|  |
| --- |
| EBA/GL/2020/14 (konsolidētā versija) |
| 2020. gada 4. novembris |

|  |
| --- |
| ØO  Pamatnostādnes |
| attiecībā uz sistēmiski nozīmīgu rādītāju specifikāciju un informācijas atklāšanu |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | | Piemērošanas datums |
| ØO | | 04.11.2020 |
| Grozījumi izdarīti ar šādiem aktiem: | |  |
| ØA1 | EBA/GL/2023/10 |  |

1. Atbilstības nodrošināšanas un ziņošanas prasības

Pamatnostādņu statuss

1. Šis dokuments ietver pamatnostādnes, kas izdotas saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 1093/2010[[1]](#footnote-2) 16. pantu. Kompetentajām iestādēm un finanšu iestādēm saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 1093/2010 16. panta 3. punktu jādara viss iespējamais, lai ievērotu šīs pamatnostādnes.
2. Pamatnostādnēs izklāstīts EBI viedoklis par attiecīgām uzraudzības praksēm Eiropas finanšu uzraudzības sistēmā jeb par to, kā Savienības tiesību akti ir jāpiemēro konkrētā jomā. Kompetentajām iestādēm, kas minētas Regulas (ES) Nr. 1093/2010 4. panta 2. punktā, uz kurām attiecas šīs pamatnostādnes, tās būtu jāievēro, iekļaujot tās attiecīgi savā praksē (piem., izdarot grozījumus savā tiesiskajā regulējumā vai uzraudzības procesos), tostarp gadījumos, kad pamatnostādnes ir paredzētas galvenokārt iestādēm.

Ziņojumu iesniegšanas prasības

1. Saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 1093/2010 16. panta 3. punktu kompetentajām iestādēm līdz 16.02.2021 jāpaziņo EBI, ka tās ievēro vai paredz ievērot šīs pamatnostādnes, vai jānorāda to neievērošanas iemesli. Ja attiecīgajā termiņā šāds paziņojums netiek saņemts, EBI uzskata, ka kompetentās iestādes neievēro šīs pamatnostādnes. Paziņojumi jānosūta, iesniedzot EBI tīmekļa vietnē pieejamo veidlapu ar norādi “EBA/GL/2020/14”. Ziņojumi ir jāiesniedz personām, kuras ir attiecīgi pilnvarotas kompetento iestāžu vārdā ziņot par atbilstību. Par jebkurām izmaiņām atbilstības statusā arī ir jāziņo EBI.
2. Paziņojumus publicēs EBI tīmekļa vietnē saskaņā ar 16. panta 3. punktu.
3. Priekšmets, piemērošanas joma un definīcijas

Priekšmets

1. Šīs pamatnostādnes attiecas uz:
   1. to rādītāju specifikāciju, kurus izmanto globālu sistēmiski nozīmīgu iestāžu (G-SNI) identifikācijai, kā noteikts Regulā (ES) Nr. 1222/2014 (“rādītāji”); un
   2. pamatā esošo datu (rādītāju, papildu informācijas un ārpusbilances posteņu) ziņošanu un iegūto rādītāju vērtību, ko izmanto G-SNI identificēšanai, ikgadēju atklāšanu.

Piemērošanas joma

1. Šīs pamatnostādnes ir piemērojamas attiecībā uz
2. grupām, ko vada ES mātes iestāde, ES mātes finanšu pārvaldītājsabiedrība vai ES mātes jaukta finanšu pārvaldītājsabiedrība; un
3. iestādēm, kas nav ES mātes iestādes, ES mātes finanšu pārvaldītājsabiedrības vai ES mātes jauktas finanšu pārvaldītājsabiedrības meitassabiedrības,

kuras ievēro kopējās riska darījumu vērtības mēru, kas konsolidēti vai individuāli pārsniedz 200 miljardus eiro (ieskaitot apdrošināšanas meitassabiedrības), izmantojot atbilstošu valūtas maiņas kursu, kurā ņemts vērā Eiropas Centrālās bankas publicētais atsauces valūtas maiņas kurss, kas piemērojams finanšu gada beigās, un starptautiskie standarti (“attiecīgās sabiedrības”).

Adresāti

1. Šīs pamatnostādnes ir adresētas kompetentajām iestādēm, kā noteikts Regulas (ES) Nr. 1093/2010 4. panta 2. punkta i) apakšpunktā, un finanšu iestādēm, uz kurām attiecas šīs pamatnostādnes. Direktīvas 2013/36/ES 131. panta 1. punktā minētās izraudzītās iestādes, kas nav kompetentās iestādes, tiek mudinātas piemērot šīs pamatnostādnes. Gan kompetentās, gan izraudzītās iestādes šajās pamatnostādnēs minētas kā “attiecīgās iestādes”.
2. Īstenošana

Piemērošanas datums

1. Šīs pamatnostādnes tiek piemērotas no 16.12.2020.

Atcelšana

Ar šo tiek atceltas 2016. gada 29. februāra pārskatītās pamatnostādnes par globāli sistēmiski nozīmīgu rādītāju un to atspoguļošanas papildu specifikācijām (EBI/PN/2016/01).

1. Pamatā esošo datu un rādītāju specifikācija, kurus izmanto G-SNI identifikācijai

⮛A1

1. Attiecīgajām iestādēm un attiecīgajām vienībām būtu jāievēro norādījumi un specifikācijas attiecībā uz pielikumā uzskaitītajiem datu posteņiem, kā izklāstīts saitē ar nosaukumu “Ziņošanas norādījumi” EBI tīmekļa vietnē G-SNI sadaļā[[2]](#footnote-3).
2. Attiecīgajām iestādēm būtu jāizmanto papildu dati (šo pamatnostādņu pielikuma 15. un 16. iedaļa), lai pamatotu savu uzraudzības vērtējumu saskaņā ar Direktīvas 2013/36/ES 131. panta 10. punktu un izziņas posteņi (pielikuma 17. līdz 22. iedaļa), lai uzlabotu datu kvalitāti un palīdzētu izstrādāt turpmākos identifikācijas metodikas uzlabojumus. Ārpusbilances posteņi tiek papildināti ar detalizētiem attiecīgo iestāžu komentāriem par datu kvalitāti un pieejamību, kur nepieciešams.
3. a Saskaņā ar Direktīvas 2013/36/ES 131. panta 2.a punktu, kurā prasīta papildu identifikācijas metodika, kas izslēdz pārrobežu darbības vienotā noregulējuma mehānisma (VNM) ietvaros, un saskaņā ar Bāzeles komitejas 2022. gada 31. maija starptautisko vienošanos atzīt Eiropas banku savienības attīstības progresu, datu posteņi, kas ir nozīmīgi koriģēto VNM pārjurisdikciju rādītāju aprēķināšanai attiecībā uz iestādēm, kuru galvenais birojs atrodas dalībvalstīs, kas piedalās VNM, būtu jāuzskata par daļu no pārjurisdikciju darbības rādītājiem un kā tādi jāatklāj saskaņā ar 12. punktu, nevis kā papildu vai izziņas posteņi G-SNI identifikācijai un apakškategoriju sadalījuma metodikai.
4. Prasības attiecībā uz ziņojumu sniegšanu un informācijas atklāšanu, ko veic attiecīgās iestādes
5. Attiecīgajām iestādēm ir jānodrošina, ka tās vāc visus šo pamatnostādņu pielikumā norādītos datu posteņus no attiecīgajām iestādēm, kuras katra gada 31. decembrī atbilst šo pamatnostādņu 6. punktā noteiktajiem kritērijiem.
6. Attiecīgajām iestādēm ir jānodrošina, ka attiecīgās vienības savās tīmekļa vietnēs katru gadu publisko informāciju par rādītāju vērtībām, kas norādītas šo pamatnostādņu pielikuma 1.–14. iedaļā, un, ja ir nepieciešama VNM papildu identifikācijas metodika, 21. iedaļas e), f) un g) punktā, kā arī visus citus 21. iedaļas posteņus, kas attiecas uz VNM pārrobežu jurisdikcijas darbībām un ko attiecīgā kompetentā iestāde var uzskatīt par būtiskiem šādas metodikas aprēķināšanai.

⮛O

1. Paziņojot un atspoguļojot 11. un 12. punktā minēto informāciju, attiecīgajām sabiedrībām jāizmanto elektroniskā veidne un jāievēro ikgadējie norādījumi, kas šim nolūkam publicēti EBI tīmekļa vietnē.

⮛A1

1. Attiecīgajām vienībām būtu jāiesniedz 11. punktā minētā informācija attiecīgajām iestādēm un publiski jāatklāj 12. punktā minētā informācija reizi gadā ne vēlāk kā četrus mēnešus pēc katra finanšu gada beigu datuma, sākot no otrā secīgā finanšu gada beigu dienas, kurā ir pārsniegta šo pamatnostādņu 6. punktā noteiktā robežvērtība. Veicot šo darbību, attiecīgajām vienībām jāidentificē sevi, izmantojot juridiskās personas identifikatorus (LEI).

⮛O

1. Attiecīgās iestādes var ļaut attiecīgajām sabiedrībām, kuru finanšu gada beigas nesakrīt ar 31. decembri, paziņot un atspoguļot šo informāciju, pamatojoties uz savu situāciju datumā, kas ir pēc iespējas tuvāk 31. decembrim. Jebkurā gadījumā, informācijas atspoguļošana notiek ne vēlāk kā 31. jūlijā.
2. Attiecīgās iestādes nodrošina, ka paziņotie un atspoguļotie dati – attiecīgos gadījumos – ir identiski tiem, kas iesniegti Bāzeles Banku uzraudzības komitejai.
3. Informācija EBI
4. Attiecīgajām iestādēm jāsniedz EBI visi dati, tostarp papildu informācija un ārpusbilances posteņi, kas ievākti saskaņā ar šīm pamatnostādnēm, lai tos varētu apkopot EBI tīmekļa vietnē. Attiecīgajām sabiedrībām jāidentificē sevi, izmantojot *LEI*. EBI neatspoguļo papildu datus un ārpusbilances posteņus.

Pielikums

|  |  |
| --- | --- |
| ⮛A1  ***Vispārējie banku dati*** | |
|  |  |
| **1.sadaļa. Vispārīga informācija** | **Atbilde** |
| a) Vispārīga informācija, ko sniedz attiecīgā uzraudzības iestāde: |
| (1) Valsts kods |  |
| (2) Bankas nosaukums |  |
| (3) Pārskata sniegšanas datums (gggg-mm-dd) |  |
| (4) Pārskata sniegšanas valūta |  |
| (5) Eiro konvertācijas koeficients |  |
| (6) Pārskata iesniegšanas datums (gggg-mm-dd) |  |
| b. Vispārīga informācija, ko sniedz pārskata sniedzēja iestāde: |  |
| (1) Pārskata vienība |  |
| (2) Grāmatvedības standarts |  |
| (3) Publicēšanas datums (gggg-mm-dd) |  |
| (4) Publicēšanas valoda |  |
| (5) Publicēšanas tīmekļa vietnes adrese |  |
| (6) LEI kods |  |
|  |  |
| ***Lieluma rādītāji*** |  |
|  |  |
| **2. sadaļa. Kopējie riska darījumi** | **Summa** |
| a) Atvasinātie instrumenti |  |
| (1) Darījuma partneru no atvasināto instrumentu līgumiem izrietošu riska darījumu vērtības |  |
| (2) Maksimālā nosacītā kredītu atvasināto instrumentu summa |  |
| (3) Potenciālie nākotnes atvasināto instrumentu riska darījumi |  |
| b) Vērtspapīru finansēšanas darījumi (VFD) |  |
| (1) VFD koriģētā bruto vērtība |  |
| (2) Darījuma partnera vērtspapīru finansēšanas riska darījumi |  |
| c) Citi aktīvi |  |
| d) Ārpusbilances posteņu nosacītā bruto summa |  |
| (1) Posteņi, kuriem piemērojams 0 % kredīta konvertācijas faktors (*CCF*) |  |
| (2) Posteņi, kuriem piemērojams 20 % kredīta konvertācijas faktors |  |
| (3) Posteņi, kuriem piemērojams 50 % kredīta konvertācijas faktors |  |
| (4) Posteņi, kuriem piemērojams 100 % kredīta konvertācijas faktors |  |
| e) Normatīvajos aktos noteiktās korekcijas |  |
| f) Kopējie riska darījumi pirms regulatīvajām korekcijām (posteņu 2.a.1. līdz 2.c summa, 0,1 reizi 2.d.(1), 0,2 reizes 2.d.(2), 0,5 reizes 2.d. (3) un 2.d.(4)) |  |
| g) Apdrošināšanas meitasuzņēmumu riska darījumi, kas nav iekļauti 2. punkta f) apakšpunktā, atskaitot grupas iekšējos darījumus: |  |
| (1) Apdrošināšanas meitasuzņēmumu bilances un ārpusbilances aktīvi |  |
| (2) Apdrošināšanas meitasuzņēmumu atvasināto instrumentu līgumu potenciālā nākotnes riska darījumu vērtība |  |
| (3) Ieguldījumu vērtība konsolidētajās sabiedrībās |  |
| h) Grupas iekšējie riska darījumi, kas iekļauti 2. punkta f) apakšpunktā, ar apdrošināšanas meitasuzņēmumiem, kas norādīti 2. punkta g) apakšpunktā. |  |
| i) Kopējo riska darījumu rādītājs, ieskaitot apdrošināšanas meitasuzņēmumus (posteņu 2.f., 2.g.(1) līdz 2.g(2) summa mīnus 2.g.(3) līdz 2.h) |  |
| ***Savstarpējās saistības rādītāji*** | |
| **3. sadaļa. Iekšējās finanšu sistēmas aktīvi** | **Summa** |
| a) Citās finanšu iestādēs noguldītie vai tām aizdotie līdzekļi |  |
| (1) Noguldījuma sertifikāti |  |
| b) Neizmantotā piešķirto līniju, kas paplašinātas uz citām finanšu iestādēm, daļa |
| c) Citu finanšu iestāžu emitētu vērtspapīru turējumi: |  |
| (1) Nodrošinātie parāda vērtspapīri |  |
| (2) Augsta līmeņa nenodrošinātie parāda vērtspapīri |  |
| (3) Pakārtotie parāda vērtspapīri |  |
| (4) Komerciālie vērtspapīri |  |
| (5) Pašu kapitāla vērtspapīri |  |
| (6) Īso pozīciju izlīdzināšana attiecībā uz speciālajiem kapitāla vērtspapīriem, kas iekļautas 3.c.(5) postenī. |  |
| d) Esošo VFD ar citām finanšu iestādēm pozitīvā neto vērtība |  |
| e) Ārpusbiržas atvasinātie instrumenti ar citām finanšu iestādēm, kam ir pozitīva patiesā neto vērtība |  |
| (1) Pozitīva patiesā neto vērtība |  |
| (2) Potenciālo nākotnes riska darījumu vērtība |  |
| f) Iekšējās finanšu sistēmas aktīvu rādītājs, tostarp apdrošināšanas meitasuzņēmumi (posteņu 3.a., 3.b. līdz 3.c.(5), 3.d., 3.e.(1) un 3.e.(2) summa, mīnus 3.c.(6)) |
|
|  |  |
| **4. sadaļa. Iekšējās finanšu sistēmas pasīvi** | **Summa** |
| a) Noguldītie vai aizņemtie līdzekļi no citām finanšu iestādēm |
| (1) Noguldījumi depozitārijos |  |
| (2) Noguldījumi finanšu iestādēs, kas nav depozitāriji |  |
| (3) Aizņēmumi no citām finanšu iestādēm |  |
| b) Neizmantotā piešķirto līniju, kas iegūtas no citām finanšu iestādēm, daļa |  |
| c) Esošo VFD ar citām finanšu iestādēm negatīvā neto vērtība |  |
| d) Ārpusbiržas atvasinātie instrumenti ar citām finanšu iestādēm, kuriem ir negatīva neto patiesā vērtība: |  |
| (1) Negatīva patiesā neto vērtība |  |
| (2) Potenciālo nākotnes riska darījumu vērtība |  |
| e) Iekšējās finanšu sistēmas pasīvu rādītājs, tostarp apdrošināšanas meitasuzņēmumi (posteņu 4.a.(1) līdz 4.d.(2) summa) |  |
|  |  |
| **5.sadaļa. Nesamaksātie vērtspapīri** | **Summa** |
| a. Nodrošināta parāda vērtspapīri |  |
| b. Augstākas prioritātes parāda vērtspapīri |  |
| c. Pakārtota parāda vērtspapīri |  |
| d. Komerciāli vērtspapīri |  |
| e. Noguldījumu sertifikāti |  |
| f. Pamata kapitāls |  |
| g) Priekšrocību akcijas un citas pakārtotā finansējuma formas, kas nav iekļautas 5.c postenī. |  |
| h) Neatmaksāto vērtspapīru rādītājs, t. sk. apdrošināšanas meitasuzņēmumu emitētie vērtspapīri (posteņu 5.a līdz 5.g summa) |  |
|  |  |
| ***Aizvietojamība / finanšu iestādes infrastruktūras rādītāji*** |  |
| **6. sadaļa. Pārskata gadā veiktie maksājumi (izņemot grupas iekšējos maksājumus)** | **Summa** |
| a) Austrālijas dolārs (AUD) |  |
| b) Kanādas dolārs (CAD) |  |
| c) Šveices franks (CHF) |  |
| d) Ķīnas juaņa (CNY) |  |
| e) Eiro (EUR) |  |
| f) Lielbritānijas mārciņa (GBP) |  |
| g) Honkongas dolārs (HKD) |  |
| h) Indijas rūpija (INR) |  |
| i) Japānas jena (JPY) |  |
| j) Jaunzēlandes dolārs (NZD) |  |
| k) Zviedrijas krona (SEK) |  |
| l) Amerikas Savienoto Valstu dolārs (USD) |  |
| n) Maksājumu darbību rādītājs (posteņu 6.a līdz 6.l summa) |  |
|  |  |
| **7. sadaļa. Glabāšanā esošie aktīvi** | **Summa** |
| a. Glabāšanā esošo aktīvu rādītājs |  |
|  |  |
| **8. sadaļa. Sākotnējās izvietošanas darījumi parāda un kapitāla tirgos** | **Summa** |
| a) Kapitāla instrumentu sākotnējās izvietošanas darbības |  |
| b) Parāda instrumentu sākotnējās izvietošanas darbības |  |
| c) Sākotnējās izvietošanas darbību rādītājs (posteņu 8.a un 8.b summa) |  |
|  |  |
| **9. sadaļa. Tirdzniecības apjoms** | **Summa** |
| a) Citu publiskā sektora struktūru emitēto vērtspapīru tirdzniecības apjoms, izņemot grupas iekšējos darījumus |  |
| b) Citu fiksētā ienākuma vērtspapīru, izņemot grupas iekšējos darījumus, tirdzniecības apjoms |  |
| c) Tirdzniecības apjoma fiksētā ienākuma apakšrādītājs (posteņu 9.a un 9.b summa) |
| d) Biržas sarakstā iekļauto kapitāla vērtspapīru tirdzniecības apjoms, izņemot grupas iekšējos darījumus |  |
| e) Visu citu vērtspapīru tirdzniecības apjoms, izņemot grupas iekšējos darījumus |  |
| f) Tirdzniecības apjoma kapitāla vērtspapīri un citu vērtspapīru apakšrādītājs (posteņu 9.d. un 9.e. summa) |
|  |  |
| ***Sarežģītības rādītāji*** |  |
|  |  |
| **10.sadaļa. Ārpusbiržas atvasinājumu nosacītā summa** | **Summa** |
| a) Ārpusbiržas atvasinātie instrumenti, kam tīrvērti veic, izmantojot centrālo darījumu partneri |  |
| b) Ārpusbiržas atvasinātie instrumenti, par kuriem norēķini notiek divpusēji |  |
| c) Ārpusbiržas atvasināto instrumentu, tostarp apdrošināšanas meitasuzņēmumu, rādītāja nosacītā summa (posteņu 10.a. un 10.b. summa) |  |
|  |  |
| **11. sadaļa. Tirdzniecības nolūkā turēti un pārdošanai pieejami vērtspapīri** | **Summa** |
| a) Tirdzniecības nolūkā turēti vērtspapīri |  |
| b) Pārdošanai pieejami vērtspapīri |  |
| c) Tirdzniecības nolūkā turēti un pārdošanai pieejami vērtspapīri, kas atbilst 1. līmeņa aktīvu definīcijai |  |
| d) Tirdzniecības nolūkā turēti un pārdošanai pieejami vērtspapīri, kas atbilst 2. līmeņa aktīvu definīcijai |  |
| f) Tirdzniecības nolūkā turētu un pārdošanai pieejamu vērtspapīru rādītājs (posteņu 11.a. un 11.b. summa, no kuras atņemta posteņu 11.c. un 11.d. summa) |  |
|  |  |
| **12. sadaļa. Trešā līmeņa aktīvi** | **Summa** |
| a) Trešā līmeņa aktīvi, ieskaitot apdrošināšanas meitasuzņēmumus |  |
|  |  |
| ***Dažādu valstu jurisdikcijās veiktās darbības rādītāji*** |  |
|  |  |
| **13. sadaļa. Dažādu valstu jurisdikciju prasības** | **Summa** |
| a) Kopējās ārvalstu prasības, pamatojoties uz galīgo risku |  |
| b) Ārvalstu atvasināto instrumentu prasības, balstoties uz galīgo risku |  |
| c) Dažādu valstu jurisdikciju prasību rādītājs (posteņu 13.a. un 13.b. summa) |
|  |  |
| **14. sadaļa. Dažādu valstu jurisdikciju saistības** | **Summa** |
| a) Ārvalstu saistības, balstoties uz tūlītēju risku, izņemot atvasinātos instrumentus un iekļaujot vietējās saistības vietējā valūtā |
| b) Ārvalstu atvasināto instrumentu saistības, balstoties uz tūlītēju risku |  |
| c) Dažādu valstu jurisdikciju saistību rādītājs (posteņu 14.a. un 14.b. summa) |
|  |  |
| ***PAPILDU DATI*** |  |
|  |  |
| **15. sadaļa. Papildu rādītāji** | **Summa** |
| a) Saistības kopā |  |
| b) Mazapjoma finansējums |  |
| c) Atkarības no starpbanku finansējuma koeficients (starpība starp posteņiem 15.a. un 15.b., dalīta ar 15.a.) |
| d) Kopējie bruto ieņēmumi |  |
| e) Neto ieņēmumi kopā |  |
| f) Ārvalstu neto ieņēmumi |  |
| g) Aizdotās skaidrās naudas bruto vērtība un vērtspapīru finansēšanas darījumiem aizdoto vērtspapīru patiesā bruto vērtība |  |
| h) Aizņemtās naudas bruto vērtība un vērtspapīru finansēšanas darījumu ietvaros aizņemto vērtspapīru bruto patiesā vērtība |  |
| i) Ārpusbiržas atvasināto instrumentu darījumu bruto pozitīvā patiesā vērtība |  |
| j) Ārpusbiržas darījumu ar atvasinātajiem instrumentiem negatīvā patiesā bruto vērtība |  |
|  | **Summa par atsevišķām vienībām** |
| k) Jurisdikciju skaits |  |
|  |  |
| **16. sadaļa. Papildu posteņi** | **Summa** |
| a) Līdz termiņa beigām turētie vērtspapīri |  |
| b) Pārskata gadā veiktie maksājumi |  |
| (1) Brazīlijas reāls (BRL) |  |
| (2) Meksikas peso (MXN) |  |
| (3) Norvēģijas krona (NOK) |  |
| (4) Krievijas rublis (RUB) |  |
| (5) Singapūras dolārs (SGD) |  |
| (6) Dienvidkorejas vona (KRW) |  |
|  |  |
| ***Izziņas posteņi*** |  |
|  |  |
| **17.sadaļa. Lieluma posteņi** | **Summa** |
| a) Apdrošināšanas meitasuzņēmumu riska darījumi, kas jau ir iekļauti prudenciālā regulējuma konsolidācijā |
| b) Kopējo riska darījumu ceturkšņa vidējā vērtība |  |
| c) Kopējo riska darījumu mēneša vidējā vērtība |  |
|  |  |
| **18. sadaļa. Savstarpējās saistības posteņi** | **Summa** |
| a) Finanšu sistēmas iekšējo aktīvu rādītājs (vecais rādītājs) |  |
| b) Finanšu sistēmas iekšējo aktīvu ceturkšņa vidējā vērtība |  |
| c) Iekšējās finanšu sistēmas aktīvu mēneša vidējā vērtība |  |
| d) Iekšējās finanšu sistēmas saistību rādītājs (vecais rādītājs) |  |
| e) Iekšējās finanšu sistēmas saistību ceturkšņa vidējā vērtība |  |
| f) Iekšējās finanšu sistēmas saistību mēneša vidējā vērtība |  |
| g) Nesamaksāto vērtspapīru rādītājs (vecais rādītājs) |  |
| h) Apgrozībā esošo vērtspapīru ceturkšņa vidējā vērtība |  |
| i) Apgrozībā esošo vērtspapīru mēneša vidējā vērtība |  |
|  |  |
| **19. sadaļa. Aizvietojamība/ Finanšu infrastruktūra Pozīcijas** | **Summa** |
| a) Valsts emitēto vērtspapīru tirdzniecības apjoms, izņemot grupas iekšējos darījumus |  |
| b) Sākotnējā drošības rezerve, kas piešķirta centrālajiem darījumu partneriem klientu vārdā |  |
| c) Sākotnējā drošības rezerve, kas piešķirta centrālajiem darījumu partneriem uz pašas pārskata sniedzējas grupas rēķina |  |
| d) Saistību neizpildes līdzekļu iemaksas centrālajiem darījumu partneriem |  |
| e) Citi mehānismi centrālajiem darījumu partneriem |  |
| f) Norēķinu pakalpojumu sniegšana saistībā ar darījumiem ar centralizēti veiktu tīrvērti |
| g) Glabāšanā esošo aktīvu ceturkšņa vidējā vērtība |  |
| h) Uzturēto aktīvu mēneša vidējā vērtība |  |
|  |  |
| **20. sadaļa. Sarežģītības posteņi** | **Summa** |
| a) Ārpusbiržas atvasināto instrumentu rādītājs (vecais rādītājs) |  |
| b) Ārpusbiržas atvasinājumu nosacītā summa, ieskaitot apdrošināšanas meitas uzņēmumus |  |
| (1) Tīrvērte, izmantojot *CCP*, ja grupa (ieskaitot apdrošināšanas meitasuzņēmumus) darbojas kā finanšu starpnieks (*CCP* daļa) |  |
| (2) Tīrvērte, izmantojot *CCP*, ja grupa (ieskaitot apdrošināšanas meitasuzņēmumus) darbojas kā finanšu starpnieks (klienta daļa) |  |
| (3) Tīrvērte, izmantojot *CCP*, ja grupa, tostarp apdrošināšanas meitasuzņēmumi, darbojas kā aģents |  |
| (4) Tīrvērte, izmantojot *CCP*, ja grupa, tostarp apdrošināšanas meitasuzņēmumi, veic darījumus savā vārdā |  |
| c) Ārpusbiržas atvasināto instrumentu darījumi, kuru tīrvērte tiek veikta, izmantojot centrālo darījumu partneri (*LIBOR* pārejas izslēgšana) |  |
| d) Ārpusbiržas atvasināto instrumentu nosacītās summas ceturkšņa vidējā vērtība |  |
| e) Ārpusbiržas atvasināto instrumentu nosacītās summas mēneša vidējā vērtība |  |
| f) Tirdzniecības un pārdošanai pieejamo vērtspapīru ceturkšņa vidējā vērtība |  |
| g) Tirdzniecības un pārdošanai pieejamo vērtspapīru mēneša vidējā vērtība |  |
| h) Trešā līmeņa aktīvu rādītājs (vecais rādītājs) |  |
| i) Trešā līmeņa aktīvu ceturkšņa vidējā vērtība |  |
| j) n) Trešā līmeņa aktīvu mēneša vidējā vērtība |  |
| k) Otrā līmeņa aktīvi, ieskaitot apdrošināšanas meitasuzņēmumus |  |
| (1) Otrā līmeņa aktīvi, ieskaitot apdrošināšanas meitasuzņēmumi, kuriem tīrvērte veikta, izmantojot *CCP* |  |
| (2) Otrā līmeņa aktīvi, ieskaitot apdrošināšanas meitasuzņēmumus, kas nokārtoti divpusēji |  |
| (3) Citi otrā līmeņa aktīvi, ieskaitot apdrošināšanas meitasuzņēmumus |  |
| l) Otrā līmeņa aktīvi, ieskaitot apdrošināšanas meitasuzņēmumus |  |
|  |  |
| **21.sadaļa. Dažādu valstu jurisdikciju darbības posteņi** | **Summa** |
| a) Dažādu valstu jurisdikciju saistību rādītājs (vecais rādītājs) |  |
| (1) Ārvalstu saistības (izņemot atvasinātos instrumentus un vietējās saistības vietējā valūtā) |  |
| (2) Visas ārvalstu saistības pret saistītajiem birojiem, kas iekļautas 21.a. panta 1. punktā. |  |
| (3) Vietējās saistības vietējā valūtā (izņemot atvasināto instrumentu darbības) |  |
| b) Vietējās saistības vietējā valūtā (izņemot darbības saistībā ar atvasinātajiem instrumentiem) |  |
| c) Dažādu valstu jurisdikciju vietējās prasības vietējā valūtā (izņemot atvasināto instrumentu darbības) |  |
| d) Dažādu valstu jurisdikciju vietējās prasības vietējā valūtā (izņemot atvasināto instrumentu darbības) |  |
| e) Kopējās ārvalstu prasības, pamatojoties uz galīgo risku (uzskatot VNM par vienu jurisdikciju) |  |
| f) Ārvalstu atvasināto instrumentu prasījumi, pamatojoties uz galīgo risku (uzskatot VNM par vienu jurisdikciju) |  |
| h) Ārvalstu saistības, balstoties uz tūlītēju risku, ieskaitot atvasinātos instrumentus (uzskatot VNM par vienotu jurisdikciju) |  |
| (1) Ārvalstu atvasināto instrumentu saistības, pamatojoties uz tūlītēju risku (uzskatot VNM par vienu jurisdikciju) |  |
| i) Dažādu valstu jurisdikciju vietējās prasības vietējā valūtā, izņemot atvasināto instrumentu darbības (uzskatot VNM par vienotu jurisdikciju) |  |
| i) Dažādu valstu jurisdikciju vietējās prasības vietējā valūtā, izņemot atvasināto instrumentu darbības (uzskatot VNM par vienotu jurisdikciju) |  |
| j) Ārvalstu saistības, izņemot atvasinātos instrumentus un vietējās saistības vietējā valūtā (uzskatot VNM par vienu jurisdikciju) |  |
| (1) Jebkuras ārvalstu saistības pret saistītiem birojiem, kas iekļautas 20.j. postenī. (uzskatot VNM par vienu jurisdikciju) |  |
| k) Vietējās saistības vietējā valūtā, izņemot atvasinātos instrumentus (uzskatot VNM par vienu jurisdikciju) |  |
| l) Vietējās saistības vietējā valūtā, ieskaitot atvasinātos instrumentus (uzskatot VNM par vienotu jurisdikciju) |  |
| m) Kopējās neto vietējās pozīcijas vietējā valūtā, ieskaitot atvasinātos instrumentus, ja neto vērtība ir pozitīva |  |
| n) Kopējās neto vietējās pozīcijas vietējā valūtā, ieskaitot atvasinātos instrumentus, ja neto vērtība ir negatīva |  |
| o) Kopējās neto vietējās pozīcijas vietējā valūtā valstīs, kas nav VNM valstis, tostarp atvasinātie instrumenti, ja neto vērtība ir pozitīva (c. VNM kā s. j.) |  |
| p) Kopējās neto vietējās pozīcijas vietējā valūtā valstīs, kas nav VNM valstis, ieskaitot atvasinātos instrumentus, ja neto vērtība ir negatīva (c. VNM kā s. j.) |  |
| q) Kopējās neto vietējās pozīcijas VNM valstu vietējā valūtā, ieskaitot atvasinātos instrumentus (uzskatot VNM par vienotu jurisdikciju) |  |
| r) Biroja iekšējās prasības, ko iegrāmatojuši ārvalstu meitasuzņēmumi |  |
| s) Biroja iekšējās prasības, ko iegrāmatojušas ārvalstu filiāles |  |
| t) Biroja iekšējās saistības, ko iegrāmatojušas ārvalstu meitasuzņēmumi |  |
| u) Biroja iekšējās saistības, ko iegrāmatojušas ārvalstu meitasuzņēmumi |  |
| v) Dažādu valstu jurisdikciju prasību ceturkšņa vidējā vērtība |  |
| w) Dažādu valstu jurisdikciju prasību mēneša vidējā vērtība |  |
| x) Dažādu valstu jurisdikciju saistību ceturkšņa vidējā vērtība |  |
| y) Dažādu valstu jurisdikciju saistību mēneša vidējā vērtība |  |
|  |  |
| **22. sadaļa. Papildu rādītāji** |  |
| a) Ārvalstu neto ieņēmumi (uzskatot VNM par vienotu jurisdikciju) |  |
| b) Jurisdikciju skaits (uzskatot VNM par vienotu jurisdikciju) |  |
|  |  |
| ***Pārbaudes kopsavilkums*** |  |
|  |  |
| **23. iedaļa. Rādītāju vērtības (pārskatītā metodika)** | **Rādītāja vērtība pārskata valūtā** |
| a) 2. sadaļa. Kopējo riska darījumu rādītājs, tostarp apdrošināšanas meitasuzņēmumi |  |
| b) 3. sadaļa. Finanšu sistēmas iekšējo aktīvu rādītājs, tostarp apdrošināšanas meitasuzņēmumi |  |
| c) 4. sadaļa. Finanšu sistēmas iekšējo saistību rādītājs, tostarp apdrošināšanas meitasuzņēmumi |  |
| d) 5. sadaļa. Nesamaksāto vērtspapīru rādītājs, tostarp apdrošināšanas meitasuzņēmumi |  |
| e) 6. sadaļa. Maksājumu darbības rādītājs |  |
| f) 7. sadaļa. Glabāšanā esošo aktīvu rādītājs |  |
| g) 8. sadaļa. Sākotnējās izvietošanas darbības rādītājs |  |
| h) 9.c sadaļa. Tirdzniecības apjoma fiksēta ienākuma apakšrādītājs |  |
| i) 9.f sadaļa. Tirdzniecības apjoma kapitāla vērtspapīri un citi vērtspapīru apakšrādītājs |  |
| j) 10. sadaļa. Ārpusbiržas atvasināto instrumentu rādītājs, tostarp apdrošināšanas meitasuzņēmumi |  |
| k) 11. sadaļa. Tirdzniecības nolūkā turēto un pārdošanai pieejamo vērtspapīru rādītājs |  |
| l) 12. sadaļa. Trešā līmeņa aktīvi, tostarp apdrošināšanas meitasuzņēmumi |  |
| m) 13. sadaļa. Dažādu valstu jurisdikciju prasību rādītājs |  |
| n) 14. sadaļa. Dažādu valstu jurisdikciju saistību rādītājs |  |
| o) Citas sadaļas |  |
| (1) 1.a postenis. Uzraudzības iestādes sniegtā vispārīgā informācija |  |
| (2) 1.b postenis. Pārskata sniedzējas iestādes sniegtā vispārīgā informācija |  |
| (3) 15. sadaļa. Papildu rādītāji |  |
| (4) 16. sadaļa. Papildu posteņi |  |
| (5) 17. sadaļa. Lieluma posteņi |  |
| (6) 18. sadaļa. Savstarpējās saistības posteņi |  |
| (7) 19. sadaļa. Aizvietojamība/ Finanšu infrastruktūra Pozīcijas |  |
| (8) 20. sadaļa. Sarežģītības posteņi |  |
| (9) 21. sadaļa. Dažādu valstu jurisdikciju darbības posteņi |  |
| (10) 22. sadaļa. Papildu rādītāji |  |
|  |  |
| **24. sadaļa. Rādītāju vērtības (vecā metodika)** | **Rādītāja vērtība pārskata valūtā** |
| a) 2. sadaļa. Kopējo riska darījumu rādītājs |  |
| b) 18. sadaļa. Iekšējās finanšu sistēmas aktīvu rādītājs |  |
| c) 18. sadaļa. Iekšējās finanšu sistēmas saistību rādītājs |  |
| d) 18. sadaļa. Nesamaksāto vērtspapīru rādītājs |  |
| e) 6. sadaļa. Maksājumu darbības rādītājs |  |
| f) 7. sadaļa. Glabāšanā esošo aktīvu rādītājs |  |
| g) 8. sadaļa. Sākotnējās izvietošanas darbības rādītājs |  |
| h) 20. sadaļa. Ārpusbiržas atvasināto instrumentu rādītājs |  |
| i) 11. sadaļa. Tirdzniecības nolūkā turēto un pārdošanai pieejamo vērtspapīru rādītājs |  |
| j) 20. sadaļa. Trešā līmeņa aktīvu rādītājs |  |
| k) 13. sadaļa. Dažādu valstu jurisdikciju prasību rādītājs |  |
| l) 21. sadaļa. Dažādu valstu jurisdikciju saistību rādītājs |  |

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.). [↑](#footnote-ref-2)
2. https://www.eba.europa.eu/risk-analysis-and-data/global-systemically-important-institutions [↑](#footnote-ref-3)