

Datum 2018-01-18

Finansinspektionen
Box 7821
SE-103 97 Stockholm
[Brunnsgatan 3]
Tel +46 8 408 980 00
Fax +46 8 24 13 35
finansinspektionen@fi.se
www.fi.se

Instruktion för anmälan till behörig myndighet om undantag från clearingkravet

Förordning (EU)nr 648/2012 om OTC-derivat, centrala motparter och transaktionsregister (Emir) ger EU-kommissionen mandat att fastställa klasser av OTC derivat som ska vara föremål för clearingkrav. Finansiella motparter och icke-finansiella motparter som ligger över clearingtröskeln måste cleara sina OTC- transaktioner i dessa klasser hos en central motpart.

Emir möjliggör för motparter som tillhör samma grupp att få undantag från clearingkravet enligt artikel 4.2 Emir. Detta avser bara transaktioner inom grupper i enlighet med artikel 3 Emir.

Den Europeiska värdepappersmarknadstillsynsmyndigheten (ESMA) har publicerat "Frågor och svar om Emir". Svaret på OTC-fråga nummer 6 är relevant för underrättelser och ansökningar om undantag från clearingkravet.

Varje motpart som är etablerad i ett EU-land ska skriftligen underrätta sin behöriga myndighet senast 30 dagar innan motparten har för avsikt att utnyttja undantaget för transaktioner med motparter inom samma grupp som är etablerade inom EU. Den behöriga myndigheten kan motsätta sig utnyttjandet av undantaget om förutsättningarna i artikel 3 inte är uppfyllda. Motparter i två olika EU-länder ska underrätta sina respektive behöriga myndigheter. En ensidig ansökan krävs om den andra motparten är etablerad i ett tredjeland. I detta fall ska den behöriga myndigheten ge sitt tillstånd till att utnyttja undantaget innan detta kan ske.

När ska anmälan göras?

Beroende på vilken kategori som en motpart tillhör, och vilken produkt som avses, träder clearingkravet i kraft vid olika tidpunkter. Finansinspektionen (FI) rekommenderar att anmälan görs i god tid innan clearingkravet träder i kraft. Anmälan ska endast omfatta de motparter som man redan handlar med eller som man har för avsikt att handla med inom en nära framtid.

Ytterligare motparter

Om behov uppkommer att anmäla undantag för transaktioner med fler motparter ska relevanta parter skicka en ny anmälan.

Fel och ändringar

Om fel, eller ett behov av att korrigera tidigare lämnad information, uppstått ska en ny anmälan göras. Ingen anmälan ska göras när handel mellan två parter upphör.

Blanketter för anmälan

Anmälan görs genom att använda anmälningsblanketter med bilagor. Det finns två alternativa blanketter. Den ena avser underrättelse när alla motparterna är etablerade inom EU. Den andra avser ansökan i de fall den andra motparten är etablerad i tredjeland.

Bilagor till anmälan

En anmälan ska innehålla en bilaga som förklarar motparternas centraliserade förfarande för bedömning, mätning och kontroll av risker i enlighet med svar OTC 6d i ESMA:s ”Frågor och svar om Emir”. Om det finns skillnader i hur den centrala riskhanteringen sker i olika delar av gruppen, som är relevant för anmälan, ska detta förklaras i bilagan. Bilagan ska vara i pdf-format.

En andra bilaga ska förklara gruppens struktur på en sådan detaljnivå att relationerna inom gruppen mellan alla motparter är uppenbar. Exakt utformning av denna bilaga är beroende av gruppstrukturen. Även denna bilaga ska vara i pdf-format.

Insändande av anmälan

Anmälan skickas med e-post till finansinspektionen@fi.se.

Bilaga 1

Instruktioner för att fylla i formulär för underrättelse av intragruppundantag *när båda parter är etablerade inom EU.*

Bilaga 2

Instruktion för att fylla i formulär för ansökan om intragruppundantag *när den andra motparten är etablerad i ett tredjeland.*

Bilaga 1

Instruktion för ifyllande av formulär för underrättelse av utnyttjande av undantag av clearingkravet vid transaktioner inom grupper när båda motparterna är etablerade inom EU.

Dessa instruktioner avser anmälan av underrättelse av utnyttjande av undantag från clearingkravet för transaktioner inom grupper och är avsedda för motparter som båda är etablerade inom EU. Ett separat formulär finns för motparter som ansöker om undantag från clearingkravet när den ena motparten är etablerad i ett EU-land och den andra motparten inom gruppen är etablerad i ett land utanför EU.

Vänligen förvissa er om att ni har läst relevant dokument innan ni fyller i formuläret.

Allmänna instruktioner

Var och en av motparterna inom gruppen ska göra en anmälan för varje annan motpart för vilken man avser att utnyttja undantaget för. Det innebär att båda motparterna har samma skyldighet. I det fall en motpart är etablerad i Sverige och den andra motparten i till exempel Finland ska den första motparten göra en anmälan till den behöriga myndigheten i Sverige, medan den andra motparten ska göra en anmälan till den behöriga myndigheten i Finland. Vissa medlemsstater har mer än en (1) behörig myndighet.

Det är möjligt för en anmälende motpart att göra flera anmälningar på samma blankett så länge anmälan ska till samma behöriga myndighet. Den som gör anmälan måste ha behörighet från samtliga motparter för vilka anmälan görs.

Behöriga myndigheter agerar inte för varandra. Av den anledningen behöver anmälan alltid göras direkt till en eller flera behöriga myndigheter om en eller flera av de andra motparterna är etablerade i andra EU-länder eller de olika motparterna har olika behöriga myndigheter.

Enkla fall

I det enklaste fallet finns två motparter inom en grupp i samma EU-land med samma behöriga myndighet för båda motparter. Motparterna kan då antingen skicka separata anmälningar eller så kan en och samma person ges behörighet av båda motparter att anmäla för båda motparters räkning på samma formulär.

Om båda motparterna har samma behöriga myndighet och den person som gör anmälan har befogenhet att agera för bådask räkning ska formuläret innehålla två rader per par, en rad för varje motpart i sin roll som anmälende motpart.

Mer än ett motpartspar

Om det förekommer transaktioner mellan fler motparter inom gruppen ska två rader fyllas i för varje par. Detta innebär att om en motpart har transaktioner med två andra motparter men dessa motparter inte handlar med varandra ska det finnas fyra rader. Två rader för den första motparten med de andra motparterna och en var för de övriga två motparterna som anmälade motparter.

Enheter i olika EU-länder

Om motparter är etablerade i olika EU-länder ska det bara vara en rad för den anmälade motparten. Landskod och fält för behörig myndighet ska i detta fall fyllas i för den andra motparten. Den andra motparten ska göra en separat anmälan till sin behöriga myndighet.

En motpart i ett EU-land och den andra motparten i ett tredjeland

Vänligen använd särskilt formulär för detta ändamål. Se instruktion i Bilaga 2.

Är det möjligt att kombinera transaktioner mellan två motparter i samma land och transaktioner mellan motparter i olika EU-länder i samma anmälan?

Ja, det är möjligt på grund av att man kan skilja på anmälningar mellan två motparter i samma EU-land från anmälningar mellan två motparter i olika EU-länder genom informationen i de olika fälten.

Övriga instruktioner

Vänligen notera att det är två ark i Excelarbetsboken. Båda ska fyllas i.

Bilaga 2

Instruktion för ifyllande av formulär för transaktioner inom grupper när den andra motparten är etablerad i ett tredjeland.

Denna instruktion avser ansökan om undantag från clearingkravet för transaktioner inom grupper. Formuläret ska användas när den andra motparten är etablerad i ett tredjeland. Ett separat formulär finns för motparter som ansöker om undantag för transaktioner när båda motparter är etablerade inom EU.

Vänligen förvissa er om att ni läst igenom dokumentet innan ni fyller i formuläret.

Allmänna instruktioner

Skyldighet att ansöka åligger motpart etablerad inom EU. En separat ansökan ska göras för varje motpart som är etablerad i tredjeland.

Vänligen notera att två formulär ska fyllas i för denna typ av anmälan

- 1) Ansökan om undantag för clearingkrav med motpart i ett icke EU-land
- 2) Motpartsinformation