II

(Ne teisėkūros procedūra priimami aktai)

REGLAMENTAI

KOMISIJOS ĮGYVENDINIMO REGLAMENTAS (ES) 2022/1650

2022 m. kovo 24 d.

kuriuo iš dalies keičiami Įgyvendinimo reglamente (ES) 2016/1646 pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (ES) Nr. 575/2013 nustatyti pagrindinių indeksų ir pripažintų biržų techniniai įgyvendinimo standartai

(Tekstas svarbus EEE)

EUROPOS KOMISIJA,

atsižvelgdama į Sutartį dėl Europos Sąjungos veikimo,

atsižvelgdama į 2013 m. birželio 26 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (ES) Nr. 575/2013 dėl riziką ribojančių reikalavimų kredito įstaigoms, kuriuo iš dalies keičiamas Reglamentas (ES) Nr. 648/2012 ([1]), ypač į jo 197 straipsnio 8 dalį,

kadangi:

(1) Komisijos įgyvendinimo reglamentas (ES) 2016/1646 ([2]) buvo priimtas remiantis prielaida, kad nuosavybės vertybinių popierių indeksai, kurie Reglamento (ES) Nr. 575/2013 taikymo tikslais laikytini pagrindiniais indeksais (todėl įstaigoms leidžiama naudoti šiuos indeksus sudarančius nuosavybės vertybinius popierius kaip reikalavimus atitinkančią užtikrinimo priemonę), iš esmės turėtų būti sudaryti iš nuosavybės vertybinių popierių, kuriuos galima pagrįstai tikėtis realizuoti, kai įstaigai prireiks juos likviduoti. Daryta prielaida, kad taip būtų tuo atveju, kai bent 90 % indekso sudaro bent 500 000 000 EUR vertės laisvosios akcijos arba, jei nėra informacijos apie laisvąsias akcijas, bent 1 000 000 000 EUR rinkos kapitalizacija. Ši prielaida lieka nepakitusi;

(2) Įgyvendinimo reglamente (ES) 2016/1646 dar nurodyta, kad įstaigos taip pat turėtų galėti kaip reikalavimus atitinkančias užtikrinimo priemones pripažinti į pagrindinius indeksus įtrauktas priemones, kurios pirmiau nurodytų kriterijų neatitinka, tačiau kurių sudedamosiomis dalimis prekiaujama pakankamu mastu, ir svarstomi nauji tų indeksų nustatymo kriterijai. Tačiau patirtis parodė, kad tuos kriterijus, apibrėžtus atsižvelgiant į rinką, kurioje sudarytas indeksas, sunku taikyti pagrindiniam trečiojoje valstybėje nustatytam indeksui, nes juos taikant reikia rinkti duomenis apie visas akcijas, kuriomis leista prekiauti toje rinkoje. Ta problema trukdė tinkamai pasiekti Reglamento (ES) Nr. 575/2013 tikslą – užtikrinti minimalią indekso sudedamųjų dalių likvidumo ribą. Todėl būtina nustatyti naujus kriterijus, kurie padėtų pašalinti nustatytus trūkumus. Tais naujais kriterijais turėtų būti užtikrintas priemonių, kaip reikalavimus atitinkančių užtikrinimo priemonių, tinkamumas, taigi ir pakankama likvidumo riba nepriklausomai nuo rinkos, kuria grindžiamas indeksas, jei įvykdomos dvi sąlygos, susijusios su standartiniais rinkos likvidumo rodikliais. Pagal pirmąją sąlygą turėtų būti reikalaujama, kad bent 80 % indekso sudarytų bent 25 000 000 EUR vertės laisvosios akcijos arba, jei nėra informacijos apie laisvąsias akcijas, bent 50 000 000 EUR rinkos kapitalizacija. Pagal antrąją sąlygą turėtų būti reikalaujama, kad visų indekso sudedamųjų dalių, kurių rinkos

([1]) OL L 176, 2013 6 27, p. 1.

([2]) 2016 m. rugsėjo 13 d. Komisijos įgyvendinimo reglamentas (ES) 2016/1646, kuriuo pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (ES) Nr. 575/2013 dėl prudencinių reikalavimų kredito įstaigoms ir investicinėms įmonėms nustatomi pagrindinių indeksų ir pripažintų biržų techniniai įgyvendinimo standartai (OL L 245, 2016 9 14, p. 5).

kapitalizacija yra mažesnė arba lygi 10 000 000 000 EUR, dienos apyvartos vidurkis būtų ne mažesnis kaip 500 000 EUR, o visų indekso sudedamųjų dalių, kurių rinkos kapitalizacija viršija 10 000 000 000 EUR, dienos apyvartos vidurkis būtų ne mažesnis kaip 1 000 000 EUR. Dienos apyvartos vidurkis turėtų būti apskaičiuojamas per kalendorinių metų, einančių prieš vertinimą, dvylika mėnesių arba, kai taikoma, per praėjusių kalendorinių metų, kuriais finansine priemone buvo galima prekiauti, dvylika mėnesių;

(3) Reglamento (ES) Nr. 575/2013 4 straipsnio 1 dalies 72 punkte pateikta termino „pripažinta birža“ apibrėžtis paskutinį kartą buvo iš dalies pakeista Europos Parlamento ir Tarybos reglamentu (ES) 2019/2033 ([3]). Tuo pakeitimu to 72 punkto a papunktyje buvo įrašyti žodžiai „arba trečiosios valstybės rinka, kuri laikoma lygiaverte reguliuojamai rinkai pagal Europos Parlamento ir Tarybos direktyvos 2014/65/ES 25 straipsnio 4 dalies a punkte nustatytą procedūrą“. Dėl šio pakeitimo „pripažintos biržos“ nebeapsiriboja tik „reguliuojamomis rinkomis“. Tas pakeitimas turėtų būti perteiktas Įgyvendinimo reglamente (ES) 2016/1646, įtraukiant į jį tas biržas, dėl kurių Komisija pagal Europos Parlamento ir Tarybos direktyvos 2014/65/ES ([4]) 25 straipsnio 4 dalies a punktą yra priėmusi sprendimą dėl lygiavertiškumo;

(4) Jungtinei Karalystei išstojus iš Sąjungos pagal Europos Sąjungos sutarties 50 straipsnį, Sutartys jai nebetaikomos nuo 2020 m. vasario 1 d. ir dabar ji yra trečioji valstybė. Šiuo metu Komisija nėra priėmusi Jungtinei Karalystei skirto sprendimo dėl lygiavertiškumo pagal Direktyvos 2014/65/ES 25 straipsnio 4 dalies a punktą. Todėl būtina iš pripažintų biržų sąrašo išbraukti tas Jungtinėje Karalystėje įsteigtas biržas;

(5) nuo Įgyvendinimo reglamento (ES) 2016/1646 įsigaliojimo įvyko tam tikrų rinkos struktūros pokyčių, visų pirma susijusių su naujų biržų atsiradimu, susijungimu, pavadinimų keitimu ar veiklos nutraukimu. Tie pakeitimai turėtų būti perteikti Įgyvendinimo reglamente (ES) 2016/1646;

(6) todėl Įgyvendinimo reglamentas (ES) 2016/1646 turėtų būti atitinkamai iš dalies pakeistas;

(7) šis reglamentas grindžiamas Europos vertybinių popierių ir rinkų institucijos (EVPRI) Komisijai pateiktu techninių įgyvendinimo standartų projektu;

(8) EVPRI surengė atviras viešas konsultacijas dėl techninių įgyvendinimo standartų projektų, kuriais grindžiamas šis reglamentas, išanalizavo galimas su jais susijusias sąnaudas ir naudą ir paprašė, kad pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 1095/2010 ([5]) 37 straipsnį įsteigta Vertybinių popierių ir rinkų suinteresuotųjų subjektų grupė pateiktų savo rekomendaciją,

PRIĖMĖ ŠĮ REGLAMENTĄ:

1 straipsnis

Įgyvendinimo reglamento (ES) 2016/1646 pakeitimai

Įgyvendinimo reglamentas (ES) 2016/1646 iš dalies keičiamas taip:

1) Įgyvendinimo reglamento (ES) 2016/1646 I priedas pakeičiamas šio reglamento I priede pateikiamu tekstu.

([3]) 2019 m. lapkričio 27 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) 2019/2033 dėl riziką ribojančių reikalavimų investicinėms įmonėms, kuriuo iš dalies keičiami reglamentai (ES) Nr. 1093/2010, (ES) Nr. 575/2013, (ES) Nr. 600/2014 ir (ES) Nr. 806/2014 (OL L 314, 2019 12 5, p. 1).

([4]) 2014 m. gegužės 15 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2014/65/ES dėl finansinių priemonių rinkų, kuria iš dalies keičiamos Direktyva 2002/92/EB ir Direktyva 2011/61/ES (OL L 173, 2014 6 12, p. 349).

([5]) 2010 m. lapkričio 24 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 1095/2010, kuriuo įsteigiama Europos priežiūros institucija (Europos vertybinių popierių ir rinkų institucija) ir iš dalies keičiamas Sprendimas Nr. 716/2009/EB bei panaikinamas Komisijos sprendimas 2009/77/EB (OL L 331, 2010 12 15, p. 84).

2) Įgyvendinimo reglamento (ES) 2016/1646 II priedas pakeičiamas šio reglamento II priede pateikiamu tekstu.

2 straipsnis

Įsigaliojimas

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

Šis reglamentas privalomas visas ir tiesiogiai taikomas visose valstybėse narėse.

Priimta Briuselyje 2022 m. kovo 24 d.

Komisijos vardu
Pirmininkė
Ursula VON DER LEYEN

I PRIEDAS

PAGAL REGLAMENTO (ES) Nr. 575/2013 197 STRAIPSNĮ NUSTATYTI PAGRINDINIAI INDEKSAI

1 lentelė

Nuosavybės vertybinių popierių indeksai

Indeksas	Šalis (teritorija)
Austrian Traded Index	Austrija
BEL 20	Belgija
CETOP20	Vidurio Europa
CNX 100	Indija
CSI 300 Index	Kinija
EGX 30	Egiptas
FTSE 350	JK
FTSE All World Europe	Europa
FTSE All-World Index	Visas pasaulis
FTSE MIB	Italija
FTSE Nasdaq Dubai UAE 20 Index	JAE
FTSE RAFI Emerging Index	Besiformuojančios rinkos
FTSE Straits Times Index	Singapūras
FTSE/JSE Capped Top 40	Pietų Afrika
FTSE/JSE Industrial 25	Pietų Afrika
Hang Seng Mainland 100 Index	Honkongas
HDAX	Vokietija
IBEX 35	Ispanija
IBOVESPA	Brazilija
ISEQ 20	Airija
KOSPI 100	Pietų Korėja
MSCI ACWI Index	Visas pasaulis
MSCI EM 50	Besiformuojančios rinkos
NASDAQ-100	JAV
Nikkei 300	Japonija
NYSE ARCA China Index	Kinija
OBX	Norvegija
OMX Copenhagen 25	Danija
OMX Helsinki 25	Suomija
OMXS60	Švedija
Qatar Exchange General Index	Kataras
S&P 500	JAV
S&P BSE 100	Indija

S&P Latin America 40	Lotynų Amerika
S&P/ASX 100	Australija
S&P/BMV IPC	Meksika
S&P/NZX 10	Naujoji Zelandija
S&P/TSX 60	Kanada
SBF 120	Prancūzija
SET 50	Tailandas
SMI Expanded	Šveicarija
STOXX Asia/Pacific 600	Azija/Ramiojo vandenyno šalys
STOXX Europe 600	Europa
TOPIX Mid 400	Japonija
TSEC Taiwan 50	Taivanas
WIG20	Lenkija

II PRIEDAS

PAGAL REGLAMENTO (ES) Nr. 575/2013 197 STRAIPSNĮ NUSTATYTOS PRIPAŽINTOS BIRŽOS

1 lentelė

Pripažintos biržos, kuriose neprekiaujama Reglamento (ES) Nr. 575/2013 II priede nurodytais sandoriais

Reguliuojama rinka	MIC kodas
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. (ANKSČIAU – BATS BYX EXCHANGE, INC.; BATS Y-EXCHANGE, INC.)	BATY
CBOE BZX EXCHANGE, INC. (ANKSČIAU – BATS BZX EXCHANGE, INC.; BATS EXCHANGE, INC.)	BATS
CBOE C2 EXCHANGE, INC.	C2OX
CBOE EDGA EXCHANGE, INC. (ANKSČIAU – BATS EDGA EXCHANGE, INC.; EDGA EXCHANGE, INC.)	EDGA
CBOE EDGX EXCHANGE, INC. (ANKSČIAU – 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. (ANKSČIAU – NASDAQ OMX BX, INC.; BOSTON STOCK EXCHANGE)	BOSD
NASDAQ GEMX, LLC (ANKSČIAU – ISE GEMINI)	GMNI
NASDAQ ISE, LLC (ANKSČIAU – INTERNATIONAL SECURITIES EXCHANGE, LLC)	XISX
NASDAQ MRX, LLC (ANKSČIAU – ISE MERCURY)	MCRY
NASDAQ PHLX LLC (ANKSČIAU – 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 kodai, kurių nėra ISO 10383 standarto „Biržų ir rinkų identifikavimo kodai“ sąraše.

2 lentelė

Pripažintos biržos, kuriose prekiaujama Reglamento (ES) Nr. 575/2013 II priede nurodytais sandoriais

Reguliuojama rinka	MIC kodas
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