

EUROPOS SISTEMINĖS RIZIKOS VALDYBA

EUROPOS SISTEMINĖS RIZIKOS VALDYBOS SPRENDIMAS

2015 m. liepos 21 d.

**dėl informacijos teikimo ir rinkimo Sąjungos finansų sistemos makrolygio rizikos ribojimo
priežiūros tikslais ir kuriuo panaikinamas Sprendimas ESRV/2011/6**

(ESRV/2015/2)

(2015/C 394/03)

EUROPOS SISTEMINĖS RIZIKOS VALDYBOS BENDROJI VALDYBA,

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

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

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

kadangi:

- (1) Reglamento (ES) Nr. 1092/2010 3 straipsnio 2 dalyje nustatyta, kad Europos sisteminės rizikos valdyba (ESRV) turi nustatyti ir (arba) surinkti bei analizuoti visą informaciją, reikalingą Sąjungos finansų sistemos makrolygio rizikos ribojimo priežiūrai, siekdama prisidėti prie sisteminės rizikos, kuri kyla finansiniam stabilumui Sąjungoje dėl pokyčių finansų sistemoje, prevencijos ar mažinimo ir, atsižvelgiant į makroekonominis pokyčius, kad būtų išvengta plataus masto finansinių sunkumų laikotarpių;
- (2) Reglamento (ES) Nr. 1092/2010 15 straipsnio 2 dalyje nustatyta, kad Europos priežiūros institucijos (EPI), Europos centrinių bankų sistema (ECBS), Europos Komisija, nacionalinės priežiūros institucijos ir nacionalinės statistikos institucijos turi glaudžiai bendradarbiauti su ESRV ir suteikti jai visą informaciją, būtiną jos užduotims vykdyti vadovaujantis Sąjungos teisės aktais;
- (3) pagal Reglamento (ES) Nr. 1092/2010 15 straipsnio 3 dalį, ESRV gali paprašyti EPI pateikti informaciją, kaip įprasta, apibendrinta arba suvestine forma, kad nebūtų galima nustatyti atskirų finansų įstaigų;
- (4) Reglamento (ES) Nr. 1096/2010 10 konstatuojamoje dalyje nurodyta, kad ECB turėtų būti patikėtas uždavinys teikti statistinę paramą ESRV, vadovaujantis jo 9 konstatuojamąja dalimi;
- (5) šis sprendimas neturi įtakos ECB teisei savo tikslais naudoti informaciją, kurią jis renka pagal 1998 m. lapkričio 23 d. Tarybos reglamentą (EB) Nr. 2533/98 dėl Europos Centrinio Banko renkamos statistinės informacijos ⁽⁴⁾.
- (6) siekdamas patenkinti ESRV poreikius, ESRV, ECB ir EPI sutarė atnaujinti esamą reguliaraus informacijos teikimo sistemą,

⁽¹⁾ OL L 331, 2010 12 15, p. 1.

⁽²⁾ OL L 331, 2010 12 15, p. 162.

⁽³⁾ OL C 58, 2011 2 24, p. 4.

⁽⁴⁾ OL L 318, 1998 11 27, p. 8.

PRIĖMĖ ŠĮ SPRENDIMĄ:

1 straipsnis

Taikymo sritis

Šiame sprendime nustatoma ESRV uždaviniams vykdyti reikalinga suvestinė informacija ir išdėstomos išsamios tos informacijos teikimo ir rinkimo taisyklės.

2 straipsnis

Reguliariai teikiama suvestinė informacija

1. ESRV uždaviniams vykdyti reikalinga suvestinė informacija reguliariai teikiama I ir II prieduose nustatyta tvarka.
2. I priede nurodytą suvestinę informaciją teikia ECB.
3. II priede nurodytą suvestinę informaciją teikia atitinkamos EPI.
4. ESRV sekretoriatas:
 - a) pasikonsultavęs su ECB ir (arba) EPI prireikus nustato 1 dalyje nurodytos informacijos technines specifikacijas; ir
 - b) renka 1 dalyje nurodytą informaciją bei bendradarbiauja atitinkamai su ECB ir EPI.

3 straipsnis

Ad hoc teikiama suvestinė informacija

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

4 straipsnis

Baigiamosios ir pereinamojo laikotarpio nuostatos

1. Sprendimas ESRV/2011/6 ⁽¹⁾ panaikinamas nuo šio sprendimo įsigaliojimo dienos.
2. Šio sprendimo II priedas taikomas nuo šio sprendimo įsigaliojimo dienos arba nuo tos dienos, kurią pirmą kartą pateikiami tame priede nurodyti rodikliai, arba nuo tos dienos, kurią nustatomos tame priede nurodytos atitinkamos duomenų teikimo techninės specifikacijos, atsižvelgiant į tai, kuri data yra vėlesnė.

5 straipsnis

Įsigaliojimas

Šis sprendimas įsigalioja 2015 m. liepos 21 d.

Priimta Frankfurte prie Maino 2015 m. liepos 21 d.

ESRV Pirmininkas

Mario DRAGHI

⁽¹⁾ 2011 m. rugsėjo 21 d. Europos sisteminės rizikos valdybos sprendimas ESRV/2011/6 dėl informacijos teikimo ir rinkimo Sąjungos finansų sistemos makrolygio rizikos ribojimo priežiūros tikslais (OL C 302, 2011 10 13, p. 3).

I PRIEDAS

Europos Centrinio Banko reguliariai teikiama suvestinė informacija

1. Remdamasis Susitarimo memorandumu dėl dalinimosi nekonfidencialia statistine informacija, kuri ECB ir ESRV sudarė 2013 m. rugsėjo 25 d. (toliau – Susitarimo memorandumas), įskaitant vėlesnius jo pakeitimus, ECB teikia ESRV jame nurodytus bendruosius duomenis (toliau – bendrieji duomenys).
2. Bendrieji duomenys pateikiami ESRV sekretoriatui vadovaujantis Susitarimo memorandume nustatytais priegros prie bendrųjų duomenų ir jų naudojimo sąlygomis. ECB savo iniciatyva ar ESRV prašymu gali pakeisti bendrųjų duomenų turinį, ypač tam, kad būtų atsižvelgta į: a) ECB statistinių duomenų saugyklos duomenų rinkinių sudėties ar valdymo pakeitimus, b) ECB gauto duomenų rengėjo sutikimo pasidalinti nepaskelbtais duomenimis pakeitimus, arba c) teisės aktuose nustatytų ESRV uždavinių apimtys ir įgyvendinimo būdo ar susijusio duomenų poreikio pakeitimus.
3. ECB taip pat pateikia ESRV suvestinius duomenis, nepriskirtinus bendriesiems duomenims, jei juose nėra konfidencialios statistinės informacijos, kaip apibrėžta Tarybos reglamento (EB) Nr. 2533/98 ⁽¹⁾ 1 straipsnio 12 punkte, ir jei negalima nustatyti atskirų finansų įstaigų, nebent šie duomenys jau buvo paviešinti. ESRV sekretoriatas, pasikonsultavęs su ECB, nustato technines priegros prie šių duomenų specifikacijas, kai jie žymimi kaip nepaskelbti.

⁽¹⁾ 1998 m. lapkričio 23 d. Tarybos reglamentas (EB) Nr. 2533/98 dėl Europos Centrinio Banko renkamos statistinės informacijos (OL L 318, 1998 11 27, p. 8; 2004 m. specialusis leidimas lietuvių k., 1 sk., 3 t., p. 23).

II PRIEDAS

Europos priežiūros institucijų reguliariai teikiama suvestinė informacija**Bendroji taisyklė**

Europos priežiūros institucijos (EPI) reguliariai teikia ESRV šiame priede nurodytą suvestinę informaciją. Teikiama informacija apima duomenis apie ne mažiau kaip tris atskaitinguosius agentus, iš kurių nė vienas neatstovauja 85 % ar daugiau atitinkamos rinkos, ar tai būtų vienos ar daugiau valstybių narių, ar visos Sąjungos rinka. Tačiau jeigu greta suvestinės informacijos teikiamos skaitinės charakteristikos, suvestinė informacija apima duomenis apie ne mažiau kaip penkis atskaitinguosius agentus, kai teikiami viešai prieinami duomenys, ir duomenis apie ne mažiau kaip šešis atskaitinguosius agentus, kai būtina apsaugoti konfidencialius įmonės lygio duomenis.

Europos bankininkystės institucija (EBI)

EBI teikia rizikos rodiklius (RR) ir išsamias rizikos analizės priemones (IRAP), kaip apibrėžta EBI vidaus dokumentuose. RR ir IRAP duomenys teikiami apie kiekvieną valstybę narę, jei tenkinamos bendrojoje taisyklėje nustatytos sąlygos, ir apie visą Sąjungą, užtikrinant, kad nebūtų pateiktas dvigubas atskaitingųjų agentų skaičius. Ypatingais atvejais gali būti susitarta dėl kitokios suvestinės informacijos. Duomenys pateikiami per dvi darbo dienas nuo išleidimo datų, nurodytų 2014 m. gegužės 14 d. EBI sprendimo EBA/DC/090 4 straipsnyje.

Europos draudimo ir profesinių pensijų institucija (EDPPI)

1. EDPPI teikia rinkinį rodiklių, išvestų iš duomenų, kuriuos EDPPI gauna iš nacionalinėms priežiūros institucijoms pateiktos Mokumo II reguliarios priežiūros informacijos, kaip apibrėžta EDPPI. Rodikliai teikiami apie kiekvieną valstybę narę, jei tenkinamos bendrojoje taisyklėje nustatytos sąlygos, ir apie visą Sąjungą, užtikrinant, kad nebūtų pateiktas dvigubas atskaitingųjų agentų skaičius. Ypatingais atvejais gali būti nustatyta kitokia suvestinė informacija. Dėl išleidimo datų bus tarpusavyje susitarta tuomet, kai bus pradėta taikyti Mokumo II teisinė sistema.
2. ESRV sekretoriatas abipusiu susitarimu su EDPPI gali nustatyti kitų suvestinių duomenų, kurie grindžiami duomenimis, EDPPI jau turimais iš nacionalinėms priežiūros institucijoms pateiktos Mokumo II reguliarios priežiūros informacijos, reguliaraus teikimo technines specifikacijas.

Europos vertybinių popierių ir rinkų institucija (EVPRI)

ESRV sekretoriatas abipusiu susitarimu su EVPRI nustato duomenų, kurie, vadovaujantis taikytiniais sektoriaus teisės aktais, turi būti perduoti ESRV, technines specifikacijas. Techninėse specifikacijose taip pat nustatomas duomenų teikimo dažnumas ir laikas.

III PRIEDAS

ESRV teikiami *ad hoc* prašymai pateikti suvestinę informaciją**Bendros pastabos**

ESRV gali teikti *ad hoc* prašymus pateikti suvestinę informaciją. Tokie ESRV *ad hoc* prašymai pateikti informaciją gali būti tenkinami:

- a) suteikiant informaciją, jau turimą iš Europos centrinių bankų sistemos (ECBS), Europos priežiūros institucijų (EPI), komercinių duomenų teikėjų arba tarptautinių organizacijų, pvz., Tarptautinių atsiskaitymų banko (TAB), duomenų bazių; arba
- b) atliekant *ad hoc* tyrimus.

Principai

ESRV sekretoriatas, ECB ir EPI (toliau – šalys), vykdydami *ad hoc* prašymus pateikti informaciją:

- a) laikosi sutartų procedūrinių etapų, kurie turi būti taikomi skaidriai;
- b) vengia pernelyg didelės sąveikos su atskaitingaisiais agentais;
- c) įvairiems analitiniams ir veiklos tikslams kuo labiau pakartotinai naudoja turimą informaciją, tuo pačiu laikydamiesi būtinų teisinių apribojimų ir apsaugodami konfidencialumą;
- d) kiek įmanoma naudoja esamas ir, jei taikytina, suderintas, metodikas ir duomenų rinkinius;
- e) sukuria *ad hoc* prašymų geriausią praktiką, nustatydami visų dalyvaujančių šalių grįžtamojo ryšio ir dalinimosi informacija apie metodiką mechanizmus.

A. TURIMOS INFORMACIJOS TEIKIMAS

1. ESRV sekretoriatas, pasikonsultavęs su ECB arba atitinkamomis EPI, gali pateikti *ad hoc* prašymą pateikti duomenis, kurie nėra reguliariai teikiami pagal I ir II priedus, bet kuriuos ECBS ar EPI (toliau kartu – adresatai) jau turi; kartu pateikiamas prašomų duomenų aprašymas. Prašomų duomenų pateikimo terminas nustatomas abipusiu ESRV sekretoriato ir atitinkamų šalių susitarimu.
2. Adresatai pateikia prašomą informaciją laikydamiesi taikytinoje teisėje nustatytų taisyklių ir procedūrų, įskaitant (bet neapsiribojant):
 - a) Europos centrinių bankų sistemos ir Europos Centrinio Banko statutą;
 - b) Tarybos reglamentą (EB) Nr. 2533/98;
 - c) Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (ES) Nr. 1093/2010 ⁽¹⁾;
 - d) Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (ES) Nr. 1094/2010 ⁽²⁾;
 - e) Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (ES) Nr. 1095/2010 ⁽³⁾;
 - f) Tarybos reglamentą (ES) Nr. 1096/2010 ⁽⁴⁾.
3. ESRV sekretoriatas pateikia duomenis atitinkamai jų prašančiai ESRV struktūrai.

⁽¹⁾ 2010 m. lapkričio 24 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 1093/2010, kuriuo įsteigiama Europos priežiūros institucija (Europos bankininkystės institucija), iš dalies keičiamas Sprendimas Nr. 716/2009/EB ir panaikinamas Komisijos sprendimas 2009/78/EB (OL L 331, 2010 12 15, p. 12).

⁽²⁾ 2010 m. lapkričio 24 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 1094/2010, kuriuo įsteigiama Europos priežiūros institucija (Europos draudimo ir profesinių pensijų institucija), iš dalies keičiamas Sprendimas Nr. 716/2009/EB ir panaikinamas Komisijos sprendimas 2009/79/EB (OL L 331, 2010 12 15, p. 48).

⁽³⁾ 2010 m. lapkričio 24 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 1095/2010, kuriuo įsteigiama Europos priežiūros institucija (Europos vertybinių popierių ir rinkų institucija) ir iš dalies keičiamas Sprendimas Nr. 716/2009/EB bei panaikinamas Komisijos sprendimas 2009/77/EB (OL L 331, 2010 12 15, p. 84).

⁽⁴⁾ 2010 m. lapkričio 17 d. Tarybos reglamentas (ES) Nr. 1096/2010, kuriuo Europos Centriniam Bankui pavedami konkretūs uždaviniai, susiję su Europos sisteminės rizikos valdybos veikla (OL L 331, 2010 12 15, p. 162).

4. Kai prašymą pateikti informaciją galima patenkinti naudojant duomenis, gautus iš komercinių teikėjų, tokie duomenys per ESRV sekretoriatą pateikiami atitinkamai jų prašančiai ESRV struktūrai kartu su kokybės vertinimu ir informacija apie susijusias išlaidas.

B. AD HOC TYRIMAS

1. *Ad hoc* tyrimo būtinybės nustatymas

- 1.1. Nepaisant prieš tai nurodytų aplinkybių, ESRV struktūroms pateikus pirminius *ad hoc* prašymus pateikti suvestinę informaciją, paprastai pirmiausia prasideda patikrinimo etapas, kurį gali atlikti pačios atitinkamos struktūros, ESRV sekretoriatas arba ECB. Tokio patikrinimo tikslas – nustatyti, ar būtina atlikti *ad hoc* tyrimą. Patikrinimo metu pirmiausia įvertinama, kokie kiekybiniai ir kokybiniai duomenys jau yra turimi ir ar jie yra tinkami. Jeigu turimi duomenys nėra tinkami ir iškyla poreikis surinkti duomenis iš atskaitingųjų agentų atliekant *ad hoc* tyrimą, jau patikrinimo metu gali būti nustatyta atitinkama atskaitingoji visuma ir bendros galimos atskaitingųjų agentų sąnaudos, susijusios su *ad hoc* tyrimo vykdymu.
- 1.2. ESRV ir viena ar kelios EPI, atsižvelgdamos į bendrą interesą konkrečiu klausimu, gali susitarti pradėti bendrą *ad hoc* tyrimą; tokiu atveju patikrinimo etapas yra nebūtinas.

2. *Ad hoc* tyrimų rūšys

Gali būti naudojamos dvi *ad hoc* tyrimų rūšys:

- a) 1 rūšies tyrimai skirti konkrečioms klausimams, pvz., tinkamam rizikos vertinimui, ir dažniausiai ja siekiama pateikti išsamesnius reguliaraus duomenų teikimo paskirstymus, pvz., pozicijas „iš jų“. 1 rūšies tyrimai taip gali apimti duomenų rinkinius, kurie yra susiję su (reguliarium) duomenų rinkimu kitokiame kontekste arba kuriuos renka kita organizacija, pavyzdžiui, Tarptautinis valiutos fondas arba TAB, ir kuriems jau sukurtos metodikos sistemos;
- b) 2 rūšies tyrimai apima reiškinis, kurie anksčiau nebuvo analizuoti ir kuriems nėra sukurta metodikos ir nėra reguliariai renkami duomenys. 2 rūšies tyrimams paprastai reikia žymiai daugiau darbo nei 1 rūšies tyrimams, ir juose gali nebūti lyginamojo standarto. Būtinybė nustatyti atitinkamus atskaitinguosius agentus ir sukurti metodinę sistemą gali reikšti, kad prieš pradėdant rinkti informaciją praeis nemažai laiko.

3. Procedūra

- 3.1. ESRV bendroji valdyba (toliau – Bendroji valdyba) sprendžia, ar suvestinė informacija turi būti renkama atliekant *ad hoc* tyrimą, atsižvelgdama į galimas susijusias sąnaudas ir laiką, kurio reikia tokiam tyrimui atlikti.

Patikrinimo etapas

- 3.2. ESRV struktūros pateikia savo pirminius prašymus dėl suvestinės informacijos *ad hoc* surinkimo ESRV sekretoriatui. ESRV sekretoriatas, bendradarbiaudamas su ESRV ryšių palaikymo grupe duomenų klausimais ir ECB, įvertina turimą informaciją, kad kuo labiau panaudotų anksčiau surinktą informaciją ir išvengtų atskaitomybės naštos padidinimo. Jei padaroma išvada, kad turima informacija nėra tinkama ir iškyla poreikis surinkti duomenis iš atskaitingųjų agentų atliekant *ad hoc* tyrimą, ESRV substruktūra, padedama ESRV sekretoriato, pradinį prašymą pateikti informaciją pakeičia konkrečių duomenų reikalavimais; atitinkamose organizacijose įvertinamas atitinkamos informacijos prieinamumas ir kokybė. Patikrinimo metu taip pat galima remtis ECBS, įskaitant ECBS statistikos komitetą (STK), ECBS finansinio stabilumo komitetą (FSK), arba kitais Europos statistikos sistemos šaltiniais, komerciniais duomenų teikėjais ir tarptautinėmis organizacijomis, pvz., TAB.
- 3.3. Jei per patikrinimo etapą padaroma išvada, kad: a) tinkami duomenys arba priimtini pakaitiniai rodikliai yra prieinami ir yra pakankamos kokybės ir b) gautas savininko sutikimas naudoti duomenis, kurie yra nevisiškai viešai prieinami, *ad hoc* tyrimas nėra būtinas ir taikomos A skyriuje nurodytos procedūros.
- 3.4. Jei paaiškėja bet kuri iš toliau nurodytų aplinkybių: a) tinkami duomenys ir (arba) priimtini pakaitiniai rodikliai yra prieinami, tačiau jų kokybė yra nežinoma arba nepakankama; b) nėra duomenų ir pakaitinių rodiklių; arba c) negautas atskaitingojo agento sutikimas naudoti duomenis, kurie yra nevisiškai viešai prieinami, ESRV sekretoriatas, bendradarbiaudamas su ECB, informuoja duomenų prašančias struktūras apie informacijos prieinamumo įvertinimo rezultata ir pasiūlo galimus *ad hoc* tyrimo šaltinius ir metodikas, įskaitant: i) atskaitingųjų agentų kategorijas ir skaičius; ii) duomenų teikimo kanalus, pvz., STK, FSK arba EPI, iii) sąnaudų ir laiko įvertinimą, iv) bet kokius numatomus sunkumus.

Duomenų rinkimo etapas

- 3.5. Gavęs patikrinimo rezultatus, ESRV sekretoriatas pateikia ESRV bendrajai valdybai tvirtinti pasiūlymą dėl tolesnių veiksmų kartu su preliminariu naudos ir sąnaudų įvertinimu. Bendroji valdyba nusprendžia, ar atlikti *ad hoc* tyrimą, kuriame gali prireikti atskaitingųjų agentų dalyvavimo. Bendrosios valdybos sprendime, kuriuo patvirtinamas toks prašymas, pirmiausia gali būti nustatyta: a) prašomos informacijos išsamumas instituciniu ir vienetų lygiu, b) taikytina konfidencialumo tvarka, ypač kam bus leidžiama susipažinti su kokiais duomenimis ir kaip duomenys bus saugomi ir perduodami, c) informacijos pateikimo terminai.
- 3.6. Kai *ad hoc* tyrimą atlieka viena iš EPI, ESRV sekretoriatas tiesiogiai susisiečia su atitinkama EPI. Duomenys gali būti teikiami per ECB, visapusiškai laikantis Reglamento (ES) Nr. 1092/2010 ⁽¹⁾ 8 straipsnio.
- 3.7. Kai *ad hoc* tyrimą atlieka ECBS, ESRV sekretoriatas susisiečia su ECB, kuris per kompetentingas nacionalines institucijas, pasinaudodamas atitinkamais ECBS komitetais ir laikydamasis taikomų konfidencialumo apribojimų, inicijuoja susisiekimą su potencialiais atskaitingaisiais agentais.
- 3.8. Užbaigus kiekvieną *ad hoc* tyrimą, šalys pasidalina informacija apie tyrimo vykdymą, o ypač apie taikytą metodiką bei kokybės patikrinimus, taip pat apie patirtus sunkumus, kad pagerintų būsimų tyrimų veiksmingumą ir efektyvumą.

⁽¹⁾ 2010 m. lapkričio 24 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 1092/2010 dėl Europos Sąjungos finansų sistemos makrolygio rizikos ribojimo priežiūros ir Europos sisteminės rizikos valdybos įsteigimo (OL L 331, 2010 12 15, p. 1).