

# EIROPAS SISTĒMISKO RISKU KOLĒĢIJA

## EIROPAS SISTĒMISKO RISKU KOLĒĢIJAS LĒMUMS

(2011. gada 21. septembris)

par informācijas sniegšanu un vākšanu finanšu sistēmas makrouzraudzībai Eiropas Savienībā

(ESRK/2011/6)

(2011/C 302/04)

EIROPAS SISTĒMISKO RISKU KOLĒĢIJAS VALDE,

ņemot vērā Eiropas Parlamenta un Padomes 2010. gada 24. novembra Regulu (ES) Nr. 1092/2010 par Eiropas Savienības finanšu sistēmas makrouzraudzību un Eiropas Sistēmisko risku kolēģijas izveidošanu<sup>(1)</sup> un jo īpaši tās 3. panta 2. punktu, 4. panta 2. punktu, 8. panta 2. punktu un 15. pantu,

ņemot vērā Padomes 2010. gada 17. novembra Regulu (ES) Nr. 1096/2010, ar kuru Eiropas Centrālajai bankai piešķir konkrētus uzdevumus saistībā ar Eiropas Sistēmisko risku kolēģijas darbību<sup>(2)</sup> un jo īpaši tās 2. panta b) apakšpunktu, 5. pantu un 6. panta 4. punktu,

ņemot vērā 2011. gada 20. janvāra Lēmumu ESRK/2011/1, ar ko pieņem Eiropas Sistēmisko risku kolēģijas Reglamentu<sup>(3)</sup>, un jo īpaši tā 28. panta 1. punktu,

tā kā:

(1) Regulas (ES) Nr. 1092/2010 3. panta 2. punktā ir noteikts, ka Eiropas Sistēmisko risku kolēģijas (ESRK) uzdevumi ir noteikt un/vai vākt un analizēt visu atbilstīgo un vajadzīgo informāciju finanšu sistēmas makrouzraudzībai Eiropas Savienībā, lai Savienībā novērstu vai mazinātu sistēmiskos riskus, ko rada norises finanšu sistēmā, ņemot vērā makroekonomiskās norises, lai izvairītos no plaši izplatītām finanšu problēmām.

(2) Regulas (ES) Nr. 1092/2010 15. panta 2. punktā ir noteikts, ka Eiropas uzraudzības iestādām (EUI), Eiropas Centrālo banku sistēmai (ECBS), Komisijai, valstu uzraudzības iestādēm un valstu statistikas iestādēm ir cieši jāsadarbjas ar ESRK un jānodrošina tā ar visu informāciju, kas tai vajadzīga, lai veiktu savus uzdevumus saskaņā ar Savienības tiesību aktiem.

(3) Saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 1092/2010 15. panta 3. punktu ESRK var pieprasīt informāciju no EUI, parasti pārskata vai apkopojuma veidā tā, lai nebūtu iespējams atpazīt atsevišķas finanšu iestādes.

(4) Regulas (ES) Nr. 1096/2010 10. apsvērumā ir teikts "ECB būtu jāuztic uzdevums sniegt atbalstu ESRK statistiskās ziņā", kā paredzēts minētās regulas 9. apsvērumā.

(5) Šis lēmums neskar ECB tiesības informāciju, ko tā savāc saskaņā ar Padomes 1998. gada 23. novembra Regulu (EK) Nr. 2533/98 par statistikas informācijas vākšanu, ko veic Eiropas Centrālā banka<sup>(4)</sup>, izmantot savos mērķos.

(6) ESRK īstermiņa darbībai vajadzīgās kopsavilkuma informācijas saturs ir noteikts sadarbībā ar ESRK un EUI, pamatojoties uz kopīgu ziņojumu,

IR PIENĒMUSI ŠO LĒMUMU.

### 1. pants

#### Darbības joma

Šajā lēmumā ir noteikts, kāda kopsavilkuma informācija ir vajadzīga ESRK uzdevumu izpildei, un iekļauti sīki izstrādāti noteikumi šādas informācijas sniegšanai un vākšanai.

### 2. pants

#### Kopsavilkuma informācijas regulāra sniegšana

1. ESRK uzdevumu izpildei vajadzīgās kopsavilkuma informācijas regulāra sniegšana notiek atbilstoši I un II pielikumam.

<sup>(1)</sup> OV L 331, 15.12.2010., 1. lpp.

<sup>(2)</sup> OV L 331, 15.12.2010., 162. lpp.

<sup>(3)</sup> OV C 58, 24.2.2011., 4. lpp.

<sup>(4)</sup> OV L 318, 27.11.1998., 8. lpp.

2. Lēmuma I pielikumā iekļauto kopsavilkuma informāciju sniedz ECB.

3. Lēmuma II pielikumā iekļauto kopsavilkuma informāciju sniedz attiecīgās EUI.

4. ESRK sekretariāts:

a) pēc apspriešanās ar ECB un/vai, attiecīgi, EUI atbilstoši vajadzībai izstrādā tehniskās specifikācijas saistībā ar 1. punktā minēto informāciju; un

b) vāc 1. punktā minēto informāciju un sadarbojas ar ECB un, attiecīgi, ar EUI.

3. pants

### **Kopsavilkuma informācijas *ad hoc* sniegšana**

Procedūras, ko ESRK sekretariāts piemēro kopsavilkuma informācijas pieprasījumu *ad hoc* izpildei, ir noteiktas III pielikumā.

4. pants

### **Stāšanās spēkā**

Šis lēmums stājas spēkā 2011. gada 15. oktobrī.

Frankfurtē pie Mainas, 2011. gada 21. septembrī

*ESRK priekšsēdētājs*

Jean-Claude TRICHET

## I PIELIKUMS

**Kopsavilkuma informācija, ko regulāri sniedz Eiropas Centrālā banka**

Eiropas Centrālā banka (ECB) dalībvalstīm, kuru valūta ir euro, paziņo gan publicētās, gan nepublicētās monetārās un finanšu statistikas datu kopas, kuru saturs, ziņošanas biežums un termiņi ir noteikti turpmāk norādītajos tiesību aktos vai tie ir saskaņā ar parasto praksi. Ciktāl dalībvalstīm, kuras nav ieviesušas euro, datu pieejamība ir nodrošināta pēc brīvprātības principa ar attiecīgo nacionālo banku apstiprinājumu, ECB paziņo arī šos datus.

1. Monetāro finanšu iestāžu (MFI) bilances dati ir dati, kas definēti 2008. gada 19. decembra Regulā ECB/2008/32 par monetāro finanšu iestāžu nozares bilanci (pārstrādāta redakcija) <sup>(1)</sup>.
2. Statistikas dati par MFI piemērotajām procentu likmēm – kā noteikts 2001. gada 20. decembra Regulā ECB/2001/18 par statistiku attiecībā uz procentu likmēm, ko monetārās finanšu iestādes piemēro mājāsaimniecību un nefinanšu sabiedrību noguldījumiem un aizņēmumiem <sup>(2)</sup>.
3. Statistikas dati par ieguldījumu fondiem – kā noteikts Regulā ECB/2007/8 par ieguldījumu fondu aktīvu un pasīvu statistiku <sup>(3)</sup>.
4. Statistikas dati par vērtspapīrošanu – kā noteikts 2008. gada 19. decembra Regulā ECB/2008/30 par vērtspapīrošanas darījumos iesaistīto finanšu instrumentsabiedrību aktīvu un pasīvu statistiku <sup>(4)</sup>.
5. Atsevišķi monetāro, finanšu un tirgu statistikas dati – kā noteikts 2007. gada 1. augusta Pamatnostādnē ECB/2007/9 par monetāro, finanšu iestāžu un tirgu statistiku (pārstrādāta) <sup>(5)</sup>.
6. ECB Padomes un Ģenerālpadomes apstiprinātie konsolidētie banku dati, kas ietver bilances datus, peļņas un zaudējumu aprēķinu un kopsavilkuma datus par banku grupu maksātspēju.

---

<sup>(1)</sup> OV L 15, 20.1.2009., 14. lpp.

<sup>(2)</sup> OV L 10, 12.1.2002., 24. lpp.

<sup>(3)</sup> OV L 211, 14.8.2007., 8. lpp.

<sup>(4)</sup> OV L 15, 20.1.2009., 1. lpp.

<sup>(5)</sup> OV L 341, 27.12.2007., 1. lpp.

## II PIELIKUMS

## Kopsavilkuma informācija, ko regulāri sniedz Eiropas Uzraudzības iestādes

## VISPĀRĪGS NOTEIKUMS

Eiropas Uzraudzības iestāžu (EUI) sniegtā kopsavilkuma informācija aptver datus par vismaz trīs juridiskajām personām, no kurām neviena neaizņem 85 % vai vairāk no attiecīgā tirgus, neatkarīgi no tā, vai tas ir tirgus vienā vai vairākās dalībvalstīs, vai tirgus Savienībā kopumā. Tomēr, ja papildu kopsavilkuma informācijai tiek paredzēti izkliešanas pasākumi, kopsavilkuma informācija aptver datus par vismaz piecām juridiskajām personām, atsaucoties uz publiski pieejamiem datiem, un datus par vismaz sešām juridiskajām personām, ja nepieciešams aizsargāt konfidencialus uzņēmuma līmeņa datus.

## A. Eiropas Banku iestāde (EBI)

EBI sniedz šādas datu kopas attiecībā uz dažām lielām banku grupām, ko noteikušas ESRK un EBI:

A1. Datu kopa – ceturkšņa dati no COREP un FINREP paraugiem <sup>(1)</sup>

Ciktāl attiecīgā informācija vākta sadarbībā ar NUI, EBI nosūta ESRK datus, kas nepieciešami, lai apkopotu tālāk tekstā minētos rādītājus, ko sniedz arī EBI, kā arī rādītāju un tālāk tekstā norādīto izkliešanas pasākumu korelāciju: minimumu, pirmo (zemāko) un trešo (augšējo) kvartili, mediānu, vidējo un maksimumu. EBI šo informāciju nosūta reizi ceturksnī, piecas darbadienas pēc tam, kad EBI datus saņēmusi no NUI, kas notiek 90 dienas pēc atsaucēšanas dienas. Par dienu, kurā informācijas nosūtīšana notiek pirmo reizi, vienosies ESRK un EBI. Pēc iespējas sniedz arī saskanīgus retrospektīvos datus par iepriekšējiem 5–8 ceturkšņiem, ja tādi ir pieejami.

Sniedz šādus rādītājus:

## a) maksātspējas rādītāji:

1. līmeņa kapitāla rādītājs, kopējais kapitāla rādītājs, 1. līmeņa kapitāla rādītājs (izņemot hibrīdinstrumentus), kredītriska kapitāla prasības no kopējām kapitāla prasībām, standartizētas pieejas kapitāla prasības no kopējām kapitāla prasībām, vērtspapīrošanas kapitāla prasības no kopējām kapitāla prasībām, "uz iekšējiem reitingiem balstītas" pieejas kapitāla prasības no kopējām kapitāla prasībām, tirgus riska kapitāla prasības no kopējām kapitāla prasībām, operacionālā riska kapitāla prasības no kopējām kapitāla prasībām, norēķinu un piegādes riska kapitāla prasības no kopējām kapitāla prasībām, pārējās kapitāla prasības no kopējām kapitāla prasībām;

## b) kredītriska un aktīvu kvalitātes rādītāji:

kavētie (> 90 dienas) kredīti pret kopējiem kredītiem un avansiem, nedrošie kredīti pret kopējiem kredītiem, nodrošinājuma rādītājs (īpaši atskaitījumi kredītiem pret kopējiem nedrošajiem kredītiem), kavētie (> 90 dienas) kredīti un parāda instrumenti pret kopējiem kredītiem un parāda instrumentiem, nodrošinājuma rādītājs (īpaši atskaitījumi kredītiem un parāda instrumentiem pret kopējiem nedrošajiem kredītiem un parāda instrumentiem), nedrošie finanšu aktīvi no kopējiem finanšu aktīviem, nedrošie parāda instrumenti pret kopējiem parāda instrumentiem, uzkrātie nedrošie finanšu aktīvi pret kopējiem (bruto) aktīviem;

## c) peļņas riska rādītāji:

kapitāla atdeve, pamatkapitāla atdeve, izdevumu un ienākumu attiecība, aktīvu atdeve, neto procentu ienākumi pret kopējiem pamatdarbības ienākumiem, neto komisijas naudas ienākumi pret kopējiem pamatdarbības ienākumiem, dividenžu ienākumi pret kopējiem pamatdarbības ienākumiem, neto realizētā peļņa (zaudējumi) no finanšu aktīviem un pasīviem, kuru patiesā vērtība nav noteikta ar peļņas un zaudējumu aprēķina palīdzību, pret kopējiem pamatdarbības ienākumiem, neto guvumi no tirdzniecības nolūkā turētajiem finanšu aktīviem un pasīviem pret kopējiem pamatdarbības ienākumiem, neto guvumi no finanšu aktīviem un pasīviem, kuru patiesā vērtība noteikta ar peļņas un zaudējumu aprēķina palīdzību, pret kopējiem pamatdarbības ienākumiem, nedrošie finanšu aktīvi pret kopējiem pamatdarbības ienākumiem;

<sup>(1)</sup> Pārskata sniegšanas dienā spēkā esošie COREP un FINREP paraugi, kas sagatavoti EBI vadlīniju veidā, ko publicē EBI interneta lapā <http://www.eba.europa.eu>, vai, vajadzības gadījumā, EBI izstrādāto tehnisko standartu veidā, ko Komisija pieņēma saskaņā ar 74. panta 2. punktu Eiropas Parlamenta un Padomes 2006. gada 14. jūnija Direktīvā 2006/48/EK kredītiestāžu darbības sākšanu un veikšanu (OV L 177, 30.6.2006, 1. lpp.).

d) bilances struktūra:

kredītu un noguldījumu attiecība, klientu noguldījumi no kopējām saistībām, piesaistītu līdzekļu rādītājs (1. līmeņa kapitāls pret (kopējiem aktīviem – nemateriālie ieguldījumi)), parāda vērtspapīri pret kopējām saistībām, kredītiestāžu noguldījumi pret kopējām saistībām, kapitāls pret kopējām saistībām un kapitālu, skaidra nauda un tirdzniecības aktīvi pret kopējiem aktīviem, skaidrā nauda, tirdzniecības aktīvi un pārdošanai pieejamie aktīvi pret kopējiem aktīviem, tirdzniecībai turēti finanšu aktīvi pret kopējiem aktīviem, tirdzniecībai turētas finanšu saistības pret kopējām saistībām un kapitālu, kredīti un avansi, (izņemot tirdzniecības portfeli) pret kopējiem aktīviem, parāda un kapitāla attiecība, ārpusbilances posteņi pret kopējiem aktīviem;

e) pieauguma temps (%) gadā:

kopējie aktīvi, kopējie kredīti, kopējie klientu noguldījumi, kopējie pamatdarbības ienākumi, nedrošie finanšu aktīvi, kavētie (> 90 dienas) kredīti un parāda instrumenti, kopējie bruto nedrošie kredīti un parāda instrumenti, riska svērtie aktīvi.

#### A2. Datu kopa – likviditātes ceturkšņa dati

EBI nosūta ESRK datus, kas nepieciešami, lai apkopotu tālāk tekstā minētos rādītājus, ko sniedz arī EBI, kā arī šādus izkļiedes pasākumus: minimumu, pirmo (zemāko) un trešo (augšējo) kvartili, mediānu, vidējo un maksimumu. Šo informāciju nosūta reizi ceturksnī, piecas darbadienas pēc tam, kad EBI datus saņēmusi no NUI, kas notiek 90 dienas pēc atsauces dienas. Informācija pirmajā nosūtīšanas reizē attieksies uz 2013. gada vidu, atkarībā no galīgajām izmaiņām pārskatu sniegšanas noteikumos, kas paredzēti Eiropas Parlamenta un Padomes 2006. gada 14. jūnija Direktīvā 2006/48/EK par kredītiestāžu darbības sākšanu un veikšanu (pārstrādātā versija) <sup>(1)</sup> un Eiropas Parlamenta un Padomes 2006. gada 14. jūnija Direktīvā 2006/49/EK par ieguldījumu sabiedrību un kredītiestāžu kapitāla pietiekamību (pārstrādātā versija) <sup>(2)</sup>. Par dienu, kurā informācijas nosūtīšana notiek pirmo reizi, vienosies ESRK un EBI. Vēsturiskie dati netiek prasīti.

Sniedz šādus rādītājus: aizstājošie rādītāji, kas balstās uz pieejamiem datiem par likviditātes nodrošinājuma rādītāju un stabila finansējuma neto rādītāju.

#### A3. Datu kopa – ceturkšņa dati no EBI lielu riska darījumu kopējās ziņošanas paraugiem <sup>(3)</sup>

Ciktāl attiecīgā informācija vākta sadarbībā ar NUI un saskaņā ar vispārīgajiem noteikumiem par kopsavilkuma informāciju, EBI nosūta ESRK datus, kas nepieciešami, lai apkopotu tālāk tekstā minētos rādītājus, ko sniedz arī EBI, kā arī izkļiedes pasākumus, par kuriem vienojušās ESRK un EBI. Šo informāciju nosūta reizi ceturksnī, piecas darbadienas pēc tam, kad saņemti dati no NUI, kas notiek 90 dienas pēc atsauces dienas. Informācija pirmajā nosūtīšanas reizē attieksies uz 2011. gada decembra beigām. Par dienu, kurā informācijas nosūtīšana notiek pirmo reizi, vienosies ESRK un EBI. Vēsturiskie dati netiek prasīti.

Sniedz šādus rādītājus: lielu Savienības banku grupu lielu riska darījumu skaits, lielu riska darījumu skaits, iedalīts pēc valsts un darījuma partnera sektora (valdība, citas lielas Savienības banku grupas, citas bankas, citi finanšu starpnieki, nefinanšu sabiedrības, mazumtirdzniecība), lielu Savienības banku grupu lielu riska darījumu summa (pirms kredītriska samazināšanas paņēmieniem), iedalīta pēc instrumenta (aktīvi, atvasinātie instrumenti, ārpusbilances posteņi, netiešie riski) un pašu līdzekļu procentuālās daļas, lielu Savienības banku grupu lielu riska darījumu summa (pēc kredītriska samazināšanas paņēmieniem, t. sk. bankas portfeli) un pašu līdzekļu procentuālās daļa.

## B. Eiropas Apdrošināšanas un fondēto pensiju iestāde (EAFPI)

EAFPI sniedz šādas datu kopas. B1. datu kopa attiecas uz lielām Savienības apdrošināšanas sabiedrībām, ko par tādām noteikusi EAFPI. B2. datu kopa attiecas uz visām Savienības apdrošināšanas sabiedrībām, šādu kopsavilkuma informāciju vācot no individuālajiem pārskatiem.

#### B1. Datu kopa – ikgadējā paātrinātā ziņošana

Ciktāl attiecīgā informācija vākta sadarbībā ar NUI un saskaņā ar vispārīgajiem noteikumiem par kopsavilkuma informāciju, EAFPI nosūta ESRK datus, kas nepieciešami, lai apkopotu tālāk tekstā minētos rādītājus, ko sniedz arī EAFPI, kā

<sup>(1)</sup> OV L 177, 30.6.2006., 1. lpp.

<sup>(2)</sup> OV L 177, 30.6.2006., 201. lpp.

<sup>(3)</sup> Pārskata dienā spēkā esošie lielu riska darījumu ziņojumu paraugi, kas sagatavoti EBI vadlīniju veidā, ko publicē EBI interneta lapā <http://www.eba.europa.eu>, vai, vajadzības gadījumā, EBI izstrādāto tehnisko standartu veidā (daļa no COREP regulējuma), ko EBI izstrādāja un Komisija pieņēma saskaņā ar Direktīvas 2006/48/EK 110. pantu.

kopējās summas vai kā šādus izkliedes pasākumus: nesvērtais vidējais, svērtais vidējais pēc bruto prēmijām, mediāna, pirmā kvartile, trešā kvartile, minimums, maksimums. Informāciju nosūta reizi gadā apmēram 80 kalendāra dienas pēc pārskata gada beigām. Par dienu, kurā informācijas nosūtīšana notiek pirmo reizi, vienosies ESRK un EAFPI.

Sniedz šādus rādītājus:

a) kopējās summas (sum):

- i) apdrošināšanas darbība kopā (dzīvības un nedzīvības): bruto parakstītās prēmijas, neto nopelnītās prēmijas, neto piekritušās prasības, neto darbības izdevumi, pieejamais maksātspējas kapitāls, prasītais maksātspējas kapitāls;
- ii) apdrošināšana, kas nav dzīvības apdrošināšana: bruto parakstītās prēmijas pēc darbības veida (nelaimes gadījumu un veselības apdrošināšana, transportlīdzekļu apdrošināšana, transportlīdzekļu īpašnieku civiltiesiskās atbildības apdrošināšana, kredītu un galvojumu apdrošināšana, cita nedzīvības apdrošināšana), neto nopelnītās prēmijas, neto piekritušās prasības, neto darbības izdevumi, pieejamais maksātspējas kapitāls, prasītais maksātspējas kapitāls;
- iii) dzīvības apdrošināšana: bruto parakstītās prēmijas pēc darbības veida (tirgum piesaistītā apdrošināšana, tirgum nepiesaistītā apdrošināšana, uzkrājošā apdrošināšana, grupu pensijas apdrošināšana, cita dzīvības apdrošināšana), neto nopelnītās prēmijas, neto piekritušās prasības, neto darbības izdevumi, pieejamais maksātspējas kapitāls, prasītais maksātspējas kapitāls.

b) izkliedes pasākumi:

- i) apdrošināšanas darbība kopā (dzīvības un nedzīvības): bruto parakstīto prēmiju pieauguma temps, kapitāla atdeve, aktīvu atdeve, maksātspējas rādītājs;
- ii) apdrošināšana, kas nav dzīvības apdrošināšana: bruto parakstīto prēmiju pieauguma temps pēc darbības veida (nelaimes gadījumu un veselības apdrošināšana, transportlīdzekļu apdrošināšana, transportlīdzekļu īpašnieku civiltiesiskās atbildības apdrošināšana, kredītu un galvojumu apdrošināšana, cita nedzīvības apdrošināšana), zaudējumu rādītājs, izdevumu rādītājs, kombinētais rādītājs, kapitāla atdeve, maksātspējas rādītājs;
- iii) dzīvības apdrošināšana: bruto parakstīto prēmiju pieauguma temps pēc darbības veida (tirgum piesaistītā apdrošināšana, tirgum nepiesaistītā apdrošināšana, uzkrājošā apdrošināšana, grupu pensijas apdrošināšana, cita dzīvības apdrošināšana), neto nopelnītās prēmijas, neto piekritušās prasības, neto darbības izdevumi, kapitāla atdeve, aktīvu atdeve, maksātspējas rādītājs.

## B2. Datu kopa – ikgadējā parastā ziņošana

Ciktāl attiecīgā informācija vākta sadarbībā ar NUI un saskaņā ar vispārīgajiem noteikumiem par kopsavilkuma informāciju, EAFPI nosūta ESRK datus, kas nepieciešami, lai apkopotu tālāk tekstā minētos rādītājus, ko sniedz arī EAFPI, kā kopējās summas: nesvērtais vidējais, svērtais vidējais pēc bruto prēmijām, lielu Savienības apdrošinātāju kopējie rādītāji, mediāna, pirmā kvartile, trešā kvartile, minimums, maksimums. Šo informāciju nosūta reizi gadā apmēram 270 kalendāra dienas pēc pārskata gada beigām. Par dienu, kurā datu nosūtīšana notiek pirmo reizi, vienosies ESRK un EAFPI. Vēsturisko datu sērijas sniedz, sākot ar 2003. gadu.

Sniedz šādus rādītājus:

- a) apdrošināšanas darbība kopā (dzīvības un nedzīvības): bruto parakstītās prēmijas, neto nopelnītās prēmijas, neto piekritušās atbildības prasības, neto darbības izdevumi, pieejamais maksātspējas kapitāls, prasītais maksātspējas kapitāls;
- b) apdrošināšana, kas nav dzīvības apdrošināšana: bruto parakstītās prēmijas pēc darbības veida (nelaimes gadījumu un veselības apdrošināšana, transportlīdzekļu apdrošināšana, transportlīdzekļu īpašnieku civiltiesiskās atbildības apdrošināšana, kredītu un galvojumu apdrošināšana, cita nedzīvības apdrošināšana), neto nopelnītās prēmijas, neto piekritušās prasības, neto darbības izdevumi, pieejamais maksātspējas kapitāls, prasītais maksātspējas kapitāls;
- c) dzīvības apdrošināšana: bruto parakstītās prēmijas pēc darbības veida (tirgum piesaistītā apdrošināšana, tirgum nepiesaistītā apdrošināšana, uzkrājošā apdrošināšana, grupu pensijas apdrošināšana, cita dzīvības apdrošināšana), neto nopelnītās prēmijas, neto piekritušās prasības, neto darbības izdevumi, pieejamais maksātspējas kapitāls, prasītais maksātspējas kapitāls;

### C. Eiropas Vērtspapīru tirgu iestāde (EVTI)

EVTI sniedz šādas datu kopas:

#### C1. Datu kopa – Finanšu instrumentu tirgu direktīvas<sup>(1)</sup> datu bāze

EVTI nosūta ESRK sadarbībā ar NUI vāktos datus, kas nepieciešami, lai apkopotu tālāk tekstā minētos rādītājus, ko sniedz arī EVTI. Šo informāciju nosūta reizi ceturksnī, piecas dienas pēc pārskata perioda beigām. Par dienu, kurā informācijas nosūtīšana notiek pirmo reizi, vienosies ESRK un EVTI. Vēsturisko informāciju sniedz, sākot ar 2007. gada novembri.

Sniedz šādus rādītājus: tās dalībvalsts nosaukums un apzīmējums, kuras kompetentā iestāde izsniegusi atļauju sistematiskajiem internalizētājiem, tās dalībvalsts nosaukums un apzīmējums, kuras kompetentā iestāde izsniegusi atļauju daudzpusējām tirdzniecības sistēmām, tās dalībvalsts nosaukums un apzīmējums, kuras kompetentā iestāde izsniegusi atļauju regulētajam tirgum, tās dalībvalsts nosaukums un apzīmējums, kuras kompetentā iestāde izsniegusi atļauju centrālo darījuma partneru norēķinu iestādēm.

#### C2. Datu kopa – atsauces datu sistēmas datu bāze

EVTI nosūta ESRK sadarbībā ar NUI vāktos datus, kas nepieciešami, lai apkopotu tālāk tekstā minētos rādītājus, ko sniedz arī EVTI, kā arī izklīdes pasākumus, par kuriem vienojušās ESRK un EVTI. Šo informāciju nosūta reizi ceturksnī, piecas dienas pēc pārskata perioda beigām. Par dienu, kurā informācijas nosūtīšana notiek pirmo reizi, vienosies ESRK un EVTI. Vēsturisko informāciju sniedz, sākot ar 2009. gada jūniju.

Sniedz šādus rādītājus: tādu finanšu instrumentu iedalījums, kuri pieņemti tirdzniecībai Eiropas Ekonomikas zonā un kuru Finanšu instrumentu klasifikācijas kods ir ES (parastās akcijas), instrumentu skaits dalībvalstīs, tirdzniecībai pieņemto instrumentu skaits, tirgū emitēto jauno instrumentu skaits, dalībvalstīs emitēto jauno instrumentu skaits.

---

<sup>(1)</sup> Eiropas Parlamenta un Padomes 2004. gada 21. aprīļa Direktīva 2004/39/EK par finanšu instrumentu tirgiem, ar ko groza Padomes Direktīvu 85/611/EEK un 93/6/EEK un Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvu 2000/12/EK un atceļ Padomes Direktīvu 93/22/EEK (OV L 145, 30.4.2004., 1. lpp.).

## III PIELIKUMS

ESRK kopsavilkuma informācijas *ad hoc* pieprasījumi

## A. VISPĀRĪGIE APSVĒRUMI

1. **Ad hoc apsekojuma nepieciešamības noteikšana**

- 1.1. Eiropas Sistēmisko risku kolēģija (ESRK) var lūgt tai sniegt *ad hoc* kopsavilkuma informāciju. Šādus ESRK *ad hoc* informācijas lūgumus var izpildīt: a) sniedzot informāciju, kas jau pieejama Eiropas Centrālā banku sistēmai (ECBS), Eiropas Uzraudzības iestādēm (EUI), komerciālajiem datu piegādātājiem vai starptautisko institūciju, piem., Starptautisko norēķinu bankas (SNB), datu bāzēm, vai b) veicot *ad hoc* apsekojumu.
- 1.2. Ņemot vērā iepriekš minēto, saņemot ESRK struktūru iesniegtos *ad hoc* lūgumus sniegt kopsavilkuma informāciju, vispirms notiks izpēte ar mērķi noskaidrot, vai nepieciešams veikt *ad hoc* apsekojumu. Šajā izpētes posmā jo īpaši izvērtēs, kādi kvantitatīvie vai kvalitatīvie dati jau ir pieejami, un vai tie ir derīgi konkrētajā gadījumā. Ja pieejamie dati nav derīgi un datus no pārskatu sniedzējiem nepieciešams vākt ar *ad hoc* apsekojuma palīdzību, izpētes posmā jau var noteikt attiecīgo pārskata grupu un aptuvenas izmaksas, kas pārskatu sniedzējiem radīsies, veicot *ad hoc* apsekojumu. Izpētes rezultātā var tikt pieņemts ESRK Valdes lēmums kopsavilkuma informāciju vākt ar *ad hoc* apsekojuma palīdzību.
- 1.3. ESRK un viena vai vairākas EUI, ja tām par jautājumu ir kopīga interese, var vienoties *ad hoc* apsekojumu veikt kopā, un šādā gadījumā izpētes posms nav vajadzīgs.

2. **Ad hoc apsekojumu veidi**

- 2.1. Var tikt izmantoti divu veidu *ad hoc* apsekojumi:
  - a) 1. veida apsekojumi vērsti uz konkrētiem jautājumiem, piem., risku adekvātu novērtējumu, un to mērķis parasti ir nodrošināt regulāri vāktu datu sīkāku iedalījumu, piem., attiecībā uz "t. sk." pozīcijām. 1. veida apsekojumi var attiekties arī uz datu kopumiem, kas iekļauti datu vākšanā citā kontekstā vai ko veic citas organizācijas, piem., Starptautiskais Valūtas fonds vai SNB, un attiecībā uz kuriem jau pastāv noteikta metodoloģiskā bāze;
  - b) 2. veida apsekojumi attiecas uz parādībām, kas iepriekš nav analizētas un attiecībā uz kurām nav noteiktas metodoloģijas, kā arī netiek veikta regulāra datu vākšana. 2. veida apsekojumi ir ievērojami darbietilpīgāki par 1. veida apsekojumiem, un tiem var nebūt noteiktu kritēriju. 2. veida apsekojumu rezultātā iegūtā informācija var būt grūtāk interpretējama. Nepieciešamība identificēt attiecīgos pārskatu sniedzējus un izveidot metodoloģisko bāzi var nozīmēt to, ka paiet ievērojams laiks pirms informācija tiek savākta.
- 2.2. Lemjot par to, vai nepieciešams *ad hoc* apsekojums, ESRK Valde tiks informēta un ņems vērā šāda apsekojuma veikšanas iespējamās izmaksas un termiņus.

## B. AD HOC LŪGUMU IZSKATĪŠANAS PRINCIPI UN PROCEDŪRA

3. **Principi**

ESRK Sekretariāts, Eiropas Centrālā banka (ECB) un EUI (turpmāk – "puses") ievēros šādus principus, pildot ESRK *ad hoc* informācijas lūgumus:

- a) ievērot procedūras posmus, par kuriem panākta vienošanās, un piemērot tos caurredzamā veidā;
- b) novērst pārmērīgu kontaktu ar pārskatu sniedzējiem;
- c) dažādiem analīzes un operacionālajiem mērķiem maksimāli izmantot pastāvošo informāciju, respektējot juridiskos ierobežojumus un konfidencialitātes aizsardzību;
- d) pēc iespējas izmantot spēkā esošo saskaņoto metodoloģiju un datu vākšanu;
- e) izstrādāt labāko praksi *ad hoc* apsekojumu veikšanai, ieviešot atsauksmju iespēju un informācijas apmaiņu pušu starpā attiecībā uz izmantoto metodoloģiju.



#### 4. Procedūra

##### 4.1. Izpētes posms

4.1.1. ESRK struktūras sākotnējos lūgumus kopsavilkuma informācijas *ad hoc* vākšanai nodod ESRK Sekretariātam, kas ar ECB atbalstu organizē izpētes posmu, veicot tālāk tekstā minētās darbības. Sākotnējo informācijas lūgumu pārveido par faktiskajām datu prasībām un novērtē attiecīgās informācijas pieejamību un kvalitāti attiecīgajās organizācijās. EUI un EUI Apvienotā komiteja tiek informēta par sākotnējā *ad hoc* lūguma saturu un uzaicinātas sadarboties ar ECB pieejamās informācijas izvērtēšanā, lai maksimāli izmantotu iepriekš savāktu informāciju un novērstu pārskatu sniegšanas pienākuma palielināšanos. Izpētes posmā var izmantot arī ECBS palīdzību, t. sk. ECBS Statistikas Komiteju (STK), ECBS Finanšu stabilitātes komiteju (FSK), vai citus avotus Eiropas Statistiskās sistēmā, komerciālos datu piegādātājus un starptautiskās organizācijas, piem., SNB.

4.1.2. Ja izpētes posma rezultāts ir: a) derīgs datu izmantošanas mērķim vai ja ir pieejami pieņemami un pietiekami kvalitatīvi aizstājošie rādītāji, un b) saņemta īpašnieka piekrišana izmantot datus, kas nav pilnībā publiski pieejami, šādus datus ar ESRK Sekretariāta palīdzību nodod attiecīgajai ESRK struktūrai, kura lūdz informāciju, pievienojot kvalitātes novērtējumu un informāciju par no komerciāliem avotiem gūto datu izmaksām.

4.1.3. Citos gadījumos, jo īpaši gadījumos, ja: a) ir pieejami aizstājošie rādītāji, bet to kvalitāte nav zināma vai ir nepietiekama, b) dati un aizstājošie rādītāji nav pieejami, c) nav saņemta īpašnieka piekrišana izmantot datus, kas nav pilnībā publiski pieejami, ECB paziņo ESRK par informācijas pieejamības novērtējuma rezultātiem un iesaka *ad hoc* apsekojuma iespējamus avotus un metodoloģijas, t. sk.: i) pārskatu sniedzēju kategorijas un skaitu, ii) pārskatu sniegšanas kanālu, piem., STK, FSK vai EUI, izmaksu aptuvenu aprēķinu un termiņus, iv) sagaidāmās grūtības.

##### 4.2. Datu vākšanas posms

4.2.1. Pēc izpētes rezultātu saņemšanas ESRK Sekretariāts ar ESRK Koordinācijas komitejas palīdzību iesniedz apstiprināšanai ESRK Valdē priekšlikumu par turpmāko rīcību, kā arī lietderības un izmaksu aptuvenu novērtējumu. ESRK Valde lemj par to, vai veikt *ad hoc* apsekojumu, kam var būt nepieciešama pārskata sniedzēju iesaistīšana. ESRK Valdes lēmumā nosaka: a) cik detalizēta informācija nepieciešama institucionālajā un posteņu līmenī, b) piemērojamo konfidencialitātes režīmu, jo īpaši to, kam būs atļauja piekļūt noteiktiem datiem un kā dati tiks glabāti un nosūtīti, c) informācijas sniegšanas termiņus.

4.2.2. Ja *ad hoc* apsekojumu veic EUI, ESRK Sekretariāts sazinās ar attiecīgo EUI un Apvienoto komiteju. Datus var nosūtīt ar ECB palīdzību, pilnībā ievērojot 8. pantu Eiropas Parlamenta un Padomes 2010. gada 24. novembra Regulā (ES) Nr. 1092/2010 par Eiropas Savienības finanšu sistēmas makrouzraudzību un Eiropas Sistēmisko risku kolēģijas izveidošanu<sup>(1)</sup>.

4.2.3. Ja *ad hoc* apsekojumu veic ECBS, ESRK Sekretariāts sazinās ar ECB, kas ar iespējamiem pārskatu sniedzējiem kontaktējas ar nacionālo kompetento iestāžu palīdzību, izmantojot attiecīgās ECBS komitejas un ievērojot piemērojamos konfidencialitātes ierobežojumus.

4.2.4. Pēc katra *ad hoc* apsekojuma pabeigšanas puses apmainās ar informāciju par apsekojuma īstenošanu un jo īpaši par piemērotajām metodoloģijām un kvalitātes pārbaudēm, kā arī pieredzētajām grūtībām, lai uzlabotu turpmāko apsekojumu iedarbīgumu un efektivitāti.

---

<sup>(1)</sup> OV L 331, 15.12.2010., 1. lpp.