



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 ansökan/underrättelse om undantag från utväxling av säkerheter enligt Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 648/2012 om OTC-derivat, centrala motparter och transaktionsregister (Emir)

Sammanfattning

Under vissa omständigheter är ett undantag från att ställa säkerheter avseende icke-clearade OTC-derivat tillgängligt för företag för deras koncerninterna transaktioner. Vissa villkor måste uppfyllas och i vissa fall måste företagen ansöka till nationell behörig myndighet och beviljas undantag. I andra fall räcker det med att underrätta den behöriga myndigheten.

Bestämmelser om marginalkraven och undantag från dessa återfinns i artikel 11 i Emir och i kommissionens delegerade förordningar nr 2016/2551 och 2013/149.

Finansinspektionen är den nationella behöriga myndigheten som ansvarar för att bedöma ansökningar/underrättelser från svenska motparter. Denna instruktion är avsedd att hjälpa företag att fylla i ansökningsblanketterna. Ifylld blankett jämte bilagor skickas med e-post till finansinspektionen@fi.se. Eventuella frågor kan skickas till emir@fi.se.

Typer av tillämpningar

1. För en i Sverige etablerad motpart som önskar undantas från kravet på att ställa säkerheter avseende för icke-centralt clearade OTC-derivattransaktioner med en annan i Sverige etablerad motpart som tillhör samma grupp krävs ingen formell ansökan eller underrättelse. Ni bör dock försäkra er om att ni uppfyller de relevanta villkoren (artikel 11.5 i Emir).
2. Om ert företag är en i Sverige etablerad finansiell motpart som önskar undantas från kravet på att ställa säkerheter avseende för icke-centralt clearade OTC-derivattransaktioner med en annan finansiell motpart, etablerad i annat land inom EU, som tillhör samma grupp måste ni skicka in en ansökan till FI om undantag (artikel 11.6 Emir).
3. Om ert företag är en i Sverige etablerad icke-finansiell motpart som önskar undantas från marginalkravet avseende OTC-derivattransaktioner med en annan icke-finansiell motpart, etablerad i annat land inom EU, som tillhör samma grupp måste ni skicka in en underrättelse till FI om utnyttjade av undantag (artikel 11.7 Emir).

4. Om ert företag är en i Sverige etablerad icke-finansiell motpart som önskar undantas från marginalkravet avseende icke-centralt clearade OTC-derivattransaktioner med en finansiell motpart, etablerad i ett annat land inom EU, som tillhör samma grupp krävs ingen ansökan av ert företag (artikel 11.10 Emir). Ett meddelande om detta undantag kommer att lämnas till FI av den nationella myndigheten för den finansiella motparten.
5. Om ert företag är en i Sverige etablerad motpart som önskar undantas från att ställa marginalsäkerheter i förhållande till icke-centralt clearade OTC-derivattransaktioner med en motpart i ett tredje land som europeiska kommissionen har antagit beslut om likvärdighet för och som tillhör samma grupp måste ni skicka in en ansökan/underrättelse till FI om undantag (artikel 11.8-9 Emir).

Ansökningsblankett

Del 1 (Uppgifter om sökanden och riskhanteringsförfaranden)

Del 1 består av avsnitt A till C och avser information om sökanden, riskhanteringsförfaranden och förekomsten av eventuella hinder för överföring av egna medel eller återbetalning av skulder mellan motparterna.

Om ni har flera koncernenheter ni vill ansöka om undantag för och uppgifterna i avsnitt A till C är desamma kan ni använda ansökningsblanketten för flera koncernenhetspar. Tabellen nedan ger ytterligare information om de uppgifter det sökande företaget ska lämna.

Fråga	Detaljeringsgrad	Relevant lagstiftning
A1 – A5	Fyll i relevanta uppgifter om sökanden.	Inte tillämpligt
A6 - 7	Välj ett alternativ i listrutan	Inte tillämpligt
B1	Välj ett alternativ i listrutan	Artikel 3 Emir
B2	Sammanfatta sökandens riskhanteringsförfaranden i koncernen. Underlag måste lämnas i avsnitt G2 som styrker detta svar. Observera dock att en sammanfattning krävs här förutom det relevanta styrkande underlaget. Se OTC Q&A 6(d) i Esmas Emir Q&As för vägledning.	Artikel 3 Emir
B3	Välj ett alternativ i listrutan	Stycke (a), artiklarna 11.6-10 Emir
B4	Beskriv hur den sökandens riskhanteringsförfaranden i koncernen säkerställer regelbunden övervakning av koncerninterna exponeringar. Beskriv hur man säkerställer reglering i tid av de skyldigheter som härrör från koncerninterna OTC-derivatkontrakt baserat på övervaknings- och likviditetsverktyg på koncernnivå. Beskriv hur övervaknings- och likviditetsverktygen är förenliga med komplexiteten i de koncerninterna transaktionerna.	Stycke (a), artiklarna 11.6-10 Emir
C1	Välj ett alternativ i listrutan	Stycke (b), artiklarna 11.6-10 Emir
C2	Beskriv vilka tester/åtgärder sökanden har vidtagit för att fastställa om det finns några aktuella eller förutsedda juridiska hinder för en snabb överföring av egna medel eller återbetalning av skulder mellan motparterna.	Stycke (b), artiklarna 11.6-10 Emir Artikel 33 i kommissionens delegerade förordning 2016/2551
C3	Välj ett alternativ i listrutan	Stycke (b), artiklarna 11.6-10 Emir
C4	Beskriv vilka tester/åtgärder sökanden har vidtagit för att fastställa om det finns några aktuella eller förutsedda praktiska hinder för en snabb överföring av egna medel eller återbetalning av skulder mellan motparterna.	Stycke (b), artiklarna 11.6-10 Emir Artikel 34 i kommissionens delegerade förordning 2016/2551

Del 2 (Uppgifter om koncernintern motpart samt transaktionsinformation)

Del 2 består av avsnitt D till F och avser uppgifter om koncernintern motpart samt transaktionsinformation.

Om ni fyller i en ansökan för flera koncernenhetspar måste alla frågor i denna del besvaras för varje koncerninternt enhetspar i alla relevanta kolumner på höger sida av Del 2 i blanketten. Det går att ha högst 20 koncerninterna par (dvs. 20 kolumner) per ansökan. Tabellen nedan ger ytterligare information om de uppgifter det sökande företaget ska lämna.

Fråga	Detaljeringsgrad	Relevant lagstiftning
D1 – D5	Fyll i relevanta uppgifter om den koncerninterna motparten	Inte tillämpligt
D6	Välj ett alternativ i listrutan.	Inte tillämpligt
D7	Lämna uppgifter om den tillsynsmyndighet som granskar ansökan för den koncerninterna motparten, inklusive kontaktuppgifter till handläggaren om sådana finns. Lämna tomt om ej tillämpligt (dvs. om den koncerninterna motparten inte är ett EU-företag)	Inte tillämpligt
E1	Välj ett alternativ i listrutan.	Artikel 11.6-10 Emir Artikel 36 i kommissionens delegerade förordning 2016/2551
E2	Välj ett alternativ i listrutan.	Artikel 3 Emir
E3	Välj ett alternativ i listrutan. Underlag måste lämnas i avsnitt G1 som styrker detta svar.	Artikel 18 i kommissionens delegerade förordning 2013/149
E4	Ange namnet på den nationella behöriga myndigheten till vilken den koncerninterna motparten skickar sin ansökan (i förekommande fall, det vill säga om den koncerninterna motparten också är ett EU-företag).	Inte tillämpligt
E5	Välj ett alternativ i listrutan.	Artikel 3 Emir
E6	Beskriv hur de koncerninterna motparterna ingår i samma koncernredovisning.	Artikel 3 Emir
E7	Välj ett alternativ i listrutan.	Artikel 3 Emir
E8 – E10	Ge information om den nationella behöriga myndigheten som ansvarar för konsoliderad tillsyn av motparterna.	Inte tillämpligt
F1 – F3	Välj "X" i listrutan för alla alternativ som gäller mellan sökanden och den koncerninterna motparten.	Artikel 18 i kommissionens delegerade förordning 2013/149
F4	Fyll i alla relevanta valutor för varje tillgångsklass som är relevant för OTC-derivatkontrakten mellan sökanden och den koncerninterna motparten.	Artikel 18 i kommissionens delegerade förordning 2013/149
F5	Fyll i den maximala besittningsrätten (i år) för OTC-derivatkontrakten mellan sökanden och den koncerninterna motparten.	Artikel 18 i kommissionens delegerade förordning 2013/149
F6	Välj "X" i listrutan för alla alternativ som gäller mellan sökanden och den koncerninterna motparten.	Artikel 18 i kommissionens delegerade förordning 2013/149
F7	Storlek: Fyll i den förväntade genomsnittliga storleken på OTC-derivattransaktionerna mellan de ansökande motparterna för det kommande året. Sökande ska ange det genomsnittliga nominella beloppet för OTC-transaktioner i miljoner euro per transaktion.	Artikel 18 i kommissionens delegerade förordning 2013/149
F8	Volym: Fyll i den förväntade volymen på OTC-derivattransaktionerna mellan de ansökande motparterna för det kommande året. Sökande ska ange det totala nominella bruttobeloppet i miljoner euro för alla transaktioner.	Artikel 18 i kommissionens delegerade förordning 2013/149
F9	Frekvens: Fyll i det förväntade antalet OTC-derivattransaktioner mellan de ansökande motparterna för det kommande året.	Artikel 18 i kommissionens delegerade förordning 2013/149

Del 3 (Styrkande dokumentation och deklARATION)

Del 3 består av avsnitt G och H och avser att sökanden bekräftar att man har lämnat relevant styrkande dokumentation och att man har förstått de villkor enligt vilka man har lämnat in ansökan.

Alla styrkande underlag ska vara i Word-, Excel- eller PDF-format och vara bifogade mejlet tillsammans med den ifyllda ansökningsblanketten.

Enligt avsnitt G ("Styrkande dokumentation") kräver inte Finansinspektionen att sökande lämnar in något juridiskt utlåtande för att styrka sin ansökan. Observera dock att Finansinspektionen vid behov kan begära ett juridiskt utlåtande för att ytterligare styrka ansökan. Tabellen nedan ger ytterligare information om de uppgifter sökanden ska lämna.

Fråga	Detaljeringsgrad	Relevant lagstiftning
G1	<p>Sökande behöver lämna dokumentation som styrker det svar som lämnats i fråga E3 om företagsrelationen mellan motparterna.</p> <p>Ett organisationsschema eller dokumentation som beskriver relationen mellan de koncerninterna motparterna räcker.</p> <p>Om ni använder en ansökningsblankett för flera koncernenhetspar räcker det med ett diagram över koncernstrukturen som omfattar alla koncernenheter i ansökan.</p> <p>Namnkonvention: [SÖKANDES NAMN]_KOD 1_FI_[bilagenummer på bifogat dokument]_[ÅR]</p>	Artikel 18.2 kommissionens delegerade förordning 2013/149
G2	<p>Sökande behöver lämna dokumentation som styrker det svar som lämnats i fråga B2 om riskhanteringsförfaranden i koncernen.</p> <p>Om ni använder en ansökningsblankett för flera koncernenhetspar räcker det med ett dokument om riskhanteringsförfaranden som omfattar alla koncernenheter i ansökan.</p> <p>Namnkonvention: [SÖKANDES NAMN]_KOD A_FI_[bilagenummer på bifogat dokument]_[ÅR]</p>	Artikel 18.2 kommissionens delegerade förordning 2013/149
G3	<p>Sökande behöver lämna dokumentation som styrker de svar som lämnats i Avsnitt F om transaktionsinformation mellan de koncerninterna motparterna.</p> <p>Sökande bör lämna uppgifter om koncerninterna transaktioner (inklusive utestående nominella positioner och antal ingångna handelsavtal) under de senaste 12 månaderna, om inte en annan tidsperiod är nödvändig för att ge Finansinspektionen insyn i de koncerninterna parens normala handelsaktivitet.</p> <p>En ögonblicksbild av handeln under ovan angiven tidsperiod är tillräcklig för respektive enhetspar.</p> <p>Namnkonvention: [SÖKANDES NAMN]_KOD B_FI_[bilagenummer på bifogat dokument]_[ÅR]</p>	Artikel 18.2 kommissionens delegerade förordning 2013/149

Fråga	Fråga	Detaljeringsgrad	Fråga	Detaljeringsgrad
G4	Sökande behöver lämna dokumentation som styrker de svar som lämnats i Avsnitt F om transaktionsinformation mellan de koncerninterna motparterna. Om ni använder ansökningsblankett för flera koncernenhetspar måste avtalskopior på relevanta ISDA-förteckningar (om sådana finns) lämnas för varje enhetspar. Namnkonvention: [SÖKANDES NAMN]_KOD C_FI_[bilagenummer på bifogat dokument]_[ÅR]		Artikel 18.2 kommissionens delegerade förordning 2013/149	
H1 – H2	Välj alternativ i listrutan för att bekräfta att den information ni har lämnat är korrekt och att ni har bifogat relevanta styrkande underlag. Ansökningar där man inte lämnar styrkande underlag enligt vad som begärs i avsnitt G ovan anses ofullständiga.		Inte tillämpligt	
H3	Denna fråga ska besvaras för alla koncerninterna ansökningar mellan företag i Sverige och övriga EU-länder. Välj alternativ i listrutan för att bekräfta att omfattningen (och därmed de uppgifter som lämnas om de transaktioner för vilka den sökande ansöker om undantag) är densamma i ansökan som den omfattning och transaktionsinformation som beskrivs i ansökan som lämnats in av den koncerninterna motparten till deras relevanta nationella behöriga myndighet. Lämna tomt om ej tillämpligt (dvs. om den koncerninterna motparten inte är ett EU-företag).		Inte tillämpligt	
H4	Välj alternativ för att bekräfta att sökanden går med på att underrätta Finansinspektionen omedelbart om eventuella ändringar som kan påverka uppfyllandet av villkoren i artikel 3 och artikel 11.6-10 i Emir samt artikel 32 till 34 i kommissionens delegerade förordning 2016/2251, enligt vad som är tillämpligt. Företagen ska meddela Finansinspektionen om eventuella ändringar enligt vad som beskrivs ovan via e-post till finansinspektionen@fi.se så snart förändringen har skett.		Inte tillämpligt	
H5	Välj alternativ för att bekräfta att deklARATIONEN har lästs och förstås.		Inte tillämpligt	
H6 – H9	Fyll i kontaktuppgifter för person med lämplig befattning. Ansökningsblanketten ska undertecknas av behörig firmatecknare. Denna person måste verifiera att all information i ansökningsblanketten är korrekt.		Inte tillämpligt	