

Šis tekstas yra skirtas tik informacijai ir teisinės galios neturi. Europos Sąjungos institucijos nėra teisiškai atsakingos už jo turinį. Autentiškos atitinkamų teisės aktų, įskaitant jų preambules, versijos skelbiamos Europos Sąjungos oficialiajame leidinyje ir pateikiamos svetainėje „EUR-Lex“. Oficialūs tekstai tiesiogiai prieinami naudojantis šiuo dokumente pateikiamomis nuorodomis

► **B** KOMISIJOS DELEGUOTASIS REGLAMENTAS (ES) 2016/592

2016 m. kovo 1 d.

kuriuo papildomos Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 648/2012 nuostatos dėl tarpuskaitos prievolės techninių reguliavimo standartų

(Tekstas svarbus EEE)

(OL L 103, 2016 4 19, p. 5)

iš dalies keičiamas:

|                    |                                                                         | Oficialusis leidinys |          |           |
|--------------------|-------------------------------------------------------------------------|----------------------|----------|-----------|
|                    |                                                                         | Nr.                  | puslapis | data      |
| ► <b><u>M1</u></b> | 2017 m. kovo 16 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2017/751     | L 113                | 15       | 2017 4 29 |
| ► <b><u>M2</u></b> | 2018 m. gruodžio 19 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2019/667 | L 113                | 1        | 2019 4 29 |
| ► <b><u>M3</u></b> | 2020 m. gruodžio 21 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2021/237 | L 56                 | 6        | 2021 2 17 |



## KOMISIJOS DELEGUOTASIS REGLAMENTAS (ES) 2016/592

2016 m. kovo 1 d.

**kuriuo papildomos Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 648/2012 nuostatos dėl tarpuskaity prievolės techninių reguliavimo standartų**

(Tekstas svarbus EEE)

### *1 straipsnis*

**Ne biržos išvestinių finansinių priemonių, kurioms taikoma tarpuskaity prievolė, klasės**

Priede nustatytų klasių ne biržos išvestinėms finansinėms priemonėms taikoma *tarpuskaity prievolė*.

### *2 straipsnis*

#### **Sandorio šalių kategorijos**

1. Taikant 3 ir 4 straipsnius, sandorio šalys, kurioms taikoma tarpuskaity prievolė, skirstomos į šias kategorijas:

- a) 1 kategorija apima sandorio šalis, kurios šio reglamento įsigaliojimo datą dėl bent vienos iš šio reglamento priede nurodytų ne biržos išvestinių finansinių priemonių klasių yra bent vienos pagrindinės sandorio šalies, kuriai iki tos datos suteiktas leidimas arba kuri yra pripažinta atlikti bent vienos iš tų klasių tarpuskaity, tarpuskaity narės, kaip apibrėžta Reglamento (ES) Nr. 648/2012 2 straipsnio 14 punkte;
- b) 2 kategorija apima 1 kategorijai nepriklausančias sandorio šalis, priklausančias grupei, kurios agreguota vidutinė išvestinių finansinių priemonių, kurioms netaikoma pagrindinės sandorio šalies tarpuskaity, mėnesio pabaigos neapmokėta bendroji tariamoji suma 2016 m. sausio, vasario ir kovo mėnesiais yra didesnė nei 8 mlrd. EUR, ir kurios yra:
  - i) finansų sandorio šalys arba
  - ii) alternatyvaus investavimo fondai, kaip apibrėžta Europos Parlamento ir Tarybos direktyvos 2011/61/ES <sup>(1)</sup> 4 straipsnio 1 dalies a punkte, kurie nėra finansų sandorio šalys;
- c) 3 kategorijai priklauso 1 arba 2 kategorijoms nepriklausančios sandorio šalys, kurios yra:
  - i) finansų sandorio šalys arba
  - ii) alternatyvaus investavimo fondai, kaip apibrėžta Direktyvos 2011/61/ES 4 straipsnio 1 dalies a punkte, kurie nėra finansų sandorio šalys;
- d) 4 kategorijai priklauso ne finansų sandorio šalys, nepriklausančios 1, 2 arba 3 kategorijai.

<sup>(1)</sup> 2011 m. birželio 8 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2011/61/ES dėl alternatyvaus investavimo fondų valdytojų, kuria iš dalies keičiami direktyvos 2003/41/EB ir 2009/65/EB bei reglamentai (EB) Nr. 1060/2009 ir (ES) Nr. 1095/2010 (OL L 174, 2011 7 1, p. 1).

**▼B**

2. Siekiant apskaičiuoti grupės agreguotą vidutinę mėnesio pabaigos neapmokėtą bendrąją tariamąją sumą, nurodytą 1 dalies b punkte, įtraukiamos grupės visos išvestinės finansinės priemonės, kurioms netaikoma pagrindinės sandorio šalies tarpuskaita, įskaitant išankstinius valiutos keitimo sandorius, apsikeitimo sandorius ir valiutos apsikeitimo sandorius.

3. Jei sandorio šalys yra alternatyvaus investavimo fondai, kaip apibrėžta Direktyvos 2011/61/ES 4 straipsnio 1 dalies a punkte, arba kolektyvinio investavimo į perleidžiamus vertybinius popierius subjektai, kaip apibrėžta Europos Parlamento ir Tarybos direktyvos 2009/65/EB <sup>(1)</sup> 1 straipsnio 2 dalyje, šio straipsnio 1 dalies b punkte nurodyta 8 mlrd. EUR riba taikoma individualiai fondo lygmeniu.

*3 straipsnis***Tarpuskaitos prievolės įsigaliojimo datos**

1. Sutarčių, priklausančių vienai iš priede nustatytų ne biržos išvestinių finansinių priemonių klasių, atžvilgiu tarpuskaitos prievolė įsigalioja:

- a) 2017 m. vasario 9 d. 1 kategorijos sandorio šalims;
- b) 2017 m. rugpjūčio 9 d. 2 kategorijos sandorio šalims;

**▼M1**

- c) 2019 m. birželio 21 d. 3 kategorijos sandorio šalims;

**▼B**

- d) 2019 m. gegužės 9 d. 4 kategorijos sandorio šalims.

Jeigu sutartį sudaro dvi sandorio šalys, priklausančios skirtingoms sandorio šalių kategorijoms, data, kurią tos sutarties atžvilgiu įsigalioja tarpuskaitos prievolė, yra vėlesnioji data.

**▼M2**

2. Nukrypstant nuo 1 dalies, jei sutartys priklauso vienai iš priede nustatytų ne biržos išvestinių finansinių priemonių klasių ir jas sudaro tai pačiai grupei priklausančios sandorio šalys, kai viena sandorio šalis yra įsteigta trečiojoje valstybėje, o kita – Sąjungoje, tų sutarčių atžvilgiu tarpuskaitos prievolė įsigalioja:

**▼M3**

- a) 2022 m. birželio 30 d., jeigu pagal Reglamento (ES) Nr. 648/2012 13 straipsnio 2 dalį atitinkamos trečiosios valstybės atžvilgiu nepriimtas sprendimas dėl lygiavertiškumo to reglamento 4 straipsnio tikslais, taikomas šio reglamento priede nurodytoms ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutartims;

**▼M2**

- b) vėlesnę iš toliau nurodytų datų, jeigu pagal Reglamento (ES) Nr. 648/2012 13 straipsnio 2 dalį atitinkamos trečiosios valstybės atžvilgiu priimtas sprendimas dėl lygiavertiškumo to reglamento 4 straipsnio tikslais, taikomas šio reglamento priede nurodytoms ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutartims:

<sup>(1)</sup> 2009 m. liepos 13 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2009/65/EB dėl įstatymų ir kitų teisės aktų, susijusių su kolektyvinio investavimo į perleidžiamus vertybinius popierius subjektais (KIPVPS), derinimo (OL L 302, 2009 11 17, p. 32).

**▼M2**

i) praėjus 60 dienų nuo sprendimo dėl lygiavertiškumo, priimto pagal Reglamento (ES) Nr. 648/2012 13 straipsnio 2 dalį atitinkamos trečiosios valstybės atžvilgiu to reglamento 4 straipsnio tikslais ir taikomo šio reglamento priede nurodytoms ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutartims, įsigaliojimo;

ii) tarpuskaitos prievolės įsigaliojimo datą pagal 1 dalį.

**▼B**

Ši nukrypti leidžianti nuostata taikoma tik jei sandorio šalys atitinka šias sąlygas:

a) trečiojoje valstybėje įsteigta sandorio šalis yra finansų sandorio šalis arba ne finansų sandorio šalis;

b) Sąjungoje įsteigta sandorio šalis yra:

i) finansų sandorio šalis, ne finansų sandorio šalis, finansų kontroliuojančioji bendrovė, finansų įstaiga arba papildomas paslaugas teikianti įmonė, kuriai taikomi atitinkami rizikos ribojimo reikalavimai, o a punkte nurodyta sandorio šalis yra finansų sandorio šalis;

ii) finansų sandorio šalis arba ne finansų sandorio šalis, o a punkte nurodyta sandorio šalis yra ne finansų sandorio šalis;

c) abi sandorio šalys yra visiškai įtrauktos į tą patį konsolidavimo procesą pagal Reglamento (ES) Nr. 648/2012 3 straipsnio 3 dalį;

d) abiem sandorio šalims taikomos atitinkamos centralizuotos rizikos vertinimo, nustatymo ir kontrolės procedūros;

e) Sąjungoje įsteigta sandorio šalis raštu pranešė savo kompetentingai institucijai, kad a, b, c ir d punktuose nustatytos sąlygos yra tenkinamos, ir per 30 kalendorinių dienų nuo pranešimo gavimo datos kompetentinga institucija patvirtino, kad sąlygos tenkinamos.

**▼M3**

3. Nukrypstant nuo 1 ir 2 dalių, sutarčių, priklausančių vienai iš priede nustatytų ne biržos išvestinių finansinių priemonių klasių, atžvilgiu tarpuskaitos prievolė įsigalioja nuo 2022 m. vasario 18 d., jei tenkinamos šios sąlygos:

a) tarpuskaitos prievolė nepradėta taikyti iki 2021 m. vasario 18 d.;

b) sutartys novacijos būdu keičiamos siekiant vienintelio tikslo – pakeisti Jungtinėje Karalystėje įsteigtą sandorio šalį valstybėje narėje įsteigta sandorio šalimi.



*5 straipsnis*

**Įsigaliojimas**

Šis reglamentas įsigalioja dvidešimtą dieną po jo paskelbimo *Europos Sąjungos oficialiajame leidinyje*.

Šis reglamentas privalomas visas ir tiesiogiai taikomas visose valstybėse narėse.

**▼ B***PRIEDAS*

**Kredito įsipareigojimų neįvykdymo ne biržos išvestinių finansinių priemonių, kurioms taikoma tarpuskaityto prievolė, klasės**

*Europos nesegmentuotų indeksų kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsaikavimo sandorių (CDS) klasės*

| id    | Rūšis       | Porūšis                 | Geografinė zona | Bazinis indeksas        | Atsiskaitymo valiuta | Serija | Terminas |
|-------|-------------|-------------------------|-----------------|-------------------------|----------------------|--------|----------|
| B.1.1 | Indeksų CDS | Nesegmentuotas indeksas | Europa          | iTraxx Europe Main      | EUR                  | Nuo 17 | 5 metai  |
| B.1.2 | Indeksų CDS | Nesegmentuotas indeksas | Europa          | iTraxx Europe Crossover | EUR                  | Nuo 17 | 5 metai  |