II

(Neleģislatīvi akti)

REGULAS

KOMISIJAS ĪSTENOŠANAS REGULA (ES) 2022/1650

(2022. gada 24. marts),

ar ko groza Īstenošanas regulā (ES) 2016/1646 noteiktos īstenošanas tehniskos standartus attiecībā uz galvenajiem indeksiem un atzītām biržām saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 575/2013

(Dokuments attiecas uz EEZ)

EIROPAS KOMISIJA,

ņemot vērā Līgumu par Eiropas Savienības darbību,

ņemot vērā Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 575/2013 (2013. gada 26. jūnijs) par prudenciālajām prasībām attiecībā uz kredītiestādēm, un ar ko groza Regulu (ES) Nr. 648/2012 ([1]), un jo īpaši tās 197. panta 8. punktu,

tā kā:

(1) Komisijas Īstenošanas regula (ES) 2016/1646 ([2]) tika pieņemta ar priekšnoteikumu, ka kapitāla vērtspapīru indeksiem, kas Regulas (ES) Nr. 575/2013 vajadzībām uzskatāmi par galvenajiem indeksiem (un tādējādi ļaujot iestādēm izmantot kapitāla vērtspapīrus, kas veido šos indeksus, kā atbilstošu nodrošinājumu), galvenokārt būtu jāsastāv no kapitāla vērtspapīriem, kurus var pamatoti uzskatīt par realizējamiem, ja iestādei tie ir jālikvidē. Tika pieņemts, ka tam tā vajadzētu būt gadījumā, kad vismaz 90 % no indeksa sastāvdaļām atrodas brīvā apgrozībā vismaz 500 000 000 EUR apmērā vai, ja informācija par brīvo apgrozību nav pieejama, to tirgus kapitalizācija sasniedz vismaz 1 000 000 000 EUR. Šis pieņēmums nav mainījies.

(2) Īstenošanas regulā (ES) 2016/1646 ir arī noteikts, ka iestādēm vajadzētu būt arī iespējai atzīt par atbilstošiem nodrošinājuma instrumentus, kas iekļauti galvenajos indeksos, kuri neatbilst iepriekš minētajiem kritērijiem, bet kuru sastāvdaļas ir pietiekami tirgotas, un apsvērti jauni kritēriji šo indeksu identificēšanai. Tomēr pieredze liecina, ka šos kritērijus, kas noteikti attiecībā uz tirgu, kas ir indeksa pamatā, ir grūti piemērot galvenajam indeksam, kas izveidots trešā valstī, jo tie prasa vākt datus par visām akcijām, kuras atļauts tirgot šajā tirgū. Šīs grūtības ir kavējušas pienācīgi sasniegt Regulas (ES) Nr. 575/2013 mērķi nodrošināt indeksa sastāvdaļu likviditātes minimālo robežvērtību. Tādēļ ir jānosaka jauni kritēriji konstatēto trūkumu novēršanai. Šiem jaunajiem kritērijiem būtu jānodrošina instrumentu kā atbilstoša nodrošinājuma adekvātums un tādējādi jānodrošina pietiekama likviditātes robežvērtība neatkarīgi no tirgus, kas ir indeksa pamatā, ja ir izpildīti divi nosacījumi, kas saistīti ar standarta tirgus likviditātes rādītājiem. Ar pirmo nosacījumu būtu jānosaka, ka vismaz 80 % no indeksa sastāvdaļām atrodas brīvā apgrozībā vismaz 25 000 000 EUR apmērā vai, ja informācija par brīvo apgrozību nav pieejama, to tirgus kapitalizācija sasniedz vismaz 50 000 000 EUR. Ar otro nosacījumu būtu jānosaka, ka visām indeksa sastāvdaļām, kuru tirgus kapitalizācija ir mazāka par vai vienāda ar 10 000 000 000 EUR, minimālais vidējais dienas apgrozījums

([1]) OV L 176, 27.6.2013., 1. lpp.

([2]) Komisijas Īstenošanas regula (ES) 2016/1646 (2016. gada 13. septembris), ar ko nosaka īstenošanas tehniskos standartus attiecībā uz galvenajiem indeksiem un atzītām biržām saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 575/2013 par prudenciālajām prasībām attiecībā uz kredītiestādēm un ieguldījumu brokeru sabiedrībām (OV L 245, 14.9.2016., 5. lpp.).

ir 500 000 EUR un visām indeksa sastāvdaļām, kuru tirgus kapitalizācija pārsniedz 10 000 000 000 EUR, minimālais vidējais dienas apgrozījums ir 1 000 000 EUR. Vidējais dienas apgrozījums būtu jāaprēķina par divpadsmit mēnešiem kalendārajā gadā pirms novērtējuma vai attiecīgā gadījumā par iepriekšējā kalendārā gada divpadsmit mēnešu periodu, kurā finanšu instruments bija pieejams tirdzniecībai.

(3) Definīcija "atzīta birža", kas noteikta Regulas (ES) Nr. 575/2013 4. panta 1. punkta 72) punktā, pēdējo reizi tika grozīta ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) 2019/2033 ([3]). Minētā grozījuma rezultātā 72) punkta a) apakšpunktā tika pievienoti vārdi "vai trešās valsts tirgus, kas tiek uzskatīts par līdzvērtīgu regulētam tirgum saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvas 2014/65/ES 25. panta 4. punkta a) apakšpunktā izklāstīto procedūru". Šā grozījuma dēļ "atzītas biržas" vairs neaprobežojas tikai ar "regulētiem tirgiem". Šis grozījums būtu jāatspoguļo Īstenošanas regulā (ES) 2016/1646, minētajā regulā iekļaujot tās biržas, par kurām Komisija ir pieņēmusi lēmumu par līdzvērtību saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvas 2014/65/ES ([4]) 25. panta 4. punkta a) apakšpunktu.

(4) Pēc Apvienotās Karalistes izstāšanās no Savienības saskaņā ar Līguma par Eiropas Savienību 50. pantu Līgumi no 2020. gada 1. februāra vairs nav piemērojami Apvienotajai Karalistei, un Apvienotā Karaliste tagad ir trešā valsts. Pašlaik Komisija attiecībā uz Apvienoto Karalisti nav pieņēmusi lēmumu par līdzvērtību saskaņā ar Direktīvas 2014/65/ES 25. panta 4. punkta a) apakšpunktu. Tādēļ no atzīto biržu saraksta ir jāizslēdz tās biržas, kas iedibinātas Apvienotajā Karalistē.

(5) Kopš Īstenošanas regulas (ES) 2016/1646 stāšanās spēkā tirgus struktūrā ir notikušas dažas izmaiņas, jo īpaši attiecībā uz jaunu biržu parādīšanos, apvienošanos, nosaukuma maiņu vai darbības izbeigšanu. Minētās izmaiņas būtu jāatspoguļo Īstenošanas regulā (ES) 2016/1646.

(6) Tāpēc Īstenošanas regula (ES) 2016/1646 būtu attiecīgi jāgroza.

(7) Šīs regulas pamatā ir īstenošanas tehnisko standartu projekts, ko Komisijai iesniegusi Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestāde (EVTI).

(8) EVTI ir veikusi atklātu sabiedrisko apspriešanu par īstenošanas tehnisko standartu projektu, kas ir šīs regulas pamatā, izanalizējusi potenciālās saistītās izmaksas un ieguvumus un pieprasījusi atzinumu no Vērtspapīru un tirgu nozares ieinteresēto personu grupas, kas izveidota saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 1095/2010 ([5]) 37. pantu,

IR PIEŅĒMUSI ŠO REGULU.

1. pants

Grozījumi Īstenošanas regulā (ES) 2016/1646

Īstenošanas regulu (ES) 2016/1646 groza šādi:

1) Īstenošanas regulas (ES) 2016/1646 I pielikumu aizstāj ar šīs regulas I pielikuma tekstu;

([3]) Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) 2019/2033 (2019. gada 27. novembris) par prudenciālajām prasībām ieguldījumu brokeru sabiedrībām un ar ko groza Regulas (ES) Nr. 1093/2010, (ES) Nr. 575/2013, (ES) Nr. 600/2014 un (ES) Nr. 806/2014 (OV L 314, 5.12.2019., 1. lpp.).

([4]) Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīva 2014/65/ES (2014. gada 15. maijs) par finanšu instrumentu tirgiem un ar ko groza Direktīvu 2002/92/ES un Direktīvu 2011/61/ES (OV L 173, 12.6.2014., 349. lpp.).

([5]) Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) Nr. 1095/2010 (2010. gada 24. novembris), ar ko izveido Eiropas Uzraudzības iestādi (Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestādi), groza Lēmumu Nr. 716/2009/EK un atceļ Komisijas Lēmumu 2009/77/EK (OV L 331, 15.12.2010., 84. lpp.).

2) Īstenošanas regulas (ES) 2016/1646 II pielikumu aizstāj ar šīs regulas II pielikuma tekstu.

2. pants

Stāšanās spēkā

Šī regula stājas spēkā divdesmitajā dienā pēc tās publicēšanas *Eiropas Savienības Oficiālajā Vēstnesī.*

Šī regula uzliek saistības kopumā un ir tieši piemērojama visās dalībvalstīs.

Briselē, 2022. gada 24. martā

Komisijas vārdā –
priekšsēdētāja
Ursula VON DER LEYEN

I PIELIKUMS

GALVENIE INDEKSI, KAS MINĒTI REGULAS (ES) Nr. 575/2013 197. PANTĀ

1. tabula

Kapitāla vērtspapīru indeksi

Indekss	Valsts/teritorija
Austrian Traded Index	Austrija
BEL 20	Beļģija
CETOP20	Centrāleiropa
CNX 100	Indija
CSI 300 Index	Ķīna
EGX 30	Ēģipte
FTSE 350	Apvienotā Karaliste
FTSE All World Europe	Eiropa
FTSE All-World Index	visa pasaule
FTSE MIB	Itālija
FTSE Nasdaq Dubai UAE 20 Index	AAE
FTSE RAFI Emerging Index	jaunietekmes tirgi
FTSE Straits Times Index	Singapūra
FTSE/JSE Capped Top 40	Dienvidāfrika
FTSE/JSE Industrial 25	Dienvidāfrika
Hang Seng Mainland 100 Index	Honkonga
HDAX	Vācija
IBEX 35	Spānija
IBOVESPA	Brazīlija
ISEQ 20	Īrija
KOSPI 100	Dienvidkoreja
MSCI ACWI Index	visa pasaule
MSCI EM 50	jaunietekmes tirgi
NASDAQ-100	ASV
Nikkei 300	Japāna
NYSE ARCA China Index	Ķīna
OBX	Norvēģija
OMX Copenhagen 25	Dānija
OMX Helsinki 25	Somija
OMXS60	Zviedrija
Qatar Exchange General Index	Katara
S&P 500	ASV
S&P BSE 100	Indija

S&P Latin America 40	Latīņamerika
S&P/ASX 100	Austrālija
S&P/BMV IPC	Meksika
S&P/NZX 10	Jaunzēlande
S&P/TSX 60	Kanāda
SBF 120	Francija
SET 50	Taizeme
SMI Expanded	Šveice
STOXX Asia/Pacific 600	Āzija / Klusā okeāna valstis
STOXX Europe 600	Eiropa
TOPIX Mid 400	Japāna
TSEC Taiwan 50	Taivāna
WIG20	Polija

II PIELIKUMS

ATZĪTAS BIRŽAS, KAS MINĒTAS REGULAS (ES) Nr. 575/2013 197. PANTĀ

1. tabula

Atzītas biržas, kurās netiek tirgoti Regulas (ES) Nr. 575/2013 II pielikumā iekļautie līgumi

Regulētais tirgus	Tirgus identifikācijas kods (*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

* *MIC* kodi nav pieejami ISO 10383 – Biržu kodi un tirgus identifikācijas saraksts

2. tabula

Atzītas biržas, kurās tiek tirgoti Regulas (ES) Nr. 575/2013 II pielikumā iekļautie līgumi

Regulētais tirgus	Tirgus identifikācijas kods (*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