II

(Nelegislatívne akty)

NARIADENIA

VYKONÁVACIE NARIADENIE KOMISIE (EÚ) 2022/1650

z 24. marca 2022,

ktorým sa menia vykonávacie technické predpisy stanovené vo vykonávacom nariadení (EÚ) 2016/1646, pokiaľ ide o hlavné indexy a uznané burzy v súlade s nariadením Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 575/2013

(Text s významom pre EHP)

EURÓPSKA KOMISIA,

so zreteľom na Zmluvu o fungovaní Európskej únie,

so zreteľom na nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 575/2013 z 26. júna 2013 o prudenciálnych požiadavkách na úverové inštitúcie a o zmene nariadenia (EÚ) č. 648/2012 ([1]), a najmä na jeho článok 197 ods. 8,

keďže:

(1) Vykonávacie nariadenie Komisie (EÚ) 2016/1646 ([2]) bolo prijaté na základe predpokladu, že akciové indexy, ktoré sa majú považovať za hlavné indexy na účely nariadenia (EÚ) č. 575/2013 (a teda umožňujú inštitúciám používať akcie tvoriace tieto indexy ako prípustný kolaterál), by mali pozostávať najmä z akcií, pri ktorých možno odôvodnene očakávať, že budú realizovateľné, keď ich inštitúcia bude potrebovať speňažiť. Predpokladalo sa, že by išlo o prípady, keď aspoň 90 % zložiek indexu má voľne obchodovaný objem (*free float*) vo výške najmenej 500 000 000 EUR alebo, ak nie sú k dispozícii informácie o voľne obchodovanom objeme, trhovú kapitalizáciu vo výške najmenej 1 000 000 000 EUR. Tento predpoklad ostáva zachovaný.

(2) Vo vykonávacom nariadení (EÚ) 2016/1646 sa takisto stanovuje, že inštitúcie by mali mať možnosť uznať ako prípustný kolaterál aj nástroje zahrnuté do hlavných indexov, ktoré nespĺňajú uvedené kritériá, ale s ktorých zložkami sa dostatočne obchoduje, pričom sa zvažujú nové kritériá na identifikáciu týchto indexov. Skúsenosti však ukázali, že uvedené kritériá, ktoré sú vymedzené s ohľadom na trh, na ktorom je index založený, sa ťažko uplatňujú na hlavný index stanovený v tretej krajine, keďže si vyžadujú zber údajov o všetkých akciách prijatých na obchodovanie na danom trhu. Tento problém bránil riadnemu dosiahnutiu cieľa nariadenia (EÚ) č. 575/2013, ktorým je zabezpečiť minimálnu prahovú hodnotu likvidity zložiek indexu. Preto treba stanoviť nové kritériá, ktorými by sa riešili zistené nedostatky. Týmito novými kritériami by sa mala zabezpečiť primeranosť nástrojov ako prípustného kolaterálu, a teda dostatočná prahová hodnota likvidity nezávisle od trhu, na ktorom je index založený, ak sú splnené dve podmienky týkajúce sa štandardných ukazovateľov trhovej likvidity. V rámci prvej podmienky by sa malo vyžadovať, aby aspoň 80 % zložiek indexu malo voľne obchodovaný objem vo výške najmenej 25 000 000 EUR alebo, ak nie sú k dispozícii informácie o voľne obchodovanom objeme, trhovú kapitalizáciu vo výške najmenej 50 000 000 EUR. V rámci druhej podmienky by sa malo vyžadovať, aby všetky zložky indexu, ktorých trhová kapitalizácia sa rovná 10 000 000 000 EUR alebo je nižšia, mali minimálny priemerný denný obrat

([1]) Ú. v. EÚ L 176, 27.6.2013, s. 1.

([2]) Vykonávacie nariadenie Komisie (EÚ) 2016/1646 z 13. septembra 2016, ktorým sa stanovujú vykonávacie technické predpisy, pokiaľ ide o hlavné indexy a uznané burzy v súlade s nariadením Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 575/2013 o prudenciálnych požiadavkách na úverové inštitúcie a investičné spoločnosti (Ú. v. EÚ L 245, 14.9.2016, s. 5).

500 000 EUR a aby všetky zložky indexu s trhovou kapitalizáciou vyššou ako 10 000 000 000 EUR mali minimálny priemerný denný obrat 1 000 000 EUR. Priemerný denný obrat by sa mal vypočítať za dvanásť mesiacov kalendárneho roka predchádzajúceho posúdeniu, alebo prípadne za obdobie dvanástich mesiacov predchádzajúceho kalendárneho roka, počas ktorého bol finančný nástroj k dispozícii na obchodovanie.

(3) Vymedzenie pojmu „uznaná burza“ stanovené v článku 4 ods. 1 bode 72 nariadenia (EÚ) č. 575/2013 bolo naposledy zmenené nariadením Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) 2019/2033 ([3]). Táto zmena spočívala v doplnení slov „alebo trh tretej krajiny, ktorý je považovaný za rovnocenný s regulovaným trhom v súlade s postupom stanoveným v článku 25 ods. 4 písm. a) smernice 2014/65/EÚ“ do uvedeného bodu 72 písm. a). V dôsledku uvedenej zmeny už pojem „uznané burzy“ nie je obmedzený len na „regulované trhy“. Táto zmena by sa mala zohľadniť vo vykonávacom nariadení (EÚ) 2016/1646 tak, že sa doň zahrnú tie burzy, v súvislosti s ktorými Komisia prijala rozhodnutie o rovnocennosti podľa článku 25 ods. 4 písm. a) smernice Európskeho parlamentu a Rady 2014/65/EÚ ([4]).

(4) Po vystúpení Spojeného kráľovstva z Únie podľa článku 50 Zmluvy o Európskej únii sa zmluvy prestali uplatňovať na Spojené kráľovstvo od 1. februára 2020 a Spojené kráľovstvo je teraz treťou krajinou. Komisia dosiaľ neprijala rozhodnutie o rovnocennosti v súlade s článkom 25 ods. 4 písm. a) smernice 2014/65/EÚ, pokiaľ ide o Spojené kráľovstvo. Preto treba zo zoznamu uznaných búrz vylúčiť burzy so sídlom v Spojenom kráľovstve.

(5) Od nadobudnutia účinnosti vykonávacieho nariadenia (EÚ) 2016/1646 došlo k určitým zmenám v štruktúre trhu, najmä pokiaľ ide o vznik nových búrz, zlúčenia, zmeny názvov alebo ukončenie činností. Tieto zmeny by sa mali zohľadniť vo vykonávacom nariadení (EÚ) 2016/1646.

(6) Vykonávacie nariadenie (EÚ) 2016/1646 by sa preto malo zodpovedajúcim spôsobom zmeniť.

(7) Toto nariadenie vychádza z návrhu vykonávacích technických predpisov, ktorý Komisii predložil Európsky orgán pre cenné papiere a trhy (ESMA).

(8) Orgán ESMA uskutočnil otvorené verejné konzultácie k návrhu vykonávacích technických predpisov, z ktorého toto nariadenie vychádza, analyzoval možné súvisiace náklady a prínosy a požiadal o poradenstvo Skupinu zainteresovaných strán v oblasti cenných papierov a trhov vytvorenú v súlade s článkom 37 nariadenia Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 1095/2010 ([5]),

PRIJALA TOTO NARIADENIE:

Článok 1

Zmeny vykonávacieho nariadenia (EÚ) 2016/1646

Vykonávacie nariadenie (EÚ) 2016/1646 sa mení takto:

1. Príloha I k vykonávaciemu nariadeniu (EÚ) 2016/1646 sa nahrádza textom uvedeným v prílohe I k tomuto nariadeniu.

([3]) Nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) 2019/2033 z 27. novembra 2019 o prudenciálnych požiadavkách na investičné spoločnosti a o zmene nariadení (EÚ) č. 1093/2010, (EÚ) č. 575/2013, (EÚ) č. 600/2014 a (EÚ) č. 806/2014 (Ú. v. EÚ L 314, 5.12.2019, s. 1).

([4]) Smernica Európskeho parlamentu a Rady 2014/65/EÚ z 15. mája 2014 o trhoch s finančnými nástrojmi, ktorou sa mení smernica 2002/92/ES a smernica 2011/61/EÚ (Ú. v. EÚ L 173, 12.6.2014, s. 349).

([5]) Nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 1095/2010 z 24. novembra 2010, ktorým sa zriaďuje Európsky orgán dohľadu (Európsky orgán pre cenné papiere a trhy) a ktorým sa mení a dopĺňa rozhodnutie č. 716/2009/ES a zrušuje rozhodnutie Komisie 2009/77/ES (Ú. v. EÚ L 331, 15.12.2010, s. 84).

2. Príloha II k vykonávaciemu nariadeniu (EÚ) 2016/1646 sa nahrádza textom uvedeným v prílohe II k tomuto nariadeniu.

Článok 2

Nadobudnutie účinnosti

Toto nariadenie nadobúda účinnosť dvadsiatym dňom po jeho uverejnení v *Úradnom vestníku Európskej únie*.

Toto nariadenie je záväzné v celom rozsahu a priamo uplatniteľné vo všetkých členských štátoch.

V Bruseli 24. marca 2022

Za Komisiu
predsedníčka
Ursula VON DER LEYEN

PRÍLOHA I

HLAVNÉ INDEXY UVEDENÉ V ČLÁNKU 197 NARIADENIA (EÚ) č. 575/2013

Tabuľka 1

Akciové indexy

Index	Krajina/oblasť
Austrian Traded Index	Rakúsko
BEL 20	Belgicko
CETOP20	stredná Európa
CNX 100	India
CSI 300 Index	Čína
EGX 30	Egypt
FTSE 350	Spojené kráľovstvo
FTSE All World Europe	Európa
FTSE All-World Index	celý svet
FTSE MIB	Taliansko
FTSE Nasdaq Dubai UAE 20 Index	Spojené arabské emiráty
FTSE RAFI Emerging Index	rozvíjajúce sa trhy
FTSE Straits Times Index	Singapur
FTSE/JSE Capped Top 40	Južná Afrika
FTSE/JSE Industrial 25	Južná Afrika
Hang Seng Mainland 100 Index	Hongkong
HDAX	Nemecko
IBEX 35	Španielsko
IBOVESPA	Brazília
ISEQ 20	Írsko
KOSPI 100	Južná Kórea
MSCI ACWI Index	celý svet
MSCI EM 50	rozvíjajúce sa trhy
NASDAQ-100	USA
Nikkei 300	Japonsko
NYSE ARCA China Index	Čína
OBX	Nórsko
OMX Copenhagen 25	Dánsko
OMX Helsinki 25	Fínsko
OMXS60	Švédsko
Qatar Exchange General Index	Katar
S&P 500	USA
S&P BSE 100	India

S&P Latin America 40	Latinská Amerika
S&P/ASX 100	Austrália
S&P/BMV IPC	Mexiko
S&P/NZX 10	Nový Zéland
S&P/TSX 60	Kanada
SBF 120	Francúzsko
SET 50	Thajsko
SMI Expanded	Švajčiarsko
STOXX Asia/Pacific 600	Ázia/Tichomorie
STOXX Europe 600	Európa
TOPIX Mid 400	Japonsko
TSEC Taiwan 50	Taiwan
WIG20	Poľsko

PRÍLOHA II

UZNANÉ BURZY UVEDENÉ V ČLÁNKU 197 NARIADENIA (EÚ) č. 575/2013

Tabuľka 1

Uznané burzy, na ktorých sa neobchoduje so zmluvami uvedenými v prílohe II k nariadeniu (EÚ) č. 575/2013

Regulovaný trh	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

* Kódy MIC nie sú k dispozícii v zozname ISO 10383 – Kódy pre burzy a identifikáciu trhu.

Tabuľka 2

Uznané burzy, na ktorých sa obchoduje so zmluvami uvedenými v prílohe II k nariadeniu (EÚ) č. 575/2013

Regulovaný trh	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