

РЕГЛАМЕНТ ЗА ИЗПЪЛНЕНИЕ (ЕС) 2016/1646 НА КОМИСИЯТА**от 13 септември 2016 година****за определяне на техническите стандарти за изпълнение по отношение на основните индекси и признатите борси в съответствие с Регламент (ЕС) № 575/2013 на Европейския парламент и на Съвета относно пруденциалните изисквания за кредитните институции и инвестиционните посредници****(текст от значение за ЕИП)**

ЕВРОПЕЙСКАТА КОМИСИЯ,

като взе предвид Договора за функционирането на Европейския съюз,

като взе предвид Регламент (ЕС) № 575/2013 на Европейския парламент и на Съвета от 26 юни 2013 г. относно пруденциалните изисквания за кредитните институции и инвестиционните посредници и за изменение на Регламент (ЕС) № 648/2012 ⁽¹⁾, и по-специално член 197, параграф 8 от него,

като има предвид, че:

- (1) Съгласно Регламент (ЕС) № 575/2013 институциите могат да използват като приемливо обезпечение капиталовите инструменти или конвертируемите облигации, включени в основен индекс. Един от критериите за приемливост е обезпечението да бъде достатъчно ликвидно. За да се разглеждат като основни индекси за целите на посочения регламент, капиталовите индекси следва да се състоят основно от капиталови инструменти, които при необходимост от продажба се очаква да бъдат реализирани лесно от институцията. Такива са случаите, при които най-малко 90 % от компонентите на индекса имат свободно търгуван обем на стойност най-малко 500 000 000 EUR или, ако липсва информация за този обем — пазарна капитализация в размер най-малко на 1 000 000 000 EUR.
- (2) Инструментите, ликвидни на пазарите, на които институциите извършват дейност, и удовлетворяващи минимално ниво на ликвидност също следва да могат да се признават от институциите като приемливо обезпечение, независимо от това дали съответният пазар е в Съюза или в трета държава. Следователно даден капиталов индекс следва да се счита за основен индекс, когато включва не повече от половината от общия брой на дружествата, чиито акции се търгуват на пазара, на който индексът се основава, при условие че среднодневният оборот е най-малко 100 000 EUR и индексът отговаря на два от следните три критерия: общата пазарна капитализация на индекса е най-малко 40 % от пазарната капитализация на всички дружества, чиито акции се търгуват на този пазар; общият оборот от търговията с компонентите на индекса е най-малко 40 % от общия оборот от всички капиталови инструменти, търгувани на този пазар; индексът е базов инструмент за деривати.
- (3) Индексите на конвертируемите облигации следва да се считат за основни индекси, само когато съставляващите индекса облигации могат да бъдат конвертирани в капиталови инструменти, в случай че най-малко 90 % от тези капиталови инструменти имат свободно търгуван обем на стойност поне 500 000 000 EUR или, ако липсва информация за този обем — пазарна капитализация в размер най-малко на 1 000 000 000 EUR.
- (4) Когато на критериите за основен индекс отговарят два индекса, единият от които е поделен на другия, за улеснение само по-широкият по обхват индекс следва да се включи в списъка на основните индекси.
- (5) Съгласно Регламент (ЕС) № 575/2013 емитираните от определени институции дългови ценни книжа без присъдена кредитна оценка от агенция за външна кредитна оценка (АВКО) могат да се използват като приемливо обезпечение, само ако отговарят на определени условия, едно от които е да се котират на призната борса.
- (6) За да може дадена борса да се счита за призната борса по смисъла на Регламент (ЕС) № 575/2013, тя следва да отговаря на условията по член 4, параграф 1, точка 72 от него. По отношение на второто от посочените в точка 72 условия, а именно че борсата следва да има клирингов механизъм, всички регулирани пазари на финансови инструменти извън обхвата на приложение II към Регламент (ЕС) № 575/2013 следва да удовлетворяват

⁽¹⁾ OBL 176, 27.6.2013 г., стр. 1.

изискването, тъй като са лицензирани като регулирани пазари съгласно Директива 2004/39/ЕО на Европейския парламент и на Съвета ⁽¹⁾ и по силата на нормите и процедурите за клиринг и сетълмента на сделките, чието въвеждане се изисква от посочената Директива 2004/39/ЕО.

- (7) Ако клиринговият механизъм на борсата е предоставен от централен контрагент (ЦК), този ЦК следва да отговаря на изискванията в Регламент (ЕС) № 648/2012 на Европейския парламент и на Съвета ⁽²⁾. В редките случаи, когато борсите за деривати не се обслужват от ЦК, преценката за това дали налаганите от тези борси изисквания за допълнително обезпечение са уместни следва да се извърши, като те се сравнят с изискванията за допълнително обезпечение в Регламент (ЕС) № 648/2012.
- (8) Настоящият регламент е изготвен въз основа на проектите на технически стандарти за изпълнение, представени на Комисията от Европейския орган за ценни книжа и пазари (ЕОЦКП).
- (9) На 17 декември 2015 г. Комисията уведоми ЕОЦКП за намерението си да одобри проекта на технически стандарт за изпълнение с изменения, които да отразят факта, че някои капиталови индекси, отговарящи на критериите за основни индекси, не са в списъка, включен в този проектостандарт. В официалното си становище от 28 януари 2016 г. ЕОЦКП потвърди своята първоначална позиция и не представи изменен съгласно предложенията на Комисията технически стандарт за изпълнение. Поради това проектът на технически стандарт за изпълнение следва да бъде одобрен с измененията, които са необходими, за да се избегне изключването на индекси, отговарящи на критериите за основни индекси за целите на Регламент (ЕС) № 575/2013.
- (10) ЕОЦКП проведе открита обществена консултация по проекта на техническите стандарти за изпълнение, въз основа на които е изготвен настоящият регламент, и поиска становище от Групата на участниците от сектора на ценните книжа и пазарите, създадена в съответствие с член 37 от Регламент (ЕС) № 1095/2010 на Европейския парламент и на Съвета ⁽³⁾. ЕОЦКП не анализира подробно потенциалните разходи и ползи във връзка с проекта на технически стандарти за изпълнение, тъй като сметна, че това би било непропорционално спрямо техния обхват и въздействие,

ПРИЕ НАСТОЯЩИЯ РЕГЛАМЕНТ:

Член 1

Основни индекси

Основните индекси за целите на член 197, параграф 8, буква а) от Регламент (ЕС) № 575/2013 са определени в приложение I към настоящия регламент.

Член 2

Признати борси

Признатите борси за целите на член 197, параграф 8, буква б) от Регламент (ЕС) № 575/2013 са определени в приложение II към настоящия регламент.

⁽¹⁾ Директива 2004/39/ЕО на Европейския парламент и на Съвета от 21 април 2004 година относно пазарите на финансови инструменти, за изменение на Директиви 85/611/ЕИО и 93/6/ЕИО на Съвета и Директива 2000/12/ЕО на Европейския парламент и на Съвета и за отмяна на Директива 93/22/ЕИО на Съвета (ОВ L 145, 30.4.2004 г., стр. 1).

⁽²⁾ Регламент (ЕС) № 648/2012 на Европейския парламент и на Съвета от 4 юли 2012 г. относно извънборсовите деривати, централните контрагенти и регистрите на трансакции (ОВ L 201, 27.7.2012 г., стр. 1).

⁽³⁾ Регламент (ЕС) № 1095/2010 на Европейския парламент и на Съвета от 24 ноември 2010 година за създаване на Европейски надзорен орган (Европейски орган за ценни книжа и пазари), за изменение на Решение № 716/2009/ЕО и за отмяна на Решение 2009/77/ЕО на Комисията (ОВ L 331, 15.12.2010 г., стр. 84).

Член 3**Влизане в сила**

Настоящият регламент влиза в сила на двадесетия ден след деня на публикуването му в *Официален вестник на Европейския съюз*.

Настоящият регламент е задължителен в своята цялост и се прилага пряко във всички държави членки.

Съставено в Брюксел на 13 септември 2016 година.

За Комисията
Председател
Jean-Claude JUNKER

ПРИЛОЖЕНИЕ I

ОСНОВНИ ИНДЕКСИ ПО ЧЛЕН 197 ОТ РЕГЛАМЕНТ (ЕС) № 575/2013

Таблица 1

Капиталови индекси

Индекс	Държава/регион
STOXX Asia/Pacific 600	Азия/Тихоокеанския басейн
ASX100	Австралия
ATX Prime ⁽¹⁾	Австрия
BEL20	Белгия
IBOVESPA	Бразилия
TSX60	Канада
CETOP20 Index	Централна Европа
Hang Seng Mainland 100 Index (China)	Китай
NYSE ARCA China Index	Китай
Shanghai Shenzhen CSI 300	Китай
PX Prague	Чешка република
OMX Copenhagen 20	Дания
FTSE RAFI Emerging Markets	Бързоразвиващи се пазари
MSCI Emerging Markets 50	Бързоразвиващи се пазари
FTSE Europe Index	Европа
STOXX Europe 600	Европа
MSCI AC Europe & Middle East	Европа и Близък изток
OMXH25	Финландия
SBF120 ⁽²⁾	Франция
S&P BMI France	Франция
HDAX ⁽³⁾	Германия
FTSE All World Index	Световен мащаб
MSCI ACWI	Световен мащаб
FT ASE Large Cap	Гърция

Индекс	Държава/регион
Hang Seng	Хонконг
Hang Seng Composite Index	Хонконг
CNX 100 Index	Индия
S&P BSE 100 Index	Индия
ISEQ 20	Ирландия
FTSE MIB	Италия
Nikkei 300	Япония
TOPIX mid 400	Япония
S&P Latin America 40	Латинска Америка
FTSE Bursa Malaysia KLCI Index	Малайзия
Mexico Bolsa Index	Мексико
AEX	Нидерландия
S&P NZX 15 Index	Нова Зеландия
OBX	Норвегия
WIG20	Полша
PSI 20	Португалия
MSCI Russia Index	Русия
Russian Traded Index	Русия
FTSE Straits Times Index	Сингапур
FTSE JSE Top 40	Южна Африка
INDI 25 Index	Южна Африка
KOSPI 100	Южна Корея
IBEX35	Испания
OMXS60	Швеция
OMXSB	Швеция
SMI Expanded Index	Швейцария
TSEC Taiwan 50	Тайван

Индекс	Държава/регион
FTSE Nasdaq Dubai UAE 20 Index	ОАЕ
FTSE 350 ⁽⁴⁾	Обединено кралство
NASDAQ100	САЩ
Russell 3000 Index	САЩ
S&P 500	САЩ
⁽¹⁾ Включва АТХ.	
⁽²⁾ Включва CAC40, CAC Next 20 и CAC Mid Cap.	
⁽³⁾ Включва DAX и MDAX.	
⁽⁴⁾ Включва FTSE 100.	

Таблица 2

Индекси на конвертируеми облигации

Exane ECI-Europe	Европа
Jefferies JACI Global	Световен мащаб
Thomson Reuters Global Convertible	Световен мащаб

ПРИЛОЖЕНИЕ II

ПРИЗНАТИ БОРСИ ПО ЧЛЕН 197 ОТ РЕГЛАМЕНТ (ЕС) № 575/2013

Таблица 1

Признати борси, на които не се търгуват договорите, изброени в приложение II към Регламент (ЕС) № 575/2013

Регулиран пазар	Идентификационен код на пазара (MIC)
EURONEXT PARIS	XPAR
BOERSE BERLIN (REGULIERTER MARKT)	BERA
BOERSE BERLIN (BERLIN SECOND REGULATED MARKET)	BERC
BOERSE DUESSELDORF (REGULIERTER MARKT)	DUSA
BOERSE DUESSELDORF — QUOTRIX (REGULIERTER MARKT)	DUSC
BOERSE BERLIN EQUIDUCT TRADING (REGULIERTER MARKT)	EQTA
BOERSE BERLIN EQUIDUCT TRADING (BERLIN SECOND REGULATED MARKET)	EQTB
HANSEATISCHE WERTPAPIERBOERSE HAMBURG (REGULIERTER MARKT)	HAMA
NIEDERSAECHSISCHE BOERSE ZU HANNOVER (REGULIERTER MARKT)	HANA
BOERSE MUENCHEN (REGULIERTER MARKT)	MUNA
BOERSE MUENCHEN — MARKET MAKER MUNICH (REGULIERTER MARKT)	MUNC
BADEN-WUERTTEMBERGISCHE WERTPAPIERBOERSE (REGULIERTER MARKT)	STUA
FRANKFURTER WERTPAPIERBOERSE (REGULIERTER MARKT)	FRAA, XETA
TRADEGATE EXCHANGE (REGULIERTER MARKT)	XGRM
IRISH STOCK EXCHANGE — MAIN SECURITIES MARKET	XDUB
EURONEXT LISBON	XLIS
BOLSA DE BARCELONA	XBAR, XMCE
BOLSA DE BILBAO	XBIL, XMCE
BOLSA DE MADRID	XMAD, XMCE, MERF
BOLSA DE VALENCIA	XVAL, XMCE

Регулиран пазар	Идентификационен код на пазара (MIC)
BONDVISION MARKET	BOND
ELECTRONIC OPEN-END FUNDS AND ETC MARKET	ETFP
MARKET FOR INVESTMENT VEHICLES (MIV)	MIVX
ELECTRONIC BOND MARKET	MOTX
ELECTRONIC SHARE MARKET	MTAA
MTS GOVERNMENT MARKET	MTSC
MTS CORPORATE MARKET	MTSM
SECURITISED DERIVATIVES MARKET	SEDX
MERCADO DE DEUDA PUBLICA EN ANOTACIONES	XDPA
AIAF — MERCADO DE RENTA FIJA	XDRE, SEND
BOURSE DE LUXEMBOURG	XLUX
CYPRUS STOCK EXCHANGE	XCYS
SPOT REGULATED MARKET — BMFMS	SBMF
SPOT REGULATED MARKET — BVB	XBSE
RM-SYSTEM CZECH STOCK EXCHANGE	XRMZ
PRAGUE STOCK EXCHANGE	XPRA
BATS EUROPE REGULATED MARKET	BATE, CHIX
ISDX MAIN BOARD	ISDX
EURONEXT LONDON	XLDN
LONDON STOCK EXCHANGE — REGULATED MARKET	XLON
NASDAQ RIGA	XRIS
NASDAQ STOCKHOLM	XSTO
NORDIC GROWTH MARKET NGM	XNGM
NASDAQ COPENHAGEN	XCSE
OSLO AXESS	XOAS
OSLO BØRS	XOSL

Регулиран пазар	Идентификационен код на пазара (MIC)
NASDAQ TALLINN	XTAL
NASDAQ HELSINKI	XHEL
VIENNA STOCKEXCHANGE OFFICIAL MARKET (AMTLICHER HANDEL)	WBAH
VIENNA STOCKEXCHANGE SECOND REGULATED MARKET (GEREGELTER FREIVERKEHR)	WBGF
BULGARIAN STOCK EXCHANGE — SOFIA JSC	XBUL
NASDAQ ICELAND	XICE
BUDAPEST STOCK EXCHANGE	XBUD
BRATISLAVA STOCK EXCHANGE	XBRA
NASDAQ VILNIUS	XLIT
EURONEXT BRUSSELS	XBRU
ZAGREB STOCK EXCHANGE	XZAG
ELECTRONIC SECONDARY SECURITIES MARKET	HDAT
ATHENS EXCHANGE SECURITIES MARKET	XATH
EUROPEAN WHOLESALE SECURITIES MARKET	EWSM
MALTA STOCK EXCHANGE	XMAL
EURONEXT AMSTERDAM	XAMS
BONDSPOT SECURITIES MARKET	RPWC
WARSAW STOCK EXCHANGE	XWAR,WBON, WETP
LJUBLJANA STOCK EXCHANGE OFFICIAL MARKET	XLJU
GIBRALTAR STOCK EXCHANGE	GSXL

Таблица 2

Признати борси, на които се търгуват договорите, изброени в приложение II към Регламент (ЕС) № 575/2013

Регулиран пазар	Идентификационен код на пазара (MIC)
MATIF	XMAT
MONEP	XMON

Регулиран пазар	Идентификационен код на пазара (MIC)
POWERNEXT DERIVATIVES	XPOW
EUROPEAN ENERGY EXCHANGE	XEEE
EUREX DEUTSCHLAND	XEUR
MERCADO DE FUTUROS E OPCOES	MFOX
MERCADO REGULAMENTADO DE DERIVADOS DO MIBEL	OMIP
MEFF EXCHANGE	XMRV, XMPW
MERCADO DE FUTUROS DE ACEITE DE OLIVA — S.A	XSRM
DERIVATIVES REGULATED MARKET — BMFMS	BMFM
POWER EXCHANGE CENTRAL EUROPE	XPXE
CME EUROPE LIMITED	CMED
ICE FUTURES EUROPE — ENERGY PRODUCTS DIVISION	IFEU
ICE FUTURES EUROPE — FINANCIAL PRODUCTS DIVISION	IFLL
ICE FUTURES EUROPE — EQUITY PRODUCTS DIVISION	IFLO
ICE FUTURES EUROPE — AGRICULTURAL PRODUCTS DIVISION	IFLX
THE LONDON INTERNATIONAL FINANCIAL FUTURES AND OPTIONS EXCHANGES (LIFFE)	XLIF
THE LONDON METAL EXCHANGE	XLME
LONDON STOCK EXCHANGE DERIVATIVES MARKET	XLOD
ITALIAN DERIVATIVES MARKET	XDMI
NASDAQ STOCKHOLM	XSTO
FISH POOL	FISH
NOREXECO	NEXO
NASDAQ OSLO	NORX
OSLO BØRS	XOSL
EURONEXT BRUSSELS DERIVATIVES	XBRD
ATHENS EXCHANGE DERIVATIVES MARKET	XADE
VIENNA STOCKEXCHANGE OFFICIAL MARKET (AMTLICHER HANDEL)	WBAH
BUDAPEST STOCK EXCHANGE	XBUD

Регулиран пазар	Идентификационен код на пазара (MIC)
ICE ENDEX DERIVATIVES	NDEX
EURONEXT EQF — EQUITIES AND INDICES DERIVATIVES	XEUE
WARSAW STOCK EXCHANGE/COMMODITIES/POLISH POWER EXCHANGE/ COMMODITY DERIVATIVES	PLPD