

Šis tekstas yra skirtas tik informacijai ir teisinės galios neturi. Europos Sąjungos institucijos nėra teisiškai atsakingos už jo turinį. Autentiškos atitinkamų teisės aktų, įskaitant jų preambules, versijos skelbiamos Europos Sąjungos oficialiajame leidinyje ir pateikiamos svetainėje „EUR-Lex“. Oficialūs tekstai tiesiogiai prieinami naudojantis šiuo dokumente pateikiamomis nuorodomis

► **B** KOMISIJOS DELEGUOTASIS REGLAMENTAS (ES) Nr. 1222/2014

2014 m. spalio 8 d.

kuriuo papildomos Europos Parlamento ir Tarybos direktyvos 2013/36/ES nuostatos dėl metodikos, skirtos pasaulinės sisteminės svarbos įstaigoms nustatyti ir pasaulinės sisteminės svarbos įstaigų pakategorėms apibrėžti, nustatymo techninių reguliavimo standartų

(Tekstas svarbus EEE)

(OL L 330, 2014 11 15, p. 27)

iš dalies keičiamas:

		Oficialusis leidinys		
		Nr.	puslapis	data
► <u>M1</u>	2016 m. gegužės 17 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2016/1608	L 240	1	2016 9 8
► <u>M2</u>	2021 m. vasario 11 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2021/539	L 108	10	2021 3 29

▼B**KOMISIJOS DELEGUOTASIS REGLAMENTAS (ES)
Nr. 1222/2014**

2014 m. spalio 8 d.

kuriu papildomos Europos Parlamento ir Tarybos direktyvos 2013/36/ES nuostatos dėl metodikos, skirtos pasaulinės sisteminės svarbos įstaigoms nustatyti ir pasaulinės sisteminės svarbos įstaigų pakategorėms apibrėžti, nustatymo techninių reguliavimo standartų

(Tekstas svarbus EEE)

*1 straipsnis***Dalykas ir taikymo sritis**

Šiuo reglamentu nustatoma metodika, pagal kurią Direktyvos 2013/36/ES 131 straipsnio 1 dalyje nurodyta valstybės narės valdžios institucija (toliau – atitinkama valdžios institucija) konsoliduotai nustato, kad atitinkamas subjektas yra pasaulinės sisteminės svarbos įstaiga (G-SII), ir G-SII pakategorių apibrėžimo bei G-SII priskyrimo prie šių pakategorių remiantis jų sistetine svarba metodika, taip pat, kaip metodikos dalis, apibrėžiami nustatymui taikomi terminai ir naudojami duomenys.

*2 straipsnis***Apibrėžtys**

Šiame reglamente vartojamos šios apibrėžtys:

▼M2

- (1) atitinkamas subjektas – grupė, kuriai vadovauja ES patronuojančioji įstaiga, ES patronuojančioji finansų kontroliuojančioji bendrovė arba ES patronuojančioji mišrią veiklą vykdanči finansų kontroliuojančioji bendrovė, arba įstaiga, kuri nėra ES patronuojančiosios įstaigos, ES patronuojančiosios finansų kontroliuojančiosios bendrovės arba ES patronuojančiosios mišrią veiklą vykdančios finansų kontroliuojančiosios bendrovės patronuojamoji įmonė;

▼B

- (2) rodiklio vertė – kiekvieno 6 straipsnyje nustatyto rodiklio ir kiekvieno atitinkamo imties subjekto atskira rodiklio vertė ir kiekvieno banko, gavusio veiklos leidimą trečiojoje šalyje, palyginama atskira vertė, viešai paskelbta pagal tarptautiniu mastu sutartus standartus;
- (3) daliklis – kiekvieno rodiklio bendra atitinkamų imties subjektų ir bankų, gavusių veiklos leidimą trečiojoje šalyje, rodiklio verčių suma;
- (4) ribinis balas – balo vertė, kuria remiantis nustatoma žemiausia riba ir ribos tarp penkių pakategorių, kaip apibrėžta Direktyvos 2013/36/ES 131 straipsnio 9 dalyje.

▼B*3 straipsnis***Bendri metodikos parametrai**

1. EBI, atsižvelgdama į tarptautiniu mastu sutartus standartus, visų pirma į Bazelio bankų priežiūros komiteto naudojamą imtį pasaulinės sisteminės svarbos bankams nustatyti, nustato įstaigų ar grupių, kurių rodiklių vertės apskaičiuojant balus turi būti naudojamos kaip pasaulio bankų sektorių atspindinčios orientacinės vertės, imtį ir iki kiekvienų metų liepos 31 d. praneša atitinkamoms valdžios institucijoms apie į imtį įtrauktus atitinkamus subjektus.

Šią imtį sudaro atitinkami subjektai ir bankai, gavę veiklos leidimą trečiojoje šalyje; į ją, remiantis bendra pozicijos suma, kaip apibrėžta 6 straipsnio 1 dalyje, įtraukiami 75 didžiausi subjektai, taip pat atitinkami subjektai, kurie buvo nustatyti kaip G-SII, ir trečiojoje šalyje veikiantys bankai, kurie praėjusiais metais buvo nustatyti kaip pasaulinės sisteminės svarbos bankai.

EBI, atsižvelgdama į tarptautiniu mastu sutartus standartus, įskaitant Bazelio bankų priežiūros komiteto naudojamą imtį, pašalina iš imties arba į ją įtraukia atitinkamus subjektus arba bankus, gavusius veiklos leidimą trečiojoje šalyje, jeigu ir tiek, kiek būtina siekiant užtikrinti tinkamą sisteminės svarbos įvertinimo atskaitos sistemą, atspindinčią pasaulines finansų rinkas ir pasaulio ekonomiką.

▼M2

2. Atitinkama valdžios institucija ne vėliau kaip iki kiekvienų metų liepos 31 d. praneša EBI kiekvieno atitinkamo subjekto, kurio bendras pozicijų matas, apskaičiuotas pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 575/2013 ⁽¹⁾ 429 straipsnio 4 dalį, yra didesnis kaip 200 mlrd. EUR ir kuris yra gavęs veiklos leidimą jos jurisdikcijoje, rodiklių vertes. Rodiklių vertes atitinkama valdžios institucija renka atsižvelgdama į papildomas pagrindinių duomenų specifikacijas, nustatytas bet kuriose EBI gairėse, parengtose pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 1093/2010 ⁽²⁾ 16 straipsnį. Atitinkama valdžios institucija užtikrina, kad rodiklių vertės būtų tokios pačios, kokios pateiktos Bazelio bankų priežiūros komitetui.

▼B

3. EBI, remdamasi rodiklių vertėmis, kurias atitinkama valdžios institucija pranešė pagal šio straipsnio 2 dalį, ir atsižvelgdama į tarptautiniu mastu sutartus standartus, visų pirma į Bazelio bankų priežiūros komiteto paskelbtus tų metų daliklius, apskaičiuoja daliklius ir juos praneša

⁽¹⁾ 2013 m. birželio 26 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 575/2013 dėl prudencinių reikalavimų kredito įstaigoms ir investicinėms įmonėms ir kuriuo iš dalies keičiamas Reglamentas (ES) Nr. 648/2012 (OL L 176, 2013 6 27, p. 1).

⁽²⁾ 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).

▼ B

atitinkamoms valdžios institucijoms. Rodiklio daliklis yra bendra visų atitinkamų imties subjektų ir bankų, gavusių veiklos leidimą trečiojoje šalyje, rodiklių verčių, apie kurias, kalbant apie atitinkamus subjektus, pranešta pagal 2 dalį ir kurias veiklos leidimą trečiojoje šalyje gavę bankai paskelbė atitinkamų metų liepos 31 d., suma.

▼ M2*4 straipsnis***Nustatymo procedūra**

1. Atitinkama valdžios institucija ne vėliau kaip iki kiekvienų metų rugsėjo 1 d. apskaičiuoja atitinkamų jos jurisdikcijoje veiklos leidimą gavusių subjektų, įtrauktų į EBI praneštą imtį, balus.

2. Jei atitinkama valdžios institucija, vadovaudamasi patikimu priežiūriniu sprendimu, atitinkamai pagal Direktyvos 2013/36/ES 131 straipsnio 10 dalies a arba b punktą perkelia G-SII iš žemesnės pakategorės į aukštesnę pakategorę arba nustato, kad atitinkamas subjektas yra G-SII, ji ne vėliau kaip kiekvienų metų lapkričio 1 d. pateikia EBI išsamų rašytinį pareiškimą, kuriame paaiškina savo įvertinimo priežastis.

3. Jei atitinkama valdžios institucija, vadovaudamasi patikimu priežiūriniu sprendimu, pagal Direktyvos 2013/36/ES 131 straipsnio 10 dalies c punktą perkelia G-SII iš aukštesnės pakategorės į žemesnę pakategorę, ji ne vėliau kaip kiekvienų metų rugsėjo 30 d. pateikia EBI išsamų rašytinį pareiškimą, kuriame paaiškina savo įvertinimo priežastis.

4. 2 dalyje nurodytas perkėlimas ar nustatymas įsigalioja antrųjų metų, einančių po kalendorinių metų, kuriais pagal 3 straipsnio 3 dalį atitinkamoms valdžios institucijoms buvo pranešti dalikliai, sausio 1 d. Jeigu G-SII priskiriama prie žemesnės pakategorės nei praėjusių metų nustatymo procese, mažesnis G-SII rezervo reikalavimas įsigalioja metų, einančių po to perkėlimo, sausio 1 d., nebent atitinkama valdžios institucija, vadovaudamasi patikimu priežiūriniu sprendimu, atideda to reikalavimo taikymą iki datos, nurodytos šios dalies pirmame sakinyje.

5. Nustačiusi, kad atitinkamas subjektas yra G-SII, atitinkama valdžios institucija nurodo visų juridinių subjektų, įtrauktų į pradžios G-SII konsolidavimą, juridinio asmens identifikatorius (LEI). Atitinkamos valdžios institucijos nustatytas atitinkamas subjektas iki metų, einančių po nustatymo proceso metų, kovo 1 d. atitinkamai valdžios institucijai atskleidžia savo grupės struktūrą pateikdamas visų konsoliduotų grupės subjektų LEI, kai jie yra. Atitinkamas subjektas užtikrina, kad jo grupės struktūra, atskleista naudojant pasaulinę LEI duomenų bazę, būtų nuolat atnaujinama.

▼ B*5 straipsnis***G-SII nustatymas, balų nustatymas ir priskyrimas prie pakategorių**

1. Rodiklių vertės konsoliduotai grindžiamos atitinkamo subjekto praėjusių finansinių metų pabaigos praneštais duomenimis, o kalbant apie trečiojoje šalyje veiklos leidimus gavusius bankus – pagal tarptautiniu mastu sutartus standartus paskelbtais duomenimis. Atitinkamos valdžios institucijos gali naudotis atitinkamų subjektų, kurių finansiniai metai baigiasi birželio 30 d., rodiklių vertėmis, remdamosi jų pozicija gruodžio 31 d.

▼ M2

1a. Nukrypstant nuo 1 dalies, 6 straipsnio 1 dalyje, 6 straipsnio 2 dalies a, b ir c punktuose ir 6 straipsnio 4 dalies a ir b punktuose nurodytos rodiklių vertės taip pat apima draudimo patronuojamąsias įmones.

2. Atitinkama valdžios institucija nustato kiekvieno atitinkamo imties subjekto balą, kuris skaičiuojamas kaip paprastas kategorijos balų vidurkis, atsižvelgiant į didžiausią 500 bazinių punktų kategorijos balą, skiriamą kategorijai, kuria įvertinamas pakeičiamumas.

Kiekvienas kategorijos balas, išskyrus kategoriją, kuria remiantis įvertinamas grupės teikiamų paslaugų ir finansinės infrastruktūros pakeičiamumas, apskaičiuojamas kaip paprastas verčių, gautų padalijus kiekvieną tos kategorijos rodiklio vertę iš EBI pranešto rodiklio daliklio, vidurkis.

Kategorijos, kuria remiantis įvertinamas grupės teikiamų paslaugų ir finansinės infrastruktūros pakeičiamumas, balas apskaičiuojamas kaip tos kategorijos rodiklių verčių svertinis vidurkis. Tuo tikslu saugomo turto, nurodyto 6 straipsnio 3 dalies a punkte, ir mokėjimo veiklos, nurodytos 6 straipsnio 3 dalies b punkte, rodikliai įvertinami taikant 100 % koeficientą, o garantuotų sandorių skolos ir nuosavybės vertybinių popierių rinkose, nurodytų 6 straipsnio 3 dalies c punkte, ir prekybos apimties, nurodytos 6 straipsnio 3 dalies d punkte, rodikliai įvertinami taikant 50 % koeficientą.

Balai išreiškiami baziniais punktais ir suapvalinami iki artimiausio sveikojo bazinio punkto.

▼ B

3. Žemiausias ribinis balas yra 130 bazinių punktų. Nustatomos tokios pakategorės:

a) 1 pakategorė, kurią sudaro balai nuo 130 iki 229 bazinių punktų;

b) 2 pakategorė, kurią sudaro balai nuo 230 iki 329 bazinių punktų;

c) 3 pakategorė, kurią sudaro balai nuo 330 iki 429 bazinių punktų;

▼ B

d) 4 pakategorė, kurią sudaro balai nuo 430 iki 529 bazinių punktų;

e) 5 pakategorė, kurią sudaro balai nuo 530 iki 629 bazinių punktų.

4. Atitinkama valdžios institucija nustato, kad atitinkamas subjektas yra G-SII, jeigu to subjekto balas yra lygus mažiausiam ribiniam balui arba už jį didesnis. Sprendimas nustatyti, kad atitinkamas subjektas yra G-SII, vadovaujantis patikimu priežiūriniu sprendimu pagal Direktyvos 2013/36/ES 131 straipsnio 10 dalies b punktą grindžiamas vertinimu, ar jo įsipareigojimų nevykdymas padarytų didelį neigiamą poveikį pasaulinei finansų rinkai ir pasaulio ekonomikai.

5. Atitinkama valdžios institucija priskiria G-SII prie pakategorės pagal jos balą. Sprendimas perkelti G-SII iš žemesnės pakategorės į aukštesnę pakategorę vadovaujantis patikimu priežiūriniu sprendimu pagal Direktyvos 2013/36/ES 131 straipsnio 10 dalies b punktą grindžiamas vertinimu, ar jos įsipareigojimų nevykdymas padarytų didelį neigiamą poveikį pasaulinei finansų rinkai ir pasaulio ekonomikai.

▼ M2

5a. Kiekvienam atitinkamam subjektui, vykdančiam tarpvalstybinę veiklą dalyvaujančiose valstybėse narėse, nurodytose Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 806/2014 ⁽¹⁾ 4 straipsnio 1 dalyje, atitinkama valdžios institucija nustato papildomą bendrą balą laikydama šio straipsnio 2 dalyje nustatytos tvarkos, tačiau 6 straipsnio 5 dalies a ir b punktuose nurodytas atitinkamo subjekto rodiklių vertes pakeičia pagal šios dalies antrą pastraipą apskaičiuotomis vertėmis, o atitinkamus daliklius pakeičia EBI pateiktais persvarstytais dalikliais.

Taikydama pirmą pastraipą atitinkama valdžios institucija visus reikalavimus ir įsipareigojimus sandorio šalių, įsteigtų Reglamento (ES) Nr. 806/2014 4 straipsnio 1 dalyje nurodytose dalyvaujančiose valstybėse narėse, atžvilgiu, vertina kaip vidinius. Direktyvos 2013/36/ES 131 straipsnio 2 dalies a–d punktuose nurodytoms kategorijoms atitinkama valdžios institucija naudoja tas pačias nepakeistas atitinkamo subjekto praneštas rodiklių vertes ir EBI praneštus daugiklius.

5b. Remiantis papildomu bendru balu, nurodytu 5a dalyje, priimtas sprendimas perkelti G-SII iš aukštesnės pakategorės į žemesnę pakategorę vadovaujantis patikimu priežiūriniu sprendimu pagal Direktyvos 2013/36/ES 131 straipsnio 10 dalies c punktą yra grindžiamas vertinimu, ar G-SII įsipareigojimų nevykdymas padarytų mažesnę neigiamą

⁽¹⁾ 2014 m. liepos 15 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 806/2014, kuriuo nustatomos kredito įstaigų ir tam tikrų investicinių įmonių pertvarkymo vienodos taisyklės ir vienoda procedūra, kiek tai susiję su bendru pertvarkymo mechanizmu ir Bendru pertvarkymo fondu, ir iš dalies keičiamas Reglamentas (ES) Nr. 1093/2010 (OL L 225, 2014 7 30, p. 1).

▼ M2

poveikį pasaulinei finansų rinkai ir pasaulio ekonomikai. Atliekant tą vertinimą, kai tinkama, atsižvelgiama į visas BBPK nuomones ar išlygas, pateiktas pagal jo viešai prieinamą pasaulinės sisteminės svarbos bankų sisteminės svarbos vertinimo metodiką.

5a dalyje nurodytas papildomas bendras balas gali būti atitinkamos valdžios institucijos sprendimo perkelti G-SII į artimiausią žemesnę pakategorę, kaip nurodyta šio straipsnio 3 dalyje, priežastis. Žemesnė pakategorė, į kurią galima perkelti G-SII, gali būti žemesnė ne daugiau kaip vienu lygmeniu.

6. 4, 5 ir 5b dalyse nurodyti sprendimai pagrindžiami papildomais rodikliais, bet tai nėra rodikliai, rodantys atitinkamo subjekto įsipareigojimų neįvykdymo tikimybę. Tokie sprendimai grindžiami tinkamai dokumentuota ir patikrinama kiekybine ir kokybine informacija.

▼ M1*6 straipsnis***Rodikliai**

1. Kategoriją, kuria remiantis įvertinamas grupės dydis, sudaro vienas rodiklis – bendra grupės pozicijos suma.

2. Kategoriją, kuria remiantis įvertinamas grupės ir finansų sistemos tarpusavio susietumas, sudaro visi toliau išvardyti rodikliai:

a) finansų sistemos vidaus turtas;

b) finansų sistemos vidaus įsipareigojimai;

c) išleisti vertybiniai popieriai.

3. Kategoriją, kuria remiantis įvertinamas grupės teikiamų paslaugų arba finansų infrastruktūros pakeičiamumas, sudaro visi toliau išvardyti rodikliai:

a) saugojamas turtas;

b) mokėjimo veikla;

c) garantuoti sandoriai skolos ir nuosavybės vertybinių popierių rinkose;

▼ M2

d) prekybos apimtis.

▼ **M1**

4. Kategoriją, kuria remiantis įvertinamas grupės sudėtingumas, sudaro visi toliau išvardyti rodikliai:

- a) ne biržos išvestinių finansinių priemonių nominalioji suma;
- b) į tikrosios vertės, nustatytos pagal Deleguotąjį reglamentą (ES) Nr. 1255/2012 ⁽¹⁾, 3 lygį įtrauktas turtas;
- c) prekybos ir parduoti laikomi vertybiniai popieriai.

5. Kategoriją, kuria remiantis įvertinama grupės vykdoma tarpvalstybinė veikla, sudaro toliau išvardyti rodikliai:

- a) kelioms jurisdikcijoms teikiami reikalavimai;
- b) kelioms jurisdikcijoms priklausantys įsipareigojimai.

6. Jei duomenys pateikiami kitomis valiutomis nei euro, atitinkama valdžios institucija, atsižvelgdama į Europos Centrinio Banko paskelbtą gruodžio 31 d. taikomą orientacinį valiutos keitimo kursą ir į tarptautinius standartus, taiko atitinkamą keitimo kursą. Dėl 3 dalies b punkte nurodyto mokėjimo veiklos rodiklio atitinkama valdžios institucija taiko vidutinį atitinkamų metų valiutos keitimo kursą.

▼ **M2**▼ **B**

8 straipsnis

Įsigaliojimas

Šis reglamentas įsigalioja dvidešimtą dieną po jo paskelbimo *Europos Sąjungos oficialiajame leidinyje*.

Jis taikomas nuo 2015 m. sausio 1 d.

Šis reglamentas privalomas visas ir tiesiogiai taikomas visose valstybėse narėse.

▼ **M1**

⁽¹⁾ 2012 m. gruodžio 11 d. Komisijos reglamentas (ES) Nr. 1255/2012, kuriuo dėl 12-ojo tarptautinio apskaitos standarto, 1-ojo ir 13-ojo tarptautinių finansinės atskaitomybės standartų ir Tarptautinio finansinės atskaitomybės aiškinimo komiteto 20-ojo aiškinimo iš dalies keičiamas Reglamentas (EB) Nr. 1126/2008, priimantis tam tikrus tarptautinius apskaitos standartus pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (EB) Nr. 1606/2002 (OL L 360, 2012 12 29, p. 78).