

EUROPEES COMITÉ VOOR SYSTEEMRISICO'S

BESLUIT VAN HET EUROPEES COMITÉ VOOR SYSTEEMRISICO'S

van 21 september 2011

betreffende het verstrekken en verzamelen van informatie voor het macroprudentieel toezicht op het financiële stelsel binnen de Unie

(ESRB/2011/6)

(2011/C 302/04)

DE ALGEMENE RAAD VAN HET EUROPEES COMITÉ VOOR SYSTEEMRISICO'S,

Gelet op Verordening (EU) nr. 1092/2010 van het Europees Parlement en de Raad van 24 november 2010 betreffende macroprudentieel toezicht van de Europese Unie op het financiële stelsel en tot oprichting van een Europees Comité voor systeemrisico's ⁽¹⁾, inzonderheid artikel 3, lid 2, artikel 4, lid 2, artikel 8, lid 2, en artikel 15,

Gelet op Verordening (EU) nr. 1096/2010 van de Raad van 17 november 2010 tot toewijzing aan de Europese Centrale Bank van specifieke taken betreffende de werking van het Europees Comité voor systeemrisico's ⁽²⁾, inzonderheid artikel 2, onder b), artikel 5 en artikel 6, lid 4,

Gelet op Besluit ESRB/2011/1 van het Europees Comité voor systeemrisico's van 20 januari 2011 houdende goedkeuring van het reglement van orde van het Europees Comité voor systeemrisico's ⁽³⁾, inzonderheid artikel 28, lid 1,

Overwegende:

- (1) Artikel 3, lid 2 van Verordening (EU) nr. 1092/2010 bepaalt dat het Europees Comité voor systeemrisico's (ESRB) tot taak heeft alle informatie te bepalen en/of te vergaren, en te analyseren die van belang en nodig is voor het macroprudentieel toezicht op het financiële stelsel binnen de Unie teneinde bij te dragen tot het voorkomen of beperken van systeemrisico's voor de financiële stabiliteit in de Unie, die voortvloeien uit ontwikkelingen binnen het financiële stelsel, waarbij rekening moet worden gehouden met macro-economische ontwikkelingen, zodat perioden van wijdverbreide financiële onrust worden voorkomen.
- (2) Artikel 15, lid 2 van Verordening (EU) nr. 1092/2010 bepaalt dat de Europese toezichthoudende autoriteiten (ESA's), het Europees Stelsel van centrale banken (ESCB), de Europese Commissie, de nationale toezichthoudende autoriteiten (NSA's), en nationale statistische autoriteiten nauw met het ESRB moeten samenwerken en daaraan

alle benodigde informatie moeten verstrekken voor het vervullen van zijn taken overeenkomstig wetgeving van de Unie.

- (3) Ingevolge artikel 15, lid 3 van Verordening (EU) nr. 1092/2010, mag het ESRB de ESA's om informatie vragen, in de regel in samengevatte of geaggregeerde vorm, zodat de individuele financiële instellingen niet kunnen worden geïdentificeerd.
- (4) Overweging 10 van Verordening (EU) nr. 1096/2010 stelt: „Het verlenen van statistische ondersteuning aan het ESRB is een taak die moet worden toevertrouwd aan de ECB”, in overeenstemming met overweging 9 van die verordening.
- (5) Het onderhavige besluit interfereert niet met het recht van de ECB om de informatie die zij verzamelt op grond van Verordening (EG) nr. 2533/98 van de Raad van 23 november 1998 met betrekking tot het verzamelen van statistische informatie door de Europese Centrale Bank ⁽⁴⁾, voor haar eigen doeleinden te gebruiken.
- (6) De inhoud van de geaggregeerde informatie die op korte termijn nodig is voor de activiteiten van het ESRB, is in samenwerking met de ECB en de ESA's op basis van een gezamenlijk rapport bepaald,

HEEFT HET VOLGENDE BESLUIT VASTGESTELD:

Artikel 1

Reikwijdte

Het onderhavige besluit zet uiteen welke geaggregeerde informatie het ESRB nodig heeft voor de uitvoering van zijn taken en legt gedetailleerde regels vast voor het verstrekken en verzamelen van die informatie.

Artikel 2

Regelmatig verstrekken van geaggregeerde informatie

1. De door het ESRB voor de uitvoering van zijn taken vereiste geaggregeerde informatie wordt regelmatig verstrekt zoals vermeld in bijlage I en II.

⁽¹⁾ PB L 331 van 15.12.2010, blz. 1.

⁽²⁾ PB L 331 van 15.12.2010, blz. 162.

⁽³⁾ PB C 58 van 24.2.2011, blz. 4.

⁽⁴⁾ PB L 318 van 27.11.1998, blz. 8.

2. De ECB verstrekt de in bijlage I uiteengezette geaggregeerde informatie.

3. De respectieve ESA's verstrekken de in bijlage II uiteengezette geaggregeerde informatie.

4. Het ESRB-secretariaat:

a) legt, waar nodig, de technische specificaties vast betreffende de in lid 1 bedoelde informatie, na raadpleging van de ECB en/of ESA's, al naar gelang het geval; en

b) verzamelt de in lid 1 bedoelde informatie en werkt dienovereenkomstig samen met de ECB en de ESA's.

Artikel 3

Ad hoc verstrekken van geaggregeerde informatie

De door het ESRB-secretariaat toe te passen procedures om te voldoen aan verzoeken om geaggregeerde informatie op een ad-hoc-basis, worden uiteengezet in bijlage III.

Artikel 4

Inwerkingtreding

Dit besluit treedt op 15 oktober 2011 in werking.

Gedaan te Frankfurt am Main, 21 september 2011.

De voorzitter van het ESRB

Jean-Claude TRICHET

BIJLAGE I

Regelmatig verstrekken van geaggregeerde informatie door de Europese Centrale Bank

De Europese Centrale Bank (ECB) rapporteert, gepubliceerde en niet-gepubliceerde, reeksen gegevens betreffende de lidstaten die de euro als munt hebben, op het gebied van monetaire en financiële statistieken, die wat inhoud, frequentie en tijdigheid betreft worden gereguleerd door de hierna genoemde rechtshandelingen, of zoals vastgelegd door algemeen gebruik. Voor zover gegevens betreffende lidstaten die de euro niet als munt hebben, op vrijwillige basis met goedkeuring van de desbetreffende nationale centrale banken beschikbaar worden gesteld, rapporteert de ECB ook die gegevens.

1. Balansgegevens van monetaire financiële instellingen (MFI's) zoals bepaald in Verordening ECB/2008/32 van 19 december 2008 met betrekking tot de balans van de sector monetaire financiële instellingen sector (herschikking) ⁽¹⁾.
2. MFI-rentestatistieken zoals gedefinieerd in Verordening ECB/2001/18 van 20 december 2001 met betrekking tot statistieken van door monetaire financiële instellingen ten aanzien van huishoudens en niet-financiële vennootschappen gehanteerde rentetarieven op deposito's en leningen ⁽²⁾.
3. Statistieken betreffende beleggingsfondsen zoals gedefinieerd in Verordening ECB/2007/8 van 27 juli 2007 houdende statistieken betreffende de activa en passiva van beleggingsfondsen ⁽³⁾.
4. Statistieken betreffende securitisatie zoals gedefinieerd in Verordening ECB/2008/30 van 19 december 2008 houdende statistieken betreffende de activa en passiva van securitisatietransacties verrichtende lege financiële instellingen ⁽⁴⁾.
5. Geselecteerde monetaire statistieken en statistieken inzake financiële instellingen en markten zoals gedefinieerd in Richtsnoer ECB/2007/9 van 1 augustus 2007 betreffende monetaire statistieken en statistieken inzake financiële instellingen en markten (herschikking) ⁽⁵⁾.
6. Geconsolideerde bankgegevens, zoals goedgekeurd door de Raad van bestuur en de Algemene Raad van de ECB, die op geaggregeerde basis gegevens betreffende de balans, winst- en verliesrekening en solvabiliteit van bankgroepen bestrijken.

⁽¹⁾ PB L 15 van 20.1.2009, blz. 14.

⁽²⁾ PB L 10 van 12.1.2002, blz. 24.

⁽³⁾ PB L 211 van 14.8.2007, blz. 8.

⁽⁴⁾ PB L 15 van 20.1.2009, blz. 1.

⁽⁵⁾ PB L 341 van 27.12.2007, blz. 1.

BIJLAGE II

Regelmatig verstrekken van geaggregeerde informatie door de Europese toezichthoudende autoriteiten**ALGEMENE REGEL**

Door de Europese toezichthoudende autoriteiten (ESA's) verstrekte geaggregeerde informatie omvat gegevens betreffende ten minste drie rechtspersonen, die geen van alle 85 % of meer van de desbetreffende markt vertegenwoordigen, hetzij bestaande uit een of meerdere lidstaten dan wel de Unie in haar totaliteit. Echter indien naast de geaggregeerde informatie spreidingsmaten worden verstrekt, omvat de geaggregeerde informatie gegevens betreffende ten minste vijf rechtspersonen wanneer het publiekelijk beschikbare gegevens betreft, en gegevens betreffende ten minste zes rechtspersonen indien het nodig is vertrouwelijke gegevens op ondernemingsniveau te beschermen.

A. Europese Bankautoriteit (EBA)

De EBA rapporteert de volgende gegevensreeksen voor een steekproef van grote bankgroepen zoals bepaald tussen het ESRB en de EBA:

A1. Gegevensreeks: kwartaalgegevens uit COREP en FINREP modelformulieren ⁽¹⁾

Voor zover de relevante informatie is verzameld in samenwerking met de nationale toezichthoudende autoriteiten (NSA's), geeft de EBA aan het ESRB gegevens door die nodig zijn om de hierna opgesomde indicatoren samen te stellen, die ook door de EBA worden verstrekt, alsmede correlaties tussen de indicatoren en de volgende spreidingsmaten: minimum, eerste (laagste) en derde (hoogste) kwartiel, mediaan, gemiddelde, maximum. De EBA dient deze informatie elke drie maanden door te geven, vijf werkdagen na ontvangst door de EBA van gegevens van de NSA's, hetgeen 90 dagen na de referentiedatum plaatsvindt. De datum voor de eerste transmissie van gegevens wordt tussen het ESRB en de EBA overeengekomen. Consistente historische gegevens voor de voorgaande vijf tot acht kwartalen dienen, indien beschikbaar, ook zo goed mogelijk te worden doorgegeven.

De volgende indicatoren moeten worden verstrekt:

a) solvabiliteitsindicatoren:

tier 1-kapitaalratio; totale kapitaalratio; tier 1-ratio (zonder hybride instrumenten); kapitaalvereisten in verband met kredietrisico t.o.v. totale kapitaalvereisten; kapitaalvereisten in verband met de standaardbenadering t.o.v. totale kapitaalvereisten; kapitaalvereisten in verband met securitisatie t.o.v. totale kapitaalvereisten; kapitaalvereisten in verband met „interne-rating benadering” t.o.v. totale kapitaalvereisten; kapitaalvereisten voor marktrisico t.o.v. totale kapitaalvereisten; kapitaalvereisten voor operationeel risico t.o.v. totale kapitaalvereisten; kapitaalvereisten voor vereffenings- en leveringsrisico t.o.v. totale kapitaalvereisten; overige kapitaalvereisten t.o.v. totale kapitaalvereisten;

b) indicatoren voor kredietrisico en activakwaliteit:

achterstallige (> 90 dagen) leningen t.o.v. totale leningen en voorschotten; dubieuze leningen t.o.v. totale leningen; dekkingsgraad (specifieke voorzieningen voor leningen t.o.v. totale bruto dubieuze leningen); achterstallige (> 90 dagen) leningen en schuldinstrumenten t.o.v. totale leningen en schuldinstrumenten; dekkingsgraad (specifieke voorzieningen voor leningen en schuldinstrumenten t.o.v. totale bruto dubieuze leningen en schuldinstrumenten); dekkingsgraad (alle voorzieningen voor leningen en schuldinstrumenten t.o.v. totale bruto dubieuze leningen en schuldinstrumenten); dubieuze financiële activa t.o.v. totale activa; dubieuze schuldinstrumenten t.o.v. totale schuldinstrumenten; geaccumuleerde bijzondere waardeverminderingen van financiële activa t.o.v. totale (bruto) activa;

c) indicatoren voor rendementrisico:

rendement op eigen vermogen; rendement op wettelijke kapitaalvereisten; kosten/baten verhouding; rendement op geïnvesteerd vermogen; netto rentebaten t.o.v. totale bedrijfsopbrengsten; nettobaten uit provisie en commissie t.o.v. totale bedrijfsopbrengsten; dividendinkomsten t.o.v. totale bedrijfsopbrengsten; gerealiseerde nettowinsten (verliezen) op financiële activa en passiva die niet tegen reële waarde gewaardeerd zijn met verwerking van waardeveranderingen in de winst- en verliesrekening, t.o.v. totale bedrijfsopbrengsten; nettowinsten op voor handelsdoeleinden aangehouden financiële activa en passiva t.o.v. totale bedrijfsopbrengsten; nettowinsten op financiële activa en passiva die zijn aangemerkt als gewaardeerd tegen reële waarde met verwerking van waardeveranderingen in de winst- en verliesrekening, t.o.v. totale bedrijfsopbrengsten; netto overige bedrijfsopbrengsten t.o.v. totale bedrijfsopbrengsten; nettobaten t.o.v. totale bedrijfsopbrengsten; bijzondere waardeverminderingen van financiële activa t.o.v. totale bedrijfsopbrengsten;

⁽¹⁾ COREP en FINREP modelformulieren, die op de rapportagedatum van kracht zijn, zoals geproduceerd in de vorm van op de website van de EBA op <http://www.eba.europa.eu> gepubliceerde EBA-richtlijnen of, in voorkomend geval, in de vorm van technische normen ontwikkeld door de EBA en goedgekeurd door de Commissie op grond van artikel 74, lid 2 van Richtlijn 2006/48/EG van het Europees Parlement en de Raad van 14 juni 2006 betreffende de toegang tot en de uitoefening van de werkzaamheden van kredietinstellingen (PB L 177 van 30.6.2006, blz. 1).

d) balansstructuur:

verhouding kredieten/deposito's; deposito's van rekeninghouders t.o.v. totaal aan passiva; hefboomfinancieringsratio (tier 1-kapitaal t.o.v. (totaal aan activa — immateriële activa)); schuldbewijzen t.o.v. totaal aan passiva; deposito's van kredietinstellingen t.o.v. totaal aan passiva; eigen vermogen t.o.v. totaal aan passiva en eigen vermogen; contanten en handelsactiva t.o.v. totaal aan activa; contanten, handelsactiva en voor verkoop beschikbare activa t.o.v. totaal aan activa; voor handelsdoeleinden aangehouden financiële passiva t.o.v. totaal aan activa; voor handelsdoeleinden aangehouden financiële passiva t.o.v. totaal aan passiva en eigen vermogen; leningen en voorschotten (zonder handelsportefeuille) t.o.v. totaal aan activa; solvabiliteitsratio; niet in de balans opgenomen posten t.o.v. totaal aan activa;

e) groeitempo (%) per jaar:

totaal aan activa; totaal aan leningen; totaal aan deposito's van rekeninghouders; totale bedrijfsopbrengsten; bijzondere waardeverminderingen van financiële activa; achterstallige (> 90 dagen) leningen en schuldinstrumenten; totaal aan bruto dubieuze leningen en schuldinstrumenten; risicogewogen activa.

A2. Gegevensreeks: driemaandelijke liquiditeitsgegevens

De EBA geeft aan het ESRB gegevens door die nodig zijn om de hierna opgesomde indicatoren samen te stellen, die ook door de EBA worden verstrekt, alsmede de volgende spreidingsmaten: minimum, eerste (laagste) en derde (hoogste) kwartiel, mediaan, gemiddelde, maximum. Deze informatie wordt elke drie maanden doorgegeven, vijf werkdagen na ontvangst door de EBA van gegevens van de NSA's, hetgeen 90 dagen na de referentiedatum plaatsvindt. De informatie in de eerste transmissie heeft betrekking op midden 2013, afhankelijk van de laatste wijzigingen in de bepalingen betreffende rapportage uiteengezet in Richtlijn 2006/48/EG van het Europees Parlement en de Raad van 14 juni 2006 betreffende de toegang tot en de uitoefening van de werkzaamheden van kredietinstellingen (herschikking) ⁽¹⁾ en Richtlijn 2006/49/EG van het Europees Parlement en de Raad van 14 juni 2006 inzake de kapitaaltoereikendheid van beleggingsondernemingen en kredietinstellingen (herschikking) ⁽²⁾. De datum voor de eerste transmissie van gegevens wordt tussen het ESRB en de EBA overeengekomen. Historische gegevens worden niet vereist.

De volgende indicatoren moeten worden verstrekt: benaderingen op basis van beschikbare gegevens voor liquiditeitsdekkingsratio en netto stabiele financieringsratio.

A3. Gegevensreeks: kwartaalgegevens uit EBA-modelformulieren voor gemeenschappelijke rapportage van grote risico's ⁽³⁾

Voor zover de relevante informatie is verzameld in samenwerking met de NSA's, zulks overeenkomstig de algemene regel inzake geaggregeerde informatie, geeft de EBA aan het ESRB gegevens door die nodig zijn om de hierna opgesomde indicatoren samen te stellen, die tevens door de EBA worden verstrekt, alsmede tussen het ESRB en de EBA overeengekomen spreidingsmaten. Deze informatie wordt elke drie maanden doorgegeven, vijf werkdagen na ontvangst van gegevens van de NSA's, hetgeen 90 dagen na de referentiedatum plaatsvindt. De informatie in de eerste transmissie heeft betrekking op eind december 2011. De datum voor de eerste transmissie van gegevens wordt tussen het ESRB en de EBA overeengekomen. Historische gegevens worden niet vereist.

De volgende indicatoren moeten worden verstrekt: aantal grote risico's van de grote bankgroepen van de Unie; bedrag aan grote risico's uitgesplitst naar land en tegenpartijsector (overheid; overige grote bankgroepen van de Unie; overige banken; overige financiële intermediairs; niet-financiële ondernemingen; huishoudens); bedrag (risico vóór kredietrisicolimitering) van grote risico's van de grote bankgroepen van de Unie uitgesplitst naar instrument (activa; derivaten; instrumenten buiten de balans; indirecte risico's) en percentage eigen middelen; bedrag (risico na kredietrisicolimitering, waarvan beleggingsportefeuille) van grote risico's van grote bankgroepen van de Unie en percentage eigen middelen.

B. Europese Autoriteit voor verzekeringen en bedrijfspensioenen (EIOPA)

De EIOPA rapporteert de volgende gegevensreeksen. De B1-gegevensreeks heeft betrekking op grote verzekeringsondernemingen in de Unie, zoals geïdentificeerd door de EIOPA. De B2-gegevensreeks heeft betrekking op alle verzekeringsondernemingen in de Unie, waarbij dergelijke geaggregeerde informatie op niet-geconsolideerde basis wordt verzameld.

B1. Gegevensreeks: jaarlijkse versnelde rapportage

Voor zover de relevante informatie is verzameld in samenwerking met de NSA's, zulks overeenkomstig de algemene regel inzake geaggregeerde informatie, geeft de EIOPA aan het ESRB gegevens door die nodig zijn om de hierna opgesomde indicatoren samen te stellen, die ook door EIOPA worden verstrekt, hetzij als totale bedragen of als de volgende

⁽¹⁾ PB L 177 van 30.6.2006, blz. 1.

⁽²⁾ PB L 177 van 30.6.2006, blz. 201.

⁽³⁾ Modelformulieren voor grote risico's, die op de rapportagedatum van kracht zijn, zoals geproduceerd in de vorm van op de website van de EBA op <http://www.eba.europa.eu> gepubliceerde EBA-richtlijnen of, in voorkomend geval, in de vorm van technische normen (deel van het COREP-kader) ontwikkeld door de EBA en goedgekeurd door de Commissie op grond van artikel 110 van Richtlijn 2006/48/EG.

spreidingsmaten: ongewogen gemiddelde, gewogen gemiddelde naar brutopremies, mediaan, eerste kwartiel, derde kwartiel, minimum, maximum. Informatie wordt jaarlijks doorgegeven, ongeveer 80 kalenderdagen na het referentiejaar. De datum voor de eerste transmissie van gegevens wordt tussen het ESRB en de EIOPA overeengekomen.

De volgende indicatoren moeten worden verstrekt:

a) totale bedragen (som):

- i) totale verzekeringsbedrijf (levens- en schadeverzekeringen): bruto geboekte premies; netto verdiende premies; netto ontstane schaden; netto-bedrijfskosten; beschikbaar solvabiliteitskapitaal; vereist solvabiliteitskapitaal;
- ii) schadeverzekeringsbedrijf: bruto geboekte premies uitgesplitst naar branche (ziekte en ongevallen; motorrijtuigen; W.A. motorrijtuigen; motorvoertuigen overige klassen; zee, luchtvaart en transport; brand en andere schade aan goederen; algemene W.A.; krediet en borgtocht; overige schadeverzekering); netto verdiende premies; netto ontstane schaden; netto-bedrijfskosten; beschikbaar solvabiliteitskapitaal; vereist solvabiliteitskapitaal;
- iii) levensverzekeringsbedrijf: bruto geboekte premies uitgesplitst naar branche (gekoppelde levensverzekering; niet-gekoppelde levensverzekering; kapitaalverzekering; collectieve pensioenverzekering; overige levensverzekering); netto verdiende premies; netto ontstane schaden; netto-bedrijfskosten; beschikbaar solvabiliteitskapitaal; vereist solvabiliteitskapitaal.

b) spreidingsmaten:

- i) totale verzekeringsbedrijf (levens- en schadeverzekeringen): groeicijfer bruto geboekte premies; rendement op eigen vermogen; rendement op geïnvesteerd vermogen; solvabiliteitsratio;
- ii) schadeverzekeringsbedrijf: groeicijfer bruto geboekte premies uitgesplitst naar branche (ziekte en ongevallen; motorrijtuigen; W.A. motorrijtuigen; overige branches; zee, luchtvaart en transport; brand en andere schade aan goederen; algemene W.A.; krediet en borgtocht; overige schadeverzekering); schaderatio; kostenratio; gecombineerde ratio; rendement op eigen vermogen; rendement op geïnvesteerd vermogen; solvabiliteitsratio;
- iii) levensverzekeringsbedrijf: groeicijfer bruto geboekte premies uitgesplitst naar branche (gekoppelde levensverzekering; niet-gekoppelde levensverzekering; kapitaalverzekering; collectieve pensioenverzekering; overige levensverzekering); rendement op eigen vermogen; rendement op geïnvesteerd vermogen; solvabiliteitsratio.

B2. Gegevensreeks: jaarlijkse reguliere rapportage

Voor zover de relevante informatie is verzameld in samenwerking met de NSA's, zulks overeenkomstig de algemene regel inzake geaggregeerde informatie, geeft de EIOPA aan het ESRB gegevens door die nodig zijn om de hierna opgesomde indicatoren samen te stellen, die tevens door EIOPA worden verstrekt, als totale bedragen: ongewogen gemiddelde, gewogen gemiddelde naar brutopremies, totale ratio's voor grote verzekeraars van de Unie, mediaan, eerste kwartiel, derde kwartiel, minimum, maximum. Deze informatie wordt jaarlijks doorgegeven, ongeveer 270 kalenderdagen na het referentiejaar. De datum voor de eerste transmissie van gegevens wordt tussen het ESRB en de EIOPA overeengekomen. Historische reeksen worden verstrekt vanaf 2003.

De volgende indicatoren moeten worden verstrekt:

- a) totale verzekeringsbedrijf (levens- en schadeverzekeringen): bruto geboekte premies; netto verdiende premies; netto ontstane schaden; netto-bedrijfskosten; beschikbaar solvabiliteitskapitaal; vereist solvabiliteitskapitaal;
- b) schadeverzekeringsbedrijf: bruto geboekte premies uitgesplitst naar branche (ziekte en ongevallen; motorrijtuigen; W.A. motorrijtuigen; overige branches; zee, luchtvaart en transport; brand en andere schade aan goederen; algemene W.A.; krediet en borgtocht; overige schadeverzekering); netto verdiende premies; netto ontstane schaden; netto-bedrijfskosten; beschikbaar solvabiliteitskapitaal; vereist solvabiliteitskapitaal;
- c) levensverzekeringsbedrijf: bruto geboekte premies uitgesplitst naar branche (gekoppelde levensverzekering; niet-gekoppelde levensverzekering; kapitaalverzekering; collectieve pensioenverzekering; overige levensverzekering); netto verdiende premies; netto ontstane schaden; netto-bedrijfskosten; beschikbaar solvabiliteitskapitaal; vereist solvabiliteitskapitaal.

C. Europese Autoriteit voor effecten en markten (ESMA)

De ESMA verstrekt de volgende gegevensreeksen:

C1. Gegevensreeks: Databank van Richtlijn betreffende markten voor financiële instrumenten ⁽¹⁾

De ESMA geeft aan het ESRB gegevens door die in samenwerking met de NSA's zijn verzameld en nodig zijn om de hierna opgesomde indicatoren samen te stellen, die tevens door de ESMA worden verstrekt. Deze informatie wordt elke drie maanden doorgegeven, vijf dagen na de referentieperiode. De datum voor de eerste transmissie van gegevens wordt tussen het ESRB en de ESMA overeengekomen. Historische gegevens worden verstrekt vanaf november 2007.

De volgende indicatoren moeten worden verstrekt: naam en aanduiding van de lidstaat van de bevoegde autoriteit die de vergunning heeft verleend aan de beleggingsondernemingen met systematische interne afhandeling; naam en aanduiding van de lidstaat van de bevoegde autoriteit die de vergunning heeft verleend aan de multilaterale handelsfaciliteiten; naam en aanduiding van de lidstaat van de bevoegde autoriteit die de vergunning heeft verleend aan de gereguleerde markt; naam en aanduiding van de lidstaat van de bevoegde autoriteit die de vergunning heeft verleend aan de clearing houses van de centrale tegenpartij.

C2. Gegevensreeks: databank van het systeem met referentiegegevens

De ESMA geeft aan het ESRB gegevens door die in samenwerking met de NSA's zijn verzameld en nodig zijn om de hierna opgesomde indicatoren samen te stellen, die tevens door de ESMA worden verstrekt, alsmede de tussen het ESRB en de ESMA overeengekomen spreidingsmaten. Deze informatie wordt elke drie maanden doorgegeven, vijf dagen na de referentieperiode. De datum voor de eerste transmissie van gegevens wordt tussen het ESRB en de ESMA overeengekomen. Historische gegevens worden verstrekt vanaf juni 2009.

De volgende indicatoren moeten worden verstrekt: uitsplitsing van tot de handel op markten in de Europese Economische Ruimte toegelaten financiële instrumenten met code ES (gewone aandelen) in de indeling van financiële instrumenten; aantal instrumenten uitgesplitst naar lidstaat; aantal toegelaten instrumenten uitgesplitst naar markttoelating; aantal nieuw uitgegeven instrumenten uitgesplitst naar markttoelating; aantal nieuw uitgegeven instrumenten uitgesplitst naar lidstaat.

⁽¹⁾ Richtlijn 2004/39/EG van het Europees Parlement en de Raad van 21 april 2004 betreffende markten voor financiële instrumenten, tot wijziging van de Richtlijnen 85/611/EEG en 93/6/EEG van de Raad en van Richtlijn 2000/12/EG van het Europees Parlement en de Raad en houdende intrekking van Richtlijn 93/22/EEG van de Raad (PB L 145 van 30.4.2004, blz. 1).

BIJLAGE III

Ad-hocverzoeken om geaggregeerde informatie door het ESRB**A. ALGEMENE OVERWEGINGEN****1. Identificatie van de noodzaak voor een ad-hoconderzoek**

- 1.1. Het Europees Comité voor systeemrisico's (ESRB) kan om op een ad-hocbasis te verstrekken geaggregeerde informatie verzoeken. Aan dergelijke ad-hocverzoeken om informatie door het ESRB kan worden voldaan door:
 - a) het verstrekken van informatie die al beschikbaar is van het Europees Stelsel van centrale banken (ESCB), de Europese toezichthoudende autoriteiten (ESA's), commerciële gegevensverstrekkers of de databanken van internationale organisaties, bijv. de Bank voor Internationale Betalingen (BIB); of (b) het uitvoeren van een ad-hoconderzoek.
- 1.2. Gezien het bovenstaande zullen initiële, door ESRB-structuren ingediende ad-hocverzoeken om geaggregeerde informatie in het algemeen eerst aanleiding geven tot een onderzoeksfase met als doel vast te stellen of een ad-hoconderzoek moet worden uitgevoerd. In de onderzoeksfase zal met name worden vastgesteld welke kwantitatieve en kwalitatieve gegevens reeds beschikbaar zijn en of ze geschikt zijn. Indien de beschikbare gegevens niet geschikt zijn en de gegevens van informatieplichtigen moeten worden verzameld via een ad-hoconderzoek, kan de betreffende populatie van informatieplichtigen al in de onderzoeksfase worden geïdentificeerd, alsook een globale kostenimplicatie worden gegeven voor de informatieplichtigen voor het uitvoeren van een ad-hoconderzoek. Het resultaat van het onderzoek kan inhouden dat de algemene raad van het ESRB een besluit vaststelt voor het verzamelen van geaggregeerde informatie via een ad-hoconderzoek.
- 1.3. Het ESRB en een of meerder ESA's kunnen, vanwege hun gemeenschappelijke interesse in een bepaald onderwerp, overeenkomen een gezamenlijk ad-hoconderzoek te lanceren, in welk geval een onderzoeksfase onnodig is.

2. Typen ad-hoconderzoeken

- 2.1. Er kunnen twee typen ad-hoconderzoeken plaatsvinden:
 - a) Type 1-onderzoeken richten zich op specifieke kwesties, bijv. adequate risicobeoordeling, en streven er gewoonlijk naar meer gedetailleerde uitsplitsingen te verschaffen binnen de reguliere gegevensverzameling, bijv. „waarvan“-posities. Type 1-onderzoeken kunnen ook gegevensreeksen bestrijken die in een andere context aanleiding geven tot (reguliere) gegevensverzameling of gegevensverzameling door een andere organisatie, zoals het Internationaal Monetair Fonds of de BIB, en waarvoor al vastgestelde methodologische kaders bestaan;
 - b) Type 2-onderzoeken bestrijken verschijnselen die niet eerder geanalyseerd zijn en waarvoor geen methode is vastgesteld en geen reguliere gegevensverzameling wordt uitgevoerd. Type 2-onderzoeken zijn aanzienlijk arbeidsintensiever dan type 1-onderzoeken en er bestaat mogelijk geen maatstaf voor. Uit type 2-onderzoeken verkregen informatie is wellicht moeilijker te interpreteren. De noodzaak om de betreffende informatieplichtigen te identificeren en een methodologisch kader vast te stellen, kan inhouden dat vrij veel tijd vereist is voordat informatie wordt verzameld.
- 2.2. Bij het nemen van een besluit of een ad-hoconderzoek nodig is, zal de algemene raad van het ESRB worden geïnformeerd over, en rekening houden met, de waarschijnlijk ermee gemoeid zijnde kosten en het tijdschema voor het uitvoeren van een dergelijk onderzoek.

B. BEGINSELEN EN PROCEDURE VOOR HET AFHANDELEN VAN AD-HOCVERZOeken**3. Beginselen**

Het ESRB-secretariaat, de Europese Centrale Bank (ECB) en de ESA's (hierna de „partijen“) zullen zich aan de volgende beginselen houden bij het voldoen aan ad-hocverzoeken van het ESRB om informatie:

- a) overeengekomen procedurele stappen volgen, die op een transparante manier dienen te worden toegepast;
- b) buitensporige interactie met informatieplichtigen vermijden;
- c) optimaal gebruikmaken van bestaande informatie voor uiteenlopende analytische en operationele doeleinden, met inachtneming van de noodzakelijke wettelijke beperkingen en vertrouwelijkheidswaarborgen;
- d) zoveel mogelijk bestaande, voor zover mogelijk geharmoniseerde, methoden en gegevensbestanden gebruiken;
- e) beste praktijken voor ad-hoconderzoeken ontwikkelen door terugkoppelingsmechanismen in te voeren en informatie betreffende methoden met alle betrokken partijen te delen.

4. Procedure

4.1. Onderzoeksfase

4.1.1. ESRB-structuren brengen hun initiële verzoeken voor een ad-hocverzameling van geaggregeerde informatie ter kennis van het ESRB-secretariaat, dat vervolgens de onderzoeksfase organiseert met ondersteuning van de ECB, door de hierna beschreven actie te ondernemen. Het initiële verzoek om informatie wordt omgezet in feitelijke gegevensvereisten en de beschikbaarheid en kwaliteit van relevante informatie wordt binnen relevante organisaties beoordeeld. De ESA's en het Gemengd Comité van de ESA's worden geïnformeerd over de inhoud van het initiële ad-hocverzoek en uitgenodigd met de ECB samen te werken in het beoordelen van de beschikbare informatie, met het oog op het optimaal gebruikmaken van eerder verzamelde informatie en het vermijden van een toegenomen rapportagelast. In de onderzoeksfase kan ook een beroep worden gedaan op het ESCB, met inbegrip van het Comité statistieken (STC) van het ESCB, het Comité voor financiële stabiliteit (FSC) van het ESCB, of andere bronnen binnen het Europees Statistisch Systeem, commerciële gegevensverstrekkers en internationale organisaties, bijv. de BIB.

4.1.2. Indien, als resultaat van de onderzoeksfase: a) geschikte gegevens of acceptabele benaderingen beschikbaar zijn en van voldoende kwaliteit, en b) de toestemming van de eigenaar is verkregen voor het gebruik van gegevens die niet volledig in het publieke domein beschikbaar zijn, worden dergelijke gegevens via het ESRB-secretariaat aan de desbetreffende ESRB-structuur verstrekt die om de informatie heeft verzocht, samen met de vereiste kwaliteitsbeoordeling en informatie betreffende de kosten van uit commerciële bronnen verkregen gegevens.

4.1.3. In overige gevallen, met name indien een van de volgende situaties plaatsvindt: a) benaderingen zijn beschikbaar, maar van onbekende of onvoldoende kwaliteit; b) gegevens, noch benaderingen zijn beschikbaar; c) toestemming voor het gebruik van gegevens die niet volledig in het publieke domein zijn, is niet verkregen, verstrekt de ECB aan het ESRB het resultaat van de beoordeling betreffende de beschikbaarheid van informatie en stelt ze mogelijke bronnen en methoden voor een ad-hoconderzoek voor, waaronder: i) categorieën en het aantal informatieplichtigen, ii) rapportagekanalen, bijv. het STC, het FSC of de ESA's, iii) een schatting van kosten en tijdsbestek, iv) verwachte moeilijkheden.

4.2. Fase van gegevensverzameling

4.2.1. Na ontvangst van de onderzoeksresultaten, dient het ESRB-secretariaat via het stuurcomité van het ESRB een voorstel voor vervolgactie in ter goedkeuring door de algemene raad van het ESRB, samen met een inhoudelijke beoordeling en schatting van de kosten. De algemene raad van het ESRB besluit of een ad-hoconderzoek zal worden uitgevoerd waarbij mogelijk informatieplichtigen moeten worden betrokken. De algemene raad kan met name een besluit nemen over: a) de mate van uitsplitsing van de vereiste informatie naar instellingen en posten, b) het geldende vertrouwelijkheidsregime, met name wie toegang zal worden verleend tot welke gegevens en hoe gegevens zullen worden opgeslagen en doorgegeven, c) de uiterste termijnen voor het verstrekken van de informatie.

4.2.2. Indien een ad-hoconderzoek wordt uitgevoerd door een ESA, neemt het ESRB-secretariaat contact op met de desbetreffende ESA en het Gemengd Comité. Gegevens kunnen via de ECB worden doorgegeven, in volledige overeenstemming met artikel 8 van Verordening (EU) nr. 1092/2010 van het Europees Parlement en de Raad van 24 november 2010 betreffende macroprudentieel toezicht van de Europese Unie op het financiële stelsel en tot oprichting van een Europees Comité voor systeemrisico's⁽¹⁾.

4.2.3. Indien een ad-hoconderzoek wordt uitgevoerd door het ESCB, neemt het ESRB-secretariaat contact op met de ECB, die vervolgens via de bevoegde nationale autoriteiten, gebruik makend van de geëigende ESCB-comités, het initiatief neemt tot contact met de potentiële informatieplichtigen, waarbij de toepasselijke vertrouwelijkheidsvereisten worden nageleefd.

4.2.4. Na voltooiing van elk ad-hoconderzoek zullen de partijen informatie delen betreffende de uitvoering van het onderzoek en, met name, over de toegepaste methoden en kwaliteitscontroles, alsook over eventuele ondervonden moeilijkheden, met het oog op het verbeteren van de effectiviteit en efficiëntie van toekomstige onderzoeken.

⁽¹⁾ PB L 331 van 15.12.2010, blz. 1.