

# EUROPOS SISTEMINĖS RIZIKOS VALDYBA

## EUROPOS SISTEMINĖS RIZIKOS VALDYBOS SPRENDIMAS

2011 m. rugsėjo 21 d.

dėl informacijos teikimo ir rinkimo Sąjungos finansų sistemos makrolygio rizikos ribojimo priežiūros tikslais

(ESRV/2011/6)

(2011/C 302/04)

EUROPOS SISTEMINĖS RIZIKOS VALDYBOS BENDROJI VALDYBA,

biauti su ESRV ir suteikti jai visą informaciją, būtiną jos užduotims vykdyti vadovaujantis Sąjungos teisės aktais;

atsižvelgdama į 2010 m. lapkričio 24 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (ES) Nr. 1092/2010 dėl Europos Sąjungos finansų sistemos makrolygio rizikos ribojimo priežiūros ir Europos sisteminės rizikos valdybos įsteigimo <sup>(1)</sup>, ypač į jo 3 straipsnio 2 dalį, 4 straipsnio 2 dalį ir 8 straipsnio 2 dalį bei 15 straipsnį,

(3) pagal Reglamento (ES) Nr. 1092/2010 15 straipsnio 3 dalį, ESRV gali paprašyti EPI pateikti informaciją, kaip įprasta, apibendrinta arba suvestine forma, kad nebūtų galima nustatyti atskirų finansų įstaigų;

atsižvelgdama į 2010 m. lapkričio 17 d. Tarybos reglamentą (ES) Nr. 1096/2010, kuriuo Europos centriniam bankui pavedami konkretūs uždaviniai, susiję su Europos sisteminės rizikos valdybos veikla <sup>(2)</sup>, ypač į jo 2 straipsnio b punktą, 5 straipsnį ir 6 straipsnio 4 dalį,

(4) Reglamento (ES) Nr. 1096/2010 10 konstatuojamoji dalis skelbia, kad „ECB turėtų būti patikėtas uždavinys teikti statistinę paramą ESRV“, vadovaujantis jo 9 konstatuojamąja dalimi;

atsižvelgdama į 2011 m. sausio 20 d. Europos sisteminės rizikos valdybos sprendimą ESRV/2011/1, kuriuo patvirtinamos Europos sisteminės rizikos valdybos darbo tvarkos taisyklės <sup>(3)</sup>, ypač į jo 28 straipsnio 1 dalį,

(5) šis sprendimas neturi įtakos ECB teisei savo tikslais naudoti informaciją, kurią jis renka pagal 1998 m. lapkričio 23 d. Tarybos reglamentą (EB) Nr. 2533/98 dėl Europos centrinio banko renkamos statistinės informacijos <sup>(4)</sup>;

kadangi:

(6) ESRV veiklai nedelsiant reikalingos suvestinės informacijos turinys buvo apibrėžtas bendradarbiaujant su ECB ir EPI, remiantis bendru pranešimu,

(1) Reglamento (ES) Nr. 1092/2010 3 straipsnio 2 dalis numato, kad Europos sisteminės rizikos valdyba (ESRV) turi nustatyti ir (arba) surinkti bei analizuoti visą informaciją, reikalingą Sąjungos finansų sistemos makrolygio rizikos ribojimo priežiūrai, siekdama prisidėti prie sisteminės rizikos, kuri kyla finansiniam stabilumui Sąjungoje dėl pokyčių finansų sistemoje, prevencijos ar mažinimo ir, atsižvelgiant į makroekonominis pokyčius, kad būtų išvengta plataus masto finansinių sunkumų laikotarpių;

PRIĖMĖ ŠĮ SPRENDIMĄ:

1 straipsnis

### Taikymo sritis

Šiame sprendime nustatoma suvestinė informacija, reikalinga ESRV, kad ji galėtų atlikti savo uždavinius, ir išdėstomos išsamios tos informacijos teikimo ir rinkimo taisyklės.

(2) Reglamento (ES) Nr. 1092/2010 15 straipsnio 2 dalis numato, kad Europos priežiūros institucijos (EPI), Europos centrinių bankų sistema (ECBS), Europos Komisija, nacionalinės priežiūros institucijos (NPI) ir nacionalinės statistikos institucijos (NSI) turi glaudžiai bendradar-

2 straipsnis

### Reguliarus suvestinės informacijos teikimas

1. Suvestinė informacija, reikalinga ESRV, kad ji galėtų atlikti savo uždavinius, reguliariai teikiama I ir II prieduose nurodyta tvarka.

<sup>(1)</sup> OL L 331, 2010 12 15, p. 1.

<sup>(2)</sup> OL L 331, 2010 12 15, p. 162.

<sup>(3)</sup> OL C 58, 2011 2 24, p. 4.

<sup>(4)</sup> OL L 318, 1998 11 27, p. 8.

2. I priede nurodytą suvestinę informaciją teikia ECB.

3 straipsnis

**Suvestinės informacijos teikimas *ad hoc***

3. II priede nurodytą suvestinę informaciją teikia atitinkamos EPI.

Procedūros, kurias ESRV sekretoriatas taikys *ad hoc* prašymams pateikti suvestinę informaciją įvykdyti, nustatytos III priede.

4 straipsnis

4. ESRV sekretoriatas:

**Įsigaliojimas**

Šis sprendimas įsigalioja 2011 m. spalio 15 d.

a) prireikus ir tinkamai pasikonsultavęs su ECB ir (ar) EPI nustato 1 dalyje nurodytos informacijos technines sąlygas; ir

Priimta Frankfurte prie Maino 2011 m. rugsėjo 21 d.

b) renka 1 dalyje nurodytą informaciją bei bendradarbiauja atitinkamai su ECB ir EPI.

ESRV pirmininkas

Jean-Claude TRICHET

## I PRIEDAS

**Europos centrinio banko reguliariai teikiama suvestinė informacija**

Europos centrinis bankas (ECB) teikia skelbiamus ir neskelbiamus duomenų rinkinius apie valstybių narių, kurių valiuta yra euro, pinigų ir finansinę statistiką, kurios turinį, dažnumą ir savalaikiškumą reglamentuoja žemiau nurodyti teisės aktai arba nustato bendra praktika. Jeigu pritarus atitinkamiems nacionaliniams centriniams bankams savanoriškai teikiami duomenys apie valstybes nares, kurių valiuta nėra euro, ECB taip pat teikia tokius duomenis.

1. Pinigų finansinių institucijų (PFI) balanso duomenys, kaip apibrėžta 2008 m. gruodžio 19 d. Reglamente ECB/2008/32 dėl pinigų finansinių institucijų sektoriaus balanso (nauja redakcija) <sup>(1)</sup>
2. PFI palūkanų normų statistika, kaip apibrėžta 2001 m. gruodžio 20 d. Reglamente ECB/2001/18 dėl statistikos apie indėlių ir paskolų palūkanų normas, kurias taiko pinigų finansų įstaigos namų ūkiams ir nefinansinėms korporacijoms <sup>(2)</sup>.
3. Investicinių fondų statistika, kaip apibrėžta 2007 m. liepos 27 d. Reglamente ECB/2007/8 dėl investicinių fondų turto ir įsipareigojimų statistikos <sup>(3)</sup>.
4. Pakeitimo vertybiniais popieriais statistika, kaip apibrėžta 2008 m. gruodžio 19 d. Reglamente ECB/2008/30 dėl finansinių priemonių korporacijų, sudarančių pakeitimo vertybiniais popieriais sandorius, turto ir įsipareigojimų statistikos <sup>(4)</sup>.
5. Pasirinkta pinigų, finansinių institucijų ir rinkų statistika, kaip apibrėžta 2007 m. rugpjūčio 1 d. Gairėse ECB/2007/9 dėl pinigų, finansinių institucijų ir rinkų statistikos (nauja redakcija) <sup>(5)</sup>.
6. ECB valdančiosios tarybos ir Bendrosios tarybos patvirtinti konsoliduoti bankų duomenys, apimantys suvestinius duomenis apie balansą, pelno ir nuostolio ataskaitą ir bankų grupių mokumą.

---

<sup>(1)</sup> OL L 15, 2009 1 20, p. 14.

<sup>(2)</sup> OL L 10, 2002 1 12, p. 24.

<sup>(3)</sup> OL L 211, 2007 8 14, p. 8.

<sup>(4)</sup> OL L 15, 2009 1 20, p. 1.

<sup>(5)</sup> OL L 341, 2007 12 27, p. 1.

## II PRIEDAS

## Europos priežiūros institucijų reguliariai teikiama suvestinė informacija

## BENDRA TAISYKLĖ

Europos priežiūros institucijų (EPI) teikiama suvestinė informacija apima duomenis apie ne mažiau kaip tris juridinius asmenis, iš kurių nė vienas neatstovauja 85 procentams ar daugiau atitinkamos rinkos, ar tai būtų vienos ar daugiau valstybių narių, ar visos Sąjungos rinka. Tačiau jeigu greta suvestinės informacijos teikiamos skaitinės charakteristikos, suvestinė informacija apima duomenis apie ne mažiau kaip penkis juridinius asmenis, kai teikiami viešai prieinami duomenys, ir duomenis apie ne mažiau kaip šešis juridinius asmenis, kai būtina apsaugoti konfidencialius įmonės lygio duomenis.

## A. Europos bankininkystės institucija (EBI)

EBI teikia šiuos atrinktų didelių bankų grupių duomenų rinkinius, kaip apibrėžta ESRV ir EBI:

A1. Duomenų rinkinys: COREP ir FINREP šablonų ketvirčio duomenys <sup>(1)</sup>

Jeigu reikiama informacija buvo renkama bendradarbiaujant su NPI, EBI perduoda ESRV duomenis, reikalingus toliau išvardytiems rodikliams parengti, kuriuos taip pat teikia EBI, taip pat koreliaciją tarp rodiklių ir šių skaitinių charakteristikų: minimumą, pirmąjį (žemutinį) ir trečiąjį (viršutinį) kvartilius, medianą, vidurkį, maksimumą. EBI turėtų perduoti šią informaciją kas ketvirtį, per penkias darbo dienas nuo to momento, kai EBI gauna duomenis iš NPI, ESRV ir EBI susitaria dėl pirmojo informacijos perdavimo datos. Praėjusių penkių–aštuonių ketvirčių atitinkami ankstesni duomenys, jei tokių yra, taip pat turi būti pateikti dedant visas pastangas.

Teikiami šie rodikliai:

## a) mokumo rodikliai:

1 lygio kapitalo rodiklis; bendro kapitalo rodiklis; 1 lygio rodiklis (išskyrus hibridines priemones); kredito rizikos kapitalo reikalavimai nuo bendro kapitalo reikalavimų; standartizuoto metodo kapitalo reikalavimai nuo bendro kapitalo reikalavimų; pakeitimo vertybiniais popieriais kapitalo reikalavimai nuo bendro kapitalo reikalavimų; vidaus reitingais pagrįsti kapitalo reikalavimai nuo bendro kapitalo reikalavimų; rinkos rizikos kapitalo reikalavimai nuo bendro kapitalo reikalavimų; operacinės rizikos kapitalo reikalavimai nuo bendro kapitalo reikalavimų; atsiskaitymų ir pervedimo rizikos kapitalo reikalavimai nuo bendro kapitalo reikalavimų; kiti kapitalo reikalavimai nuo bendro kapitalo reikalavimų;

## b) kredito rizikos ir turto kokybės rodikliai:

pradelstos paskolos (daugiau kaip 90 dienų) lyginant su bendromis paskolomis ir gautinomis sumomis; nuvertėjusios paskolos lyginant su bendromis paskolomis; išsipareigojimų padengimo santykis (specialieji atidėjiniai paskoloms lyginant su bendromis nuvertėjusiomis paskolomis; pradelstos paskolos (daugiau kaip 90 dienų) ir skolos priemonės lyginant su bendromis paskolomis ir skolos priemonėmis; padengimo santykis (specialieji atidėjiniai paskoloms ir skolos priemonėmis lyginant su bendromis nuvertėjusiomis paskolomis ir skolos priemonėmis), padengimo santykis (visi atidėjiniai paskoloms ir skolos priemonėmis lyginant su bendromis nuvertėjusiomis paskolomis ir skolos priemonėmis), nuvertėjęs finansinis turtas lyginant su bendru turto; nuvertėjusios skolos priemonės lyginant su bendromis skolos priemonėmis; sukaupti finansinio turto nuvertėjimai lyginant su bendru (bruto) turto;

## c) pajamų rizikos rodikliai:

nuosavybės grąža; reguliacinio kapitalo grąža; išlaidų-pajamų santykis; turto grąža; grynosios palūkanų pajamos lyginant su bendromis veiklos pajamomis; grynasis iš finansinio turto gautas pelnas (nuostolis) neįvertintas tikrąja pelno ir nuostolio verte lyginant su bendromis veiklos pajamomis; grynasis pelnas, gautas iš finansinio turto ir išsipareigojimų, laikomų prekybos tikslais, lyginant su bendromis veiklos pajamomis; grynasis pelnas, gautas iš finansinio turto ir išsipareigojimų, išreikštas tikrąja pelno ir nuostolio verte lyginant su bendromis veiklos pajamomis; grynosios kitos veiklos pajamos lyginant su bendromis veiklos pajamomis; grynosios pajamos lyginant su veiklos pajamomis; finansinio turto nuvertėjimas nuo visų veiklos pajamų;

<sup>(1)</sup> COREP ir FINREP šablonai, galiojantys ataskaitinę dieną, yra parengiami EBI gairių forma, paskelbta EBI svetainėje <http://www.eba.europa.eu>, arba, jei tinkama, techninių standartų forma, parengta EBI ir patvirtinta Komisijos remiantis 2006 m. birželio 14 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyvos 2006/48/EB dėl kredito įstaigų veiklos pradėjimo ir vykdymo (OL L 177, 2006 6 30, p. 1) 74 straipsnio 2 dalimi.

d) balanso struktūra:

paskolos ir indėlio santykis; klientų indėliai ir visi įsipareigojimai; finansinio svėro koeficientas (pirmojo lygio kapitalas nuo (visas turtas – nematerialusis turtas)); skolos vertybiniai popieriai ir visi įsipareigojimai; kredito įstaigų indėliai ir visi įsipareigojimai; nuosavybė ir visi įsipareigojimai ir nuosavybė; grynieji pinigai ir prekybinis turtas ir visas turtas; grynieji pinigai, prekybinis ir parengtas parduoti turtas ir visas turtas; finansinis turtas, laikomas prekybos tikslais, ir visas turtas; finansiniai įsipareigojimai, laikomi prekybos tikslais, ir visi įsipareigojimai ir nuosavybė; paskolos ir avansai (išskyrus prekybos knygą) ir visas turtas; skolos ir nuosavybės santykis; nebalansiniai straipsniai ir visas turtas;

e) augimo rodikliai (%) per metus:

visas turtas; visos paskolos; visi klientų indėliai; visos veiklos pajamos; finansinio turto nuvertėjimas; negrąžintos (daugiau kaip 90 dienų) paskolos ir skolos priemonės; visos nuvertėjusios paskolos bendrąja verte ir skolos priemonės; pagal riziką įvertintas turtas.

#### A2. Duomenų rinkinys: likvidumo ketvirčio duomenys

EBI perduoda ESRV duomenis, reikalingus toliau išvardytiems rodikliams parengti, kuriuos taip pat teikia EBI, taip pat ir šias skaitines charakteristikas: minimumą, pirmąjį (žemutinį) ir trečiąjį (viršutinį) kvartilius, medianą, vidurkį, maksimumą. Informacija teikiama kas ketvirtį, per penkias darbo dienas nuo to momento, kai EBI gauna duomenis iš NSI, t. y. praėjus 90 dienų nuo ataskaitinės datos. Pirmą kartą teikiama informacija bus susijusi su 2013 m. viduriu, priklausomai nuo to, kaip galutinai bus pakeistos nuostatos dėl ataskaitų teikimo, įtvirtintos 2006 m. birželio 14 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyvoje 2006/48/EB dėl kredito įstaigų veiklos pradėjimo ir vykdymo (nauja redakcija) <sup>(1)</sup> ir 2006 m. birželio 14 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyvoje 2006/49/EB dėl investicinių įmonių ir kredito įstaigų kapitalo pakankamumo (nauja redakcija) <sup>(2)</sup>. ESRV ir EBI susitaria dėl pirmojo informacijos perdavimo datos. Istoriniai duomenys neteikiami.

Teikiami šie rodikliai: turimų duomenų apie likvidumo padengimo rodiklį ir grynąjį stabilų finansavimo rodiklį pakaitiniai rodikliai.

#### A3. Duomenų rinkinys: EBI bendrų ataskaitų apie dideles pozicijas šablonų ketvirčio duomenys <sup>(3)</sup>

Jeigu reikiama informacija buvo renkama bendradarbiaujant su NPI ir vadovaujantis bendra taisykle dėl suvestinės informacijos, EBI perduoda ESRV duomenis, reikalingus toliau išvardytiems rodikliams parengti, kuriuos taip pat teikia EBI, taip pat skaitines charakteristikas, dėl kurių susitarė ESRV ir EBI. Ši informacija teikiama kas ketvirtį, per penkias darbo dienas nuo to momento, kai EBI gauna duomenis iš NPI, t. y. praėjus 90 dienų nuo ataskaitinės datos. Pirmą kartą teikiama informacija bus susijusi su 2011 m. gruodžio pabaiga. ESRV ir EBI susitars dėl pirmojo informacijos perdavimo datos. Istoriniai duomenys neteikiami.

Teikiami šie rodikliai: didelių Sąjungos bankų grupių didelių pozicijų skaičius; didelių pozicijų suma, suskirstyta pagal šalis ir priešingos šalies sektorių (valdžios sektorius; kitos didelės Sąjungos bankų grupės; kiti bankai; kiti finansiniai tarpininkai; nefinansinės korporacijos; mažmenininkai); didelių Sąjungos bankų grupių didelių pozicijų suma (pozicija prieš kredito rizikos sumažinimą), suskirstyta pagal priemones (turtas; išvestinės priemonės; nebalansiniai straipsniai; netiesioginės pozicijos) ir nuosavos lėšos procentais; didelių Sąjungos bankų grupių didelių pozicijų suma (pozicija po kredito rizikos sumažinimo, įskaitant bankinę knygą) ir nuosavos lėšos procentais.

## B. Europos draudimo ir profesinių pensijų institucija (EDPPI)

EDPPI teikia šiuos duomenų rinkinius. B1 duomenų rinkinys skirtas didelėms Sąjungos draudimo bendrovėms, kurias nustato EDPPI. B2 duomenų rinkinys skirtas visoms Sąjungos draudimo bendrovėms, suvestinę informaciją renkant pagal kiekvieną bendrovę atskirai.

#### B1. Duomenų rinkinys: metinė greita atskaitomybė

Jeigu reikiama informacija buvo renkama bendradarbiaujant su NPI ir vadovaujantis bendra taisykle dėl suvestinės informacijos, EDPPI perduoda ESRV duomenis, reikalingus toliau išvardytiems rodikliams parengti, kuriuos taip pat teikia EDPPI, arba kaip bendras sumas, arba kaip šias skaitines charakteristikas: nesvertinis vidurkis, svertinis įmokų vidurkis,

<sup>(1)</sup> OL L 177, 2006 6 30, p. 1.

<sup>(2)</sup> OL L 177, 2006 6 30, p. 201.

<sup>(3)</sup> Didelių pozicijų šablonai, galiojantys ataskaitų teikimo dieną, parengti EBI gairių forma ir paskelbti EBI svetainėje <http://www.eba.europa.eu> arba, jei tinkama, techninių standartų forma (COREP sistemos dalis), parengtų EBI ir patvirtintų Komisijos pagal Direktyvos 2006/48/EB 110 straipsnį.

neišskaičius perdraudikų dalies, mediana, pirmasis kvartilis, trečiasis kvartilis, minimumas, maksimumas. Informacija perduodama kasmet, apytiksliai praėjus 80 kalendorinių dienų pasibaigus ataskaitiniams metams. ESRV ir EDPPi susitars dėl pirmojo informacijos perdavimo datos.

Teikiami šie rodikliai:

a) bendros sumos (suma):

- i) visa draudimo veikla (gyvybės ir ne gyvybės): pasirašytų įmokų suma, neišskaičius perdraudikų dalies; uždirbtos įmokos, išskaičius perdraudikų dalį; išmokų sąnaudos, išskaičius perdraudikų dalį; gryniosios veiklos sąnaudos; turimas mokumo kapitalas; būtinas mokumo kapitalas;
- ii) ne gyvybės draudimo veikla: pasirašytų įmokų suma, neišskaičius perdraudikų dalies, paskirstyta pagal draudimo grupes (nelaimingų atsitikimų ir sveikatos draudimas; transporto priemonių draudimas; transporto priemonių valdytojų civilinės atsakomybės draudimas; kitos draudimo grupės; jūrų, oro ir transporto draudimas; turto draudimas nuo gaisro ir kitų žalių; bendrosios civilinės atsakomybės draudimas; kredito ir laidavimo draudimas, kita ne gyvybės draudimo veikla); uždirbtos įmokos, išskaičius perdraudikų dalį; išmokų sąnaudos, išskaičius perdraudikų dalį; gryniosios veiklos sąnaudos; turimas mokumo kapitalas; būtinas mokumo kapitalas;
- iii) gyvybės draudimo veikla: pasirašytų įmokų suma, neišskaičius perdraudikų dalies, paskirstyta pagal draudimo grupes (gyvybės draudimas, susijęs su investiciniais fondais (kai investavimo rizika tenka draudėjui); gyvybės draudimas, nesusijęs su investiciniais fondais; kapitalo išpirkimo operacijos; kolektyvinis pensijų draudimas; kitas gyvybės draudimas); uždirbtos įmokos, išskaičius perdraudikų dalį; išmokų sąnaudos, išskaičius perdraudikų dalį; gryniosios veiklos sąnaudos; turimas mokumo kapitalas; būtinas mokumo kapitalas.

b) skaitinės charakteristikos:

- i) visa draudimo veikla (gyvybės ir ne gyvybės): pasirašytų įmokų sumos, neišskaičius perdraudikų dalies, augimo tempas; nuosavybės grąža, turto grąža, mokumo koeficientas;
- ii) ne gyvybės draudimo veikla: pasirašytų įmokų sumos, neišskaičius perdraudikų dalies, augimo tempas, paskirstytas pagal draudimo grupes (nelaimingų atsitikimų ir sveikatos draudimas; transporto priemonių draudimas; transporto priemonių valdytojų civilinės atsakomybės draudimas; kitos draudimo grupės; jūrų, oro ir transporto draudimas; turto draudimas nuo gaisro ir kitų žalių; bendrosios civilinės atsakomybės draudimas; kredito ir laidavimo draudimas, kita ne gyvybės draudimo veikla); nuostolingumo rodiklis; veiklos sąnaudų rodiklis; sudėtinis sąnaudų rodiklis; nuosavybės grąža, turto grąža, mokumo koeficientas;
- iii) gyvybės draudimo veikla: pasirašytų įmokų sumos, neišskaičius perdraudikų dalies, augimo tempas, paskirstytas pagal draudimo grupes (gyvybės draudimas, susijęs su investiciniais fondais (kai investavimo rizika tenka draudėjui), su su investiciniais fondais nesusijęs gyvybės draudimas; kapitalo išpirkimo operacijos; kolektyvinis pensijų draudimas; kitas gyvybės draudimas); nuosavybės grąža, turto grąža, mokumo koeficientas.

## B2. Duomenų rinkinys: metinė reguliari atskaitomybė

Jeigu reikiama informacija buvo renkama bendradarbiaujant su NPI ir vadovaujantis bendra taisykle dėl suvestinės informacijos, EDPPi perduoda ESRV duomenis, reikalingus toliau išvardytiems rodikliams parengti, kuriuos taip pat teikia EDPPi, kaip bendras sumas: nesvertinis vidurkis, svertinis įmokų vidurkis, neišskaičius perdraudikų dalies, bendri didelių Sąjungos draudikų rodikliai, mediana, pirmasis kvartilis, trečiasis kvartilis, minimumas, maksimumas. Ši informacija perduodama kasmet, apytiksliai praėjus 270 kalendorinių dienų pasibaigus ataskaitiniams metams. ESRV ir EDPPi susitars dėl pirmojo informacijos perdavimo datos. Istorinės eilutės teikiamos nuo 2003 m.

Teikiami šie rodikliai:

- a) visa draudimo veikla (gyvybės ir ne gyvybės): pasirašytų įmokų suma, neišskaičius perdraudikų dalies; uždirbtos įmokos, išskaičius perdraudikų dalį; išmokų sąnaudos, išskaičius perdraudikų dalį; gryniosios veiklos sąnaudos; turimas mokumo kapitalas; būtinas mokumo kapitalas;
- b) ne gyvybės draudimo veikla: pasirašytų įmokų suma, neišskaičius perdraudikų dalies, paskirstyta pagal draudimo grupes (nelaimingų atsitikimų ir sveikatos draudimas; transporto priemonių draudimas; transporto priemonių valdytojų civilinės atsakomybės draudimas; kitos draudimo grupės; jūrų, oro ir transporto draudimas; turto draudimas nuo gaisro ir kitų žalių; bendrosios civilinės atsakomybės draudimas; kredito ir laidavimo draudimas, kita ne gyvybės draudimo veikla); uždirbtos įmokos, išskaičius perdraudikų dalį; išmokų sąnaudos, išskaičius perdraudikų dalį; gryniosios veiklos sąnaudos; turimas mokumo kapitalas; būtinas mokumo kapitalas;
- c) gyvybės draudimo veikla: pasirašytų įmokų suma, neišskaičius perdraudikų dalies, paskirstyta pagal draudimo grupes (gyvybės draudimas, susijęs su investiciniais fondais (kai investavimo rizika tenka draudėjui); gyvybės draudimas, nesusijęs su investiciniais fondais; kapitalo išpirkimo operacijos; kolektyvinis pensijų draudimas; kitas gyvybės draudimas); uždirbtos įmokos, išskaičius perdraudikų dalį; išmokų sąnaudos, išskaičius perdraudikų dalį; gryniosios veiklos sąnaudos; turimas mokumo kapitalas; būtinas mokumo kapitalas.

### C. Europos vertybinių popierių rinkų institucija (EVPRI)

EVPRI teikia šiuos duomenų rinkinius:

#### C1. Duomenų rinkinys: Finansinių priemonių rinkų direktyvos <sup>(1)</sup> duomenų bazė

EVPRI perduoda ESRV duomenis, surinktus bendradarbiaujant su NPI, reikalingus toliau išvardytiems rodikliams parengti, kuriuos taip pat teikia EVPRI. Ši informacija perduodama kas ketvirtį, per penkias dienas pasibaigus ataskaitiniam laikotarpiui. ESRV ir EVPRI susitars dėl pirmojo informacijos perdavimo datos. Istorinė informacija teikiama nuo 2007 m. lapkričio mėn.

Teikiami šie rodikliai: valstybės narės paskirtos kompetentingos institucijos, kuri suteikė leidimus finansų tarpininkams, nuolatos vykdančioms pavedimus iš savo nuosavo finansinio turto, pavadinimas ir paskyrimas; valstybės narės paskirtos kompetentingos institucijos, kuri suteikė leidimus daugiašalėms prekybos sistemoms, pavadinimas ir paskyrimas; valstybės narės paskirtos kompetentingos institucijos, kuri suteikė leidimus reguliuojamai rinkai, pavadinimas ir paskyrimas; valstybės narės paskirtos kompetentingos institucijos, kuri suteikė leidimus pagrindinių sandorio šalių kliringo rūmams, pavadinimas ir paskyrimas.

#### C2. Duomenų rinkinys: ataskaitinių duomenų sistemos duomenų bazė

EVPRI perduoda ESRV duomenis, surinktus bendradarbiaujant su NPI, reikalingus toliau išvardytiems rodikliams parengti, kuriuos taip pat teikia EVPRI, taip pat skaitines charakteristikas, dėl kurių susitarė ESRV ir EVPRS. Ši informacija perduodama kas ketvirtį, per penkias dienas pasibaigus ataskaitiniam laikotarpiui. ESRV ir EVPRI susitars dėl pirmojo informacijos perdavimo datos. Istorinė informacija teikiama nuo 2009 m. birželio mėn.

Teikiami šie rodikliai: finansinių priemonių, kuriomis leidžiama prekiauti Europos ekonominės erdvės rinkose ir kurių finansinių priemonių klasifikacijos kodas yra ES (paprastosios akcijos); priemonių kiekis pagal valstybes nares; priemonių, kuriomis leidžiama prekiauti rinkoje, kiekis pagal rinkas; naujų išleistų priemonių kiekis pagal rinką; naujų išleistų priemonių kiekis pagal valstybes nares.

---

<sup>(1)</sup> 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).

## III PRIEDAS

ESRV teikiami *ad hoc* prašymai pateikti suvestinę informaciją

## A. BENDROS PASTABOS

1. *Ad hoc* tyrimo būtinybės nustatymas

- 1.1. Europos sisteminės rizikos valdyba (ESRV) gali paprašyti pateikti suvestinę informaciją *ad hoc* pagrindu. Tokie ESRV *ad hoc* prašymai pateikti informaciją gali būti pateikti: a) suteikiant informaciją, jau gautą iš Europos centrinių bankų sistemos (ECBS), Europos priežiūros institucijų (EPI), komercinių duomenų teikėjų arba tarptautinių organizacijų, pvz., Tarptautinių atsiskaitymų banko (TAB), duomenų bazių, arba b) atliekant *ad hoc* tyrimą.
- 1.2. Atsižvelgiant į tai, ESRV struktūroms pateikus pradinius *ad hoc* prašymus pateikti suvestinę informaciją, paprastai pirmiausia pradedamas patikrinimas, kurio metu siekiama nustatyti, ar reikia atlikti *ad hoc* tyrimą. Patikrinimo metu pirmiausia įvertinama, kokie kiekybiniai ir kokybiniai duomenys jau turimi ir ar jie yra tinkami siekiamam tikslui. Jeigu turimi duomenys nėra tinkami siekiamam tikslui ir iškyla poreikis surinkti duomenis iš atskaitingųjų agentų atliekant *ad hoc* tyrimą, jau patikrinimo metu gali būti nustatyta atitinkama atskaitingoji visuma ir bendros galimos atskaitingųjų agentų sąnaudos, susijusios su *ad hoc* tyrimo vykdymu. Atlikus patikrinimą ESRV bendroji valdyba gali priimti sprendimą dėl suvestinės informacijos surinkimo *ad hoc* tyrimo būdu.
- 1.3. ESRV ir viena ar kelios EPI, atsižvelgdamos į bendrą interesą konkrečiu klausimu, gali susitarti pradėti bendrą *ad hoc* tyrimą; tokiu atveju patikrinimo etapas nėra būtinas.

2. *Ad hoc* tyrimų rūšys

- 2.1. Gali būti naudojamos dvi *ad hoc* tyrimų rūšys:
  - a) 1 rūšis skirta konkrečioms klausimams, pvz., tinkamam pozicijos vertinimui, ir dažniausiai ja siekiama pateikti išsamesnius, nei renkant duomenis įprastiniu būdu, suskirstymus, pvz., pozicijas „iš jų“. 1 rūšies tyrimai taip gali apimti duomenų rinkinius, kuriems (reguliarius) duomenis reikia surinkti kitokiame kontekste arba kuriuos turi surinkti kita organizacija, pavyzdžiui, Tarptautinis valiutos fondas arba TAB, ir kuriems jau yra nustatytos nusistovėjusios metodologinės sistemos;
  - b) 2 rūšies tyrimai apima reiškinius, kurie anksčiau nebuvo analizuoti ir kuriems nėra nustatyta metodologijų, taip pat reguliariai nerenkami duomenys. 2 rūšies tyrimams reikia žymiai daugiau darbo nei 1 rūšies tyrimams, be to, jie gali neturėti orientacinės vertės. 2 rūšies tyrimo metu gautą informaciją gali būti sunkiau interpretuoti. Būtinybė nustatyti atitinkamus atskaitingus agentus ir sukurti metodologinę sistemą gali reikšti, kad prireiks nemažai laiko dar prieš informacijos surinkimą.
- 2.2. Sprendžiant, ar reikia atlikti *ad hoc* tyrimą, ESRV bendroji valdyba informuojama apie galimas su tokio tyrimo atlikimu susijusias sąnaudas bei tvarkaraštį ir į tai atsižvelgia.

## B. AD HOC PRAŠYMŲ NAGRINĖJIMO PRINCIPAI IR TVARKA

## 3. Principai

ESRV sekretoriatas, Europos centrinis bankas (ECB) ir EPI (toliau – šalys), vykdydamos ESRV *ad hoc* prašymus pateikti informaciją, laikosi šių principų:

- a) laikosi sutartų procesinių etapų, kurie turi būti taikomi skaidriai;
- b) vengia pernelyg intensyvaus bendravimo su atskaitingaisiais agentais;
- c) įvairiems analitiniais ir veiklos tikslams kiek įmanoma naudoja turimą informaciją, tuo pačiu laikydamiesi būtinų teisinių apribojimų ir konfidencialumo priemonių;
- d) kiek įmanoma naudoja esamas, kuo labiau suderintas, metodologijas ir duomenų rinkinius;
- e) sukuria *ad hoc* tyrimų atlikimo geriausią praktiką, nustatydami visų dalyvaujančių šalių grįžamojo ryšio ir dalijimosi informacija apie metodologijas mechanizmus.



#### 4. Tvarka

##### 4.1. Patikrinimo etapas

4.1.1. Pradinius prašymus dėl *ad hoc* suvestinės informacijos surinkimo ESRV struktūros perduoda ESRV sekretoriui, kuris, padedamas ECB, organizuoja patikrinimą, imdamasis tokių veiksmų. Pradinis prašymas pateikti informaciją pakeičiamas konkrečių duomenų reikalavimais, o atitinkamos organizacijos įvertina atitinkamos turimos informacijos kokybę. EPI ir EPI Jungtinis komitetas informuojami apie pradinio *ad hoc* prašymo turinį ir kviečiami bendradarbiauti su ECB vertinant turimą informaciją, siekiant kiek įmanoma panaudoti anksčiau surinktą informaciją ir išvengti atskaitomybės naštos padidinimo. Patikrinimo metu taip pat galima remtis ECBS, įskaitant ECBS Statistikos komitetą (STK), ECBS Finansinio stabilumo komitetą (FSK), arba kitais Europos statistikos sistemos šaltiniais, komerciniais duomenų teikėjais ir tarptautinėmis organizacijomis, pvz., TAB.

4.1.2. Jeigu, atlikus patikrinimą: a) siekiamam tikslui tinkami duomenys arba priimtini pakaitiniai rodikliai yra turimi ir yra pakankamos kokybės; ir b) gaunamas savininko sutikimas naudoti duomenis, kurie yra nevisiškai viešai prieinami, per ESRV sekretoriatai tokie duomenys kartu su reikalaujama kokybės įvertinimu ir informacija apie iš komercinių šaltinių gautų duomenų kainą teikiami atitinkamai ESRV struktūrai, kuri prašo informacijos.

4.1.3. Kitais atvejais, ypač kai susiklosto bet kuri iš toliau nurodytų aplinkybių: a) pakaitiniai rodikliai yra prieinami, tačiau jų kokybė yra nežinoma arba nepakankama; b) nėra nei duomenų, nei pakaitinių rodiklių; c) negaunamas sutikimas naudoti duomenų, kurie yra nevisiškai viešai prieinami, ECB informuoja ESRV apie informacijos prieinamumo įvertinimo rezultatą ir pasiūlo galimus *ad hoc* tyrimo šaltinius ir metodologijas, įskaitant: i) atskaitingųjų agentų kategorijas ir skaičių; ii) atskaitomybės kanalus, pvz., STK, FSK arba EPI; iii) preliminarų sąnaudų ir laiko paskaičiavimą; iv) numatomus sunkumus.

##### 4.2. Duomenų rinkimo etapas

4.2.1. Gavęs patikrinimo rezultatus, ESRV sekretoriatas per ESRV valdymo komitetą pateikia ESRV bendrajai valdybai tvirtinti pasiūlymą dėl tolesnių veiksmų kartu su preliminariu naudos ir sąnaudų įvertinimu. ESRV bendroji valdyba nusprendžia, ar atlikti *ad hoc* tyrimą, kuriame gali tekti dalyvauti atskaitingiesiems agentams. Bendrosios valdybos sprendimas gali nustatyti, pirmiausia: a) prašomos informacijos išsamumą instituciniu ir straipsnių lygiu, b) taikytiną konfidencialumo tvarką, ypač tai, kam bus leidžiama susipažinti ir su kokiais duomenimis ir kaip duomenys bus saugomi bei perduodami; c) informacijos pateikimo terminus.

4.2.2. Kai *ad hoc* tyrimą atlieka EPI, ESRV sekretoriatas susisiečia su atitinkama EPI ir Jungtiniu komitetu. Duomenys gali būti teikiami per ECB, visapusiškai laikantis 2010 m. lapkričio 24 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 1092/2010 dėl Europos Sąjungos finansų sistemos makrolygio rizikos ribojimo priežiūros ir Europos sisteminės rizikos valdybos įsteigimo <sup>(1)</sup> 8 straipsnio.

4.2.3. Kai *ad hoc* tyrimą atlieka ECBS, ESRV sekretoriatas susisiečia su ECB, kuris per atitinkamas nacionalines kompetentingas institucijas, pasinaudodamas atitinkamais ECBS komitetais, ir laikydamasis taikomų konfidencialumo apribojimų, inicijuoja susisiekimą su potencialiais atskaitingaisiais agentais.

4.2.4. Užbaigus kiekvieną *ad hoc* tyrimą, šalys pasidalina informacija apie tyrimo vykdymą, o ypač apie taikytus metodologiją bei kokybės patikrinimus, taip pat apie visus sunkumus, su kuriais susidurta, taip siekiant pagerinti būsimų tyrimų veiksmingumą ir efektyvumą.

---

<sup>(1)</sup> OL L 331, 2010 12 15, p. 1.