

REGOLAMENT DELEGAT TAL-KUMMISSJONI (UE) 2017/208**tal-31 ta' Ottubru 2016****li jissupplimenta r-Regolament (UE) Nru 575/2013 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill fir-rigward ta' standards tekniċi regolatorji għal flussi ta' hruġ ta' likwidità addizzjonali li jikkorrispondu għal htigijiet ta' kollateral li jirriżultaw mill-impatt ta' xenarju negattiv tas-suq fuq it-tranzazzjonijiet derivattivi ta' istituzzjoni****(Test b'rilevanza għaż-ŻEE)**

IL-KUMMISSJONI EWROPEA,

Wara li kkunsidrat it-Trattat dwar il-Funzjonament tal-Unjoni Ewropea,

Wara li kkunsidrat ir-Regolament (UE) Nru 575/2013 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill tas-26 ta' Ġunju 2013 dwar ir-rekwiziti prudenzjali għall-istituzzjonijiet ta' kreditu u d-ditti tal-investment u li jemenda r-Regolament (UE) Nru 648/2012 ⁽¹⁾, u b'mod partikolari r-raba' sottoparagrafu tal-Artikolu 423(3) tiegħu,

Billi:

- (1) Skont l-Artikolu 423(3) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, l-istituzzjonijiet għandhom iżidu fluss 'il barra (fluss ta' hruġ) addizzjonali li jikkorrispondi għall-htigijiet kollaterali li jirriżultaw mill-impatt ta' xenarju negattiv tas-suq fuq it-tranzazzjonijiet ta' derivati, it-tranzazzjonijiet ta' finanzjament u kuntratti ohra tal-istituzzjoni jekk ikunu materjali. Minhabba kunsiderazzjonijiet ta' materjalità, hemm urġenza li jkun speċifikat fluss ta' hruġ addizzjonali li jikkorrispondi għall-htigijiet ta' kollateral li jirriżultaw mill-impatt ta' xenarju negattiv tas-suq fuq it-tranzazzjonijiet derivattivi tal-istituzzjoni, filwaqt li l-materjalità tal-htigijiet ta' kollateral li jirriżultaw mill-impatt ta' xenarju negattiv tas-suq fuq it-tranzazzjonijiet ta' finanzjament u kuntratti oħrajn tal-istituzzjoni se jiġu kkunsidrati fi stadju segwenti.
- (2) Ladarba l-Artikolu 423(3) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 jirreferi għall-htigijiet kollaterali, ir-regoli li għandhom jiddaħhlu jenhtieg li jkunu ristretti għal tranzazzjonijiet derivattivi li huma kollateralizzati, inkluzi dawk li jimmaturaw fi żmien 30 jum.
- (3) Sabiex ikunu assigurati kundizzjonijiet ekwi għas-swieq tad-derivattivi u l-istituzzjonijiet, il-kalkolu tal-flussi ta' hruġ ta' kollateral addizzjonali jenhtieg li jkun ibbażat fuq l-Approċċ Storiku għall-bidliet fil-valwazzjonijiet tas-suq żviluppat mill-Kumitat ta' Basel dwar is-Supervizjoni Bankarja ("BCBS") għall-iddeterminar ta' dawn il-flussi ta' hruġ ta' kollateral addizzjonali, li għal dik il-fini juża l-akbar fluss ta' hruġ jew ta' dhul nett kumulattiv aggregat ta' kollateral fit-tmiem il-perjodi kollha ta' 30 jum matul l-24 xahar preċedenti fil-livell tal-portafoll.
- (4) L-Awtorità Bankarja Ewropea ("EBA") issottomettiet abbozz ta' standards tekniċi regolatorji lill-Kummissjoni. Madankollu, f'konformità mal-proċedura stipulata fl-Artikolu 10 tar-Regolament (UE) Nru 1093/2010 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill ⁽²⁾, il-Kummissjoni infurmat lill-EBA dwar l-intenzjoni tagħha li ma tapprovax dak l-abbozz ta' standards tekniċi regolatorji, u spjegat ir-raġunijiet għan-nuqqas ta' approvazzjoni. L-EBA reġgħet issottomettiet l-abbozz ta' standards tekniċi regolatorji fl-għamla ta' opinjoni formali u aċċettat l-approċċ propost mill-Kummissjoni bbażat strettament fuq l-Approċċ Storiku tal-BCBS.
- (5) Dan ir-Regolament huwa bbażat fuq l-abbozz ta' standards tekniċi regolatorji kif sottomessi mill-ġdid mill-EBA lill-Kummissjoni.
- (6) L-EBA wettqet konsultazzjonijiet pubbliċi miftuħa dwar l-abbozz ta' standards tekniċi regolatorji li fuqu huwa bbażat dan ir-Regolament, analizzat il-kostijiet u l-benefiċċji potenzjali relatati u talbet l-opinjoni tal-Grupp tal-Partijiet Bankarji Interessati stabbilit f'konformità mal-Artikolu 37 tar-Regolament (UE) Nru 1093/2010,

⁽¹⁾ ĠUL 176, 27.6.2013, p. 1.

⁽²⁾ Ir-Regolament (UE) Nru 1093/2010 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill tal-24 ta' Novembru 2010 li jstabbilixxi Awtorità Superviżorja Ewropea (Awtorità Bankarja Ewropea) u li jemenda d-Deċiżjoni Nru 716/2009/KE u jhassar id-Deċiżjoni tal-Kummissjoni 2009/78/KE (ĠUL 331, 15.12.2010, p. 12).

ADOTTAT DAN IR-REGOLAMENT:

Artikolu 1

Materjalità tat-tranzazzjonijiet derivattivi ta' istituzzjoni

1. It-tranzazzjonijiet derivattivi ta' istituzzjoni għandhom jiġu kkunsidrati materjali għall-finijiet tal-ewwel sottoparagrafu tal-Artikolu 423(3) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 f'dawk il-każijiet li fihom it-total tal-ammonti nozzjonali ta' tali tranzazzjonijiet ikun qabeż 1-10 % tal-flussi ta' hruġ netti ta' likwidità kif imsemmi fl-Artikolu 412(1) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 f'kull waqt fis-sentejn preċedenti.
2. Għall-finijiet tal-paragrafu 1, il-flussi ta' hruġ netti ta' likwidità għandhom jiġu kkalkulati minghajr il-fluss ta' hruġ addizzjonali msemmi fl-ewwel sottoparagrafu tal-Artikolu 423(3) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.

Artikolu 2

Kalkolu ta' fluss ta' hruġ addizzjonali li jikkorrispondi għal htigijiet ta' kollateral li jirriżultaw mill-impatt ta' xenarju negattiv tas-suq fuq it-tranzazzjonijiet derivattivi ta' istituzzjoni

1. Il-fluss ta' hruġ addizzjonali li jikkorrispondi għal htigijiet ta' kollateral li jirriżultaw mill-impatt ta' xenarju negattiv tas-suq fuq it-tranzazzjonijiet derivattivi ta' istituzzjoni kkunsidrati materjali fl-applikazzjoni tal-Artikolu 1 ta' dan ir-Regolament, għandu jkun l-akbar fluss nett assolut ta' kollateral fuq 30 jum matul l-24 xahar ta' qabel id-data tal-kalkolu tar-rekwiżit tal-kopertura ta' likwidità msemmi fl-Artikolu 412(1) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.
2. L-istituzzjonijiet jistgħu jittrattaw il-flussi ta' dhul u ta' hruġ tat-tranzazzjonijiet fuq bażi netta, biss meta dawn ikunu eżegwiti taht l-istess ftehim prinċipali ta' netting. Il-fluss nett assolut ta' kollateral għandu jkun ibbażat fuq il-fluss kemm ta' hruġ kif ukoll ta' dhul irrealizzat, u n-netting għandu jiġi kkalkulat fil-livell ta' portafoll tal-istituzzjoni.

Artikolu 3

Dhul fis-sehh

Dan ir-Regolament għandu jidhol fis-sehh fl-għoxrin jum wara dak tal-pubblikazzjoni tiegħu f'Il-Ġurnal Uffiċjali tal-Unjoni Ewropea.

Dan ir-Regolament għandu jorbot fl-intier tiegħu u japplika direttament fl-Istati Membri kollha.

Magħmul fi Brussell, il-31 ta' Ottubru 2016.

Għall-Kummissjoni
Il-President
Jean-Claude JUNCKER