

COMITETUL EUROPEAN PENTRU RISC SISTEMIC

DECIZIA COMITETULUI EUROPEAN PENTRU RISC SISTEMIC

din 21 septembrie 2011

privind furnizarea și colectarea de informații în vederea supravegherii macroprudențiale a sistemului financiar în cadrul Uniunii

(CERS/2011/6)

(2011/C 302/04)

CONSILIUL GENERAL AL COMITETULUI EUROPEAN PENTRU RISC SISTEMIC,

având în vedere Regulamentul (UE) nr. 1092/2010 al Parlamentului European și al Consiliului din 24 noiembrie 2010 privind supravegherea macroprudențială la nivelul Uniunii Europene a sistemului financiar și de înființare a unui Comitet european pentru risc sistemic ⁽¹⁾, în special articolul 3 alineatul (2), articolul 4 alineatul (2), articolul 8 alineatul (2) și articolul 15,

având în vedere Regulamentul (UE) nr. 1096/2010 al Consiliului din 17 noiembrie 2010 privind acordarea unor competențe specifice Băncii Centrale Europene referitoare la funcționarea Comitetului european pentru risc sistemic ⁽²⁾, în special articolul 2 litera (b), articolul 5 și articolul 6 alineatul (4),

având în vedere Decizia CERS/2011/1 a Comitetului european pentru risc sistemic din 20 ianuarie 2011 de adoptare a Regulamentului de procedură al Comitetului european pentru risc sistemic ⁽³⁾, în special articolul 28 alineatul (1),

întrucât:

(1) Articolul 3 alineatul (2) din Regulamentul (UE) nr. 1092/2010 prevede că Comitetul european pentru risc sistemic (CERS) trebuie să determine și/sau să colecteze, precum și să analizeze toate informațiile relevante și necesare în vederea supravegherii macroprudențiale a sistemului financiar în cadrul Uniunii, pentru a contribui la prevenirea sau diminuarea riscurilor sistemice pentru stabilitatea financiară a Uniunii generate de evoluții din sistemul financiar, luând în considerare evoluțiile macroeconomice, astfel încât să se evite perioadele de dificultăți financiare generalizate.

(2) Articolul 15 alineatul (2) din Regulamentul (UE) nr. 1092/2010 prevede că Autoritățile europene de supraveghere (AES), Sistemul European al Băncilor Centrale (SEBC), Comisia Europeană, autoritățile naționale de supraveghere (ANS) și autoritățile naționale din

domeniul statisticii trebuie să coopereze îndeaproape cu CERS și să îi furnizeze toate informațiile necesare pentru îndeplinirea atribuțiilor acestuia în conformitate cu legislația Uniunii.

(3) În temeiul articolului 15 alineatul (3) din Regulamentul (UE) nr. 1092/2010, CERS poate solicita informații din partea AES, de regulă într-o formă sintetică sau agregată, astfel încât instituțiile financiare individuale să nu poată fi identificate.

(4) Considerentul 10 al Regulamentului (UE) nr. 1096/2010 prevede că „ar trebui să se încredințeze BCE sarcina de a oferi sprijin statistic CERS”, conform considerentului 9 al aceluiași regulament.

(5) Prezenta decizie nu aduce atingere dreptului BCE de a utiliza în scopuri proprii informațiile pe care le colectează în temeiul Regulamentului (CE) nr. 2533/98 al Consiliului din 23 noiembrie 1998 privind colectarea informațiilor statistice de către Banca Centrală Europeană ⁽⁴⁾.

(6) Conținutul informațiilor agregate necesare pe termen scurt pentru activitatea CERS a fost definit în cooperare cu BCE și cu AES, în temeiul unui raport comun,

ADOPTĂ PREZENTA DECIZIE:

Articolul 1

Domeniul de aplicare

Prezenta decizie stabilește informațiile agregate de care CERS are nevoie pentru desfășurarea atribuțiilor sale și prevede normele detaliate pentru furnizarea și colectarea acestor informații.

Articolul 2

Furnizarea periodică de informații agregate

(1) Informațiile agregate de care CERS are nevoie pentru desfășurarea atribuțiilor sale sunt furnizate periodic conform prevederilor din anexele I și II.

⁽¹⁾ JO L 331, 15.12.2010, p. 1.

⁽²⁾ JO L 331, 15.12.2010, p. 162.

⁽³⁾ JO C 58, 24.2.2011, p. 4.

⁽⁴⁾ JO L 318, 27.11.1998, p. 8.

(2) Informațiile agregate prevăzute în anexa I sunt furnizate de BCE.

(3) Informațiile agregate prevăzute în anexa II sunt furnizate de AES relevante.

(4) Secretariatul CERS:

(a) stabilește, atunci când este necesar, specificațiile tehnice privind informațiile menționate la alineatul (1), după consultarea BCE și/sau a AES, după caz; și

(b) colectează informațiile menționate la alineatul (1) și cooperează în mod corespunzător cu BCE și cu AES.

Articolul 3

Furnizarea ad-hoc de informații agregate

Procedurile pe care secretariatul CERS le urmează pentru a efectua solicitări ad-hoc de informații agregate sunt prevăzute în anexa III.

Articolul 4

Intrarea în vigoare

Prezenta decizie intră în vigoare la 15 octombrie 2011.

Adoptată la Frankfurt pe Main, 21 septembrie 2011.

Președintele CERS
Jean-Claude TRICHET

ANEXA I

Furnizarea periodică de informații agregate de către Banca Centrală Europeană

Banca Centrală Europeană (BCE) raportează seturi de date, publicate și nepublicate, în domeniul statisticii monetare și financiare, pentru statele membre a căror monedă este euro, seturi care sunt reglementate de actele normative prevăzute mai jos în ceea ce privește conținutul, frecvența și termenul de raportare sau astfel cum se stabilește prin practica obișnuită. În măsura în care sunt furnizate în mod voluntar, cu aprobarea băncilor centrale naționale relevante, date privind statele membre a căror monedă nu este euro, BCE raportează și aceste date.

1. Date de bilanț ale instituțiilor financiare monetare (IFM), astfel cum sunt definite în Regulamentul BCE/2008/32 din 19 decembrie 2008 privind bilanțul sectorului instituții financiare monetare (reformare) ⁽¹⁾.
2. Statistici privind ratele dobânzilor practicate de IFM, astfel cum sunt definite în Regulamentul BCE/2001/18 din 20 decembrie 2001 privind statisticile referitoare la ratele dobânzilor practicate de instituțiile financiare monetare pentru depozitele constituite de gospodării și societăți nefinanciare și creditele acordate acestora ⁽²⁾.
3. Statistici privind fondurile de investiții, astfel cum sunt definite în Regulamentul BCE/2007/8 din 27 iulie 2007 privind statisticile referitoare la activele și pasivele fondurilor de investiții ⁽³⁾.
4. Statistici privind securitizarea, astfel cum sunt definite în Regulamentul BCE/2008/30 din 19 decembrie 2008 privind statisticile referitoare la activele și pasivele societăților vehicul investițional angajate în operațiuni de securitizare ⁽⁴⁾.
5. Statistici monetare selecționate și statistici selecționate privind instituțiile și piețele financiare, astfel cum sunt definite în Orientarea BCE/2007/9 din 1 august 2007 privind statistica monetară și statistica privind instituțiile și piețele financiare (reformare) ⁽⁵⁾.
6. Date bancare consolidate, astfel cum sunt aprobate de Consiliul guvernatorilor și de Consiliul general ale BCE, care cuprind date agregate privind bilanțul, contul de profit și pierdere și solvabilitatea grupurilor bancare.

⁽¹⁾ JO L 15, 20.1.2009, p. 14.

⁽²⁾ JO L 10, 12.1.2002, p. 24.

⁽³⁾ JO L 211, 14.8.2007, p. 8.

⁽⁴⁾ JO L 15, 20.1.2009, p. 1.

⁽⁵⁾ JO L 341, 27.12.2007, p. 1.

ANEXA II

Furnizarea periodică de informații agregate de către Autoritățile europene de supraveghere

REGULĂ GENERALĂ

Informațiile agregate furnizate de Autoritățile europene de supraveghere (AES) cuprind date privind cel puțin trei persoane juridice, dintre care niciuna nu reprezintă 85 % sau mai mult din piața relevantă (națională, a Uniunii sau regională). Cu toate acestea, dacă, pe lângă informațiile agregate, sunt prevăzuți indicatori de dispersie, informațiile agregate cuprind date privind cel puțin cinci persoane juridice, în cazul datelor accesibile publicului, și date privind cel puțin șase persoane juridice, atunci când este necesară protejarea datelor confidențiale privind societățile.

A. Autoritatea bancară europeană (ABE)

ABE raportează următoarele seturi de date pentru un segment de grupuri bancare mari, astfel cum este definit între CERS și ABE:

A1. Set de date: date trimestriale din formularele de raportare COREP și FINREP ⁽¹⁾

În măsura în care informațiile relevante au fost colectate în cooperare cu autoritățile naționale de supraveghere (ANS), ABE transmite CERS datele necesare în vederea calculării indicatorilor menționați mai jos, care sunt furnizați și de ABE, precum și corelațiile dintre indicatori și următorii indicatori de dispersie: minimul, prima cuartilă (cuartila inferioară) și a treia cuartilă (cuartila superioară), mediana, media, maximumul. ABE trebuie să transmită aceste informații trimestrial, în termen de cinci zile lucrătoare de la primirea de către ABE a datelor din partea ANS, care are loc în termen de 90 de zile de la data de referință. Data pentru prima transmitere a informațiilor va fi stabilită de CERS și de ABE de comun acord. De asemenea, trebuie transmise cu maximă diligență posibilă, dacă sunt disponibile, date anterioare coerente pentru cinci până la opt trimestre anterioare.

Următorii indicatori trebuie furnizați:

(a) indicatori privind solvabilitatea:

rata fondurilor proprii de nivel 1; rata capitalului total; rata fondurilor proprii de nivel 1 (excluzând instrumentele hibride); cerințele de capital pentru riscul de credit în raport cu cerințele totale de capital; cerințele de capital conform abordării standardizate în raport cu cerințele totale de capital; cerințele de capital pentru pozițiile din securitizare în raport cu cerințele totale de capital; cerințele de capital conform abordării bazate pe ratinguri interne în raport cu cerințele totale de capital; cerințele de capital pentru riscul de piață în raport cu cerințele totale de capital; cerințele de capital pentru riscul operațional în raport cu cerințele totale de capital; cerințele de capital pentru riscul de decontare/livrare în raport cu cerințele totale de capital; alte cerințe de capital în raport cu cerințele totale de capital;

(b) indicatori privind riscul de credit și calitatea activelor:

credite restante (> 90 de zile) raportate la totalul creditelor și al avansurilor; credite depreciate raportate la valoarea totală a creditelor; rata de acoperire (provizioane specifice pentru credite, raportate la valoarea totală brută a creditelor depreciate); credite și titluri de creanță restante (> 90 de zile) raportate la valoarea totală a creditelor și a titlurilor de creanță; rata de acoperire (provizioane specifice pentru credite și titluri de creanță, raportate la valoarea totală brută a creditelor și a titlurilor de creanță depreciate); rata de acoperire (toate provizioanele pentru credite și titluri de creanță, raportate la valoarea totală brută a creditelor și a titlurilor de creanță depreciate); active financiare depreciate raportate la totalul activelor; titluri de creanță depreciate raportate la totalul titlurilor de creanță; deprecieri acumulate pentru activele financiare, raportate la valoarea totală (brută) a activelor;

(c) indicatori privind riscurile de rentabilitate:

rentabilitatea capitalurilor proprii; rentabilitatea capitalului de reglementare; raportul cheltuieli/venituri; rentabilitatea activelor; venituri nete din dobânzi raportate la veniturile totale din exploatare; venituri nete din taxe și comisioane raportate la veniturile totale din exploatare; venituri din dividende raportate la veniturile totale din exploatare; profituri (pierderi) nete realizate din activele și pasivele financiare neevaluate la valoare justă prin profit și pierdere, raportate la veniturile totale din exploatare; profituri nete din activele și pasivele financiare deținute în vederea tranzacționării, raportate la veniturile totale din exploatare; profituri nete din activele și pasivele financiare desemnate la valoarea justă prin profit sau pierdere, raportate la veniturile totale din exploatare; alte venituri nete din exploatare raportate la veniturile totale din exploatare; venituri nete raportate la veniturile totale din exploatare; deprecierea activelor financiare, raportată la veniturile totale din exploatare;

⁽¹⁾ Formularele COREP și FINREP, aflate în vigoare la data raportării, astfel cum sunt elaborate sub forma orientărilor ABE publicate pe website-ul ABE, <http://www.eba.europa.eu>, sau, după caz, sub forma standardelor tehnice elaborate de ABE și adoptate de Comisie în temeiul articolului 74 alineatul (2) din Directiva 2006/48/CE a Parlamentului European și a Consiliului din 14 iunie 2006 privind inițierea și exercitarea activității instituțiilor de credit (JO L 177, 30.6.2006, p. 1).

(d) structura bilanțului:

raportul credite-depozite; depozitele clienților raportate la totalul pasivului; efectul de levier [fonduri proprii de nivel 1 raportate la (totalul activelor – imobilizări necorporale)]; titluri de creanță raportate la totalul pasivelor; depozite de la instituții de credit raportate la totalul pasivelor; capitaluri proprii raportate la totalul pasivelor și al capitalurilor proprii; numerar și active deținute în vederea tranzacționării raportate la totalul activelor; numerar, active deținute în vederea tranzacționării și active disponibile pentru vânzare raportate la totalul activelor; active financiare deținute în vederea tranzacționării raportate la totalul activelor; pasive financiare deținute în vederea tranzacționării raportate la totalul pasivelor și al capitalurilor proprii; credite și avansuri (excluzând portofoliul de tranzacționare) raportate la totalul activelor; raportul datorii-capitaluri proprii; elemente extrabilanțiere raportate la totalul activelor;

(e) rate de creștere (%) pe an:

total active; total credite; total depozite făcute de clienți; total venituri din exploatare; deprecierea activelor financiare; credite și titluri de creanță restante (> 90 de zile); total brut credite și titluri de creanță depreciate; active ponderate în funcție de risc.

A2. Set de date: date trimestriale privind lichiditatea

ABE transmite CERS datele necesare în vederea calculării indicatorilor menționați mai jos, care sunt furnizați și de ABE, precum și următorii indicatori de dispersie: minimul, prima cuartilă (cuartila inferioară) și a treia cuartilă (cuartila superioară), mediana, media, maximul. Aceste informații se transmit trimestrial, în termen de cinci zile lucrătoare de la primirea de către ABE a datelor de la ANS, care are loc în termen de 90 de zile de la data de referință. Informațiile din prima transmitere se referă la jumătatea anului 2013, în funcție de modificările finale ale dispozițiilor privind raportarea, prevăzute de Directiva 2006/48/CE a Parlamentului European și a Consiliului din 14 iunie 2006 privind inițierea și exercitarea activității instituțiilor de credit (reformare) ⁽¹⁾ și de Directiva 2006/49/CE a Parlamentului European și a Consiliului din 14 iunie 2006 privind rata de adecvare a capitalului întreprinderilor de investiții și al instituțiilor de credit (reformare) ⁽²⁾. Data pentru prima transmitere a informațiilor va fi stabilită de CERS și de ABE. Nu se solicită transmiterea informațiilor istorice.

Următorii indicatori trebuie furnizați: substituenți pe baza datelor disponibile pentru rata de acoperire a lichidității și pentru indicatorul de finanțare stabilă netă.

A3. Set de date: date trimestriale din formularele comune elaborate de ABE pentru raportarea expunerilor mari ⁽³⁾

În măsura în care informațiile relevante au fost colectate în cooperare cu ANS, ABE transmite CERS datele necesare în vederea calculării indicatorilor enumerați mai jos, precum și indicatorii de dispersie conveniți de CERS și de ABE. Aceste informații se transmit trimestrial, în termen de cinci zile lucrătoare de la primirea datelor din partea ANS, care are loc în termen de 90 de zile de la data de referință. Informațiile din prima transmitere fac referire la sfârșitul lunii decembrie 2011. Data pentru prima transmitere a informațiilor va fi convenită de CERS și de ABE. Nu se solicită transmiterea informațiilor istorice.

Următorii indicatori trebuie furnizați: numărul expunerilor mari ale grupurilor bancare mari din Uniune; valoarea expunerilor mari defalcate pe stat membru și pe sector al contrapărții (administrație publică; alte grupuri bancare mari din Uniune; alte bănci, alți intermediari financiari; societăți nefinanciare; retail); valoare (expunere anterior diminuării riscului de credit) a expunerilor mari ale grupurilor bancare mari din Uniune defalcată pe instrumente (active; instrumente financiare derivate; instrumente extrabilanțiere; expunere indirectă) și procentul din fondurile proprii; valoare (expunere ulterior diminuării riscului de credit, din care portofoliu bancar) a expunerilor mari ale grupurilor bancare mari din Uniune și procentul din fondurile proprii.

B. Autoritatea europeană pentru asigurări și pensii ocupaționale (AEAPO)

AEAPO raportează următoarele seturi de date. Setul de date B1 se referă la societățile de asigurare mari din Uniune, astfel cum sunt identificate de AEAPO. Setul de date B2 se referă la toate societățile de asigurare din Uniune, aceste date agregate fiind colectate pe bază individuală.

B1. Set de date: raportare anuală accelerată

În măsura în care informațiile relevante au fost colectate în cooperare cu AES și în conformitate cu regula generală privind informațiile agregate, AEAPO transmite CERS datele necesare în vederea calculării indicatorilor enumerați mai jos, care

⁽¹⁾ JO L 177, 30.6.2006, p. 1.

⁽²⁾ JO L 177, 30.6.2006, p. 201.

⁽³⁾ Formularele privind expunerile mari, aflate în vigoare la data raportării, astfel cum sunt elaborate sub forma orientărilor ABE publicate pe website-ul ABE, <http://www.eba.europa.eu>, sau, după caz, sub forma standardelor tehnice (parte a cadrului COREP) elaborate de ABE și adoptate de Comisie în temeiul articolului 110 din Directiva 2006/48/CE.

sunt furnizați și de AEAPO, fie sub formă de sume totale, fie sub forma următorilor indicatori de dispersie: medie neponderată, medie ponderată în funcție de prime brute, mediana, prima cuartilă, a treia cuartilă, minimul, maximum. Informațiile se transmit anual, în aproximativ 80 de zile calendaristice după anul de referință. Data pentru prima transmitere a informațiilor va fi stabilită de comun acord de CERS și AEAPO.

Următorii indicatori trebuie furnizați:

- (a) valori totale (sumă):
- (i) totalul activității de asigurări (de viață și generale): prime brute subscrise; prime nete încasate; daune nete survenite; cheltuieli nete de exploatare; capital de solvabilitate disponibil; capital de solvabilitate impus;
 - (ii) activități de asigurări generale: prime brute subscrise, cu defalcare pe sectoare de activitate (asigurare contra accidentelor și asigurare de sănătate; asigurare a autovehiculelor; asigurare a autovehiculelor, răspundere civilă față de terți; alte servicii de asigurare a autovehiculelor; asigurare maritimă, aeriană și de transport; asigurare a bunurilor contra incendiilor și altor daune; asigurare de răspundere civilă generală; asigurare a creditelor și a garanțiilor; alte asigurări generale); prime nete încasate; daune nete survenite; cheltuieli nete de exploatare; capital de solvabilitate disponibil; capital de solvabilitate impus;
 - (iii) activități de asigurări de viață: prime brute subscrise cu defalcare pe sectoare de activitate (asigurare de viață legată de fonduri de investiții; asigurare de viață nelegată de fonduri de investiții; asigurare a operațiunilor de capitalizare; asigurări de pensii colective; alte servicii de asigurare de viață); prime nete încasate; daune nete survenite; cheltuieli nete de exploatare; capital de solvabilitate disponibil; capital de solvabilitate impus;
- (b) indicatori de dispersie:
- (i) totalul activității de asigurări (de viață și generale): rata de creștere a primelor brute subscrise; rentabilitatea capitalurilor proprii; rentabilitatea activelor; rată de solvabilitate;
 - (ii) activități de asigurări generale: rata de creștere a primelor brute subscrise defalcate pe sectoare de activitate (asigurare contra accidentelor și asigurare de sănătate; asigurare a autovehiculelor; asigurare a autovehiculelor, răspundere civilă față de terți; alte servicii de asigurare a autovehiculelor; asigurare maritimă, aeriană și de transport; asigurare a bunurilor contra incendiilor și altor daune; asigurare de răspundere civilă generală; asigurare a creditelor și a garanțiilor; alte asigurări generale); rata pierderilor; rata cheltuielilor; rată combinată; rentabilitatea capitalurilor proprii; rentabilitatea activelor; rată de solvabilitate;
 - (iii) activități de asigurări de viață: rata de creștere a primelor brute subscrise defalcate pe sectoare de activitate (asigurare de viață legată de fonduri de investiții; asigurare de viață nelegată de fonduri de investiții; asigurare a operațiunilor de capitalizare; asigurări de pensii colective; alte servicii de asigurare de viață); rentabilitatea capitalurilor proprii; rentabilitatea activelor; rată de solvabilitate.

B2. Set de date: raportare periodică anuală

În măsura în care informațiile relevante au fost colectate în cooperare cu ANS și în conformitate cu regula generală privind informațiile agregate, AEAPO transmite CERS datele necesare în vederea calculării indicatorilor enumerați mai jos, care sunt furnizați și de AEAPO, fie sub formă de sume totale, fie sub forma următorilor indicatori de dispersie: medie neponderată, medie ponderată în funcție de prime brute, ponderile totale ale societăților de asigurare mari din Uniune, mediana, prima cuartilă, a treia cuartilă, minimul, maximum. Aceste informații se transmit anual, în aproximativ 270 de zile calendaristice după anul de referință. Data pentru prima transmitere a datelor va fi convenită de CERS și de AEAPO. Seriile istorice sunt furnizate începând din anul 2003.

Următorii indicatori trebuie furnizați:

- (a) totalul activității de asigurări (de viață și generale): prime brute subscrise; prime nete încasate; daune nete survenite; cheltuieli nete de exploatare; capital de solvabilitate disponibil; capital de solvabilitate impus;
- (b) activități de asigurări generale: prime brute subscrise, defalcate pe sectoare de activitate (asigurare contra accidentelor și asigurare de sănătate; asigurare a autovehiculelor; asigurare a autovehiculelor, răspundere civilă față de terți; alte servicii de asigurare a autovehiculelor; asigurare maritimă, aeriană și de transport; asigurare a bunurilor contra incendiilor și altor daune; asigurare de răspundere civilă generală; asigurare a creditelor și a garanțiilor; alte asigurări generale); prime nete încasate; daune nete survenite; cheltuieli nete de exploatare; capital de solvabilitate disponibil; capital de solvabilitate impus;
- (c) activități de asigurări de viață: prime brute subscrise, defalcate pe sectoare de activitate (asigurare de viață legată de fonduri de investiții; asigurare de viață nelegată de fonduri de investiții; asigurare a operațiunilor de capitalizare; asigurări de pensii colective; alte servicii de asigurare de viață); prime nete încasate; daune nete survenite; cheltuieli nete de exploatare; capital de solvabilitate disponibil; capital de solvabilitate impus.

C. Autoritatea europeană pentru valori mobiliare și piețe (AEVMP)

AEVMP furnizează următoarele seturi de date:

C1. Set de date: baza de date constituită conform Directivei privind piețele instrumentelor financiare ⁽¹⁾

AEVMP transmite CERS datele, colectate în cooperare cu ANS, necesare în vederea calculării indicatorilor enumerați mai jos, care sunt furnizați și de AEVMP. Aceste informații se transmit trimestrial, la cinci zile după perioada de referință. Data pentru prima transmitere a informațiilor va fi convenită de CERS și de AEVMP. Informațiile istorice sunt furnizate începând cu luna noiembrie 2007.

Următorii indicatori trebuie furnizați: numele și desemnarea statului membru al autorității competente care a autorizat internalizatorii sistematici; numele și desemnarea statului membru al autorității competente care a autorizat sistemele multilaterale de tranzacționare; numele și desemnarea statului membru al autorității competente care a autorizat piața reglementată; numele și desemnarea statului membru al autorității competente care a autorizat casele de compensare ale contrapărților centrale.

C2. Set de date: baza de date a sistemului de referință

AEVMP transmite CERS datele colectate în cooperare cu ANS, necesare în vederea calculării indicatorilor enumerați mai jos, care sunt furnizați și de AEVMP, precum și indicatorii de dispersie conveniți de CERS și de AEVMP. Aceste informații se transmit trimestrial, la cinci zile după perioada de referință. Data pentru prima transmitere a informațiilor va fi convenită de CERS și de AEVMP. Informațiile istorice sunt furnizate începând cu luna iunie 2009.

Următorii indicatori trebuie furnizați: defalcarea instrumentelor financiare admise spre tranzacționare pe piețe din Spațiul Economic European al căror cod de clasificare a instrumentelor financiare este „ES” (acțiuni comune/ordinare); numărul de instrumente defalcate pe stat membru; numărul de instrumente admise defalcate pe piață; numărul de instrumente noi emise, defalcate pe piață; numărul de instrumente noi emise, defalcate pe stat membru.

⁽¹⁾ Directiva 2004/39/CE a Parlamentului European și a Consiliului din 21 aprilie 2004 privind piețele instrumentelor financiare, de modificare a Directivelor 85/611/CEE și 93/6/CEE ale Consiliului și a Directivei 2000/12/CE a Parlamentului European și a Consiliului și de abrogare a Directivei 93/22/CEE a Consiliului (JO L 145, 30.4.2004, p. 1).

ANEXA III

Solicitări ad-hoc de informații agregate din partea CERS**A. CONSIDERAȚII GENERALE****1. Stabilirea necesității efectuării unei anchete ad-hoc**

- 1.1. Comitetul european pentru risc sistemic (CERS) poate solicita să-i fie furnizate informații agregate în mod ad-hoc. Aceste solicitări ad-hoc de informații din partea CERS pot fi adresate: (a) prin furnizarea informațiilor disponibile deja de la Sistemul European al Băncilor Centrale (SEBC), de la Autoritățile europene de supraveghere (AES), de la furnizorii comerciali de date sau din bazele de date ale organizațiilor internaționale, de exemplu Banca Reglementelor Internaționale (BRI); sau (b) prin efectuarea unei anchete ad-hoc.
- 1.2. Având în vedere considerațiile de mai sus, solicitările ad-hoc inițiale pentru furnizarea de informații agregate adresate de structurile CERS vor determina în general mai întâi o etapă de investigare, care are drept obiectiv să identifice necesitatea efectuării unei anchete ad-hoc. În cursul etapei de investigare se va aprecia în special ce date cantitative și calitative sunt deja disponibile și măsura în care acestea corespund scopului avut în vedere. În cazul în care datele disponibile nu corespund scopului avut în vedere și intervine necesitatea de a colecta date de la agenții raportori prin intermediul unei anchete ad-hoc, în etapa de investigare se pot identifica deja unitățile de observare statistică relevante, cu obligații de raportare, precum și implicațiile extinse în materie de costuri care există pentru agenții raportori în contextul efectuării unei anchete ad-hoc. Rezultatul investigării poate implica adoptarea unei decizii de către Consiliul general al CERS privind colectarea de informații agregate prin intermediul unei anchete ad-hoc.
- 1.3. Datorită interesului lor comun privind un subiect specific, CERS și una sau mai multe AES pot conveni să inițieze o anchetă ad-hoc comună, situație în care nu este necesară o etapă de investigare.

2. Tipuri de anchete ad-hoc

- 2.1. Se pot utiliza două tipuri de anchete ad-hoc:
 - (a) Anchetele de tipul 1 vizează aspecte specifice, de exemplu evaluarea adecvată a expunerilor, și, în general, au drept scop să furnizeze defalcări mai detaliate în cadrul exercițiilor de colectare periodică de date, de exemplu poziții „din care”. Anchetele de tipul 1 se pot referi și la seturi de date care determină colectarea (obișnuită) de date într-un context diferit sau de către organizații diferite, precum Fondul Monetar Internațional sau BRI, și pentru care există deja un cadru metodologic stabilit;
 - (b) Anchetele de tipul 2 se referă la fenomene care nu au fost analizate anterior, pentru care nu s-a stabilit nicio metodologie și cu privire la care nu se efectuează colectări periodice de date. Anchetele de tipul 2 sunt în mod considerabil mai laborioase decât anchetele de tipul 1 și pot să nu aibă niciun nivel de referință. Informațiile obținute din anchetele de tipul 2 pot fi mai dificil de interpretat. Necesitatea de a identifica agenții raportori relevanți și de a stabili un cadru metodologic poate implica faptul că este necesară o perioadă considerabilă de timp până la colectarea informațiilor.
- 2.2. În vederea deciderii necesității unei anchete ad-hoc, Consiliul general al CERS va fi informat și va lua în considerare costurile probabile pe care aceasta le implică și calendarul pentru derularea unei astfel de anchete.

B. PRINCIPIILE ȘI PROCEDURA PENTRU TRATAREA SOLICITĂRILOR AD-HOC**3. Principii**

Secretariatul CERS, Banca Centrală Europeană (BCE) și AES (denumite în continuare „părțile”) vor adopta următoarele principii atunci când răspund solicitărilor ad-hoc de informații ale CERS:

- (a) urmează etape procedurale convenite, care trebuie aplicate în mod transparent;
- (b) evită interacțiunea excesivă cu agenții raportori;
- (c) utilizează în mod optim informațiile existente pentru diferite scopuri analitice și operaționale, respectând în același timp constrângerile legale și garanțiile de confidențialitate necesare;
- (d) utilizează cât de mult posibil metodologiile și colectările de date existente, în măsura posibilului, armonizate;
- (e) dezvoltă cele mai bune practici pentru anchetele ad-hoc, prin introducerea unor mecanisme de feedback și prin schimbul de informații privind metodologiile între toate părțile implicate.

4. Procedură

4.1. Etapa de investigare

4.1.1. Structurile CERS transmit solicitările lor inițiale privind colectarea ad-hoc de informații agregate către secretariatul CERS, care ulterior organizează etapa de investigare cu susținerea BCE, prin efectuarea acțiunilor prezentate mai jos. Solicitarea inițială de informații este transformată în cerințe efective de prezentare de date, iar disponibilitatea și calitatea informațiilor relevante sunt evaluate în cadrul organizațiilor corespunzătoare. AES și Comitetul comun al AES sunt informate de contextul solicitării ad-hoc inițiale și sunt invitate să coopereze cu BCE în evaluarea informațiilor disponibile, pentru a utiliza în mod optim informațiile colectate anterior și pentru a evita creșterea sarcinii de raportare. În etapa de investigare se poate, de asemenea, face apel la SEBC, inclusiv la Comitetul de statistică al SEBC (STC), la Comitetul de stabilitate financiară al SEBC (CSF), sau la alte surse din cadrul Sistemului Statistic European, la furnizorii comerciali de date și la organizațiile internaționale, de exemplu BRI.

4.1.2. În cazul în care, ca urmare a etapei de investigare: (a) datele care corespund scopului avut în vedere sau substituenții acceptabili sunt disponibili și sunt de calitate corespunzătoare și (b) se obține permisiunea titularului în vederea utilizării datelor care nu sunt în întregime disponibile în domeniul public, aceste date sunt furnizate prin intermediul secretariatului CERS către structura CERS relevantă care solicită informația, împreună cu evaluarea necesară a calității și informațiile privind costul datelor obținute din surse comerciale.

4.1.3. În alte cazuri, în special în cele în care apar oricare dintre următoarele aspecte: (a) substituenții sunt disponibili, dar sunt de o calitate necunoscută sau insuficientă; (b) nu sunt disponibile date și substituenți; (c) nu se obține permisiunea de a utiliza date care nu sunt în întregime disponibile în domeniul public, BCE transmite CERS rezultatul evaluării privind disponibilitatea informațiilor și propune posibile surse și metodologii pentru o anchetă ad-hoc, care include: (i) categoriile și numărul agenților raportori; (ii) canale de raportare, de exemplu, STC, CSF sau AES, (iii) estimarea aproximativă a costurilor și a calendarului; (iv) dificultățile anticipate.

4.2. Etapa de colectare a datelor

4.2.1. După primirea rezultatelor investigării, secretariatul CERS prezintă spre aprobarea Consiliului general al CERS, prin intermediul Comitetului director al CERS, o propunere privind acțiuni de monitorizare, împreună cu o evaluare aproximativă a avantajelor și a costurilor. Consiliul general al CERS decide dacă este cazul să se efectueze o anchetă ad-hoc, care poate necesita implicarea agenților raportori. Decizia Consiliului general poate determina în special: (a) gradul de detaliu al informațiilor necesare la nivel instituțional și de rubrică, (b) regimul de confidențialitate care trebuie aplicat, în special persoanele care sunt autorizate să acceseze anumite date și modul în care datele vor fi păstrate și transmise, (c) limitele de timp pentru furnizarea informațiilor.

4.2.2. În cazul în care o AES efectuează o anchetă ad-hoc, Secretariatul CERS contactează AES relevantă și Comitetul comun. Datele pot fi transmise prin intermediul BCE, în deplină conformitate cu articolul 8 din Regulamentul (UE) nr. 1092/2010 al Parlamentului European și al Consiliului din 24 noiembrie 2010 privind supravegherea macro-prudențială la nivelul Uniunii Europene a sistemului financiar și de înființare a unui Comitet European pentru risc sistemic ⁽¹⁾.

4.2.3. În cazul în care SEBC efectuează o anchetă ad-hoc, secretariatul CERS contactează BCE, care ulterior inițiază contact cu potențiali agenți raportori prin intermediul comitetelor SEBC corespunzătoare, cu respectarea constrângerilor de confidențialitate aplicabile.

4.2.4. În urma finalizării fiecărei anchete ad-hoc, părțile vor efectua un schimb de informații privind punerea în aplicare a anchetei, în special privind metodologiile aplicate și verificările privind calitatea, precum și cu privire la orice dificultate întâmpinată, în vederea îmbunătățirii eficacității și a eficienței anchetelor viitoare.

⁽¹⁾ JO L 331, 15.12.2010, p. 1.