različite kategorije drugih ugovornih strana, datum od kojeg obveza poravnanja proizvodi učinke za taj ugovor jest kasniji datum.

▼M5

1.a Odstupajući od stavka 1., u pogledu ugovora koji pripadaju vrsti OTC izvedenica navedenoj u redcima D.4.1. i D.4.2. tablice 4. Priloga, obveza poravnanja za takve ugovore proizvodi učinke 18. svibnja 2022.

1.b Odstupajući od stavka 1., u pogledu ugovora koji pripadaju vrsti OTC izvedenica navedenoj u retku D.4.3. tablice 4. Priloga, obveza poravnanja za takve ugovore proizvodi učinke 18. kolovoza 2022.

⁽¹⁾ Direktiva 2009/65/EZ Europskog parlamenta i Vijeća od 13. srpnja 2009. o usklađivanju zakona i drugih propisa u odnosu na subjekte za zajednička ulaganja u prenosive vrijednosne papire (UCITS) (SL L 302, 17.11.2009., str. 32.).

▼M2

2. ►**M5** Odstupajući od stavaka 1., 1.a i 1.b, u pogledu ugovora koji pripadaju vrsti OTC izvedenica navedenoj u Prilogu i koji su sklopljeni između drugih ugovornih strana koje su dio iste grupe i kad jedna druga ugovorna strana ima poslovni nastan u trećoj zemlji, a druga u Uniji, obveza poravnanja proizvodi učinke:

- (a) 30. lipnja 2022. ako nije donesena odluka o istovrijednosti na temelju članka 13. stavka 2. Uredbe (EU) br. 648/2012 za potrebe članka 4. te uredbe kojom su obuhvaćeni ugovori o OTC izvedenicama iz Priloga ovoj Uredbi u pogledu relevantne treće zemlje;
- (b) kasnijeg od sljedećih datuma ako je donesena odluka o istovrijednosti na temelju članka 13. stavka 2. Uredbe (EU) br. 648/2012 za potrebe članka 4. te uredbe kojom su obuhvaćeni ugovori o OTC izvedenicama iz Priloga ovoj Uredbi u pogledu relevantne treće zemlje:
 - i. 60 dana od datuma stupanja na snagu odluke o istovrijednosti donesene na temelju članka 13. stavka 2. Uredbe (EU) br. 648/2012 za potrebe članka 4. te uredbe kojom su obuhvaćeni ugovori o OTC izvedenicama iz Priloga ovoj Uredbi u pogledu relevantne treće zemlje;
 - ii. datum od kojeg obveza poravnanja proizvodi učinke na temelju stavka 1. ◀

▼B

To odstupanje primjenjuje se samo ako druge ugovorne strane ispunjuju sljedeće uvjete:

- (a) druga ugovorna strana s poslovnim nastanom u trećoj zemlji jest financijska druga ugovorna strana ili nefinancijska druga ugovorna strana;
- (b) druga ugovorna strana s poslovnim nastanom u Uniji jest:
 - i. financijska druga ugovorna strana, nefinancijska druga ugovorna strana, financijski holding, financijska institucija ili društvo za pomoćne usluge na koje se primjenjuju odgovarajući bonitetni zahtjevi, dok je druga ugovorna strana iz točke (a) financijska druga ugovorna strana; ili
 - ii. financijska druga ugovorna strana ili nefinancijska druga ugovorna strana, dok je druga ugovorna strana iz točke (a) nefinancijska druga ugovorna strana;
- (c) obje druge ugovorne strane u cijelosti su obuhvaćene istom konsolidacijom u skladu s člankom 3. stavkom 3. Uredbe (EU) br. 648/2012;
- (d) obje druge ugovorne strane podliježu odgovarajućim centraliziranim postupcima ocjene, mjerenja i kontrole rizika;

▼ B

- (e) druga ugovorna strana s poslovnim nastanom u Uniji obavijestila je u pisanom obliku svoje nadležno tijelo da su ispunjeni uvjeti utvrđeni u točkama (a), (b), (c) i (d), a nadležno tijelo potvrdilo je u roku od 30 kalendarskih dana od primitka obavijesti da su ti uvjeti ispunjeni.

▼ M5

3. Odstupajući od stavaka 1., 1.a, 1.b i 2., u pogledu ugovora koji pripadaju vrsti OTC izvedenica navedenoj u Prilogu, obveza poravnanja proizvodi učinke od 18. veljače 2022. ako su ispunjeni sljedeći uvjeti:

- (a) nije nastala obveza poravnanja do 18. veljače 2021.;
- (b) ugovori se obnavljaju isključivo u svrhu zamjene druge ugovorne strane s poslovnim nastanom u Ujedinjenoj Kraljevini drugom ugovornom stranom s poslovnim nastanom u državi članici.

▼ M4**▼ B**

*Članak 5.***Stupanje na snagu**

Ova Uredba stupa na snagu dvadesetog dana od dana objave u *Službenom listu Europske unije*.

Ova je Uredba u cijelosti obvezujuća i izravno se primjenjuje u svim državama članicama.

▼ **M5***PRILOG***Vrste kamatnih OTC izvedenica koje podliježu obvezi poravnanja***Tablica 1.***Vrste ugovora o zamjeni osnove**

Identifikacijska oznaka	Vrsta	Referentni indeks	Valuta namire	Preostalo dospijeće	Vrsta valute namire	Neobveznost	Vrsta zamišljenog iznosa
A.1.1	osnova	Euribor	EUR	28D-50Y	jedinstvena valuta	ne	stalan ili promjenjiv

*Tablica 2.***Vrste kamatnih ugovora o razmjeni fiksne za promjenjivu kamatnu stopu**

Identifikacijska oznaka	Vrsta	Referentni indeks	Valuta namire	Preostalo dospijeće	Vrsta valute namire	Neobveznost	Vrsta zamišljenog iznosa
A.2.1	fiksna za promjenjivu	Euribor	EUR	28D-50Y	jedinstvena valuta	ne	stalan ili promjenjiv

*Tablica 3.***Vrste terminskih ugovora o kamatnoj stopi**

Identifikacijska oznaka	Vrsta	Referentni indeks	Valuta namire	Preostalo dospijeće	Vrsta valute namire	Neobveznost	Vrsta zamišljenog iznosa
A.3.1	FRA	Euribor	EUR	3D-3Y	jedinstvena valuta	ne	stalan ili promjenjiv

*Tablica 4.***Vrste prekonoćnih kamatnih ugovora o zamjeni**

Identifikacijska oznaka	Vrsta	Referentni indeks	Valuta namire	Preostalo dospijeće	Vrsta valute namire	Neobveznost	Vrsta zamišljenog iznosa
A.4.2	OIS	FedFunds	USD	7D-3Y	jedinstvena valuta	ne	stalan ili promjenjiv
D.4.1	OIS	€STR	EUR	7D-3Y	jedinstvena valuta	ne	stalan ili promjenjiv
D.4.2	OIS	SONIA	GBP	7D-50Y	jedinstvena valuta	ne	stalan ili promjenjiv
D.4.3	OIS	SOFR	USD	7D-3Y	jedinstvena valuta	ne	stalan ili promjenjiv