

32011Y1013(01)

13.10.2011.

SLUŽBENI LIST EUROPSKE UNIJE

C 302/3

ODLUKA EUROPSKOG ODBORA ZA SISTEMSKE RIZIKE**od 21. rujna 2011.****o dostavljanju i prikupljanju informacija za makrobonitetni nadzor financijskog sustava unutar Unije****(ESRB/2011/6)**

(2011/C 302/04)

OPĆI ODBOR EUROPSKOG ODBORA ZA SISTEMSKE RIZIKE,

uzimajući u obzir Uredbu (EU) br. 1092/2010 Europskog parlamenta i Vijeća od 24. studenoga 2010. o makrobonitetnom nadzoru financijskog sustava Europske unije i osnivanju Europskog odbora za sistemske rizike ⁽¹⁾, a posebno njezin članak 3. stavak 2., članak 4. stavak 2., članak 8. stavak 2. i članak 15.,

uzimajući u obzir Uredbu Vijeća (EU) br. 1096/2010 od 17. prosinca 2010. o dodjeljivanju posebnih zadaća Europskoj središnjoj banci u vezi s funkcioniranjem Europskog odbora za sistemske rizike ⁽²⁾, a posebno njegov članak 2. točku (b), članak 5. i članak 6. stavak 4.,

uzimajući u obzir Odluku ESRB/2011/1 Europskog odbora za sistemske rizike od 20. siječnja 2011. o donošenju Poslovnika Europskog odbora za sistemske rizike ⁽³⁾, a posebno njezin članak 28. stavak 1.,

budući da:

(1) Članak 3. stavak 2. Uredbe (EU) br. 1092/2010 propisuje da Europski odbor za sistemske rizike (ESRB) mora odrediti i/ili prikupiti te analizirati sve relevantne i potrebne informacije za makrobonitetni nadzor financijskog sustava unutar Unije kako bi pridonio sprječavanju ili ublažavanju sistemskih rizika za financijsku stabilnost u Uniji koji proizlaze iz kretanja unutar financijskog sustava, vodeći računa o makroekonomskim kretanjima, a kako bi se izbjegla razdoblja rasprostranjenih financijskih poteškoća.

(2) Članak 15. stavak 2. Uredbe (EU) br. 1092/2010 propisuje da europska nadzorna tijela (ESA), Europski sustav središnjih banaka (ESSB), Europska komisija, nacionalna nadzorna tijela i nacionalna nadležna tijela za statistiku

blisko surađuju s ESRB-om i pružaju mu sve informacije koje su potrebne za provedbu njegovih zadaća u skladu sa zakonodavstvom Unije.

(3) U skladu s člankom 15. stavkom 3. Uredbe (EU) br. 1092/2010 ESRB može zahtijevati informacije od europskih nadzornih tijela, u pravilu u sažetom ili zbirnom obliku, tako da nije moguće prepoznati pojedinu financijsku instituciju.

(4) Uvodna izjava 10. Uredbe (EU) br. 1096/2010 navodi da „bi se ESB-u trebala povjeriti zadaća osiguranja statističke potpore ESRB-u“, u skladu s njezinom uvodnom izjavom 9.

(5) Ova Odluka ne utječe na ovlasti ESB-a da iskoristi za svoje potrebe informacije koje prikupi u skladu s Uredbom Vijeća (EZ) br. 2533/98 od 23. studenoga 1998. o prikupljanju statističkih podataka od strane Europske središnje banke ⁽⁴⁾.

(6) Sadržaj agregiranih informacija koje su kratkoročno potrebne za aktivnosti ESRB-a utvrđen je u suradnji s ESB-om i europskim nadzornim tijelima na temelju zajedničkog izvještaja,

DONIO JE OVU ODLUKU:

Članak 1.**Područje primjene**

Ova Odluka utvrđuje agregirane informacije koje su potrebne ESRB-u za obavljanje njegovih zadaća kao i iscrpna pravila za dostavljanje i prikupljanje tih informacija.

Članak 2.**Redovito dostavljanje agregiranih informacija**

1. Redovito dostavljanje agregiranih informacija, koje su potrebne ESRB-u za obavljanje njegovih zadaća, odvija se na način utvrđen u prilogima I. i II.

⁽¹⁾ SL L 331, 15.12.2010., str. 1.

⁽²⁾ SL L 331, 15.12.2010., str. 162.

⁽³⁾ SL C 58, 24.2.2011., str. 4.

⁽⁴⁾ SL L 318, 27.11.1998., str. 8.

2. Agregirane informacije utvrđene u Prilogu I. dostavlja ESB.

Članak 3.

Ad hoc dostavljanje agregiranih informacija

Postupci koje Tajništvo ESRB-a primjenjuje radi izvršenja zahtjeva za agregirane informacije na *ad hoc* osnovi utvrđeni su u Prilogu III.

3. Agregirane informacije utvrđene u Prilogu II. dostavlja odgovarajuće europsko nadzorno tijelo.

Članak 4.

Stupanje na snagu

Ova Odluka stupa na snagu 15. listopada 2011.

4. Tajništvo ESRB-a:

Sastavljeno u Frankfurtu na Majni 21. rujna 2011.

(a) utvrđuje prema potrebi tehničke specifikacije u vezi s informacijama navedenima u stavku 1. nakon savjetovanja s ESB-om i/ili europskim nadzornim tijelima ovisno o slučaju; i

(b) prikuplja informacije iz stavka 1. i surađuje na odgovarajući način s ESB-om i europskim nadzornim tijelima.

Predsjednik ESRB-a

Jean-Claude TRICHET

PRILOG I.

Redovito dostavljanje agregiranih informacija od strane Europske središnje banke

Europska središnja banka (ESB) izvještava o skupovima podataka, objavljenima i neobjavljenima, za države članice čija je valuta euro, u području monetarne i financijske statistike, koji su uređeni dalje navedenim pravnim aktima u smislu sadržaja, učestalosti i pravodobnosti ili su utvrđeni zajedničkom praksom. ESB također izvještava i o podacima za države članice čija valuta nije euro, u mjeri u kojoj su ti podaci učinjeni dostupnim na dobrovoljnoj osnovi uz odobrenje nadležne nacionalne središnje banke.

1. Podaci iz bilance monetarnih financijskih institucija (MFI) određeni Uredbom ESB/2008/32 od 19. prosinca 2008. o bilanci sektora monetarnih financijskih institucija (preinačeno) ⁽¹⁾.
2. Statistika kamatnih stopa monetarnih financijskih institucija određena Uredbom ESB/2001/18 od 20. prosinca 2001. o statistici kamatnih stopa koje monetarne financijske institucije primjenjuju na depozite i kredite kućanstava i nefinancijskih društava ⁽²⁾.
3. Statistika investicijskih fondova određena Uredbom ESB/2007/8 od 27. srpnja 2007. o statistici imovine i obveza investicijskih fondova ⁽³⁾.
4. Statistika sekuritizacije određena Uredbom ESB/2008/30 od 19. prosinca 2008. o statistici imovine i obveza financijskih društava posebne namjene koja se bave sekuritizacijskim transakcijama ⁽⁴⁾.
5. Izabrana monetarna statistika, statistika financijskih institucija i statistika financijskih tržišta određena Smjernicom ESB/2007/9 od 1. kolovoza 2007. o monetarnoj statistici, statistici financijskih institucija i statistici financijskih tržišta (preinačeno) ⁽⁵⁾.
6. Konsolidirani bankovni podaci koje su odobrili Upravno vijeće i Opće vijeće ESB-a i koji obuhvaćaju podatke o bilanci, računu dobiti i gubitka i solventnosti bankarskih grupa na agregiranoj osnovi.

⁽¹⁾ SL L 15, 20.1.2009., str. 14.

⁽²⁾ SL L 10, 12.1.2002., str. 24.

⁽³⁾ SL L 211, 14.8.2007., str. 8.

⁽⁴⁾ SL L 15, 20.1.2009., str. 1.

⁽⁵⁾ SL L 341, 27.12.2007., str. 1.

PRILOG II.

Redovito dostavljanje agregiranih informacija od strane europskih nadzornih tijela**OPĆE PRAVILO**

Agregirane informacije koje dostavljaju europska nadzorna tijela obuhvaćaju podatke o najmanje tri pravne osobe, od kojih niti jedna ne čini 85 % ili više odgovarajućeg tržišta, bez obzira na to sastoji li se ono od jedne ili više država članica ili Unije u cjelini. Međutim, ako se mjere disperzije dostavljaju povrh agregiranih informacija, agregirane informacije obuhvaćaju podatke o najmanje pet pravnih osoba kada se pozivaju na javno dostupne podatke i podatke o najmanje šest pravnih osoba u slučaju potrebe za zaštitom povjerljivih podataka na razini društva.

A. Europsko nadzorno tijelo za bankarstvo (EBA)

EBA izvještava o sljedećim skupovima podataka za uzorak velikih bankarskih grupa utvrđenih između ESRB-a i EBA-e:

A1. Skup podataka: tromjesečni podaci iz obrazaca COREP i FINREP (¹)

U mjeri u kojoj su odgovarajuće informacije prikupljene u suradnji s nacionalnim nadzornim tijelima, EBA prenosi ESRB-u podatke potrebne za sastavljanje dalje navedenih pokazatelja, koje također dostavlja EBA, kao i korelacije između pokazatelja i sljedećih mjera disperzije: minimum, prvi (donji) i treći (gornji) kvartil, medijan, prosjek i maksimum. EBA treba prenositi ove informacije tromjesečno, u roku od pet radnih dana nakon što primi podatke od nacionalnih nadzornih tijela, što nastupa 90 dana nakon referentnog datuma. ESRB i EBA suglasno utvrđuju datum prvog prijenosa informacija. U okviru mogućnosti dosljedni povijesni podaci za prethodnih pet do osam tromjesečja također se dostavljaju ako su dostupni.

Dostavljaju se sljedeći pokazatelji:

(a) pokazatelji solventnosti:

stopa adekvatnosti osnovnoga kapitala; stopa adekvatnosti jamstvenoga kapitala; stopa osnovnoga kapitala (isključujući hibridne instrumente); kapitalni zahtjevi za kreditni rizik u odnosu na ukupne kapitalne zahtjeve; kapitalni zahtjevi prema standardiziranom pristupu u odnosu na ukupne kapitalne zahtjeve; kapitalni zahtjevi za sekuritizaciju u odnosu na ukupne kapitalne zahtjeve; kapitalni zahtjevi prema IRB pristupu u odnosu na ukupne kapitalne zahtjeve; kapitalni zahtjevi za tržišni rizik u odnosu na ukupne kapitalne zahtjeve; kapitalni zahtjevi za operativni rizik u odnosu na ukupne kapitalne zahtjeve; kapitalni zahtjevi za rizik namire i isporuke u odnosu na ukupne kapitalne zahtjeve; drugi kapitalni zahtjevi u odnosu na ukupne kapitalne zahtjeve;

(b) pokazatelji kreditnog rizika i kvalitete aktive:

dospjeli krediti (> 90 dana) u odnosu na ukupne kredite i predumove; krediti s umanjenom vrijednošću u odnosu na ukupne kredite; stopa pokrivenosti (posebna rezerviranja za kredite u odnosu na ukupne bruto kredite s umanjenom vrijednošću); dospjeli krediti i dužnički instrumenti (> 90 dana) u odnosu na ukupne kredite i dužničke instrumente; stopa pokrivenosti (posebna rezerviranja za kredite i dužničke instrumente u odnosu na ukupne bruto kredite i dužničke instrumente s umanjenom vrijednošću); stopa pokrivenosti (sva rezerviranja za kredite i dužničke instrumente u odnosu na ukupne bruto kredite i dužničke instrumente s umanjenom vrijednošću); financijska imovina s umanjenom vrijednošću u odnosu na ukupnu imovinu; dužnički instrumenti s umanjenom vrijednošću u odnosu na ukupne dužničke instrumente; ukupna umanjena vrijednost financijske imovine u odnosu na ukupnu (bruto) imovinu;

(c) pokazatelji rizika zarade:

prinos na kapital; prinos na regulatorne kapitalne zahtjeve; omjer troškova i prihoda; prinos na imovinu; neto kamatni prihod u odnosu na ukupni prihod iz poslovanja; neto prihod od naknada i provizija u odnosu na ukupni prihod iz poslovanja; prihod od dividende u odnosu na ukupni prihod iz poslovanja; neto realizirana dobit (gubitak) od financijske imovine i obveza koje se ne vrednuju prema fer vrijednosti kroz račun dobiti i gubitka u odnosu na ukupni prihod iz poslovanja; neto dobit od financijske imovine i obveza koje se drži radi trgovanja u odnosu na ukupni prihod iz poslovanja; neto dobit od financijske imovine i obveza koje se vrednuje prema fer vrijednosti kroz račun dobiti i gubitka u odnosu na ukupni prihod iz poslovanja; drugi neto prihod iz poslovanja u odnosu na ukupni prihod iz poslovanja; neto prihod u odnosu na ukupni prihod iz poslovanja; umanjene vrijednosti financijske imovine u odnosu na ukupni prihod iz poslovanja;

(¹) Obrasci COREP i FINREP, na snazi na dan podnošenja izvještaja, u obliku smjernica EBA-e objavljenih na internetskoj stranici EBA-e www.eba.europa.eu ili, prema potrebi, u obliku tehničkih standarda koje je razvila EBA i donijela Komisija prema članku 74. stavku 2. Direktive 2006/48/EZ Europskog parlamenta i Vijeća od 14. lipnja 2006. o osnivanju i obavljanju djelatnosti kreditnih institucija (SL L 177, 30.6.2006., str. 1.).

(d) struktura bilance:

omjer kredita i depozita; depoziti klijenata prema ukupnim obvezama; omjer financijske poluge (osnovni kapital prema (ukupna imovina – nematerijalna imovina)); dužnički vrijednosni papiri u odnosu na ukupne obveze; depoziti kreditnih institucija u odnosu na ukupne obveze; vlasnički kapital u odnosu na ukupne obveze i vlasnički kapital; gotovina i imovina namijenjena trgovanju u odnosu na ukupnu imovinu; gotovina, imovina namijenjena trgovanju i imovina raspoloživa za prodaju u odnosu na ukupnu imovinu; financijska imovina koja se drži radi trgovanja u odnosu na ukupnu imovinu; financijske obveze koje se drže radi trgovanja u odnosu na ukupne obveze i vlasnički kapital; krediti i predujmovi (isključujući knjigu trgovanja) u odnosu na ukupnu imovinu; omjer duga i kapitala; izvanbilančne stavke u odnosu na ukupnu imovinu;

(e) godišnje stope rasta (%):

ukupna imovina; ukupni krediti; ukupni depoziti klijenata; ukupni prihod iz poslovanja; umanjenje vrijednosti financijske imovine; dospjeli krediti i dužnički instrumenti (> 90 dana); ukupni bruto krediti i dužnički instrumenti s umanjenom vrijednošću; imovina ponderirana rizikom.

A2. Skup podataka: tromjesečni podaci o likvidnosti

EBA prenosi ESRB-u podatke potrebne za sastavljanje dalje navedenih pokazatelja, koje također dostavlja EBA, kao i sljedeće mjere disperzije: minimum, prvi (donji) i treći (gornji) kvartil, medijan, prosjek i maksimum. Ove se informacije prenose tromjesečno, u roku od pet radnih dana nakon što EBA primi podatke od nacionalnih nadzornih tijela, što nastupa 90 dana nakon referentnog datuma. Informacije kod prvog prijenosa odnosit će se na sredinu 2013. godine, ovisno o konačnim izmjenama odredbi o izvještavanju utvrđenih u Direktivi 2006/48/EZ Europskog parlamenta i Vijeća od 14. lipnja 2006. o osnivanju i obavljanju djelatnosti kreditnih institucija (preinačeno) ⁽¹⁾ i Direktivi 2006/49/EZ Europskog parlamenta i Vijeća od 14. lipnja 2006. o adekvatnosti kapitala investicijskih društava i kreditnih institucija (preinačeno) ⁽²⁾. ESRB i EBA suglasno utvrđuju datum prvog prijenosa informacija. Povijesne informacije ne zahtijevaju se.

Dostavljaju se sljedeći pokazatelji: zamjenske vrijednosti na temelju dostupnih podataka za koeficijent likvidnosne pokrivenosti i koeficijent neto stabilnih izvora financiranja.

A3. Skup podataka: tromjesečni podaci iz obrazaca EBA-e za zajedničko izvještavanje velikih izloženosti ⁽³⁾

U mjeri u kojoj su odgovarajuće informacije prikupljene u suradnji s nacionalnim nadzornim tijelima i u skladu s općim pravilom o agregiranim informacijama, EBA prenosi ESRB-u podatke potrebne za sastavljanje dalje navedenih pokazatelja, koje također dostavlja EBA, kao i mjere disperzije koje su dogovorene između ESRB-a i EBA-e. Ove se informacije prenose tromjesečno, u roku od pet radnih dana nakon primitka podataka od nacionalnih nadzornih tijela, što nastupa 90 dana nakon referentnog datuma. Informacije kod prvog prijenosa odnosit će se na kraj prosinca 2011. ESRB i EBA suglasno utvrđuju datum prvog prijenosa informacija. Povijesne informacije ne zahtijevaju se.

Dostavljaju se sljedeći pokazatelji: broj velikih izloženosti velikih bankarskih grupa u Uniji; iznos velikih izloženosti s raščlambom po zemljama i sektoru protustranke (vlade, velike bankarske grupe u Uniji, druge banke, drugi financijski posrednici, nefinancijska društva, stanovništvo); iznos (izloženost prije smanjenja kreditnog rizika) velikih izloženosti velikih bankarskih grupa u Uniji s raščlambom po instrumentima (imovina, izvedeni financijski instrumenti, izvanbilančni instrumenti, neizravne izloženosti) i postotak vlastitih sredstava; iznos (izloženost nakon smanjenja kreditnog rizika, od toga knjiga banke) velikih izloženosti velikih bankarskih grupa u Uniji i postotak vlastitih sredstava.

B. Europsko nadzorno tijelo za osiguranje i strukovno mirovinsko osiguranje (EIOPA)

EIOPA izvještava o sljedećim skupovima podataka. Skup podataka B1 odnosi se na velika osiguravajuća društva u Uniji koja utvrđi EIOPA. Skup podataka B2 odnosi se na sva osiguravajuća društva u Uniji s agregiranim informacijama prikupljenima na pojedinačnoj osnovi.

B1. Skup podataka: žurno godišnje izvještavanje

U mjeri u kojoj su odgovarajuće informacije prikupljene u suradnji s nacionalnim nadzornim tijelima i u skladu s općim pravilom o agregiranim informacijama, EIOPA prenosi ESRB-u podatke potrebne za sastavljanje dalje navedenih

⁽¹⁾ SL L 177, 30.6.2006., str. 1.

⁽²⁾ SL L 177, 30.6.2006., str. 201.

⁽³⁾ Obrasci za velike izloženosti, na snazi na dan podnošenja izvještaja, u obliku smjernica EBA-e objavljenih na internetskoj stranici EBA-e www.eba.europa.eu ili, prema potrebi, u obliku tehničkih standarda (dio okvira COREP) koje je razvila EBA i donijela Komisija prema članku 110. Direktive 2006/48/EZ.

pokazatelja, koje također dostavlja EIOPA, kao ukupne iznose ili kao sljedeće mjere disperzije: neponderirani prosjek, ponderirani prosjek prema bruto premijama, medijan, prvi kvartil, treći kvartil, minimum, maksimum. Ove se informacije prenose godišnje, otprilike 80 kalendarskih dana nakon referentne godine. ESRB i EIOPA suglasno utvrđuju datum prvog prijensa informacija.

Dostavljaju se sljedeći pokazatelji:

(a) ukupni iznosi (zbroj):

- i. ukupni posao osiguranja (životno i neživotno osiguranje): bruto obračunate premije; neto prihod od premija; neto izdaci za štete; neto operativni troškovi; minimalni raspoloživi kapital; zahtijevani minimalni kapital;
- ii. posao neživotnog osiguranja: bruto obračunate premije s raščlambom po vrsti posla (osiguranje od nezgode i zdravstveno osiguranje, osiguranje motornih vozila, osiguranje od odgovornosti za upotrebu motornog vozila, drugi razredi, pomorsko osiguranje, zračno osiguranje i osiguranje u prijevozu, osiguranje od požara i druge štete na imovini, osiguranje od opće odgovornosti, kreditno i kaucijsko osiguranje, drugo neživotno osiguranje); neto prihod od premija; neto izdaci od šteta; neto operativni troškovi; minimalni raspoloživi kapital; zahtijevani minimalni kapital;
- iii. posao životnog osiguranja: bruto obračunate premije s raščlambom po vrsti posla (vezano životno osiguranje, nevezano životno osiguranje, osiguranje s kapitalizacijom, grupno mirovinsko osiguranje, drugo životno osiguranje); neto prihod od premija; neto izdaci od šteta; neto operativni troškovi; minimalni raspoloživi kapital; zahtijevani minimalni kapital.

(b) mjere disperzije:

- i. ukupni posao osiguranja (životno i neživotno osiguranje): stopa rasta bruto obračunatih premija; prinos na kapital; prinos na imovinu; stopa solventnosti;
- ii. posao neživotnog osiguranja: stopa rasta bruto obračunate premije s raščlambom po vrsti posla (osiguranje od nezgode i zdravstveno osiguranje, osiguranje motornih vozila, osiguranje od odgovornosti za upotrebu motornog vozila, drugi razredi, pomorsko osiguranje, zračno osiguranje i osiguranje u prijevozu, osiguranje od požara i druge štete na imovini, osiguranje od opće odgovornosti, kreditno i kaucijsko osiguranje, drugo neživotno osiguranje); razmjernost šteta; razmjernost troškova; kombinirani razmjernost; prinos na kapital; prinos na imovinu; stopa solventnosti;
- iii. posao životnog osiguranja: stopa rasta bruto obračunatih premija s raščlambom po vrsti posla (vezano životno osiguranje, nevezano životno osiguranje, osiguranje s kapitalizacijom, grupno mirovinsko osiguranje, drugo životno osiguranje); prinos na kapital; prinos na imovinu; stopa solventnosti.

B2. Skup podataka: godišnje redovito izvještavanje

U mjeri u kojoj su odgovarajuće informacije prikupljene u suradnji s nacionalnim nadzornim tijelima i u skladu s općim pravilom o agregiranim informacijama, EIOPA prenosi ESRB-u podatke potrebne za sastavljanje dalje navedenih pokazatelja, koje također dostavlja EIOPA, kao ukupne iznose: neponderirani prosjek, ponderirani prosjek prema bruto premijama, stope svih velikih osiguravatelja u Uniji, medijan, prvi kvartil, treći kvartil, minimum, maksimum. Ove se informacije prenose godišnje, otprilike 270 kalendarskih dana nakon referentne godine. ESRB i EIOPA suglasno utvrđuju datum prvog prijensa podataka. Povijesne serije dostavljaju se od 2003. godine.

Dostavljaju se sljedeći pokazatelji:

- (a) ukupni posao osiguranja (životno i neživotno osiguranje): bruto obračunate premije; neto prihod od premija; neto izdaci od šteta; neto operativni troškovi; minimalni raspoloživi kapital; zahtijevani minimalni kapital;
- (b) posao neživotnog osiguranja: bruto obračunate premije s raščlambom po vrsti posla (osiguranje od nezgode i zdravstveno osiguranje, osiguranje motornih vozila, osiguranje od odgovornosti za upotrebu motornog vozila, drugi razredi, pomorsko osiguranje, zračno osiguranje i osiguranje u prijevozu, osiguranje od požara i druge štete na imovini, osiguranje od opće odgovornosti, kreditno i kaucijsko osiguranje, drugo neživotno osiguranje); neto prihod od premija; neto izdaci od šteta; neto operativni troškovi; minimalni raspoloživi kapital; zahtijevani minimalni kapital;
- (c) posao životnog osiguranja: bruto obračunate premije s raščlambom po vrsti posla (vezano životno osiguranje, nevezano životno osiguranje, osiguranje s kapitalizacijom, grupno mirovinsko osiguranje, drugo životno osiguranje); neto prihod od premija; neto izdaci od šteta; neto operativni troškovi; minimalni raspoloživi kapital; zahtijevani minimalni kapital.

C. Europsko nadzorno tijelo za tržišta vrijednosnih papira (ESMA)

ESMA dostavlja sljedeće skupove podataka:

C1. Skup podataka: baza podataka prema Direktivi o tržištima financijskih instrumenata ⁽¹⁾

ESMA prenosi ESRB-u podatke prikupljene u suradnji s nacionalnim nadzornim tijelima, potrebne za sastavljanje dalje navedenih pokazatelja, koje također dostavlja ESMA. Ove se informacije prenose tromjesečno, u roku od pet dana nakon referentnog razdoblja. ESRB i ESMA suglasno utvrđuju datum prvog prijenosa informacija. Povijesne informacije dostavljaju se od studenoga 2007.

Dostavljaju se sljedeći pokazatelji: ime i oznaka države članice nadležnog tijela koje je odobrilo sistematične internalizatore; ime i oznaka države članice nadležnog tijela koje je izdalo odobrenje za multilateralnu trgovinsku platformu; ime i oznaka države članice nadležnog tijela koje je izdalo odobrenje za uređeno tržište; ime i oznaka države članice nadležnog tijela koje je izdalo odobrenje klirinškim kućama s položajem središnje protustranke.

C2. Skup podataka: baza podataka iz sustava referentnih podataka

ESMA prenosi ESRB-u podatke prikupljene u suradnji s nacionalnim nadzornim tijelima, potrebne za sastavljanje dalje navedenih pokazatelja, koje također dostavlja ESMA, kao i mjere disperzije koje su dogovorene između ESRB-a i ESMA-e. Ove se informacije dostavljaju tromjesečno, u roku od pet dana nakon referentnog razdoblja. ESRB i ESMA suglasno utvrđuju datum prvog prijenosa informacija. Povijesne informacije dostavljaju se od lipnja 2009. godine.

Dostavljaju se sljedeći pokazatelji: raščlamba po financijskim instrumentima uvrštenima na tržišta Europskoga gospodarskog prostora čija je klasifikacijska oznaka financijskog instrumenta ES (obične dionice); broj instrumenata po državama članicama; broj instrumenata uvrštenih na tržište; broj novih instrumenata izdanih po tržištu; broj novih instrumenata izdanih po državi članici.

⁽¹⁾ Direktiva 2004/39/EZ Europskog parlamenta i Vijeća od 21. travnja 2004. o tržištima financijskih instrumenata te o izmjeni direktiva Vijeća 85/611/EEZ i 93/6/EEZ i Direktive 2000/12/EZ Europskog parlamenta i Vijeća te stavljanju izvan snage Direktive Vijeća 93/22/EEZ (SL L 145, 30.4.2004., str. 1.).

PRILOG III.

Ad hoc zahtjevi ESRB-a za agregiranim informacijama**A. OPĆA RAZMATRANJA****1. Utvrđivanje potrebe za *ad hoc* anketama**

- 1.1. Europski odbor za sistemske rizike (ESRB) može zahtijevati agregirane informacije koje se dostavljaju na *ad hoc* osnovi. Na takve ESRB-ove *ad hoc* zahtjeve za informacijama može se odgovoriti: (a) dostavljanjem postojećih informacija od strane Europskog sustava središnjih banaka (ESSB), europskih nadzornih tijela (ESA), pružatelja komercijalnih podataka ili baza podataka međunarodnih organizacija, npr. Banke za međunarodne namire (BIS); ili (b) provođenjem *ad hoc* ankete.
- 1.2. S obzirom na navedeno, početni *ad hoc* zahtjevi za agregiranim informacijama, koje dostave tijela ESRB-a, u načelu najprije dovode do faze istraživanja čiji je cilj utvrditi postoji li potreba za provođenjem *ad hoc* ankete. Faza istraživanja posebno će utvrditi koji su kvantitativni i kvalitativni podaci već dostupni i jesu li podobni za postizanje svrhe. Ako dostupni podaci nisu podobni za postizanje svrhe i ako se pokaže potreba za prikupljanjem podataka od izvještajnih jedinica putem *ad hoc* ankete, već se u fazi istraživanja mogu utvrditi odgovarajuća izvještajna populacija i okvirni troškovi izvještajnih jedinica u provođenju *ad hoc* ankete. Ishod istraživanja može biti odluka Općeg odbora ESRB-a da se agregirane informacije prikupe putem *ad hoc* ankete.
- 1.3. ESRB i jedno ili više europskih nadzornih tijela mogu dogovoriti zbog zajedničkog interesa za određenu temu provođenje zajedničke *ad hoc* ankete, te je u tom slučaju faza istraživanja nepotrebna.

2. Vrste *ad hoc* anketa**2.1. Mogu se primijeniti dvije vrste anketa:**

- (a) ankete tipa 1 usredotočuju se na specifična pitanja, npr. dovoljna procjena izloženosti, i obično imaju za cilj pružiti detaljnije raščlambe unutar redovitog prikupljanja podataka, npr. pozicije „od toga”. Ankete tipa 1 mogu obuhvatiti skupove podataka koji dovode do (redovitog) prikupljanja podataka u različitim kontekstima ili od strane različite organizacije, kao što je Međunarodni monetarni fond ili BIS, i za koje već postoje utvrđeni metodološki okviri;
- (b) ankete tipa 2 obuhvaćaju fenomene koji nisu ranije analizirani i za koje nije utvrđena metodologija i za koje se ne provodi redovito prikupljanje podataka. Ankete tipa 2 zahtijevaju znatno više rada nego ankete tipa 1 i možda nemaju referentne vrijednosti. Tumačenje informacija dobivenih iz anketa tipa 2 može biti teže. Potreba za utvrđivanjem odgovarajućih izvještajnih jedinica i metodološkog okvira može zahtijevati dosta vremena prije prikupljanja informacija.

- 2.2. Pri odlučivanju o potrebi za *ad hoc* anketom obavješćuje se Opći odbor ESRB-a o vjerojatnim troškovima i vremenskom rasporedu za provođenje ankete te ih uzima u obzir.

B. NAČELA I POSTUPCI ZA POSTUPANJE S AD HOC ZAHTJEVIMA**3. Načela**

Tajništvo ESRB-a, Europska središnja banka (ESB) i europska nadzorna tijela (dalje u tekstu „strane”) pridržavat će se sljedećih načela u ispunjenju ESRB-ovih *ad hoc* zahtjeva za informacijama:

- (a) pridržavanje suglasno utvrđenih postupovnih koraka, koji se primjenjuju na transparentan način;
- (b) izbjegavanje pretjerane interakcije s izvještajnim jedinicama;
- (c) što veća upotreba postojećih informacija za različite analitičke i operativne svrhe, uz pridržavanje potrebnih pravnih ograničenja i mjera za zaštitu povjerljivosti;
- (d) što veća upotreba postojećih, u najvećoj mogućoj mjeri usklađenih, metodologija i skupova podataka;
- (e) razvijanje najbolje prakse za *ad hoc* ankete uvođenjem mehanizama za davanje povratnih informacija i dijeljenja informacija o metodologijama između svih uključenih strana.

4. Postupak

4.1. Faza istraživanja

4.1.1. Tijela ESRB-a mogu prenijeti svoje početne zahtjeve za *ad hoc* prikupljanje agregiranih informacija na Tajništvo ESRB-a, koje tada organizira fazu istraživanja uz potporu ESB-a, poduzimajući dalje opisane radnje. Početni zahtjevi za informacijama pretvaraju se u stvarne zahtjeve za podacima te se dostupnost i kvaliteta odgovarajućih informacija procjenjuju unutar nadležnih organizacija. Europska nadzorna tijela i Zajednički odbor europskih nadzornih tijela obavješćuju se o sadržaju početnog *ad hoc* zahtjeva za informacijama te se pozivaju na suradnju s ESB-om u procjeni dostupnih informacija, radi što boljeg iskorištavanja prethodno prikupljenih informacija i izbjegavanja povećanog tereta izvještavanja. Faza istraživanja može se osloniti na ESSB, uključujući Statistički odbor ESSB-a (SO), Odbor za financijsku stabilnost ESSB-a (FSC), ili druge izvore unutar Europskog statističkog sustava, pružatelje komercijalnih podataka ili međunarodne organizacije, npr. BIS.

4.1.2. Ako su kao ishod faze istraživanja: (a) podobni podaci ili prihvatljive zamjenske vrijednosti dostupni i zadovoljavajuće kvalitete, i (b) ako je pribavljena dozvola vlasnika za upotrebu podataka koji nisu u potpunosti u javnom vlasništvu, takvi se podaci dostavljaju putem Tajništva ESRB-a nadležnim tijelima ESRB-a koja zahtijevaju informacije, zajedno s potrebnom ocjenom kvalitete i informacijama o trošku podataka pribavljenih iz komercijalnih izvora.

4.1.3. U drugim slučajevima, a posebno kada nastupi jedan od navedenih događaja: (a) zamjenske vrijednosti dostupne su, ali su nepoznate ili nezadovoljavajuće kvalitete, (b) podaci i zamjenske vrijednosti nedostupni su, (c) dozvola za upotrebu podataka koji nisu u potpunosti u javnom vlasništvu nije pribavljena, ESB dostavlja ESRB-u ishod procjene vezane uz dostupnost informacija i predlaže moguće izvore i metodologije za *ad hoc* ankete, uključujući: i. kategorije i broj izvještajnih jedinica, ii. izvještajne kanale, npr. SO, FSC ili europska nadzorna tijela, iii. približnu procjenu troškova i vremenski okvir, i iv. predviđene poteškoće.

4.2. Faza prikupljanja podataka

4.2.1. Nakon što zaprimi rezultate istraživanja, Tajništvo ESRB-a podnosi putem Upravljačkog odbora ESRB-a na odobrenje Općem odboru ESRB-a prijedlog daljnjih mjera zajedno s približnom procjenom koristi i troškova. Opći odbor ESRB-a donosi odluku o tome hoće li provesti *ad hoc* anketu, koja može obuhvaćati izvještajne jedinice. Odlukom Općeg odbora mogu se utvrditi posebno: (a) podrobnost potrebnih informacija na razini institucije i pozicije, (b) režim povjerljivosti koji se primjenjuje, posebno kome će se omogućiti pristup podacima i kako će se podaci pohraniti i prenositi, i (c) rokovi za dostavu informacija.

4.2.2. Kada *ad hoc* anketu provodi europsko nadzorno tijelo, Tajništvo ESRB-a stupa u kontakt s nadležnim europskim nadzornim tijelom i Zajedničkim odborom. Podaci se mogu prenositi putem ESB-a u potpunosti u skladu s člankom 8. Uredbe (EU) br. 1092/2010 Europskog parlamenta i Vijeća od 24. studenoga 2010. o makrobonitetnom nadzoru financijskog sustava u Europskoj uniji i osnivanju Europskog odbora za sistemske rizike⁽¹⁾.

4.2.3. Kada *ad hoc* anketu provodi ESSB, Tajništvo ESSB-a stupa u kontakt s ESB-om koji tada ostvaruje kontakt s mogućim izvještajnim jedinicama putem nadležnih nacionalnih tijela koristeći se odgovarajućim odborom ESSB-a i pridržavajući se primjenjivih ograničenja povezanih s povjerljivošću.

4.2.4. Nakon dovršetka *ad hoc* ankete strane dijele informacije o provedbi ankete i posebno o primijenjenim metodologijama i provjerama kvalitete te o poteškoćama na koje su naišle, radi poboljšanja uspješnosti i učinkovitosti budućih anketa.

⁽¹⁾ SL L 331, 15.12.2010., str. 1.