II

(Muud kui seadusandlikud aktid)

MÄÄRUSED

KOMISJONI RAKENDUSMÄÄRUS (EL) 2022/1650,

24. märts 2022,

millega muudetakse rakendusmääruses (EL) 2016/1646 sätestatud rakenduslikke tehnilisi standardeid seoses põhiindeksite ja tunnustatud börsidega vastavalt Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrusele (EL) nr 575/2013

(EMPs kohaldatav tekst)

EUROOPA KOMISJON,

võttes arvesse Euroopa Liidu toimimise lepingut,

võttes arvesse Euroopa Parlamendi ja nõukogu 26. juuni 2013. aasta määrust (EL) nr 575/2013, mis käsitleb krediidiasutuste suhtes kohaldatavaid usaldatavusnõudeid ja millega muudetakse määrust (EL) nr 648/2012, ([1]) eriti selle artikli 197 lõiget 8,

ning arvestades järgmist:

(1) Komisjoni rakendusmäärus (EL) 2016/1646 ([2]) võeti vastu eeldusel, et aktsiaindeksid, mida määruse (EL) nr 575/2013 kohaldamisel käsitatakse põhiindeksitena (ja mis seega võimaldavad krediidiasutustel ja investeerimisühingutel kasutada nendesse indeksitesse kuuluvaid aktsiaid aktsepteeritud tagatisena), peaksid koosnema peamiselt aktsiatest, mille puhul võib põhjendatult eeldada, et need saab realiseerida juhul, kui krediidiasutus või investeerimisühing peab need likvideerima. Eeldati, et see oleks nii, kui vähemalt 90 % indeksi komponentideks olevate avalikkusele kuuluvate aktsiate väärtus on vähemalt 500 000 000 eurot või avalikkusele kuuluvate aktsiate kohta teabe puudumise korral on indeksi komponentide turukapitalisatsioon vähemalt 1 000 000 000 eurot. See eeldus ei ole muutunud.

(2) Samuti on rakendusmääruses (EL) 2016/1646 sätestatud, et krediidiasutustel ja investeerimisühingutel peaks olema võimalik võtta aktsepteeritud tagatisena arvesse instrumente, mis kuuluvad põhiindeksitesse, mis ei vasta eespool nimetatud kriteeriumidele, kuid mille komponentidega kaubeldakse piisavalt, ning on käsitletud nende indeksite kindlaksmääramiseks uusi kriteeriume. Kogemused on siiski näidanud, et kuna need kriteeriumid on määratletud seoses turuga, millel indeks põhineb, on neid keeruline kohaldada kolmandas riigis kehtestatud põhiindeksi suhtes, sest selleks tuleks koguda andmeid kõigi sellel turul kauplemisele lubatud aktsiate kohta. See on takistanud nõuetekohaselt saavutada määruse (EL) nr 575/2013 eesmärki tagada indeksi komponentide likviidsuse miinimumkünnis. Seepärast tuleks kehtestada tuvastatud puuduste kõrvaldamiseks uued kriteeriumid. Uued kriteeriumid peaksid tagama, et instrumente saab kasutada aktsepteeritud tagatisena, ja seega tagama piisava likviidsuskünnise sõltumata turust, millel indeks põhineb, kui täidetud on kaks standardsete turu likviidsusnäitajatega seotud tingimust. Esimese tingimuse kohaselt peaks vähemalt 80 % indeksi komponentideks olevate avalikkusele kuuluvate aktsiate väärtus olema vähemalt 25 000 000 eurot või avalikkusele kuuluvate aktsiate kohta teabe puudumise korral peaks indeksi komponentide turukapitalisatsioon olema vähemalt 50 000 000 eurot. Teise tingimuse kohaselt peaks kõigil indeksi komponentidel, mille turukapitalisatsioon on kuni 10 000 000 000 eurot,

([1]) ELT L 176, 27.6.2013, lk 1.

([2]) Komisjoni 13. septembri 2016. aasta rakendusmäärus (EL) 2016/1646, milles sätestatakse rakenduslikud tehnilised standardid seoses põhiindeksite ja tunnustatud börsidega vastavalt Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrusele (EL) nr 575/2013 krediidiasutuste ja investeerimisühingute suhtes kohaldatavate usaldatavusnõuete kohta (ELT L 245, 14.9.2016, lk 5).

olema minimaalne keskmine päevakäive 500 000 eurot, ja kõigil indeksi komponentidel, mille turukapitalisatsioon on üle 10 000 000 000 euro, olema minimaalne keskmine päevakäive 1 000 000 eurot. Keskmine päevakäive tuleks arvutada hindamisele eelneva kalendriaasta 12 kuu alusel või, kui see on asjakohane, sellise eelneva kalendriaasta 12 kuu alusel, mille jooksul finantsinstrument oli kauplemiseks kättesaadav.

(3) Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 4 lõike 1 punktis 72 sätestatud „tunnustatud börsi" määratlust muudeti viimati Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrusega (EL) 2019/2033 ([3]). Muudatus seisnes selles, et kõnealuse punkti 72 alapunkti a lisati sõnad „või kolmanda riigi turud, mida loetakse võrdväärseks reguleeritud turuga kooskõlas Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2014/65/EL artikli 25 lõike 4 punktis a sätestatud menetlusega". Selle muudatuse tõttu ei piirdu „tunnustatud börsid" enam üksnes „reguleeritud turgudega". Kõnealust muudatust tuleks kajastada rakendusmääruses (EL) 2016/1646, lisades kõnealusesse määrusesse börsid, mille kohta komisjon on vastu võtnud samaväärsust kinnitava otsuse vastavalt Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2014/65/EL ([4]) artikli 25 lõike 4 punktile a.

(4) Pärast Ühendkuningriigi väljaastumist liidust vastavalt Euroopa Liidu lepingu artiklile 50 lõpetati 1. veebruaril 2020 aluslepingute kohaldamine Ühendkuningriigi suhtes ja Ühendkuningriik on nüüd kolmas riik. Praeguse seisuga ei ole komisjon Ühendkuningriigi suhtes vastu võtnud direktiivi 2014/65/EL artikli 25 lõike 4 punkti a kohast samaväärsust kinnitavat otsust. Seepärast tuleb Ühendkuningriigis asutatud börsid tunnustatud börside loetelust välja jätta.

(5) Alates rakendusmääruse (EL) 2016/1646 jõustumisest on turustruktuuris toimunud teatavad muutused, eelkõige seoses uute börside tekke, ühinemiste, nimevahetuste ja tegevuse lõpetamisega. Neid muutusi tuleks kajastada rakendusmääruses (EL) 2016/1646.

(6) Seepärast tuleks rakendusmäärust (EL) 2016/1646 vastavalt muuta.

(7) Käesolev määrus põhineb Euroopa Väärtpaberiturujärelevalve (ESMA) poolt komisjonile esitatud rakenduslike tehniliste standardite eelnõul.

(8) ESMA on korraldanud käesoleva määruse aluseks olevate rakenduslike tehniliste standardite eelnõu kohta avaliku konsultatsiooni, analüüsinud võimalikke seonduvaid kulusid ja kasu ning küsinud nõu Euroopa Parlamendi ja nõukogu määruse (EL) nr 1095/2010 ([5]) artikli 37 kohaselt loodud väärtpaberituru sidusrühmade kogult,

ON VASTU VÕTNUD KÄESOLEVA MÄÄRUSE:

Artikkel 1

Rakendusmääruse (EL) 2016/1646 muutmine

Rakendusmäärust (EL) 2016/1646 muudetakse järgmiselt.

(1) Rakendusmääruse (EL) 2016/1646 I lisa asendatakse käesoleva määruse I lisas esitatud tekstiga.

([3]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 27. novembri 2019. aasta määrus (EL) 2019/2033, mis käsitleb investeerimisühingute suhtes kohaldatavaid usaldatavusnõudeid ning millega muudetakse määrusi (EL) nr 1093/2010, (EL) nr 575/2013, (EL) nr 600/2014 ja (EL) nr 806/2014 (ELT L 314, 5.12.2019, lk 1).

([4]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 15. mai 2014. aasta direktiiv 2014/65/EL finantsinstrumentide turgude kohta ning millega muudetakse direktiive 2002/92/EÜ ja 2011/61/EL (ELT L 173, 12.6.2014, lk 349).

([5]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 24. novembri 2010. aasta määrus (EL) nr 1095/2010, millega asutatakse Euroopa Järelevalveasutus (Euroopa Väärtpaberiturujärelevalve), muudetakse otsust nr 716/2009/EÜ ning tunnistatakse kehtetuks komisjoni otsus 2009/77/EÜ (ELT L 331, 15.12.2010, lk 84).

(2) Rakendusmääruse (EL) 2016/1646 II lisa asendatakse käesoleva määruse II lisas esitatud tekstiga.

Artikkel 2

Jõustumine

Käesolev määrus jõustub kahekümnendal päeval pärast selle avaldamist *Euroopa Liidu Teatajas*.

Käesolev määrus on tervikuna siduv ja vahetult kohaldatav kõikides liikmesriikides.

Brüssel, 24. märts 2022

Komisjoni nimel
president
Ursula VON DER LEYEN

I LISA

MÄÄRUSE (EL) nr 575/2013 ARTIKLI 197 KOHASED PÕHIINDEKSID

Tabel 1

Aktsiaindeksid

Indeks	Riik/piirkond
Austrian Traded Index	Austria
BEL 20	Belgia
CETOP20	Kesk-Euroopa
CNX 100	India
CSI 300 Index	Hiina
EGX 30	Egiptus
FTSE 350	Ühendkuningriik
FTSE All World Europe	Euroopa
FTSE All-World Index	Üleilmne
FTSE MIB	Itaalia
FTSE Nasdaq Dubai UAE 20 Index	Araabia Ühendemiraadid
FTSE RAFI Emerging Index	Tärkava turumajandusega riigid
FTSE Straits Times Index	Singapur
FTSE/JSE Capped Top 40	Lõuna-Aafrika
FTSE/JSE Industrial 25	Lõuna-Aafrika
Hang Seng Mainland 100 Index	Hongkong
HDAX	Saksamaa
IBEX 35	Hispaania
IBOVESPA	Brasiilia
ISEQ 20	Iirimaa
KOSPI 100	Lõuna-Korea
MSCI ACWI Index	Üleilmne
MSCI EM 50	Tärkava turumajandusega riigid
NASDAQ-100	Ameerika Ühendriigid
Nikkei 300	Jaapan
NYSE ARCA China Index	Hiina
OBX	Norra
OMX Copenhagen 25	Taani
OMX Helsinki 25	Soome
OMXS60	Rootsi
Qatar Exchange General Index	Katar
S&P 500	Ameerika Ühendriigid
S&P BSE 100	India

S&P Latin America 40	Ladina-Ameerika
S&P/ASX 100	Austraalia
S&P/BMV IPC	Mehhiko
S&P/NZX 10	Uus-Meremaa
S&P/TSX 60	Kanada
SBF 120	Prantsusmaa
SET 50	Tai
SMI Expanded	Šveits
STOXX Asia/Pacific 600	Aasia ja Vaikse ookeani piirkond
STOXX Europe 600	Euroopa
TOPIX Mid 400	Jaapan
TSEC Taiwan 50	Taiwan
WIG20	Poola

II LISA

MÄÄRUSE (EL) nr 575/2013 ARTIKLI 197 KOHASED TUNNUSTATUD BÖRSID

Tabel 1

Tunnustatud börsid, kus ei kaubelda määruse (EL) nr 575/2013 II lisas loetletud lepingutega

Reguleeritud turg	Turu tunnuskood
AIAF — MERCADO DE RENTA FIJA	XDRF, SEND
ATHENS EXCHANGE SECURITIES MARKET	XATH
BADEN-WUERTTEMBERGISCHE WERTPAPIERBOERSE	STUC, STUA
BOERSE BERLIN	BERC, BERA, EQTB, EQTA
BOERSE DUESSELDORF	DUSC, DUSA
BOERSE MUENCHEN	MUNC, MUNA
BOLSA DE BARCELONA	XBAR, SBAR
BOLSA DE BILBAO	XBIL, SBIL
BOLSA DE MADRID	XMAD, MERF
BOLSA DE VALENCIA	XVAL
BONDSPOT SECURITIES MARKET	RPWC
BOURSE DE LUXEMBOURG	XLUX
BRATISLAVA STOCK EXCHANGE	XBRA
BUCHAREST STOCK EXCHANGE	XBSE
BUDAPEST STOCK EXCHANGE	XBUD
BULGARIAN STOCK EXCHANGE — SOFIA JSC	XBUL
CBOE EUROPE	CCXE
CME AMSTERDAM	BTAM
CYPRUS STOCK EXCHANGE	XCYS
ELECTRONIC BOND MARKET	MOTX
ELECTRONIC ETF AND ETC/ETN MARKET – ETFplus	ETFP
ELECTRONIC SECONDARY SECURITIES MARKET	HDAT
ELECTRONIC SHARE MARKET	MTAA
EURONEXT AMSTERDAM	XAMS
EURONEXT BRUSSELS	XBRU
EURONEXT DUBLIN	XMSM
EURONEXT EXPAND	XOAS
EURONEXT LISBON	XLIS
EURONEXT OSLO	XOSL
EURONEXT PARIS	XPAR
FRANKFURTER WERTPAPIERBOERSE (REGULIERTER MARKT)	FRAA, XETA

HANSEATISCHE WERTPAPIERBOERSE HAMBURG (REGULIERTER MARKT)	HAMA, HAMM
LJUBLJANA STOCK EXCHANGE OFFICIAL MARKET	XLJU
MALTA STOCK EXCHANGE	XMAL, IFSM
MARKET FOR INVESTMENT VEHICLES (MIV)	MIVX
MTS GOVERNMENT MARKET	MTSC
NASDAQ COPENHAGEN	XCSE
NASDAQ HELSINKI	XHEL
NASDAQ ICELAND	XICE
NASDAQ RIGA	XRIS
NASDAQ STOCKHOLM	XSTO
NASDAQ TALLINN	XTAL
NASDAQ VILNIUS	XLIT
NIEDERSAECHSISCHE BOERSE ZU HANNOVER (REGULIERTER MARKT)	HANA
NORDIC GROWTH MARKET NGM	XNGM
NXCHANGE	XNXC
PRAGUE STOCK EXCHANGE	XPRA
RM-SYSTEM CZECH STOCK EXCHANGE	XRMZ
TRADEGATE EXCHANGE (REGULIERTER MARKT)	XGRM
VIENNA STOCKEXCHANGE OFFICIAL MARKET (AMTLICHER HANDEL)	WBAH
WARSAW STOCK EXCHANGE	XWAR, WBON, WETP
ZAGREB STOCK EXCHANGE	XZAG
ASX LIMITED	XASX
CHI-X AUSTRALIA PTY LTD	CHIA
THE STOCK EXCHANGE OF HONG KONG LIMITED (SEHK)	SHKG
BOX OPTIONS EXCHANGE LLC	XBOX
CBOE BYX EXCHANGE, INC. (FORMERLY BATS BYX EXCHANGE, INC.; BATS Y-EXCHANGE, INC.)	BATY
CBOE BZX EXCHANGE, INC. (FORMERLY BATS BZX EXCHANGE, INC.; BATS EXCHANGE, INC.)	BATS
CBOE C2 EXCHANGE, INC.	C2OX
CBOE EDGA EXCHANGE, INC. (FORMERLY BATS EDGA EXCHANGE, INC.; EDGA EXCHANGE, INC.)	EDGA
CBOE EDGX EXCHANGE, INC. (FORMERLY BATS EDGX EXCHANGE, INC.; EDGX EXCHANGE, INC.)	EDGX
CBOE EXCHANGE, INC.	CBSX
CHICAGO STOCK EXCHANGE, INC.	XCHI
THE INVESTORS EXCHANGE LLC	IEXG
MIAMI INTERNATIONAL SECURITIES EXCHANGE	XMIO

MIAX PEARL, LLC	MPRL
NASDAQ BX, INC. (FORMERLY NASDAQ OMX BX, INC.; BOSTON STOCK EXCHANGE)	BOSD
NASDAQ GEMX, LLC (FORMERLY ISE GEMINI)	GMNI
NASDAQ ISE, LLC (FORMERLY INTERNATIONAL SECURITIES EXCHANGE, LLC)	XISX
NASDAQ MRX, LLC (FORMERLY ISE MERCURY)	MCRY
NASDAQ PHLX LLC (FORMERLY NASDAQ OMX PHLX, LLC; PHILADELPHIA STOCK EXCHANGE)	XPHL
THE NASDAQ STOCK MARKET	XNAS
NEW YORK STOCK EXCHANGE LLC	XNYS
NYSE ARCA, INC.	ARCX
AQUA SECURITIES L.P.	AQUA
ATS-1	MSTX
ATS-4	MSPL
ATS-6	MSRP
BARCLAYS ATS	BARX
BARCLAYS DIRECTEX	BCDX
BIDS TRADING, L.P.	BIDS
CIOI	CIOI
CITIBLOC	CBLC
CITICROSS	CICX
CODA MARKETS, INC	CODA
CREDIT SUISSE SECURITIES (USA) LLC	CAES
DEUTSCHE BANK SECURITIES, INC	DBSX
EBX LLC	LEVL
INSTINCT X	BAML
INSTINET CONTINUOUS BLOCK CROSSING SYSTEM (CBX)	ICBX
INSTINET, LLC (INSTINET CROSSING, INSTINET BLX)	XINS
INSTINET, LLC (BLOCKCROSS)	BLKX
JPB-X	JPBX
J.P. MORGAN ATS ('JPM-X')	JPMX
JSVC LLC	(*)
LIQUIDNET H_2O ATS	LIUH
LIQUIDNET NEGOTIATION ATS	LIUS
LUMINEX TRADING & ANALYTICS LLC	LMNX
NATIONAL FINANCIAL SERVICES, LLC	NFSC
POSIT	ITGI
SIGMA X2	SGMT

SPOT QUOTE LLC	(*)
SPREAD ZERO LLC	(*)
UBS ATS	UBSS
USTOCKTRADE	(*)
VIRTU MATCHIT	VFMI
XE	PJCX

* Turu tunnuskoodid (MIC) ei ole kättesaadavad standardi ISO 10383 (börside koodid ja turutunnuste loetelu) puhul

Tabel 2

Tunnustatud börsid, kus kaubeldakse määruse (EL) nr 575/2013 II lisas loetletud lepingutega

Reguleeritud turg	Turu tunnuskood
ATHENS EXCHANGE DERIVATIVES MARKET	XADE
BUDAPEST STOCK EXCHANGE	XBUD
CBOE DERIVATIVES	CDEX
EUREX DEUTSCHLAND	XEUR
EURONEXT BRUSSELS DERIVATIVES	XBRD
EURONEXT COM\, COMMODITIES FUTURES AND OPTIONS	XEUC
EURONEXT EQF\, EQUITIES AND INDICES DERIVATIVES	XEUE
EUROPEAN ENERGY EXCHANGE	XEEE, XEER
FISH POOL	FISH
HENEX FINANCIAL ENERGY MARKET - DERIVATIVES MARKET	HEDE
HUDEX ENERGY EXCHANGE	HUDX
ICE ENDEX MARKETS	NDEX
ITALIAN DERIVATIVES MARKET	XDMI
MATIF	XMAT
MEFF EXCHANGE	XMRV, XMPW, XMFX
MERCADO DE FUTUROS E OPCOES	MFOX
MONEP	XMON
NASDAQ OSLO	NORX
NASDAQ STOCKHOLM	XSTO
NOREXECO	NEXO
OMIP – POLO PORTUGUES	OMIP
OSLO BØRS	XOSL
WARSAW STOCK EXCHANGE/COMMODITIES/POLISH POWER EXCHANGE/ COMMODITY DERIVATIVES	PLPD
WARSAW STOCK EXCHANGE/FINANCIAL DERIVATIVES	WDER