

II

(Nelegislativní akty)

NAŘÍZENÍ

PROVÁDĚCÍ NAŘÍZENÍ KOMISE (EU) 2022/1650

ze dne 24. března 2022,

kterým se mění prováděcí technické normy stanovené v prováděcím nařízení (EU) 2016/1646, pokud jde o hlavní indexy a uznané burzy v souladu s nařízením Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 575/2013

(Text s významem pro EHP)

EVROPSKÁ KOMISE,

s ohledem na Smlouvu o fungování Evropské unie,

s ohledem na nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 575/2013 ze dne 26. června 2013 o obezřetnostních požadavcích na úvěrové instituce a o změně nařízení (EU) č. 648/2012 ⁽¹⁾, a zejména na čl. 197 odst. 8 uvedeného nařízení,

vzhledem k těmto důvodům:

- (1) Prováděcí nařízení Komise (EU) 2016/1646 ⁽²⁾ bylo přijato za předpokladu, že akciové indexy, které mají být považovány za hlavní indexy pro účely nařízení (EU) č. 575/2013 (a které tak institucím umožní používat akcie, jež tyto indexy tvoří, jako způsobilý kolaterál), by se měly skládat především z akcií, o nichž lze důvodně předpokládat, že je v případě potřeby instituce bude moci zpeněžit. Mělo se za to, že by se jednalo o případ, kdy nejméně 90 % složek indexu má volně obchodovaný objem nejméně 500 000 000 EUR, nebo nejsou-li k dispozici informace o volně obchodovaném objemu, tržní kapitalizaci ve výši nejméně 1 000 000 000 EUR. Tento předpoklad se nemění.
- (2) Prováděcí nařízení (EU) 2016/1646 rovněž stanoví, že instituce by měly mít také možnost uznat jako způsobilý kolaterál nástroje zahrnuté do hlavních indexů, které nesplňují výše uvedená kritéria, avšak jejichž složky jsou dostatečně obchodovány, a zvažuje nová kritéria pro identifikaci těchto indexů. Zkušenosti však ukázaly, že tato kritéria, definovaná s ohledem na trh, na němž je index založen, lze obtížně uplatnit vůči hlavnímu indexu zřízenému ve třetí zemi, jelikož vyžadují shromažďování údajů o všech akciích přijatých k obchodování na tomto trhu. Tento problém bránil řádnému dosažení cíle nařízení (EU) č. 575/2013, kterým je zajistit minimální prahovou hodnotu likvidity složek indexu. Je proto nezbytné stanovit nová kritéria, která by zjištěné nedostatky řešila. Tato nová kritéria by měla zajistit přiměřenost nástrojů jako způsobilého kolaterálu, a tudíž zajistit dostatečnou prahovou hodnotu likvidity nezávisle na trhu, na němž je index založen, pokud jsou splněny dvě podmínky týkající se standardních ukazatelů tržní likvidity. První podmínka by měla vyžadovat, aby nejméně 80 % složek indexu mělo volně obchodovaný objem nejméně 25 000 000 EUR, nebo nejsou-li k dispozici informace o volně obchodovaném objemu, tržní kapitalizaci ve výši nejméně 50 000 000 EUR. Druhá podmínka by měla vyžadovat, aby všechny složky indexu, jejichž tržní kapitalizace je nižší nebo rovna 10 000 000 000 EUR, měly minimální průměrný denní obrat ve výši 500 000 EUR a aby všechny složky indexu, jejichž tržní kapitalizace přesahuje 10 000 000 000 EUR,

⁽¹⁾ Úř. věst. L 176, 27.6.2013, s. 1.

⁽²⁾ Prováděcí nařízení Komise (EU) 2016/1646 ze dne 13. září 2016, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o hlavní indexy a uznané burzy v souladu s nařízením Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 575/2013 o obezřetnostních požadavcích na úvěrové instituce a investiční podniky (Úř. věst. L 245, 14.9.2016, s. 5).

měly minimální průměrný denní obrat 1 000 000 EUR. Průměrný denní obrat by měl být vypočten za dvanáct měsíců kalendářního roku předcházejícího posouzení nebo případně za období dvanácti měsíců předchozího kalendářního roku, během něhož byl finanční nástroj k dispozici k obchodování.

- (3) Definice „uznané burzy“ stanovená v čl. 4 odst. 1 bodě 72 nařízení (EU) č. 575/2013 byla naposledy změněna nařízením Evropského parlamentu a Rady (EU) 2019/2033 ⁽³⁾. Tato změna spočívala v doplnění slov „nebo trhem třetí země, který je považován za rovnocenný regulovanému trhu v souladu s postupem podle čl. 25 odst. 4 písm. a) směrnice 2014/65/EU“, do písmene a) uvedeného bodu 72. V důsledku této změny se „uznané burzy“ již neomezují pouze na „regulované trhy“. Tato změna by měla být zohledněna v prováděcím nařízení (EU) 2016/1646 tím, že do uvedeného nařízení zahrne ty burzy, pro něž Komise přijala rozhodnutí o rovnocennosti podle čl. 25 odst. 4 písm. a) směrnice Evropského parlamentu a Rady 2014/65/EU ⁽⁴⁾.
- (4) Po vystoupení Spojeného království z Unie podle článku 50 Smlouvy o Evropské unii přestaly Smlouvy ode dne 1. února 2020 na Spojené království platit a Spojené království je nyní třetí zemí. Komise dosud nepřijala rozhodnutí o rovnocennosti v souladu s čl. 25 odst. 4 písm. a) směrnice 2014/65/EU, pokud jde o Spojené království. Je proto nezbytné ze seznamu uznaných burz vyjmout ty burzy, které jsou usazené ve Spojeném království.
- (5) Od vstupu prováděcího nařízení (EU) 2016/1646 v platnost došlo ve struktuře trhu k určitým změnám, zejména pokud jde o výskyt nových burz, fúze, změny názvu nebo ukončení činnosti. Tyto změny by měly být zohledněny v prováděcím nařízení (EU) 2016/1646.
- (6) Prováděcí nařízení (EU) 2016/1646 by proto mělo být odpovídajícím způsobem změněno.
- (7) Toto nařízení vychází z návrhu prováděcích technických norem, který Komisi předložil Evropský orgán pro cenné papíry a trhy (ESMA).
- (8) Orgán ESMA uskutečnil otevřenou veřejnou konzultaci o návrzích prováděcích technických norem, z nichž toto nařízení vychází, analyzoval potenciální související náklady a přínosy a vyžádal si stanovisko skupiny subjektů působících v oblasti cenných papírů a trhů zřízené podle článku 37 nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 1095/2010 ⁽⁵⁾,

PŘIJALA TOTO NAŘÍZENÍ:

Článek 1

Změny prováděcího nařízení (EU) 2016/1646

Prováděcí nařízení (EU) 2016/1646 se mění takto:

- 1) Příloha I prováděcího nařízení (EU) 2016/1646 se nahrazuje zněním uvedeným v příloze I tohoto nařízení.

⁽³⁾ Nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) 2019/2033 ze dne 27. listopadu 2019 o obezřetnostních požadavcích na investiční podniky a o změně nařízení (EU) č. 1093/2010, (EU) č. 575/2013, (EU) č. 600/2014 a (EU) č. 806/2014 (Úř. věst. L 314, 5.12.2019, s. 1).

⁽⁴⁾ Směrnice Evropského parlamentu a Rady 2014/65/EU ze dne 15. května 2014 o trzích finančních nástrojů a o změně směrnic 2002/92/ES a 2011/61/EU (Úř. věst. L 173, 12.6.2014, s. 349).

⁽⁵⁾ Nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 1095/2010 ze dne 24. listopadu 2010 o zřízení Evropského orgánu dohledu (Evropského orgánu pro cenné papíry a trhy), o změně rozhodnutí č. 716/2009/ES a o zrušení rozhodnutí Komise 2009/77/ES (Úř. věst. L 331, 15.12.2010, s. 84).

2) Příloha II prováděcího nařízení (EU) 2016/1646 se nahrazuje zněním uvedeným v příloze II tohoto nařízení.

Článek 2

Vstup v platnost

Toto nařízení vstupuje v platnost dvacátým dnem po vyhlášení v *Úředním věstníku Evropské unie*.

Toto nařízení je závazné v celém rozsahu a přímo použitelné ve všech členských státech.

V Bruselu dne 24. března 2022.

Za Komisi
předsedkyně
Ursula VON DER LEYEN

PŘÍLOHA I

HLAVNÍ INDEXY UVEDENÉ V ČLÁNKU 197 NAŘÍZENÍ (EU) č. 575/2013

Tabulka 1

Akciové indexy

Index	Země/oblast
Austrian Traded Index	Rakousko
BEL 20	Belgie
CETOP20	střední Evropa
CNX 100	Indie
CSI 300 Index	Čína
EGX 30	Egypt
FTSE 350	Spojené království
FTSE All World Europe	Evropa
FTSE All-World Index	celosvětový
FTSE MIB	Itálie
FTSE Nasdaq Dubai UAE 20 Index	SAE
FTSE RAFI Emerging Index	rozvíjející se trhy
FTSE Straits Times Index	Singapur
FTSE/JSE Capped Top 40	Jižní Afrika
FTSE/JSE Industrial 25	Jižní Afrika
Hang Seng Mainland 100 Index	Hongkong
HDAX	Německo
IBEX 35	Španělsko
IBOVESPA	Brazílie
ISEQ 20	Irsko
KOSPI 100	Jižní Korea
MSCI ACWI Index	celosvětový
MSCI EM 50	rozvíjející se trhy
NASDAQ-100	Spojené státy americké
Nikkei 300	Japonsko
NYSE ARCA China Index	Čína
OBX	Norsko
OMX Copenhagen 25	Dánsko
OMX Helsinki 25	Finsko
OMXS60	Švédsko
Qatar Exchange General Index	Katar
S&P 500	Spojené státy americké
S&P BSE 100	Indie

S&P Latin America 40	Latinská Amerika
S&P/ASX 100	Austrálie
S&P/BMV IPC	Mexiko
S&P/NZX 10	Nový Zéland
S&P/TSX 60	Kanada
SBF 120	Francie
SET 50	Thajsko
SMI Expanded	Švýcarsko
STOXX Asia/Pacific 600	Asie a Tichomoří
STOXX Europe 600	Evropa
TOPIX Mid 400	Japonsko
TSEC Taiwan 50	Tchaj-wan
WIG20	Polsko

PŘÍLOHA II

UZNANÉ BURZY UVEDENÉ V ČLÁNKU 197 NAŘÍZENÍ (EU) č. 575/2013

Tabulka 1

Uznané burzy, na nichž se neobchodují smlouvy uvedené v příloze II nařízení (EU) 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 ₂ O 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 nejsou k dispozici v seznamu normy ISO 10383 – Kódy pro burzy a identifikaci trhu

Tabulka 2

Uznávané burzy, na nichž se obchodují smlouvy uvedené v příloze II nařízení (EU) 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, XMFY
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