II

(Nem jogalkotási aktusok)

RENDELETEK

A BIZOTTSÁG (EU) 2022/1650 VÉGREHAJTÁSI RENDELETE

(2022. március 24.)

az (EU) 2016/1646 végrehajtási rendeletben meghatározott végrehajtás-technikai standardoknak az 575/2013/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletnek megfelelő fő indexek és elismert tőzsdék tekintetében történő módosításáról

(EGT-vonatkozású szöveg)

AZ EURÓPAI BIZOTTSÁG

tekintettel az Európai Unió működéséről szóló szerződésre,

tekintettel a hitelintézetekre vonatkozó prudenciális követelményekről és a 648/2012/EU rendelet módosításáról szóló, 2013. június 26-i 575/2013/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletre ([1]) és különösen annak 197. cikke (8) bekezdésére,

mivel:

(1) Az (EU) 2016/1646 bizottsági végrehajtási rendeletet ([2]) abból az előfeltevésből kiindulva fogadták el, hogy az 575/2013/EU rendelet alkalmazásában azok a részvényindexek, amelyek fő indexnek tekintendők (és ezáltal lehetővé teszik az intézmények számára, hogy az ilyen indexeket alkotó részvényeket elismerhető biztosítékként használhassák) főként olyan részvényekből állnak, amelyekről észszerűen feltételezhető, hogy realizálhatók, amennyiben az intézménynek értékesítenie kell azokat. A feltevés szerint ez az eset áll fenn akkor, amikor az index összetevőinek legalább 90 %-a esetében a közkézhányad legalább 500 000 000 EUR, illetve a közkézhányadra vonatkozó információk hiányában a piaci tőkeérték legalább 1 000 000 000 EUR. Ez a feltevés változatlanul érvényes.

(2) Az (EU) 2016/1646 végrehajtási rendelet továbbá előírja, hogy az intézményeknek lehetőséget kell biztosítani arra is, hogy elismerhető biztosítékként alkalmazhassanak a fő indexekben szereplő olyan instrumentumokat, amelyek nem felelnek meg a fent említett feltételeknek, de amelyek összetevőivel kellő mértékben kereskednek, valamint új feltételeket mérlegel az említett indexek azonosítására. A tapasztalat azonban azt mutatja, hogy az index alapjául szolgáló piacra vonatkozóan meghatározott feltételek nehezen alkalmazhatók harmadik országbeli fő indexre, mivel az e piacra bevezetett valamennyi részvényre vonatkozó adatgyűjtést igényelnek. Ez a nehézség akadályozza az 575/2013/EU rendelet célkitűzésének megfelelő elérését, nevezetesen az index összetevői tekintetében a minimális likviditási küszöbértékének biztosítását. Ezért új feltételeket kell megállapítani a feltárt hiányosságok kezelésére. Ezeknek az új feltételeknek biztosítaniuk kell az instrumentumok elfogadható fedezetkénti megfelelőségét, és ezáltal az index alapjául szolgáló piactól függetlenül elegendő likviditási küszöbértéket, amennyiben a szokásos piaci likviditási mutatókkal kapcsolatos két feltétel teljesül. Az első feltétel értelmében az index összetevőinek legalább 80 %-a esetében a közkézhányad legalább 25 000 000 EUR, illetve a közkézhányadra vonatkozó információk hiányában a piaci tőkeérték legalább 50 000 000 EUR. A második feltétel értelmében az index legfeljebb 10 000 000 000 EUR piaci tőkeértékű minden összetevőjének átlagos napi forgalma legalább 500 000 EUR, és az

([1]) HL L 176., 2013.6.27., 1. o.

([2]) A Bizottság (EU) 2016/1646 végrehajtási rendelete (2016. szeptember 13.) a hitelintézetekre és befektetési vállalkozásokra vonatkozó prudenciális követelményekről szóló 575/2013/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletnek megfelelően a fő indexekkel és az elismert tőzsdékkel kapcsolatos végrehajtás-technikai standardok meghatározásáról (HL L 245., 2016.9.14., 5. o.).

index 10 000 000 000 EUR-nál nagyobb piaci tőkeértékű minden összetevőjének átlagos napi forgalma legalább 1 000 000 EUR. Az átlagos napi forgalmat az értékelést megelőző naptári év tizenkét hónapjára, vagy adott esetben az előző naptári év azon tizenkét hónapos időszakára vonatkozóan kell kiszámítani, amelynek során a pénzügyi eszköz kereskedés céljára rendelkezésre állt.

(3) Az „elismert tőzsde" 575/2013/EU rendelet 4. cikke (1) bekezdésének 72. pontjában foglalt meghatározását legutóbb az (EU) 2019/2033 európai parlamenti és tanácsi rendelet ([3]) módosította. Ez a módosítás a 72. pont a) alpontjában beillesztette az „olyan szabályozott piac vagy harmadik országbeli piac, amely a 2014/65/EU irányelv 25. cikke (4) bekezdésének a) pontjában meghatározott eljárással összhangban a szabályozott piaccal egyenértékűnek tekintendő" szövegrészt. E módosítás miatt az „elismert tőzsdék" már nem korlátozódnak kizárólag a „szabályozott piacokra". E módosításnak tükröződnie kell az (EU) 2016/1646 végrehajtási rendeletben azáltal, hogy az említett rendeletbe bele kell foglalni azokat a tőzsdéket, amelyekre vonatkozóan a Bizottság a 2014/65/EU európai parlamenti és tanácsi irányelv ([4]) 25. cikke (4) bekezdésének a) pontja alapján egyenértékűségi határozatot fogadott el.

(4) Az Egyesült Királyságnak az Unióból való, az Európai Unióról szóló szerződés 50. cikke szerinti kilépését követően a Szerződések 2020. február 1-jétől már nem alkalmazandók az Egyesült Királyságra, és az Egyesült Királyság immáron harmadik ország. A Bizottság eddig nem fogadott el a 2014/65/EU irányelv 25. cikke (4) bekezdésének a) pontja szerinti egyenértékűségi határozatot az Egyesült Királyság tekintetében. Ezért az elismert tőzsdék jegyzékéből törölni kell az Egyesült Királyságban letelepedett tőzsdéket.

(5) Az (EU) 2016/1646 végrehajtási rendelet hatálybalépése óta bizonyos változások történtek a piac szerkezetében, különösen az új tőzsdék megjelenése, az összefonódások, a névváltozások vagy a tevékenységek megszüntetése tekintetében. Az (EU) 2016/1646 végrehajtási rendeletnek tükröznie kell ezeket a változásokat.

(6) Az (EU) 2016/1646 végrehajtási rendeletet ezért ennek megfelelően módosítani kell.

(7) Ez a rendelet az Európai Értékpapírpiaci Hatóság (a továbbiakban: ESMA) által a Bizottságnak benyújtott végrehajtás-technikai standardtervezeteken alapul.

(8) Az ESMA nyilvános konzultációt folytatott az e rendelet alapját képező végrehajtás-technikai standardtervezetekről, elemezte az ezzel kapcsolatos potenciális költségeket és hasznokat, továbbá kikérte az 1095/2010/EU európai parlamenti és tanácsi rendelet ([5]) 37. cikkével összhangban létrehozott Értékpapírpiaci Érdekképviseleti Csoport tanácsát,

ELFOGADTA EZT A RENDELETET:

1. cikk

Az (EU) 2016/1646 végrehajtási rendelet módosításai

Az (EU) 2016/1646 végrehajtási rendelet a következőképpen módosul:

1. Az (EU) 2016/1646 végrehajtási rendelet I. mellékletének helyébe e rendelet I. mellékletének szövege lép.

([3]) Az Európai Parlament és a Tanács (EU) 2019/2033 rendelete (2019. november 27.) a befektetési vállalkozásokra vonatkozó prudenciális követelményekről, valamint az 1093/2010/EU, az 575/2013/EU, a 600/2014/EU és a 806/2014/EU rendelet módosításáról (HL L 314., 2019.12.5., 1. o.).

([4]) Az Európai Parlament és a Tanács 2014/65/EU irányelve (2014. május 15.) a pénzügyi eszközök piacairól, valamint a 2002/92/EK irányelv és a 2011/61/EU irányelv módosításáról (HL L 173., 2014.6.12., 349. o.).

([5]) Az Európai Parlament és a Tanács 1095/2010/EU rendelete (2010. november 24.) az európai felügyeleti hatóság (Európai Értékpapírpiaci Hatóság) létrehozásáról, a 716/2009/EK határozat módosításáról és a 2009/77/EK bizottsági határozat hatályon kívül helyezéséről (HL L 331., 2010.12.15., 84. o.).

2. Az (EU) 2016/1646 végrehajtási rendelet II. mellékletének helyébe e rendelet II. mellékletének szövege lép.

2. cikk

Hatálybalépés

Ez a rendelet az *Európai Unió Hivatalos Lapjában* való kihirdetését követő huszadik napon lép hatályba.

Ez a rendelet teljes egészében kötelező és közvetlenül alkalmazandó valamennyi tagállamban.

Kelt Brüsszelben, 2022. március 24-én.

a Bizottság részéről
az elnök
Ursula VON DER LEYEN

I. MELLÉKLET

AZ 575/2013/EU RENDELET 197. CIKKE SZERINT MEGHATÁROZOTT FŐ INDEXEK

1. táblázat

Részvényindexek

Index	Ország/terület
Austrian Traded Index	Ausztria
BEL 20	Belgium
CETOP20	Közép-Európa
CNX 100	India
CSI 300 Index	Kína
EGX 30	Egyiptom
FTSE 350	Egyesült Királyság
FTSE All World Europe	Európa
FTSE All-World Index	Globális
FTSE MIB	Olaszország
FTSE Nasdaq Dubai UAE 20 Index	Egyesült Arab Emírségek
FTSE RAFI Emerging Index	Feltörekvő piacok
FTSE Straits Times Index	Szingapúr
FTSE/JSE Capped Top 40	Dél-Afrika
FTSE/JSE Industrial 25	Dél-Afrika
Hang Seng Mainland 100 Index	Hongkong
HDAX	Németország
IBEX 35	Spanyolország
IBOVESPA	Brazília
ISEQ 20	Írország
KOSPI 100	Dél-Korea
MSCI ACWI Index	Globális
MSCI EM 50	Feltörekvő piacok
NASDAQ-100	Amerikai Egyesült Államok
Nikkei 300	Japán
NYSE ARCA China Index	Kína
OBX	Norvégia
OMX Copenhagen 25	Dánia
OMX Helsinki 25	Finnország
OMXS60	Svédország
Qatar Exchange General Index	Katar
S&P 500	Amerikai Egyesült Államok
S&P BSE 100	India

S&P Latin America 40	Latin-Amerika
S&P/ASX 100	Ausztrália
S&P/BMV IPC	Mexikó
S&P/NZX 10	Új-Zéland
S&P/TSX 60	Kanada
SBF 120	Franciaország
SET 50	Thaiföld
SMI Expanded	Svájc
STOXX Asia/Pacific 600	Ázsia/Csendes-óceán térsége
STOXX Europe 600	Európa
TOPIX Mid 400	Japán
TSEC Taiwan 50	Tajvan
WIG20	Lengyelország

II. MELLÉKLET

Az 575/2013/EU RENDELET 197. CIKKE SZERINT MEGHATÁROZOTT ELISMERT TŐZSDÉK

1. táblázat

Elismert tőzsdék, amelyeken az 575/2013/EU rendelet II. mellékletében felsorolt szerződésekkel nem kereskednek

Szabályozott piac	MIC
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

* Az ISO 10383 szabványban nem szereplő MIC-kódok – Tőzsdei és piacazonosító kódok jegyzéke

2. táblázat

Elismert tőzsdék, amelyeken az 575/2013/EU rendelet II. mellékletében felsorolt szerződésekkel kereskednek

Szabályozott piac	MIC
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