

II

(Nelegislatīvi akti)

REGULAS

KOMISIJAS DELEĢĒTĀ REGULA (ES) 2016/1608

(2016. gada 17. maijs),

ar ko groza Deleģēto regulu (ES) Nr. 1222/2014 attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par metožu noteikšanu globāli sistēmiski nozīmīgu iestāžu identificēšanai un par globāli sistēmiski nozīmīgu iestāžu apakškategoriju definēšanu

(Dokuments attiecas uz EEZ)

EIROPAS KOMISIJA,

ņemot vērā Līgumu par Eiropas Savienības darbību,

ņemot vērā Eiropas Parlamenta un Padomes 2013. gada 26. jūnija Direktīvu 2013/36/ES par piekļuvi kredītiestāžu darbībai un kredītiestāžu un ieguldījumu brokeru sabiedrību prudenciālo uzraudzību, ar ko groza Direktīvu 2002/87/EK un atceļ Direktīvas 2006/48/EK un 2006/49/EK ⁽¹⁾, un jo īpaši tās 131. panta 18. punktu,

tā kā:

- (1) Komisijas Deleģētajā regulā (ES) Nr. 1222/2014 ⁽²⁾ noteikta metodoloģija tādu globāli sistēmiski nozīmīgu iestāžu (G-SNI) identificēšanai, kas minētas Direktīvā 2013/36/ES. Deleģētajā regulā (ES) Nr. 1222/2014 konkrēti paredzēti kvantitatīvi nosakāmi rādītāji, kas veido piecas bankas sistēmiskā nozīmīguma kategorijas, kā noteikts Direktīvā 2013/36/ES. Deleģētās regulas (ES) Nr. 1222/2014 pielikumā ir iekļautas sīki izstrādātas rādītāju vērtību tehniskās specifikācijas.
- (2) Deleģētajā regulā (ES) Nr. 1222/2014 ņemti vērā Bāzeles Banku uzraudzības komitejas (BCBS) izstrādātie starptautiskie standarti par metodoloģiju, kas vajadzīga, lai novērtētu globāli sistēmiski nozīmīgas bankas, un par prasību par augstāku zaudējumu absorbēšanas spēju, tostarp tehniskās specifikācijas attiecībā uz rādītājiem, ko izmanto, lai identificētu globāli sistēmiski nozīmīgas bankas.
- (3) BCBS metodoloģija, ko izmanto, lai novērtētu globāli sistēmiski nozīmīgas bankas, un ko izmanto attiecībā uz prasību par augstāku zaudējumu absorbēšanas spēju, tiek regulāri atjaunināta. Pamatojoties uz 2015. gada beigu datiem, BCBS nesen publicēja nedaudz pārskatītu pārskatu sniegšanas veidni un pārskatu sniegšanas norādījumus datu vākšanai par 2016. gadu. Tiek sagaidīts, ka būs turpmāki atjauninājumi.
- (4) Lai atspoguļotu notiekošās pārmaiņas globālajā banku sistēmā un pēc iespējas samazinātu administratīvo slogu iestādēm, ir svarīgi nodrošināt, lai rādītāju vērtības tiktu noteiktas atbilstoši starptautiski atzītajiem standartiem, kurus noteikusi BCBS. Tāpēc attiecīgajām valstu iestādēm būtu jānodrošina, lai to kvantificējamo rādītāju vērtības, kas paredzēti Deleģētajā regulā (ES) Nr. 1222/2014, tiktu noteiktas atbilstoši piemērojamajai datu kopai, ko paredzējusi BCBS.

⁽¹⁾ OV L 176, 27.6.2013., 338. lpp.

⁽²⁾ Komisijas 2014. gada 8. oktobra Deleģētā regula (ES) Nr. 1222/2014, ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvu 2013/36/ES attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par metožu noteikšanu globāli sistēmiski nozīmīgu iestāžu identificēšanai un par globāli sistēmiski nozīmīgu iestāžu apakškategoriju definēšanu (OV L 330, 15.11.2014., 27. lpp.).

- (5) Lai nodrošinātu saskanību ar atjaunināto metodoloģiju, ko izmanto BCBS, Deleģētās regulas (ES) Nr. 1222/2014 5. panta 6. punktā būtu jāparedz, ka lēmumus, kas minēti 5. panta 4. un 5. punktā, var pamatot ar "papildu datiem", nevis "papildu rādītājiem".
- (6) Lai nodrošinātu, ka to rādītāju vērtības, kas paredzēti Deleģētajā regulā (ES) Nr. 1222/2014, tiek noteiktas atbilstoši atjauninātajām specifikācijām, kuras piemēro BCBS, būtu jāsvītro Deleģētās regulas (ES) Nr. 1222/2014 pielikums.
- (7) Tāpēc būtu attiecīgi jāgroza Deleģētā regula (ES) Nr. 1222/2014.
- (8) Ņemot vērā to, ka datu vākšana 2016. gada identifikācijas procesam tika sākta 2016. gada pirmajā ceturksnī un iestādēm nepieciešama skaidrība par to, kādi dati jāatklāj, šai regulai būtu jāstājas spēkā nekavējoties.
- (9) Šī regula pamatojas uz regulatīvo tehnisko standartu projektu, ko Komisijai ir iesniegusi Eiropas Banku iestāde (EBI).
- (10) EBI ir veikusi atklātu sabiedrisko apspriešanu par regulatīvo tehnisko standartu projektu, uz ko pamatojas šī regula, analizējusi potenciālās saistītās izmaksas un ieguvumus un pieprasījusi atzinumu no Banku nozares ieinteresēto personu grupas, kas izveidota saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 1093/2010 ⁽¹⁾ 37. pantu,

IR PIEŅĒMUSI ŠO REGULU.

1. pants

Deleģēto regulu (ES) Nr. 1222/2014 groza šādi:

- 1) regulas 5. panta 6. punktu aizstāj ar šādu:

"6. Lēmumus, kas minēti 4. un 5. punktā, var pamatot arī ar papildu datiem, kas nav attiecīgās sabiedrības maksāt-nespējas iespējamības rādītāji. Šajos lēmumos iekļauj labi dokumentētu un pārbaudāmu kvantitatīvo un kvalitatīvo informāciju."

- 2) regulas 6. pantu aizstāj ar šādu:

"6. pants

Rādītāji

1. Kategoriju, kura raksturo grupas lielumu, veido viens rādītājs, kurš ir vienāds ar grupas kopējo riska darījumu apjomu.
2. Kategoriju, kura raksturo grupas saisti ar finanšu sistēmu, veido visi turpmāk minētie rādītāji:
 - a) aktīvi finanšu sistēmas ietvaros;
 - b) saistības finanšu sistēmas ietvaros;
 - c) apgrozībā esošie vērtspapīri.
3. Kategoriju, kura raksturo grupas sniegto pakalpojumu vai finanšu infrastruktūras aizvietojamību, veido visi turpmāk minētie rādītāji:
 - a) glabāšanā esošie aktīvi;

⁽¹⁾ Eiropas Parlamenta un Padomes 2010. gada 24. novembra Regula (ES) Nr. 1093/2010, ar ko izveido Eiropas Uzraudzības iestādi (Eiropas Banku iestādi), groza Lēmumu Nr. 716/2009/EK un atceļ Komisijas Lēmumu 2009/78/EK (OV L 331, 15.12.2010., 12. lpp.).

- b) maksājumu darbības;
 - c) sākotnēji izvietotie darījumi parāda un kapitāla tirgos.
4. Kategoriju, kura raksturo grupas sarežģītību, veido visi turpmāk minētie rādītāji:
- a) OTC atvasināto instrumentu nosacītā summa;
 - b) 3. līmenī iekļautie aktīvi patiesajā vērtībā, ko nosaka saskaņā ar Komisijas Regulu (ES) Nr. 1255/2012 (*);
 - c) tirdzniecības nolūkā turēti un pārdošanai pieejami vērtspapīri.
5. Kategoriju, kas raksturo grupas pārrobežu darbības, veido turpmāk minētie rādītāji:
- a) pārfurisdikciju prasījumi;
 - b) pārfurisdikciju saistības.
6. Attiecībā uz datiem, kas paziņoti citās valūtās, nevis euro, attiecīgā iestāde izmanto atbilstošu maiņas kursu, ņemot vērā Eiropas Centrālā bankas publicēto 31. decembrī piemērojamo atsauces maiņas kursu un starptautiskos standartus. Attiecībā uz 3. punkta b) apakšpunktā minēto maksājumu darbību rādītāju attiecīgā iestāde izmanto attiecīgā gada vidējos maiņas kursus.

(*) Komisijas 2012. gada 11. decembra Regula (ES) Nr. 1255/2012, ar kuru groza Regulu (EK) Nr. 1126/2008, ar ko pieņem vairākus starptautiskos grāmatvedības standartus saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (EK) Nr. 1606/2002, attiecībā uz 12. starptautisko grāmatvedības standartu, 1. un 13. starptautisko finanšu pārskatu standartu un Starptautisko finanšu pārskatu interpretācijas komitejas 20. interpretāciju (OV L 360, 29.12.2012., 78. lpp.).”;

- 3) regulas 7. panta pēdējo teikumu svītro;
- 4) pielikumu svītro.

2. pants

Stāšanās spēkā

Šī regula stājas spēkā nākamajā dienā pēc tās publicēšanas Eiropas Savienības Oficiālajā Vēstnesī.

Šī regula uzliek saistības kopumā un ir tieši piemērojama visās dalībvalstīs.

Briselē, 2016. gada 17. maijā

Komisijas vārdā –
priekšsēdētājs
Jean-Claude JUNCKER