KOMISIJOS ĮGYVENDINIMO REGLAMENTAS (ES) 2021/1122

2021 m. liepos 8 d.

kuriuo iš dalies keičiamas Įgyvendinimo reglamentas (ES) 2016/1368 į finansų rinkose naudojamų ypatingos svarbos lyginamųjų indeksų sąrašą, nustatytą pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (ES) 2016/1011, įtraukiant Norvegijos tarpbankinę palūkanų normą ir iš jo išbraukiant Londono tarpbankinę palūkanų normą

(Tekstas svarbus EEE)

EUROPOS KOMISIJA,

atsižvelgdama į Sutartį dėl Europos Sąjungos veikimo,

atsižvelgdama į 2016 m. birželio 8 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (ES) 2016/1011 dėl indeksų, kurie kaip lyginamieji indeksai naudojami finansinėse priemonėse ir finansinėse sutartyse arba siekiant įvertinti investicinių fondų veiklos rezultatus, kuriuo iš dalies keičiami direktyvos 2008/48/EB ir 2014/17/ES bei Reglamentas (ES) Nr. 596/2014 ([1]), ypač į jo 20 straipsnio 1 dalį,

kadangi:

(1) lyginamieji indeksai gali būti pripažįstami ypatingos svarbos lyginamaisiais indeksais pagal Reglamento (ES) 2016/1011 20 straipsnio 1 dalies a, b arba c punktą. Pagal 20 straipsnio 1 dalies b punktą, kad galėtų būtų pripažinti ypatingos svarbos lyginamaisiais indeksais, lyginamieji indeksai turi būti grindžiami duomenų teikėjų, kurių dauguma yra vienoje valstybėje narėje, pateiktais duomenimis ir toje valstybėje narėje jie turi būti laikomi ypatingos svarbos. 2016 m. rugpjūčio 11 d. Komisija priėmė Komisijos įgyvendinimo reglamentą (ES) 2016/1368 ([2]), kuriuo nustatytas ypatingos svarbos lyginamųjų indeksų sąrašas;

(2) Reglamentas (ES) 2016/1011 taikomas Europos ekonominėje erdvėje (EEE) ir 2019 m. gruodžio 6 d. buvo įgyvendintas Norvegijos teisės aktais;

(3) 2020 m. gruodžio 3 d. Norvegijos kompetentinga institucija „Finanstilsynet“ pranešė Europos vertybinių popierių ir rinkų institucijai (toliau – ESMA) apie savo pasiūlymą pagal Reglamento (ES) 2016/1011 20 straipsnio 1 dalies b punktą pripažinti Norvegijos tarpbankinę palūkanų normą (toliau – NIBOR) ypatingos svarbos lyginamuoju indeksu, nes NIBOR yra ypatingos svarbos Norvegijoje ir yra grindžiama duomenų teikėjų, kurie visi yra Norvegijoje, pateiktais duomenimis;

(4) NIBOR – pagrindinė palūkanų norma, pagrįsta palūkanų normų, kuriomis Norvegijos pinigų rinkoje veikiantys bankai nori skirtingais terminais skolinti vienas kitam neužtikrintas lėšas, vidurkiu. Kasdien nustatoma penkių skirtingų terminų NIBOR: vienos savaitės ir vieno, dviejų, trijų ir šešių mėnesių. 2020 m. gruodžio 3 d. NIBOR bankų grupėje dalyvavo šeši bankai, kurie visi yra Norvegijoje;

(5) Europos vertybinių popierių ir rinkų institucijai pateiktame vertinime „Finanstilsynet“ padarė išvadą, kad nustojus teikti NIBOR arba ją teikiant remiantis pradiniais duomenimis arba duomenų teikėjų grupe, kurie nebeatspindi pagrindinės rinkos arba ekonomikos realijos, galėtų būti padarytas didelis neigiamas poveikis finansų rinkų veikimui Norvegijoje;

(6) „Finanstilsynet“ vertinimas rodo, kad su NIBOR yra susietos maždaug 418 mlrd. EUR namų ūkiams ir ne finansų įstaigoms suteiktų paskolų, kurios sudaro 94 % visų Norvegijoje namų ūkiams ir ne finansų įstaigoms suteiktų paskolų ir atitinka 136 % Norvegijos bendrojo vidaus produkto (BVP). Be to, su NIBOR yra susieta maždaug 60 % visos nominaliosios Norvegijos kintamųjų palūkanų obligacijų vertės, t. y. iš viso apie 130 mlrd. EUR, atkarpos mokėjimų. Remdamasi vienos pagrindinės sandorio šalies duomenimis „Finanstilsynet“ taip pat įrodė, kad su

([1]) OL L 171, 2016 6 29, p. 1.

([2]) 2016 m. rugpjūčio 11 d. Komisijos įgyvendinimo reglamentas (ES) 2016/1368, kuriuo pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (ES) 2016/1011 nustatomas finansų rinkose naudojamų ypatingos svarbos lyginamųjų indeksų sąrašas (OL L 217, 2016 8 12, p. 1).

NIBOR yra susietos ne biržos palūkanų normos išvestinės finansinės priemonės, kurių nominalioji suma 2020 m. spalio mėn. sudarė ne mažiau kaip 1 988 mlrd. EUR. Galiausiai „Finanstilsynet“ nurodė, kad su NIBOR šiuo metu yra susieti investiciniai fondai, kurių bendra grynojo turto vertė yra 0,3 mlrd. EUR. Todėl bendra su NIBOR susietų finansinių priemonių ir finansinių sutarčių vertė yra bent aštuonis kartus didesnė už Norvegijos bendrąjį nacionalinį produktą;

(7) „Finanstilsynet“ vertinime padaryta išvada, kad NIBOR yra labai svarbi norint užtikrinti finansinį stabilumą ir rinkos vientisumą Norvegijoje ir kad nustojus teikti NIBOR arba jai tapus nepatikima tai galėtų turėti didelį neigiamą poveikį finansų rinkų veikimui Norvegijoje ir bendrovėms bei vartotojams, nes ji naudojama paskoloms, vartojimo kredito produktams, ne biržos palūkanų normos išvestinėms finansinėms priemonėms ir investiciniams fondams;

(8) 2021 m. sausio 28 d. ESMA nusiuntė Komisijai savo nuomonę, kurioje išdėstė, kad „Finanstilsynet“ vertinimas atitinka Reglamento (ES) 2016/1011 20 straipsnio 3 dalies reikalavimus ir kad „Finanstilsynet“ pateikė kiekybinių duomenų, pagrindžiančių, kodėl reikia NIBOR pripažinti ypatingos svarbos lyginamuoju indeksu, taip pat analitinius motyvus, kuriais pabrėžiama NIBOR svarba Norvegijos ekonomikai;

(9) pagal Reglamento (ES) 2016/1011 20 straipsnio 1 dalį Komisija turi bent kas dvejus metus peržiūrėti ypatingos svarbos lyginamųjų indeksų sąrašą ir tuos lyginamuosius indeksus turi teikti Sąjungoje esantys administratoriai. 2020 m. sausio 31 d. Jungtinė Karalystė išstojo iš Sąjungos. Todėl Jungtinėje Karalystėje esančio administratoriaus teikiami lyginamieji indeksai nebegali būti laikomi ypatingos svarbos lyginamaisiais indeksais ir turėtų būti išbraukti iš Įgyvendinimo reglamento (ES) 2016/1368 priede pateikto ypatingos svarbos lyginamųjų indeksų sąrašo. Londono tarpbankinė palūkanų norma (LIBOR) pripažinta ypatingos svarbos lyginamuoju indeksu 2017 m. gruodžio 19 d., todėl LIBOR turėtų būti išbraukta iš Įgyvendinimo reglamento (ES) 2016/1368 priede pateikto ypatingos svarbos lyginamųjų indeksų sąrašo;

(10) Reglamentas (ES) 2016/1011 buvo iš dalies pakeistas Europos Parlamento ir Tarybos reglamentu (ES) 2019/2175 ([3]), be kita ko, nuo 2022 m. sausio 1 d. ESMA paskiriant ypatingos svarbos lyginamųjų indeksų, nurodytų Reglamento (ES) 2016/1011 20 straipsnio 1 dalies a ir c punktuose, administratorių kompetentinga institucija. Tačiau ypatingos svarbos lyginamųjų indeksų, nurodytų Reglamento (ES) 2016/1011 20 straipsnio 1 dalies b punkte, administratorių kompetencija liks atitinkamai nacionalinei kompetentingai institucijai. Todėl tikslinga, kad Komisijos nustatytame ypatingos svarbos lyginamųjų indeksų sąraše būtų skiriami Reglamento (ES) 2016/1011 20 straipsnio 1 dalies a ir c punktuose nurodyti ypatingos svarbos lyginamieji indeksai ir to reglamento 20 straipsnio 1 dalies b punkte nurodyti lyginamieji indeksai;

(11) todėl Įgyvendinimo reglamentas (ES) 2016/1368 turėtų būti atitinkamai iš dalies pakeistas;

(12) atsižvelgiant į ypatingą NIBOR svarbą, platų naudojimą ir vaidmenį paskirstant kapitalą Norvegijoje, šis reglamentas turėtų įsigalioti skubos tvarka;

(13) šiame reglamente numatytos priemonės atitinka Europos vertybinių popierių komiteto nuomonę,

PRIĖMĖ ŠĮ REGLAMENTĄ:

1 straipsnis

Įgyvendinimo reglamento (ES) 2016/1368 priedas pakeičiamas šio reglamento priedo tekstu.

([3]) 2019 m. gruodžio 18 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) 2019/2175, kuriuo iš dalies keičiamas Reglamentas (ES) Nr. 1093/2010, kuriuo įsteigiama Europos priežiūros institucija (Europos bankininkystės institucija), Reglamentas (ES) Nr. 1094/2010, kuriuo įsteigiama Europos priežiūros institucija (Europos draudimo ir profesinių pensijų institucija), Reglamentas (ES) Nr. 1095/2010, kuriuo įsteigiama Europos priežiūros institucija (Europos vertybinių popierių ir rinkų institucija), Reglamentas (ES) Nr. 600/2014 dėl finansinių priemonių rinkų, Reglamentas (ES) 2016/1011 dėl indeksų, kurie kaip lyginamieji indeksai naudojami finansinėse priemonėse ir finansinėse sutartyse arba siekiant įvertinti investicinių fondų veiklos rezultatus, ir Reglamentas (ES) 2015/847 dėl informacijos, teikiamos pervedant lėšas (OL L 334, 2019 12 27, p. 1).

2 straipsnis

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

Šis reglamentas privalomas visas ir tiesiogiai taikomas visose valstybėse narėse.

Priimta Briuselyje 2021 m. liepos 8 d.

Komisijos vardu
Pirmininkė
Ursula VON DER LEYEN

PRIEDAS

„*PRIEDAS*

Ypatingos svarbos lyginamųjų indeksų sąrašas pagal Reglamento (ES) 2016/1011 20 straipsnio 1 dalies a ir c punktus

Nr.	Lyginamasis indeksas	Administratorius	Vieta
1	euro tarpbankinio skolinimo palūkanų norma (EURIBOR®)	Europos pinigų rinkų institutas (EMMI)	Briuselis, Belgija
2	euro vienos nakties palūkanų vidurkio indeksas (EONIA®)	Europos pinigų rinkų institutas (EMMI)	Briuselis, Belgija

Ypatingos svarbos lyginamųjų indeksų sąrašas pagal Reglamento (ES) 2016/1011 20 straipsnio 1 dalies b punktą

Nr.	Lyginamasis indeksas	Administratorius	Vieta
1	Stokholmo tarpbankinė palūkanų norma (STIBOR)	Švedijos bankininkų asociacija („Svenska Bankföreningen“)	Stokholmas, Švedija
2	Varšuvos tarpbankinė palūkanų norma (WIBOR)	„GPW Benchmarks S.A.“	Varšuva, Lenkija
5	Norvegijos tarpbankinė palūkanų norma (NIBOR)	„Norske Finansielle Referanser“ (Nore)	Oslas, Norvegija“