

KOMISIJOS ĮGYVENDINIMO REGLAMENTAS (ES) 2016/1646**2016 m. rugsėjo 13 d.****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****(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 prudencinių reikalavimų kredito įstaigoms ir investicinėms įmonėms ir kuriuo iš dalies keičiamas Reglamentas (ES) Nr. 648/2012 ⁽¹⁾, ypač į jo 197 straipsnio 8 dalį,

kadangi:

- (1) Reglamentu (ES) Nr. 575/2013 nustatoma, kad į pagrindinį indeksą įtrauktus nuosavybės vertybinius popierius arba konvertuojamąsias obligacijas įstaigos gali naudoti kaip reikalavimus atitinkančią užtikrinimo priemonę. Vienas iš atitikties reikalavimams kriterijų yra pakankamas likvidumas. Taikant tą reglamentą pagrindiniais indeksais laikomi nuosavybės vertybinių popierių indeksai, kuriuos iš esmės sudaro nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriuos galima pagrįstai tikėtis realizuoti, kai įstaigai prireikia juos likviduoti. Taip turėtų būti, kai bent 90 % indekso sudaro bent 500 000 000 EUR vertės laisvosios akcijos arba, jei nėra informacijos apie laisvasias akcijas, bent 1 000 000 000 EUR rinkos kapitalizacija;
- (2) be to, įstaigos turėtų galėti kaip reikalavimus atitinkančią užtikrinimo priemonę pripažinti priemones, kurios yra santykinai likvidžios rinkose, kuriose cirkuliuoja, ir atitinka minimalų likvidumo lygį nepriklausomai nuo, ar ta rinka įsikūrusi Sąjungoje, ar trečiojoje valstybėje. Todėl nuosavybės vertybinių popierių indeksą reikėtų laikyti pagrindiniu indeksu, kai jis apima ne daugiau kaip pusę visų įmonių, kurių akcijomis prekiaujama rinkoje, kuria grindžiamas indeksas, kai dienos apyvartos vidurkis yra bent 100 000 EUR ir kai jis taip pat atitinka du iš toliau nurodytų trijų kriterijų: bendra indekso rinkos kapitalizacija sudaro bent 40 % visų įmonių, kurių akcijomis prekiaujama toje rinkoje, rinkos kapitalizacijos; bendra prekybos indekso sudedamosiomis dalimis apyvarta sudaro bent 40 % bendros prekybos visais nuosavybės vertybiniais popieriais apyvartos toje rinkoje ir indeksas naudojamas kaip išvestinių finansinių priemonių produktų pagrindinė priemonė;
- (3) konvertuojamųjų obligacijų indeksai turėtų būti laikomi pagrindiniais indeksais tik tais atvejais, kai sudedamąsias obligacijas galima konvertuoti į nuosavybės vertybinius popierius, kai bent 90 % tų nuosavybės vertybinių popierių sudaro bent 500 000 000 EUR vertės laisvosios akcijos arba, jei nėra informacijos apie laisvasias akcijas, bent 1 000 000 000 EUR rinkos kapitalizacija;
- (4) kai du indeksai atitinka pagrindinio indekso kriterijus ir vienas iš jų įeina į kitą, paprastumo sumetimais tik platesnio masto indeksas turėtų būti įtrauktas į pagrindinių indeksų sąrašą;
- (5) Reglamentu (ES) Nr. 575/2013 nustatoma, kad tam tikrų įstaigų, neturinčių išorinės kredito rizikos vertinimo institucijos (ECAI) parengto kredito rizikos vertinimo, išleistus skolos vertybinius popierius galima naudoti kaip reikalavimus atitinkančią užtikrinimo priemonę, kai jie tenkina keletą sąlygų, o iš jų sąlygą būti įtrauktiems į pripažintos biržos sąrašus;
- (6) taikant Reglamentą (ES) Nr. 575/2013 pripažinta birža laikoma birža, atitinkanti to reglamento 4 straipsnio 1 dalies 72 punkte nurodytas sąlygas. Kiek tai susiję su viena iš šių sąlygų, t. y. tai, kad birža turėtų turėti

⁽¹⁾ OL L 176, 2013 6 27, p. 1.

tarpuskaits mechanizmą, visos reguliuojamos rinkos, kuriose prekiaujama finansinėmis priemonėmis, neįtrauktomis į Reglamento (ES) Nr. 575/2013 II priedą, šią antrąją sąlygą turėtų įvykdyti gaudamos reguliuojamos rinkos licenciją pagal Europos Parlamento ir Tarybos direktyvą 2004/39/EB ⁽¹⁾ ir laikydamosi pagal tą direktyvą reikalaujamų sandorių tarpuskaits ir atsiskaitymo taisyklių ir procedūrų;

- (7) kai biržos tarpuskaits mechanizmą suteikia pagrindinė sandorio šalis (PSŠ), ta PSŠ turėtų laikytis Europos Parlamento ir Tarybos reglamentu (ES) Nr. 648/2012 ⁽²⁾ nustatytų reikalavimų. Retų išvestinių finansinių priemonių biržų, kurių PSŠ neaptarnauja, atveju vertinant, ar tų biržų taikomi garantinės įmokos nustatymo reikalavimai yra tinkami, kaip kriterijumi vadovaujamosi Reglamentu (ES) Nr. 648/2012 nustatytais garantinės įmokos nustatymo taisyklėmis;
- (8) šis reglamentas grindžiamas Europos vertybinių popierių ir rinkų institucijos (EVPRI) Komisijai pateiktais techninių įgyvendinimo standartų projektais;
- (9) 2015 m. gruodžio 17 d. Komisija EVPRI informavo apie ketinimą patvirtinti techninio įgyvendinimo standarto projektą su pakeitimais, kad būtų atsižvelgta į tai, kad kai kurie nuosavybės vertybinių popierių indeksai, kuriuos pagal atitikties reikalavimams kriterijus galima laikyti pagrindiniais indeksais, nebuvo įtraukti į to standarto projekto sąrašą. 2016 m. sausio 28 d. oficialioje nuomonėje EVPRI patvirtino savo pirminę poziciją ir iš naujo nepateikė techninio įgyvendinimo standarto, iš dalies pakeisto pagal Komisijos siūlytus pakeitimus. Todėl techninio įgyvendinimo standarto projektas turėtų būti patvirtintas su pakeitimais, kurių reikia, kad indeksai, kuriuos taikant Reglamentą (ES) Nr. 575/2013 pagal atitikties reikalavimams kriterijus galima laikyti pagrindiniais indeksais, būtų įtraukti į sąrašą;
- (10) EVPRI surengė atviras viešas konsultacijas dėl techninių įgyvendinimo standartų projektų, kuriais grindžiamas šis reglamentas, ir paprašė, kad pagal Reglamento (ES) Nr. 1095/2010 ⁽³⁾ 37 straipsnį įsteigta Vertybinių popierių ir rinkų suinteresuotųjų subjektų grupė pateiktų savo nuomonę. EVPRI išsamiai neanalizavo galimų sąnaudų ir naudos, susijusių su techninių įgyvendinimo standartų projektais, nes, atsižvelgiant į jų mastą ir poveikį, tai laikyta neproporcinga,

PRIĖMĖ ŠĮ REGLAMENTĄ:

1 straipsnis

Pagrindiniai indeksai

Taikant Reglamento (ES) Nr. 575/2013 197 straipsnio 8 dalies a punktą naudojami pagrindiniai indeksai yra nurodyti šio reglamento I priede.

2 straipsnis

Pripažintos biržos

Taikant Reglamento (ES) Nr. 575/2013 197 straipsnio 8 dalies b punktą pripažintos biržos yra nurodytos šio reglamento II priede.

⁽¹⁾ 2004 m. balandžio 21 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2004/39/EB dėl finansinių priemonių rinkų, iš dalies keičianti Tarybos direktyvas 85/611/EEB, 93/6/EEB ir Europos Parlamento ir Tarybos direktyvą 2000/12/EB bei panaikinanti Tarybos direktyvą 93/22/EEB (OL L 145, 2004 4 30, p. 1).

⁽²⁾ 2012 m. liepos 4 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 648/2012 dėl ne biržos išvestinių finansinių priemonių, pagrindinių sandorio šalių ir sandorių duomenų saugyklių (OL L 201, 2012 7 27, p. 1).

⁽³⁾ 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).

3 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 2016 m. rugsėjo 13 d.

Komisijos vardu

Pirmininkas

Jean-Claude JUNCKER

I PRIEDAS

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

1 lentelė

Nuosavybės vertybinių popierių indeksai

Indeksas	Šalis (teritorija)
STOXX Asia/Pacific 600	Azija/Ramiojo vandenyno šalys
ASX100	Australija
ATX Prime ⁽¹⁾	Austrija
BEL20	Belgija
IBOVESPA	Brazilija
TSX60	Kanada
CETOP20 Index	Vidurio Europa
Hang Seng Mainland 100 Index (China)	Kinija
NYSE ARCA China Index	Kinija
Shanghai Shenzhen CSI 300	Kinija
PX Prague	Čekija
OMX Copenhagen 20	Danija
FTSE RAFI Emerging Markets	Besiformuojančios rinkos
MSCI Emerging Markets 50	Besiformuojančios rinkos
FTSE Europe Index	Europa
STOXX Europe 600	Europa
MSCI AC Europe & Middle East	Europa ir Artimieji Rytai
OMXH25	Suomija
SBF120 ⁽²⁾	Prancūzija
S&P BMI France	Prancūzija
HDAX ⁽³⁾	Vokietija
FTSE All World Index	Visas pasaulis
MSCI ACWI	Visas pasaulis
FT ASE Large Cap	Graikija

Indeksas	Šalis (teritorija)
Hang Seng	Honkongas
Hang Seng Composite Index	Honkongas
CNX 100 Index	Indija
S&P BSE 100 Index	Indija
ISEQ 20	Airija
FTSE MIB	Italija
Nikkei 300	Japonija
TOPIX mid 400	Japonija
S&P Latin America 40	Lotynų Amerika
FTSE Bursa Malaysia KLCI Index	Malaizija
Mexico Bolsa Index	Meksika
AEX	Nyderlandai
S&P NZX 15 Index	Naujoji Zelandija
OBX	Norvegija
WIG20	Lenkija
PSI 20	Portugalija
MSCI Russia Index	Rusija
Russian Traded Index	Rusija
FTSE Straits Times Index	Singapūras
FTSE JSE Top 40	Pietų Afrika
INDI 25 Index	Pietų Afrika
KOSPI 100	Pietų Korėja
IBEX35	Ispanija
OMXS60	Švedija
OMXSB	Švedija
SMI Expanded Index	Šveicarija
TSEC Taiwan 50	Taivanas

Indeksas	Šalis (teritorija)
FTSE Nasdaq Dubai UAE 20 Index	JAE
FTSE 350 ⁽⁴⁾	JK
NASDAQ100	JAV
Russell 3000 Index	JAV
S&P 500	JAV
⁽¹⁾ Apima ATX. ⁽²⁾ Apima CAC40, CAC Next 20 ir CAC Mid Cap. ⁽³⁾ Apima DAX ir MDAX. ⁽⁴⁾ Apima FTSE 100.	

*2 lentelė***Konvertuojamųjų obligacijų indeksai**

Exane ECI-Europe	Europa
Jefferies JACI Global	Visas pasaulis
Thomson Reuters Global Convertible	Visas pasaulis

II PRIEDAS

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

1 lentelė

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

Reguliuojamos rinkos	MIC kodas
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

Reguliuojamos rinkos	MIC kodas
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

Reguliuojamos rinkos	MIC kodas
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

2 lentelė

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

Reguliuojamos rinkos	MIC kodas
MATIF	XMAT
MONEP	XMON

Reguliuojamos rinkos	MIC kodas
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

Reguliuojamos rinkos	MIC kodas
ICE ENDEX DERIVATIVES	NDEX
EURONEXT EQF – EQUITIES AND INDICES DERIVATIVES	XEUE
WARSAW STOCK EXCHANGE/COMMODITIES/POLISH POWER EXCHANGE/ COMMODITY DERIVATIVES	PLPD