

KOMISIJAS DELEĢĒTĀ REGULA (ES) 2015/2205**(2015. gada 6. augusts),****ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 648/2012 attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par tīrvērtes pienākumu****(Dokuments attiecas uz EEZ)**

EIROPAS KOMISIJA,

ņemot vērā Līgumu par Eiropas Savienības darbību,

ņemot vērā Eiropas Parlamenta un Padomes 2012. gada 4. jūlija Regulu (ES) Nr. 648/2012 par ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, centrālajiem darījumu partneriem un darījumu reģistriem ⁽¹⁾ un jo īpaši tās 5. panta 2. punktu,

tā kā:

- (1) Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestāde (EVTI) ir tikusi informēta par procentu likmju ārpusbiržas atvasināto instrumentu klasēm, attiecībā uz kurām konkrētiem centrālajiem darījumu partneriem (turpmāk – “CCP”) ir piešķirta atļauja veikt tīrvērti. Attiecībā uz katru no šīm klasēm EVTI ir novērtējusi būtiskos kritērijus, pēc kuriem uz tām attiecināta tīrvērtes pienākumu, tostarp standartizācijas pakāpi, apjomu un likviditāti, kā arī cenu noteikšanas informācijas pieejamību. EVTI, ņemot vērā vispārējo mērķi – sistēmiskā riska samazināšanu, saskaņā ar Regulā (ES) Nr. 648/2012 izklāstīto procedūru ir noteikusi, uz kurām procentu likmju ārpusbiržas atvasināto instrumentu klasēm būtu jāattiecināta tīrvērtes pienākums.
- (2) Procentu likmju ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem var būt konstants nomināls, mainīgs nomināls vai nosacīts nomināls. Līgumiem ar konstantu nominālu ir nomināls, kas visā līguma darbības laikā paliek nemainīgs. Līgumiem ar mainīgu nominālu ir nomināls, kas līguma darbības laikā mainās prognozējamā veidā. Līgumiem ar nosacītu nominālu ir nomināls, kas līguma darbības laikā mainās neprognozējamā veidā. Nosacīts nomināls vēl vairāk sarežģī cenu noteikšanu un riska pārvaldību saistībā ar procentu likmju ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem un tādējādi arī CCP spēju veikt to tīrvērti. Šī iezīme būtu jāņem vērā, nosakot, uz kurām procentu likmju ārpusbiržas atvasināto instrumentu klasēm ir attiecināms tīrvērtes pienākums.
- (3) Lai noteiktu, uz kurām ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu klasēm būtu jāattiecināta tīrvērtes pienākums, būtu jāņem vērā to ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu konkrētās būtiskās iezīmes, kuri ir noslēgti ar nodrošināto obligāciju emitentiem vai ar nodrošināto obligāciju nodrošinājuma portfeļiem. Šajā ziņā procentu likmju ārpusbiržas atvasināto instrumentu klasēm, uz kurām saskaņā ar šo regulu attiecas tīrvērtes pienākums, nebūtu jāietver līgumi, kas noslēgti ar nodrošināto obligāciju emitentiem vai nodrošināto obligāciju nodrošinājuma portfeļiem, ja vien tie atbilst konkrētiem nosacījumiem.
- (4) Dažādiem darījumu partneriem ir nepieciešami atšķirīgi laikposmi, lai noslēgtu nepieciešamās vienošanās par tādu procentu likmju ārpusbiržas atvasināto instrumentu tīrvērti, uz kuriem attiecas tīrvērtes pienākums. Lai nodrošinātu, ka šis pienākums tiek īstenots pienācīgi un laikus, darījumu partneri būtu jāklasificē kategorijās, kurās uz pietiekamiem līdzīgiem darījumu partneriem tīrvērtes pienākums attiecas no tā paša datuma.
- (5) Pirmajā kategorijā būtu jāiekļauj gan finanšu, gan nefinanšu darījumu partneri, kas šīs regulas spēkā stāšanās dienā ir tīrvērtes dalībnieki vismaz vienam no attiecīgajiem CCP un attiecībā uz vismaz vienu no procentu likmju ārpusbiržas atvasināto instrumentu klasēm, uz kurām attiecas tīrvērtes pienākums, jo šādiem darījumu partneriem jau ir pieredze ar brīvprātīgo tīrvērti, un tie jau ir izveidojuši saikni ar minētajiem CCP nolūkā veikt

⁽¹⁾ OV L 201, 27.7.2012., 1. lpp.

tūrvērti vismaz vienai no šīm klasēm. Nefinanšu darījumu partneriem, kas ir tūrvērtes dalībnieki, arī vajadzētu būt iekļautiem šajā pirmajā kategorijā, jo to pieredze un sagatavošanās centralizētajai tūrvērti ir salīdzināma ar tajā iekļauto finanšu darījumu partneru pieredzi un sagatavošanos.

- (6) Otrajā kategorijā un trešajā kategorijā būtu jāiekļauj finanšu darījumu partneri, kas nav iekļauti pirmajā kategorijā, sagrupējot tos atbilstoši to tiesībspējas un darbībspējas pakāpei attiecībā uz ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem. Finanšu darījumu partneru dažādo tiesībspējas un darbībspējas pakāpju diferencēšana būtu jābalsta uz apjomu, kādā tiek veikta darbība ar ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, un tāpēc būtu jānosaka kvantitatīvs sliekšnis dalījumam starp otro kategoriju un trešo kategoriju, balstoties uz atvasināto instrumentu, kuru tūrvērtē tiek veikta necentralizēti, nominālu vidējo kopsummu mēneša beigās. Šis sliekšnis būtu jānosaka atbilstošā līmenī, lai diferencētu mazākus tirgus dalībniekus, vienlaikus arī otrās kategorijas ietvaros aptverot ievērojamu riska līmeni. Šim sliekšnim arī vajadzētu būt pielāgotam starptautiskā mērogā saskaņotajam nodrošinājuma rezerves (*margin*) prasību sliekšnim attiecībā uz atvasināto instrumentu necentralizētu tūrvērti, lai tādējādi veicinātu regulējuma konverģenci un lai mazinātu darījumu partneru izmaksas saistībā ar atbilstības nodrošināšanu. Tāpat kā minētajos starptautiskajos standartos, lai gan vispār sliekšni piemēro grupas mērogā, ņemot vērā potenciālos riskus, kas piemīt visai grupai, ieguldījumu fondu gadījumā šis sliekšnis būtu jāpiemēro atsevišķi katram fondam, jo parasti citu fondu saistības un ieguldījumu pārvaldītāja saistības neietekmē konkrēta fonda saistības. Tādējādi sliekšnis būtu jāpiemēro katram fondam atsevišķi, ciktāl fonda maksātnespējas vai bankrota gadījumā katrs ieguldījumu fonds ir uzskatāms par pilnīgi nošķirtu un norobežotu aktīvu kopumu, kam nav nodrošinājuma, galvojuma vai citāda atbalsta no citiem ieguldījumu fondiem vai paša ieguldījumu pārvaldītāja.
- (7) Regulā (ES) Nr. 648/2012 minētā finanšu darījumu partneru definīcija neaptver dažus alternatīvos ieguldījumu fondus (AIF), lai gan to darbībspējas pakāpe attiecībā uz ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem līdzinās šajā definīcijā ietverto AIF darbībspējai. Tādēļ AIF, kas klasificēti kā nefinanšu darījumu partneri, būtu jāiekļauj tajās pašās darījumu partneru kategorijās kā AIF, kas klasificēti kā finanšu darījumu partneri.
- (8) Ceturtajā kategorijā būtu jāiekļauj nefinanšu darījumu partneri, kas nav iekļauti pārējās kategorijās, ņemot vērā, ka tiem ir mazāka pieredze un darbībspēja ārpusbiržas atvasināto instrumentu un centralizētās tūrvērtes jomā nekā darījumu partneriem, kuri ietilpst pārējās kategorijās.
- (9) Jautājumā par dienu, kad tūrvērtes pienākums stājas spēkā attiecībā uz darījumu partneriem, kas ietilpst pirmajā kategorijā, būtu jāņem vērā tas, ka tiem var nebūt nepieciešamās, jau iepriekš pastāvošās saiknes ar CCP attiecībā uz visām klasēm, uz kurām attiecas tūrvērtes pienākums. Turklāt darījumu partneri, kas ietilpst šajā kategorijā, ir uzskatāmi par tādiem, kas nodrošina piekļuvi tūrvērtē tādiem darījumu partneriem, kuri nav tūrvērtes dalībnieki, un ir sagaidāms, ka līdz ar tūrvērtes pienākuma stāšanos spēkā būtiski palielināsies klientu tūrvērtē un netiešo klientu tūrvērtē. Visbeidzot, šī pirmā darījumu partneru kategorija veido ievērojamu daļu no tādu procentu likmju ārpusbiržas atvasināto instrumentu apjoma, kuriem jau tiek veikta tūrvērtē, un to darījumu apjoms, kuriem ir veicama tūrvērtē, ievērojami palielināsies pēc tam, kad stāsies spēkā šajā regulā noteiktais tūrvērtes pienākums. Tādēļ attiecībā uz darījumu partneriem, kuri ietilpst pirmajā kategorijā, būtu jānosaka termiņš, kas būtu saprātīgs un dotu iespēju sagatavoties papildu klašu tūrvērtē, kā arī reaģēt uz klientu tūrvērtes un netiešo klientu tūrvērtes pieaugumu un pielāgoties to darījumu apjoma kāpumam, kuriem veicama tūrvērtē, proti, seši mēneši.
- (10) Jautājumā par dienu, kurā tūrvērtes pienākums stājas spēkā attiecībā uz darījumu partneriem, kuri ietilpst otrajā kategorijā vai trešajā kategorijā, būtu jāņem vērā tas, ka to lielākā daļa iegūs piekļuvi CCP, kļūstot par kāda tūrvērtes dalībnieka klientu vai netiešo klientu. Šis process varētu ilgt 12 līdz 18 mēnešus atkarībā no darījumu partneru tiesībspējas un darbībspējas un to gatavības slēgt vienošanās ar tūrvērtes dalībniekiem, kuras ir nepieciešamas, lai veiktu līgumu tūrvērtē.
- (11) Jautājumā par dienu, kurā tūrvērtes pienākums stājas spēkā attiecībā uz darījumu partneriem, kas ietilpst ceturtajā kategorijā, būtu jāņem vērā to tiesībspēja un darbībspēja, kā arī tas, ka to pieredze ar ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem un centralizēto tūrvērti ir mazāka nekā darījumu partneriem, kuri ietilpst pārējās kategorijās.
- (12) Attiecībā uz ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem, kuri noslēgti starp darījumu partneri, kas uzņēmējdarbību veic (ir reģistrēti) trešā valstī, un citu darījumu partneri, kas uzņēmējdarbību veic Savienībā, kad abi ietilpst vienā grupā, pilnā apmērā ir iekļauti kopīgā konsolidācijā un uz tiem attiecas atbilstošas centralizētas riska novērtēšanas, mērīšanas un kontroles procedūras, būtu jāparedz atlikts tūrvērtes pienākuma piemērošanas datums.

Šādai atliktaī piemērošanai būtu jānodrošina, ka uz ierobežotu laikposmu – apstākļos, kad nepastāv Regulas (ES) Nr. 648/2012 13. panta 2. punktā minētie īstenošanas akti, kas aptvertu šīs regulas pielikumā minētos ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumus un tādas tiesību sistēmas ārpus Savienības, kurās uzņēmējdarbību veic darījumu partneri, tūrvērtes pienākums uz minētajiem līgumiem neattiecas. Kompetentām iestādēm būtu jāspēj iepriekš pārbaudīt, vai darījumu partneri, kas noslēdz šādus līgumus, ietilpst vienā grupā un atbilst pārējiem Regulā (ES) Nr. 648/2012 izklāstītajiem grupas iekšējo darījumu nosacījumiem.

- (13) Atšķirībā no ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, kuru darījumu partneri ir nefinanšu darījumu partneri, tādu ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu gadījumā, kuru darījumu partneri ir finanšu darījumu partneri, Regula (ES) Nr. 648/2012 paredz, ka tūrvērtes pienākumu piemēro tad, ja līgumi noslēgti pēc paziņojuma nosūtīšanas uz EVTI pēc tam, kad CCP ir piešķirta atļauja veikt konkrētas ārpusbiržas atvasināto instrumentu klases tūrvērti, tomēr pirms dienas, kad tūrvērtes pienākums stājas spēkā, un ja to attaisno minēto līgumu atlikušais termiņš (dienā, kad stājas spēkā tūrvērtes pienākums). Tūrvērtes pienākuma attiecināšanai uz minētajiem līgumiem būtu jāatbilst mērķim – nodrošināt vienveidīgu un saskaņotu Regulas (ES) Nr. 648/2012 piemērošanu. Ar tā palīdzību varētu veicināt finanšu stabilitāti un mazināt sistēmisko risku, kā arī nodrošināt vienlīdzīgu konkurences apstākļus tirgus dalībniekiem apstākļos, kad uz ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu klasi tiek attiecināts tūrvērtes pienākums. Tāpēc būtu jānosaka tāds minimālais atlikušais termiņš, kas nodrošinātu šo mērķu sasniegšanu.
- (14) Pirms stājas spēkā regulatīvie tehniskie standarti, kas pieņemti saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 5. panta 2. punktu, darījumu partneri nevar prognozēt, vai dienā, kad stājas spēkā tūrvērtes pienākums, šis pienākums attieksies uz to noslēgtajiem ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem. Šī nenoteiktība ievērojami ietekmē tirgus dalībnieku spēju precīzi noteikt cenu to noslēgtajiem ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem, jo uz līgumiem, kuriem veic centralizētu tūrvērti, attiecas nodrošinājuma režīms, kas atšķiras no tā, kurš attiecas uz līgumiem, kuriem veic necentralizētu tūrvērti. Ja nākotnes (*forward*) tūrvērtē tiktu attiecināta uz ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem, kas noslēgti pirms šīs regulas stāšanās spēkā (neatkarīgi no to atlikušā termiņa dienā, kad tūrvērtes pienākums stājas spēkā), tas varētu mazināt darījumu partneru spēju atbilstoši ierobežot savus tirgus riskus un varētu vai nu ietekmēt tirgus darbību un finanšu stabilitāti, vai arī liegt tiem iespēju veikt savu parasto darbību, ierobežojot risku ar citiem piemērotiem līdzekļiem.
- (15) Turklāt uz ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem, kas noslēgti pēc šīs regulas stāšanās spēkā un pirms tūrvērtes pienākuma stāšanās spēkā, tūrvērtes pienākums nebūtu jāattiecinā – līdz laikam, kad šādus līgumus noslēgušie darījumu partneri var konstatēt, kurā kategorijā tie ietilpst un vai uz tiem attiecas konkrētu līgumu (tostarp to grupas iekšējo darījumu) tūrvērtes pienākums, un kad tie varēs īstenot vienošanās, kas nepieciešamas, lai noslēgtu šādus līgumus, ņemot vērā tūrvērtes pienākumu. Tāpēc, lai nodrošinātu tirgus pienācīgu darbību un stabilitāti, kā arī vienlīdzīgu konkurenci starp darījumu partneriem, būtu atbilstoši uzskatīt, ka neatkarīgi no minēto līgumu atlikušā termiņa tūrvērtes pienākums uz tiem nebūtu jāattiecinā.
- (16) Uz ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem, kas noslēgti pēc EVTI informēšanas pēc tam, kad CCP ir piešķirta atļauja veikt konkrētas ārpusbiržas atvasināto instrumentu klases tūrvērti, bet pirms dienas, kad tūrvērtes pienākums stājas spēkā, nebūtu jāattiecinā tūrvērtes pienākums, ja šādi līgumi sistēmiskā riska ziņā nav ievērojami nozīmīgi vai ja tūrvērtes pienākuma attiecināšana uz tiem varētu apdraudēt vienveidīgu un saskaņotu Regulas (ES) Nr. 648/2012 piemērošanu. Darījumu partneru kredītrisks, kas saistīts ar ilgāka termiņa procentu likmju ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem, tirgū pastāv ilgāk nekā kredītrisks, kas saistīts ar procentu likmju ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem ar īsu atlikušo termiņu. Ja tūrvērtes pienākums tiktu attiecināts uz līgumiem ar īsu atlikušo termiņu, tas nozīmētu slogu darījumu partneriem, kas nebūtu samērīgs ar mazinātā riska apmēru. Turklāt procentu likmju ārpusbiržas atvasinātie instrumenti ar īsu atlikušo termiņu veido salīdzinoši nelielu daļu no tirgus kopapjoma un tādējādi salīdzinoši nelielu daļu no sistēmiskā riska kopapjoma, kas saistīts ar šo tirgu. Tādēļ būtu jānosaka tādi minimālie atlikušie termiņi, kas nodrošinātu, ka uz līgumiem, kuru atlikušais termiņš nepārsniedz dažus mēnešus, tūrvērtes pienākums neattiecas.
- (17) Darījumu partneri, kas ietilpst trešajā kategorijā, uzņemas salīdzinoši nelielu daļu no vispārējā sistēmiskā riska, un tiem ir mazāka tiesībspēja un darbībspēja attiecībā uz ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem nekā darījumu partneriem, kuri ietilpst pirmajā kategorijā vai otrajā kategorijā. Būtiski ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu elementi, tostarp cenu noteikšana procentu likmju ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, uz kuriem attiecas tūrvērtes pienākums un kuri noslēgti pirms šā pienākuma stāšanās spēkā, īsā laikā būs jāpielāgo, lai tajos

iekļautu tīrvērti, kas notiks tikai vairākus mēnešus pēc līguma noslēgšanas. Šis nākotnes tīrvērtes process ir saistīts ar svarīgiem cenu noteikšanas modeļa pielāgojumiem un šādu ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumu dokumentācijas grozījumiem. Darījumu partneriem, kas ietilpst trešajā kategorijā, ir ļoti nelielas iespējas savos ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumos iekļaut šādu nākotnes tīrvērti. Tādējādi, ja uz ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem, kas noslēgti pirms tīrvērtes pienākuma stāšanās spēkā, attiecinātu tīrvērtes pienākumu, tiktu mazināta šo darījumu partneru spēja pienācīgi ierobežot savus riskus un vai nu tiktu ietekmēta tirgus darbība un stabilitāte, vai arī šiem darījumu partneriem tiktu liegta iespēja veikt savu parasto darbību, ja tie nevarētu turpināt ierobežot riskus. Tādēļ uz ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem, kurus pirms tīrvērtes pienākuma stāšanās spēkā ir noslēguši trešajā kategorijā ietilpstoši darījumu partneri, tīrvērtes pienākums nebūtu jāattiecinā.

- (18) Turklāt ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumi, kas noslēgti starp darījumu partneriem, kuri ietilpst vienā grupā, var tikt atbrīvoti no tīrvērtes pienākuma (ja vien ir ievēroti konkrēti nosacījumi), lai izvairītos no grupas iekšējo riska pārvaldības procesu efektivitātes mazināšanās un lai tādējādi neapdraudētu Regulas (ES) Nr. 648/2012 vispārējā mērķa sasniegšanu. Tāpēc uz grupas iekšējiem darījumiem, kuri atbilst konkrētiem nosacījumiem un kuri ir noslēgti pirms dienas, kad attiecībā uz šādiem darījumiem stājas spēkā tīrvērtes pienākums, tīrvērtes pienākums nebūtu jāattiecinā.
- (19) Šī regula ir balstīta uz regulatīvo tehnisko standartu projektu, ko EVTI ir iesniegusi Komisijai.
- (20) Komisija saskaņā ar procedūru, kas izklāstīta Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 1095/2010 ⁽¹⁾ 10. panta 1. punkta piektajā un sestajā daļā, ir informējusi EVTI par savu nodomu atbalstīt EVTI ierosināto regulatīvo tehnisko standartu projektu (ar grozījumiem). EVTI ir pieņēmusi formālu atzinumu par šiem grozījumiem un iesniegusi to Komisijai.
- (21) EVTI ir rīkojusi atklātu sabiedrisko apspriešanu par regulatīvo tehnisko standartu projektu, uz kuru ir balstīta šī regula, ir izvērtējusi potenciālās saistītās izmaksas un ieguvumus, kā arī ir lūgusi atzinumu no Vērtspapīru un tirgu nozares ieinteresēto personu grupas, kas izveidota saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 1095/2010 37. pantu, un ir apspriedusies ar Eiropas Sistēmisko risku kolēģiju,

IR PIEŅĒMUSI ŠO REGULU.

1. pants

Ārpusbiržas atvasināto instrumentu klases, uz kurām attiecas tīrvērtes pienākums

1. Uz šīs regulas pielikumā minētajām ārpusbiržas atvasināto instrumentu klasēm attiecas tīrvērtes pienākums.
2. Pielikumā minēto ārpusbiržas atvasināto instrumentu klases neietver līgumus, kas noslēgti ar nodrošināto obligāciju emitentiem vai nodrošināto obligāciju nodrošinājuma portfeļiem, ja vien minētie līgumi atbilst visiem šādiem nosacījumiem:
 - a) tie tiek izmantoti vienīgi tam, lai ierobežotu nodrošinājuma portfeļa procentu likmju vai valūtu nesakrītības risku saistībā ar nodrošināto obligāciju;
 - b) tie ir reģistrēti jeb ierakstīti nodrošinātās obligācijas nodrošinājuma portfelī saskaņā ar valsts tiesību aktiem par nodrošinātām obligācijām;
 - c) nodrošinātu obligāciju emitenta vai nodrošinājuma portfeļa noregulējuma vai maksātnespējas gadījumā to darbība netiek izbeigta;

⁽¹⁾ Eiropas Parlamenta un Padomes 2010. gada 24. novembra Regula (ES) Nr. 1095/2010, ar ko izveido Eiropas Uzraudzības iestādi (Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestādi), groza Lēmumu Nr. 716/2009/EK un atceļ Komisijas Lēmumu 2009/77/EK (OV L 331, 15.12.2010., 84. lpp.).

- d) ārpusbiržas atvasinātā instrumenta, kas noslēgts ar nodrošināto obligāciju emitentiem vai nodrošināto obligāciju nodrošinājuma portfeļiem, darījumu partnera rangs ir vismaz līdzvērtīgs (*pari-passu*) nodrošināto obligāciju turētāju rangam, ja vien nav tā, ka ārpusbiržas atvasinātā instrumenta, kas noslēgts ar nodrošināto obligāciju emitentiem vai nodrošināto obligāciju nodrošinājuma portfeļiem, darījumu partneris nepilda savas saistības, ir ietekmētā puse vai atsakās no šāda līdzvērtīga ranga;
- e) nodrošinātā obligācija atbilst Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 575/2013 ⁽¹⁾ 129. panta prasībām un uz to attiecas regulatora prasība par nodrošinājuma attiecību vismaz 102 % apmērā.

2. pants

1. Šīs regulas 3. un 4. panta vajadzībām darījumu partnerus, uz kuriem attiecas tīrvērtes pienākums, iedala šādās kategorijās:

- a) 1. kategorijā ietilpst darījumu partneri, kuri dienā, kad stājas spēkā šī regula, ir tīrvērtes dalībnieki Regulas (ES) Nr. 648/2012 2. panta 14. punkta izpratnē attiecībā uz vismaz vienu no šīs regulas pielikumā minētajām ārpusbiržas atvasināto instrumentu klasēm vismaz vienam no CCP, kuri pirms minētās dienas ir saņēmuši atļauju (vai ir atzīti) veikt vismaz vienas šādas klases tīrvērti;
- b) 2. kategorijā ietilpst darījumu partneri, kuri neietilpst 1. kategorijā, bet kuri ietilpst grupā, kuras vēl nedzēsto atvasināto instrumentu, kuru tīrvērtē tiek veikta necentralizēti, bruto nominālu vidējā kopsumma mēneša beigās attiecībā uz 2016. gada janvāri, februāri un martu pārsniedz astoņus miljardus EUR un kuri atbilst jebkurai no šādām pazīmēm:
- i) finanšu darījumu partneris;
 - ii) alternatīvo ieguldījumu fonds, kas definēts Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvas 2011/61/ES ⁽²⁾ 4. panta 1. punkta a) apakšpunktā un kas ir nefinanšu darījumu partneris;
- c) 3. kategorijā ietilpst darījumu partneri, kuri neietilpst 1. un 2. kategorijā un kuri atbilst jebkurai no šādām pazīmēm:
- i) finanšu darījumu partneris;
 - ii) alternatīvo ieguldījumu fonds, kas definēts Direktīvas 2011/61/ES 4. panta 1. punkta a) apakšpunktā un kas ir nefinanšu darījumu partneris;
- d) 4. kategorijā ietilpst nefinanšu darījumu partneri, kuri neietilpst 1., 2. un 3. kategorijā.

2. Aprēķinot 1. punkta b) apakšpunktā minēto grupas vēl nedzēsto nominālu vidējo bruto kopsummu mēneša beigās, aprēķinā iekļauj visus grupas atvasinātos instrumentus, kuru tīrvērtē veic necentralizēti, tostarp ārvalstu valūtu nākotnes darījumus, mijmaiņas darījumus un valūtu mijmaiņas darījumus.

3. Ja darījumu partneri ir alternatīvie ieguldījumu fondi, kas definēti Direktīvas 2011/61/ES 4. panta 1. punkta a) apakšpunktā, vai pārvedamu vērtspapīru kolektīvo ieguldījumu uzņēmumi, kas definēti Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvas 2009/65/EK ⁽³⁾ 1. panta 2. punktā, šā panta 1. punkta b) apakšpunktā minēto astoņu miljardu EUR sliekšni piemēro atsevišķi katram fondam.

3. pants

Datumi, kuros stājas spēkā tīrvērtes pienākums

1. Attiecībā uz līgumiem, kas ietilpst kādā no pielikumā minētajām ārpusbiržas atvasināto instrumentu klasēm, tīrvērtes pienākums stājas spēkā:

- a) 2016. gada 21. jūnijā attiecībā uz darījumu partneriem, kas ietilpst 1. kategorijā;
- b) 2016. gada 21. decembrī attiecībā uz darījumu partneriem, kas ietilpst 2. kategorijā;

⁽¹⁾ Eiropas Parlamenta un Padomes 2013. gada 26. jūnija Regula (ES) Nr. 575/2013 par prudenciālajām prasībām attiecībā uz kredītiestādēm un ieguldījumu brokeru sabiedrībām un ar ko groza Regulu (ES) Nr. 648/2012 (OV L 176, 27.6.2013., 1. lpp.).

⁽²⁾ Eiropas Parlamenta un Padomes 2011. gada 8. jūnija Direktīva 2011/61/ES par alternatīvo ieguldījumu fondu pārvaldniekiem un par grozījumiem Direktīvā 2003/41/EK, Direktīvā 2009/65/EK, Regulā (EK) Nr. 1060/2009 un Regulā (ES) Nr. 1095/2010 (OV L 174, 1.7.2011., 1. lpp.).

⁽³⁾ Eiropas Parlamenta un Padomes 2009. gada 13. jūlija Direktīva 2009/65/EK par normatīvo un administratīvo aktu koordināciju attiecībā uz pārvedamu vērtspapīru kolektīvo ieguldījumu uzņēmumiem (PVKIU) (OV L 302, 17.11.2009., 32. lpp.).

- c) 2017. gada 21. jūnijā attiecībā uz darījumu partneriem, kas ietilpst 3. kategorijā;
- d) 2018. gada 21. decembrī attiecībā uz darījumu partneriem, kas ietilpst 4. kategorijā.

Ja līgums ir noslēgts starp diviem darījumu partneriem, kas ietilpst dažādās darījumu partneru kategorijās, tūrvērtes pienākums attiecībā uz šo līgumu stājas spēkā vēlākajā datumā.

2. Atkāpjoties no 1. punkta a), b) un c) apakšpunkta, attiecībā uz līgumiem, kas ietilpst kādā no pielikumā minētajām ārpusbiržas atvasināto instrumentu klasēm un kas noslēgti starp darījumu partneriem, kuri neietilpst 4. kategorijā, bet kuri ietilpst vienā grupā, un ja viens darījumu partneris uzņēmējdarbību veic trešā valstī, bet otrs darījumu partneris uzņēmējdarbību veic Savienībā, tūrvērtes pienākums stājas spēkā:

- a) 2018. gada 21. decembrī, ja nav pieņemts Regulas (ES) Nr. 648/2012 13. panta 2. punktā paredzētais lēmums par līdzvērtību minētās regulas 4. panta vajadzībām, kas aptvertu šīs regulas pielikumā minētos ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumus attiecībā uz konkrēto trešo valsti; vai
- b) ja ir pieņemts Regulas (ES) Nr. 648/2012 13. panta 2. punktā paredzētais lēmums par līdzvērtību minētās regulas 4. panta vajadzībām, kas aptver šīs regulas pielikumā minētos ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumus attiecībā uz konkrēto trešo valsti, vēlākajā no šādiem datumiem:
 - i) 60. dienā pēc tāda lēmuma stāšanās spēkā, kas pieņemts saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 13. panta 2. punktu minētās regulas 4. panta vajadzībām par šīs regulas pielikumā minētajiem ārpusbiržas atvasināto instrumentu līgumiem attiecībā uz konkrēto trešo valsti;
 - ii) dienā, kad saskaņā ar 1. punktu stājas spēkā tūrvērtes pienākums.

Šo izņēmumu piemēro vienīgi tad, ja darījumu partneri atbilst šādiem nosacījumiem:

- a) darījumu partneris, kas uzņēmējdarbību veic trešā valstī, ir finanšu darījumu partneris vai nefinanšu darījumu partneris;
- b) darījumu partneris, kas uzņēmējdarbību veic Savienībā, ir:
 - i) finanšu darījumu partneris, nefinanšu darījumu partneris, finanšu pārvaldītājsabiedrība, finanšu iestāde vai palīgpakalpojumu uzņēmums, uz kuru attiecas atbilstošas prudenciālās uzraudzības prasības, bet a) apakšpunktā minētais darījumu partneris ir finanšu darījumu partneris; vai
 - ii) finanšu darījumu partneris vai nefinanšu darījumu partneris, bet a) apakšpunktā minētais darījumu partneris ir nefinanšu darījumu partneris;
- c) abi darījumu partneri saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 648/2012 3. panta 3. punktu pilnā apmērā ir iekļauti kopīgā konsolidācijā;
- d) uz abiem darījumu partneriem attiecas atbilstošas centralizētas riska novērtēšanas, mērīšanas un kontroles procedūras;
- e) darījumu partneris, kas uzņēmējdarbību veic Savienībā, ir rakstveidā informējis savu kompetento iestādi, ka ir ievēroti a), b), c) un d) apakšpunktā izklāstītie nosacījumi, un 30 kalendāro dienu laikā pēc šādas informācijas saņemšanas kompetentā iestāde ir apliecinājusi, ka šie nosacījumi ir ievēroti.

4. pants

Minimālais atlikušais termiņš

1. Attiecībā uz finanšu darījumu partneriem, kas ietilpst 1. kategorijā, dienā, kad stājas spēkā tūrvērtes pienākums, Regulas (ES) Nr. 648/2012 4. panta 1. punkta b) apakšpunkta ii) punktā minētais minimālais atlikušais termiņš ir:
- a) 50 gadi attiecībā uz līgumiem, kas noslēgti vai pārjaunoti pirms 2016. gada 21. februāra un kas ietilpst kādā no pielikuma 1. vai 2. tabulā minētajām klasēm;
 - b) trīs gadi attiecībā uz līgumiem, kas noslēgti vai pārjaunoti pirms 2016. gada 21. februāra un kas ietilpst kādā no pielikuma 3. vai 4. tabulā minētajām klasēm;
 - c) seši mēneši attiecībā uz līgumiem, kas noslēgti vai pārjaunoti 2016. gada 21. februārī vai pēc tam un kas ietilpst kādā no pielikuma 1.–4. tabulā minētajām klasēm.

2. Attiecībā uz finanšu darījumu partneriem, kas ietilpst 2. kategorijā, dienā, kad stājas spēkā tīrvērtes pienākums, Regulas (ES) Nr. 648/2012 4. panta 1. punkta b) apakšpunkta ii) punktā minētais minimālais atlikušais termiņš ir:

- a) 50 gadi attiecībā uz līgumiem, kas noslēgti vai pārjaunoti pirms 2016. gada 21. maija un kas ietilpst kādā no pielikuma 1. vai 2. tabulā minētajām klasēm;
- b) trīs gadi attiecībā uz līgumiem, kas noslēgti vai pārjaunoti pirms 2016. gada 21. maija un kas ietilpst kādā no pielikuma 3. vai 4. tabulā minētajām klasēm;
- c) seši mēneši attiecībā uz līgumiem, kas noslēgti vai pārjaunoti 2016. gada 21. maijā vai pēc tam un kas ietilpst kādā no pielikuma 1.–4. tabulā minētajām klasēm.

3. Attiecībā uz finanšu darījumu partneriem, kas ietilpst 3. kategorijā, un attiecībā uz šīs regulas 3. panta 2. punktā minētajiem darījumiem, kuri noslēgti starp finanšu darījumu partneriem, dienā, kad stājas spēkā tīrvērtes pienākums, Regulas (ES) Nr. 648/2012 4. panta 1. punkta b) apakšpunkta ii) punktā minētais minimālais atlikušais termiņš ir:

- a) 50 gadi attiecībā uz līgumiem, kas ietilpst kādā no pielikuma 1. vai 2. tabulā minētajām klasēm;
- b) trīs gadi attiecībā uz līgumiem, kas ietilpst kādā no pielikuma 3. vai 4. tabulā minētajām klasēm.

4. Ja līgums ir noslēgts starp diviem finanšu darījumu partneriem, kas ietilpst dažādās kategorijās, vai starp diviem finanšu darījumu partneriem, kuri ir iesaistīti 3. panta 2. punktā minētajos darījumos, minimālais atlikušais termiņš, kas ņemams vērā šā panta vajadzībām, ir ilgākais piemērojamais atlikušais termiņš.

5. pants

Stāšanās spēkā

Šī regula stājas spēkā divdesmitajā dienā pēc tās publicēšanas *Eiropas Savienības Oficiālajā Vēstnesī*.

Šī regula uzliek saistības kopumā un ir tieši piemērojama visās dalībvalstīs.

Briselē, 2015. gada 6. augustā

Komisijas vārdā –
priekšsēdētājs
Jean-Claude JUNCKER

PIELIKUMS

Procentu likmju ārpusbiržas atvasināto instrumentu klases, uz kurām attiecas tīrvērtes pienākums

1. tabula

Bāzes mijmaiņas darījumu klases

| ID | Veids | Atsauces indekss | Norēķinu valūta | Termiņš | Norēķinu valūtas veids | Izvēles iespējas | Nomināla veids |
|-------|-------|------------------|-----------------|---------|------------------------|------------------|-----------------------|
| A.1.1 | Bāze | EURIBOR | EUR | 28d–50g | Viena valūta | Nav | Konstants vai mainīgs |
| A.1.2 | Bāze | LIBOR | GBP | 28d–50g | Viena valūta | Nav | Konstants vai mainīgs |
| A.1.3 | Bāze | LIBOR | JPY | 28d–30g | Viena valūta | Nav | Konstants vai mainīgs |
| A.1.4 | Bāze | LIBOR | USD | 28d–50g | Viena valūta | Nav | Konstants vai mainīgs |

2. tabula

Fiksēto un svārstīgo procentu likmju mijmaiņas darījumu klases

| ID | Veids | Atsauces indekss | Norēķinu valūta | Termiņš | Norēķinu valūtas veids | Izvēles iespējas | Nomināla veids |
|-------|------------------------|------------------|-----------------|---------|------------------------|------------------|-----------------------|
| A.2.1 | Fiksētās un svārstīgās | EURIBOR | EUR | 28d–50g | Viena valūta | Nav | Konstants vai mainīgs |
| A.2.2 | Fiksētās un svārstīgās | LIBOR | GBP | 28d–50g | Viena valūta | Nav | Konstants vai mainīgs |
| A.2.3 | Fiksētās un svārstīgās | LIBOR | JPY | 28d–30g | Viena valūta | Nav | Konstants vai mainīgs |
| A.2.4 | Fiksētās un svārstīgās | LIBOR | USD | 28d–50g | Viena valūta | Nav | Konstants vai mainīgs |

3. tabula

Regulētā tirgū netirgotu procentu likmju nākotnes līgumu klases

| ID | Veids | Atsauces indekss | Norēķinu valūta | Termiņš | Norēķinu valūtas veids | Izvēles iespējas | Nomināla veids |
|-------|-------|------------------|-----------------|---------|------------------------|------------------|-----------------------|
| A.3.1 | FRA | EURIBOR | EUR | 3d–3g | Viena valūta | Nav | Konstants vai mainīgs |
| A.3.2 | FRA | LIBOR | GBP | 3d–3g | Viena valūta | Nav | Konstants vai mainīgs |
| A.3.3 | FRA | LIBOR | USD | 3d–3g | Viena valūta | Nav | Konstants vai mainīgs |

4. tabula

Uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas darījumu klases

| ID | Veids | Atsauces indekss | Norēķinu valūta | Termiņš | Norēķinu valūtas veids | Izvēles iespējas | Nomināla veids |
|-------|-------|------------------|-----------------|---------|------------------------|------------------|-----------------------|
| A.4.1 | OIS | EONIA | EUR | 7d–3g | Viena valūta | Nav | Konstants vai mainīgs |
| A.4.2 | OIS | FedFunds | USD | 7d–3g | Viena valūta | Nav | Konstants vai mainīgs |
| A.4.3 | OIS | SONIA | GBP | 7d–3g | Viena valūta | Nav | Konstants vai mainīgs |