

Šis dokuments ir tikai informatīvs, un tam nav juridiska spēka. Eiropas Savienības iestādes neatbild par tā saturu. Attiecīgo tiesību aktu un to preambulu autentiskās versijas ir publicētas Eiropas Savienības “Oficiālajā Vēstnesī” un ir pieejamas datubāzē “Eur-Lex”. Šie oficiāli spēkā esošie dokumenti ir tieši pieejami, noklikšķinot uz šajā dokumentā iegultajām saitēm

► **B****KOMISIJAS DELEĢĒTĀ REGULA (ES) Nr. 1222/2014**

(2014. gada 8. oktobris),

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

(Dokuments attiecas uz EEZ)

(OV L 330, 15.11.2014., 27. lpp.)

Grozīta ar:

Oficiālais Vēstnesis

		Nr.	Lappuse	Datums
► <u>M1</u>	Komisijas Deleģētā regula (ES) 2016/1608 (2016. gada 17. maijs)	L 240	1	8.9.2016.
► <u>M2</u>	Komisijas Deleģētā regula (ES) 2021/539 (2021. gada 11. februāris)	L 108	10	29.3.2021.

▼B**KOMISIJAS DELEĢĒTĀ REGULA (ES) Nr. 1222/2014**

(2014. gada 8. oktobris),

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 apakšskategoriju definēšanu

(Dokuments attiecas uz EEZ)

*1. pants***Priekšmets un darbības joma**

Šajā regulā ir precizēta metodoloģija, saskaņā ar kuru Direktīvas 2013/36/ES 131. panta 1. punktā minētā dalībvalsts iestāde (turpmāk "attiecīgā iestāde") konsolidēti identificē attiecīgu sabiedrību kā globāli sistēmiski nozīmīgu finanšu iestādi (G-SNI), metodoloģija globāli sistēmiski nozīmīgu iestāžu apakšskategoriju definēšanai un G-SNI iedalīšanai šajās apakšskategorijās, pamatojoties uz to sistēmisko nozīmīgumu, un – kā daļa no metodoloģijas – laika grafiki un identificēšanai izmantotie dati.

*2. pants***Definīcijas**

Šajā regulā piemēro šādas definīcijas:

▼M2

- 1) "attiecīgā sabiedrība" ir grupa, ko vada ES mātes iestāde vai ES mātes finanšu pārvaldītājsabiedrība, vai ES mātes jaukta finanšu pārvaldītājsabiedrība, vai iestāde, kas nav ES mātes iestādes, ES mātes finanšu pārvaldītājsabiedrības vai ES mātes jauktas finanšu pārvaldītājsabiedrības meitasuzņēmums;

▼B

- 2) "rādītāja vērtība" ir – attiecībā uz katru 6. pantā izklāstīto rādītāju un katru reprezentatīvas izlases attiecīgo sabiedrību – rādītāja individuāla vērtība un – attiecībā uz katru trešā valstī atļauju saņēmušu banku – salīdzināma individuāla vērtība, kas publiskota atbilstīgi starptautiski pieņemtiem standartiem;
- 3) "saucējs" ir – katram rādītājam – reprezentatīvās izlases attiecīgo sabiedrību un banku, kas saņēmušas atļauju trešās valstīs, rādītāja vērtību kopsumma;
- 4) "robežvērtējums" ir vērtējuma vērtība, kura nosaka zemāko robežšķirtni un robežšķirtnes starp piecām apakšskategorijām, kā definēts Direktīvas 2013/36/ES 131. panta 9. punktā.

▼B

3. pants

Metodoloģijas kopējie parametri

1. Reprezentatīvo izlasi, kas sastāv no iestādēm vai grupām, kuru rādītāju vērtības ir jāizmanto kā pasaules banku nozares atsaucē vērtības vērtējumu rezultātu aprēķināšanai, EBI nosaka, ņemot vērā starptautiski pieņemtos standartus, – jo īpaši izlasi, kuru izmanto Bāzeles Banku uzraudzības komiteja globāli sistēmiski nozīmīgu banku identificēšanai, – un ik gadu līdz 31. jūlijam informē attiecīgās iestādes par to, kādas attiecīgās sabiedrības iekļautas reprezentatīvajā izlasē.

Reprezentatīvā izlase sastāv no attiecīgām sabiedrībām un trešās valstīs atļauju saņēmušām bankām un aptver 75 lielākās no tām, pamatojoties uz kopējo riska darījumu apjomu, kā definēts 6. panta 1. punktā, kā arī attiecīgām sabiedrībām, kas tikušas identificētas kā globāli sistēmiski nozīmīgas iestādes, un trešo valstu bankām, kas tikušas identificētas kā globāli sistēmiski nozīmīgas bankas iepriekšējā gadā.

EBI izslēdz no reprezentatīvās izlases vai pievieno tai attiecīgas sabiedrības vai trešās valstīs atļauju saņēmušas bankas, ja un ciktāl tas ir nepieciešams, lai nodrošinātu atbilstošu atsaucē sistēmu, kas ļautu novērtēt sistēmisko nozīmīgumu un atspoguļotu pasaules finanšu tirgus un pasaules ekonomiku, ņemot vērā starptautiski pieņemtos standartus, tostarp reprezentatīvo izlasi, kuru izmanto Bāzeles Banku uzraudzības komiteja.

▼M2

2. Attiecīgā iestāde katru gadu ne vēlāk kā 31. jūlijā paziņo EBI rādītāju vērtības par katru attiecīgo sabiedrību, kuras kopējās riska darījumu vērtības mērs, kas aprēķināts saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 575/2013 ⁽¹⁾ 429. panta 4. punktu, pārsniedz 200 miljardus euro un kura ir saņēmusi atļauju tās jurisdikcijā. Attiecīgā iestāde rādītāju vērtības apkopo, ņemot vērā papildu specifikācijas attiecībā uz pamatā esošajiem datiem, kuras sniegtas pamatnostādnēs, ko EBI izstrādājusi saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 1093/2010 ⁽²⁾ 16. pantu. Attiecīgā iestāde nodrošina, ka rādītāju vērtības ir identiskas tām, kuras iesniedz Bāzeles Banku uzraudzības komitejai.

▼B

3. EBI aprēķina saucējus, pamatojoties uz attiecīgo iestāžu atbilstīgi 2. punktam paziņotajām rādītāju vērtībām, ņemot vērā starptautiski pieņemtos standartus – jo īpaši Bāzeles Banku uzraudzības komitejas publicētos saucējus par attiecīgo gadu –, un paziņo tos attiecīgajām iestādēm. Rādītāja saucējs ir kopējā summa, ko veido visu reprezentatīvajā izlasē ietilpstošo attiecīgu sabiedrību un trešās valstīs atļauju saņēmušu banku rādītāja vērtības, kas paziņotas par attiecīgajām sabiedrībām saskaņā ar 2. punktu un ko atklājušas trešās valstīs atļauju saņēmušas bankas attiecīgā gada 31. jūlijā.

⁽¹⁾ Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) Nr. 575/2013 (2013. gada 26. jūnijs) par prudenciālajām prasībām attiecībā uz kredītiestādēm un ieguldījumu brokeru sabiedrībām, un ar ko groza Regulu (ES) Nr. 648/2012 (OV L 176, 27.6.2013., 1. lpp.).

⁽²⁾ Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) Nr. 1093/2010 (2010. gada 24. novembris), 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.).

▼ **M2***4. pants***Identificēšanas procedūra**

1. Attiecīgā iestāde ne vēlāk kā katra gada 1. septembrī aprēķina vērtējuma punktu skaitu par attiecīgajām sabiedrībām, kas iekļautas EBI paziņotajā reprezentatīvajā izlasē un ir saņēmušas atļauju tās juridiskijā.

2. Ja attiecīgā iestāde, īstenojot pārdomātu uzraudzības vērtēšanu, G-SNI no zemākas apakš kategorijas pārklasificē augstākā apakš kategorijā vai attiecīgo sabiedrību norāda kā G-SNI saskaņā ar Direktīvas 2013/36/ES 131. panta 10. punkta attiecīgi a) vai b) apakšpunktu, attiecīgā iestāde ne vēlāk kā katra gada 1. novembrī EBI rakstiskā paziņojumā sīki izklāsta sava novērtējuma pamatojumu.

3. Ja attiecīgā iestāde, īstenojot pārdomātu uzraudzības vērtēšanu, G-SNI no augstākas apakš kategorijas pārklasificē zemākā apakš kategorijā saskaņā ar Direktīvas 2013/36/ES 131. panta 10. punkta c) apakšpunktu, attiecīgā iestāde ne vēlāk kā katra gada 30. septembrī EBI rakstiskā paziņojumā sīki izklāsta sava novērtējuma pamatojumu.

4. Šā panta 2. punktā minētā pārklasifikācija vai norādīšana stājas spēkā tā gada 1. janvārī, kurš ir otrais gads pēc kalendārā gada, kad attiecīgajām iestādēm saskaņā ar 3. panta 3. punktu paziņoti saucēji. Ja G-SNI ir pārklasificēta zemākā apakš kategorijā nekā iepriekšējā gada identificēšanas procedūrā, zemāka G-SNI rezervju prasība stājas spēkā nākamā gada 1. janvārī pēc minētās pārklasifikācijas, ja vien attiecīgā iestāde neīsteno pārdomātu uzraudzības vērtēšanu, lai minētās prasības piemērošanu atliktu līdz šā punkta pirmajā teikumā minētajai dienai.

5. Attiecīgajai iestādei attiecīgās sabiedrības identificējot kā G-SNI, ietver visu to juridisko personu juridiskās personas identifikatorus (*LEI*), kas iekļautas G-SNI prudenciālās konsolidācijas tvērumā. Attiecīgā sabiedrība, ko identificējusi attiecīgā iestāde, attiecīgajai iestādei līdz nākamā gada 1. martam pēc identificēšanas procedūras atklāj savas grupas struktūru, norādot *LEI*, ja tādi ir pieejami, par visām grupas konsolidētajām sabiedrībām. Attiecīgā sabiedrība nodrošina, ka grupas struktūra, kas atklāta, izmantojot globālo *LEI* datubāzi, vienmēr ir atjaunināta.

▼ **B***5. pants***Identificēšana kā G-SNI, vērtējumu noteikšana un iedalīšana apakš kategorijās**

1. Rādītāju vērtību pamatā attiecībā uz attiecīgo sabiedrību ir konsolidēti paziņotie iepriekšējā finanšu gada beigu dati un attiecībā uz trešās valstīs atļauju saņēmušām bankām – saskaņā ar starptautiski pieņemtiem standartiem atklātie dati. Tādām attiecīgajām sabiedrībām, kuru finanšu gada beigas ir 30. jūnijs, attiecīgās iestādes var izmantot rādītāju vērtības, kuru pamatā ir 31. decembra situācija.

▼B

2. Attiecīgā iestāde nosaka katras reprezentatīvajā izlasē iekļautās sabiedrības vērtējuma punktu skaitu kā kategorijas vērtējumu vidējo aritmētisko, turklāt kategorijai, kura raksturo aizstājamību, maksimālais rezultāts ir 500 bāzes punkti. Katras kategorijas vērtējumu aprēķina kā vidējo aritmētisko vērtību, kas rodas, dalot katru attiecīgās kategorijas rādītāja vērtību ar EBI paziņoto rādītāja saucēju. Vērtējumus izsaka bāzes punktos un noapaļo līdz tuvākajam veselajam bāzes punktam.

3. Viszemākais robežvērtējums ir 130 bāzes punkti. Apakškategorijas sadala šādi:

- a) 1. apakškategorija ietver vērtējumu no 130 līdz 229 bāzes punktiem;
- b) 2. apakškategorija ietver vērtējumu no 230 līdz 329 bāzes punktiem;
- c) 3. apakškategorija ietver vērtējumu no 330 līdz 429 bāzes punktiem;
- d) 4. apakškategorija ietver vērtējumu no 430 līdz 529 bāzes punktiem;
- e) 5. apakškategorija ietver vērtējumu no 530 līdz 629 bāzes punktiem.

4. Attiecīgā iestāde identificē attiecīgu sabiedrību kā G-SNI, ja šīs sabiedrības vērtējums ir vienāds ar viszemāko robežvērtējumu vai lielāks par to. Lēmums norādīt attiecīgu sabiedrību kā G-SNI, īstenojot pārdomātu uzraudzības vērtēšanu saskaņā ar Direktīvas 2013/36/ES 131. panta 10. punkta b) apakšpunktu, ir balstīts uz novērtējumu par to, vai tās maksātnespējai būtu ievērojama negatīva ietekme uz pasaules finanšu tirgu un pasaules ekonomiku.

5. Attiecīgā iestāde iedala G-SNI kādā no apakškategorijām atbilstīgi tās vērtējumam. Lēmums iedalīt G-SNI no zemākas apakškategorijas augstākā, īstenojot pārdomātu uzraudzības vērtēšanu saskaņā ar Direktīvas 2013/36/ES 131. panta 10. punkta a) apakšpunktu, ir balstīts uz novērtējumu par to, vai tās maksātnespējai būtu ievērojama negatīva ietekme uz pasaules finanšu tirgu un pasaules ekonomiku.

▼M2

5.a Attiecīgā iestāde nosaka papildu vispārējo vērtējumu katrai attiecīgajai sabiedrībai, kas veic pārrobežu darbības iesaistītajās dalībvalstīs, kuras minētas Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 806/2014⁽¹⁾ 4. panta 1. punktā, ievērojot šā panta 2. punktā noteikto procesu, bet attiecīgās sabiedrības rādītāju vērtības, kas minētas 6. panta 5. punkta a) un b) apakšpunktā, aizstājot ar vērtībām, kuras aprēķinātas saskaņā ar šā punkta otro daļu, un attiecīgos saucējus aizstājot ar pārskatītajiem saucējiem, kurus nodrošina EBI.

⁽¹⁾ Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) Nr. 806/2014 (2014. gada 15. jūlijs), ar ko izveido vienādus noteikumus un vienotu procedūru kredītiestāžu un noteiktu ieguldījumu brokeru sabiedrību noregulējumam, izmantojot vienotu noregulējuma mehānismu un vienotu noregulējuma fondu, un groza Regulu (ES) Nr. 1093/2010 (OV L 225, 30.7.2014., 1. lpp.).

▼ M2

Piemērojot pirmo daļu, attiecīgā iestāde par iekšzemes prasījumiem uzskata visus prasījumus un saistības pret darījumu partneriem, kas veic uzņēmējdarbību iesaistītajās dalībvalstīs, kuras minētas Regulas (ES) Nr. 806/2014 4. panta 1. punktā. Attiecībā uz kategorijām, kas minētas Direktīvas 2013/36/ES 131. panta 2. punkta a)–d) apakšpunktā, attiecīgā iestāde ņem vērā attiecīgās sabiedrības paziņotās tās pašas nemainītās rādītāju vērtības un EBI paziņotos saucējus.

5.b Pamatojoties uz 5.a punktā minēto papildu vispārējo vērtējumu, lēmumu par G-SNI pārklassificēšanu no augstākas apakškategorijas zemākā apakškategorijā, īstenojot pārdomātu uzraudzības vērtēšanu saskaņā ar Direktīvas 2013/36/ES 131. panta 10. punkta c) apakšpunktu, balsta uz novērtējumu par to, vai G-SNI maksātnespējai būtu mazāka negatīvā ietekme uz globālo finanšu tirgu un globālo ekonomiku. Minētajā novērtējumā attiecīgā gadījumā ņem vērā atzinumus vai atrunas, ko BCBS pieņēmusi saskaņā ar tās publiski pieejamo metodiku globālu sistēmiski nozīmīgu banku sistēmiskās nozīmes novērtēšanai.

Šā panta 5.a punktā minētais papildu vispārējais vērtējums var ļaut attiecīgajai iestādei pārklassificēt G-SNI nākamajā zemākajā apakškategorijā, kas minēta šā panta 3. punktā. G-SNI pārklassificēšana zemākā apakškategorijā nepārsniedz vienas apakškategorijas līmeni.

6. Lēmumus, kas minēti 4., 5. un 5.b punktā, pamato ar papildu rādītājiem, kas nav attiecīgās sabiedrības maksātnespējas iespējamības rādītāji. Šos lēmumus balsta uz labi dokumentētu un pārbaudāmu kvantitatīvo un kvalitatīvo informāciju.

▼ M1*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 sasaisti 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;

b) maksājumu darbības;

c) sākotnēji izvietotie darījumi parāda un kapitāla tirgos.

▼ M1

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 ⁽¹⁾;
- 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.

▼ M2**▼ B***8. pants***Stāšanās spēkā**

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

To piemēro no 2015. gada 1. janvāra.

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

▼ M1

⁽¹⁾ 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.).