



European Securities and
Markets Authority

Pamatnostādnes

par vērtspapīrošanas repozitoriju datu pilnīguma un konsekvences robežvērtībām





European Securities and
Markets Authority

Saturs

I.	Piemērošanas joma	3
II.	Normatīvās atsauces, saīsinājumi un definīcijas	3
III.	Mērķis	4
IV.	Atbilstība un ziņošanas pienākumi	5
V.	Pamatnostādnes par vērtspapīrošanas repozitoriju datu pilnīguma un konsekvenču robežvērtībām.....	5
VI.	Pielikums.....	7

I. Piemērošanas joma

Kam paredzētas šīs pamatnostādnes?

1. Šīs pamatnostādnes attiecas uz vērtspapīrošanas repozitorijiem.

Ko nosaka ar šīm pamatnostādnēm?

2. Šīs pamatnostādnes tiek piemērotas attiecībā uz vērtspapīrošanas repozitoriju pienākumu pārbaudīt, vai “nav datu” norādīšanas iespēju izmantošana datu iesniegšanā neliedz iesniegt pietiekami reprezentatīvu informāciju par vērtspapīrošanas pamatā esošajiem riska darījumiem saskaņā ar Deleģētās regulas par vērtspapīrošanas repozitorija darbības standartiem 4. panta 2. punkta d) apakšpunktu.

Kad šīs pamatnostādnes stājas spēkā?

3. Šīs pamatnostādnes tiks pārtulkotas Eiropas Savienības oficiālajās valodās un publicētas EVTI tīmekļa vietnē. EVTI ņems vērā šīs pamatnostādnes, lai veiktu savus uzraudzības pienākumus no 2021. gada 1. janvāra.

II. Normatīvās atsauces, saīsinājumi un definīcijas

Normatīvās atsauces

<i>EVTI regula</i>	Eiropas Parlamenta un Padomes 2010. gada 24. novembra Regula (ES) Nr. 1095/2010, ar ko izveido Eiropas Uzraudzības iestādi (Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestādi), groza Lēmumu Nr. 716/2009/EK un atceļ Komisijas Lēmumu 2009/77/EK ¹ .
<i>Vērtspapīrošanas regula</i>	Eiropas Parlamenta un Padomes 2017. gada 12. decembra Regula (ES) 2017/2402, ar ko nosaka vispārēju regulējumu vērtspapīrošanai un izveido īpašu satvaru attiecībā uz vienkāršu, pārredzamu un standartizētu vērtspapīrošanu, un groza Direktīvas 2009/65/EK, 2009/138/EK un 2011/61/ES un Regulas (EK) Nr. 1060/2009 un (ES) Nr. 648/2012 ⁽²⁾
<i>Deleģētā regula par vērtspapīrošanas repozitorija darbības standartiem</i>	Komisijas 2019. gada 29. novembra Deleģētā regula (ES) 2017/2402 ⁽³⁾ , ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) 2017/2402 papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par vērtspapīrošanas repozitorija darbības standartiem datu vākšanai, apkopošanai,

¹ OV L 331, 15.12.2010., 84. lpp.

² OV L 347, 28.12.2017., 35. lpp.

³ OV L 289, 03.09.2020., 335. lpp.

salīdzināšanai, piekļuvei un pilnīguma un konsekvences pārbaudei

Deleģētā regula par prasībām atklāt informāciju par vērtspapīrošanu

Komisijas 2019. gada 16. oktobra Deleģētā regula (ES) Nr. 2020/1224 ⁽⁴⁾, ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) 2017/2402 papildina attiecībā uz regulatīviem tehniskajiem standartiem, kuros precizēta informācija un dati, kas iniciatoram, sponsoram un īpašam nolūkam dibinātai sabiedrībai, kura veic vērtspapīrošanu, ir jādara pieejami par vērtspapīrošanas darījumu

Saīsinājumi

EVTI

Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestāde

Definīcijas

piemērojamās “Nav datu” norādīšanas iespējas

ir Deleģētās regulas par prasībām atklāt informāciju par vērtspapīrošanu 9. panta 3. punktā noteiktās “Nav datu” norādīšanas iespējas, izņemot “ND5”

riska darījuma veida ziņojums

ir Deleģētās regulas par prasībām atklāt informāciju par vērtspapīrošanu II–XI pielikumā minētā informācija, kas tiek paziņota datu iesniegumā par vērtspapīrošanu, izņemot informāciju par neaktīviem pamatā esošajiem riska darījumiem, kas minēti šīs regulas 2. panta 5. punkta b) apakšpunktā

III. Mērķis

4. Šīs pamatnostādnes ir sagatavotas saskaņā ar EVTI regulas 16. panta 1. punktu. Šo pamatnostādņu mērķis ir izveidot konsekventu, efektīvu un rezultatīvu uzraudzības praksi Eiropas finanšu uzraudzības sistēmā un nodrošināt Savienības tiesību aktu kopīgu, vienveidīgu un konsekventu piemērošanu. Šīs pamatnostādnes atbilst šiem mērķiem, jo tajās ir aprakstītas robežvērtības attiecībā uz gadījumiem, kad “Nav datu” norādīšanas iespēju izmantošana liedz iesniegt “pietiekami reprezentatīvus datus par vērtspapīrošanas pamatā esošajiem riska darījumiem” saskaņā ar Deleģētās regulas par vērtspapīrošanas repozitorija darbības standartiem 4. panta 2. punkta d) apakšpunktu.

⁴ OV L 289, 03.09.2020., 1. lpp.

IV. Atbilstība un ziņošanas pienākumi

Pamatnostādņu statuss

5. Saskaņā ar EVTI Regulas 16. panta 3. punktu vērtspapīrošanas repozitorijiem ir jādara viss iespējamais, lai nodrošinātu atbilstību šīm pamatnostādņēm.
6. EVTI pastāvīgas tiešas uzraudzības gaitā izvērtēs to, kā vērtspapīrošanas repozitoriji piemēro šīs pamatnostādnes, .

Ziņošanas prasības

7. Vērtspapīrošanas repozitorijiem nav jāziņo, vai viņi ievēro šīs pamatnostādnes.

V. Pamatnostādnes par vērtspapīrošanas repozitoriju datu pilnīguma un konsekvences robežvērtībām

8. Vērtspapīrošanas repozitorijiem ir jāpārbauda, vai “Nav datu” norādīšanas iespēju dēļ datu iesniegšana nerada situāciju, ka tā nav pietiekami reprezentatīva attiecībā uz pamatā esošajiem riska darījumiem saskaņā ar Deleģētās regulas par vērtspapīrošanas repozitorija darbības standartiem 4. panta 2. punkta d) apakšpunktu, nosakot:
 - (a) attiecīgajā datu iesniegšanā piemērojamo “Nav datu” norādīšanas iespēju atsevišķo lauku procentuālās daļas katram riska darījuma veida ziņojumam;
 - (b) to, vai minēto procentuālo daļu skaits pārsniedz kādu no robežvērtībām, kas piemērojamas minētajiem riska darījumu veida ziņojumiem.
9. Šo pamatnostādņu 8. punkta a) apakšpunkta vajadzībām vērtspapīrošanas repozitorijiem attiecībā uz riska darījuma veida ziņojumu ir jānosaka piemērojamo “Nav datu” norādīšanas iespēju individuālo lauku procentuālās daļas:
 - (a) nosakot katrā riska darījuma veida ziņojuma laukā uzrādīto piemērojamo “Nav datu” norādīšanas iespēju skaitu;
 - (b) dalot katru no šo lauku skaita ar to pamatā esošo riska darījumu kopējo skaitu, kas uzrādīti minētajā riska darījumu veida ziņojumā.
10. Šo pamatnostādņu 8. punkta b) apakšpunkta vajadzībām vērtspapīrošanas repozitorijiem ir jānosaka, vai riska darījuma veida ziņojumam piemērojamo “Nav datu” norādīšanas iespēju individuālo lauku procentuālo daļu skaits nepārsniedz robežvērtības, kas piemērojamas minētajam riska darījuma veida ziņojumam, nosakot:
 - (a) riska darījuma veida ziņojumā iekļauto atsevišķo lauku procentuālo daļu skaits, kas ir:
 - (i) lielāks par 0 % un mazāks par 10 % (“1. robežvērtības gadījumu procentuālā daļa”);

- (ii) vienāds ar vai lielāks par 10 % (“2. robežvērtības gadījumu procentuālā daļa”);
 - (b) vai 1. robežvērtības gadījumu procentuālā daļa pārsniedz A pielikumā noteikto 1. robežvērtību, kas piemērojama attiecīgajam riska darījuma veida ziņojumam;
 - (c) vai 2. robežvērtības gadījumu procentuālā daļa pārsniedz A pielikumā noteikto 2. robežvērtību, kas piemērojama attiecīgajam riska darījuma veida ziņojumam;
11. Ja kāda no A pielikumā noteiktajām robežvērtībām ir pārsniegta attiecībā uz kādu no iesniegtajiem riska darījumu veida ziņojumiem, vērtspapīrošanas repozitorijiem ir jāņem vērā, ka “Nav datu” norādīšanas iespēju dēļ datu iesniegšana nevar būt pietiekami reprezentatīva attiecībā uz pamatā esošajiem riska darījumiem saskaņā ar Deleģētās regulas par vērtspapīrošanas repozitorija darbības standartiem 4. panta 2. punkta d) apakšpunktu.
12. Pieteikuma paraugi reprezentativitātes verificācijai saskaņā ar 8.–11. punktu riska darījuma veida ziņojumiem par darījumiem “mājokļa īpašumu” saistībā ar datu iesniegšanu vērtspapīrošanai ir sniegti B pielikumā.

VI. Pielikums

A PIELIKUMS

Robežvērtības, kas piemērojamas riska darījumu veida ziņojumiem

Pielikums Deleģētajai regulai par prasībām atklāt informāciju par vērtspapīrošanu	Riska darījuma veida ziņojums	1. robežvērtība	2. robežvērtība
II	Mājokļa īpašums	30	30
III	Komerציālais nekustamais īpašums	50	50
IV	Uzņēmums	35	35
V	Automobilis	15	15
VI	Patērētājs	15	15
VII	Kredītkarte	10	10
VIII	Noma	15	15
IX	“Ezoteriskie” darījumi	61	61
X	Palielinājums par ienākumus nenesošiem riska darījumiem	203	203
XI	Uz aktīviem balstīts komerciāls vērtspapīrs	39	39

B PIELIKUMS

1. daļa. Reprēzentativitātes verifikācijas iesnieguma paraugs attiecībā uz riska darījuma veida ziņojumu ar 100 pamatā esošajiem riska darījumiem ar mājokļa īpašumu

Aizdevums#	Rezidents	Ģeogrāfiskais reģions — saistību pildītājs	Nodarbinātības statuss	Primārais ienākums	Primārā ienākuma verifikācija	Iniciēšanas datums	Termiņa datums	Iniciēšanas kanāls	Mērķis	Parāda/ienākuma attiecība (%)	Procentu likmes veids	Pašreizējā procentu likmju starpība (%)	Procentu likmes pārskatīšanas intervāls (mēneši)	Aizdevuma un vērtības sākotnējā attiecība (%)
1	Y	BE351	PUBLISKAIS SEKTORS	30 478 EUR	ND1	17.12.2010	17.12.2026	BROKERIS	PIRKUMS	5	MAINĪGA	1,51	3	45
2	Y	BE351	PUBLISKAIS SEKTORS	60 324 EUR	ND1	27.05.2014	17.09.2032	INTERNETS	PIRKUMS	28	MAINĪGA	1,52	3	50
3	Y	BE351	PRIVĀTAIS SEKTORS	33 678 EUR	ND1	15.02.2011	09.07.2030	INTERNETS	PIRKUMS	9	FIKSĒTA	ND5	ND5	31
4	Y	BE351	ND1	ND1	ND1	04.07.2010	26.07.2032	ND1	ND1	ND1	FIKSĒTA	ND5	ND5	ND1
5	N	BE351	ND1	ND1	ND1	05.03.2009	06.07.2027	ND1	ND1	ND1	FIKSĒTA	ND5	ND5	ND1
6	N	BE351	ND1	74 308 EUR	ND1	10.01.2009	24.12.2025	ND1	ND1	ND1	FIKSĒTA	ND5	ND5	ND1
7	N	BE351	ND1	89 875 EUR	ND1	19.03.2008	15.08.2029	FILIĀLE	ND1	ND1	FIKSĒTA	ND5	ND5	ND1
8	N	BE201	PRIVĀTAIS SEKTORS	23 304 EUR	ND1	20.11.2019	15.08.2031	FILIĀLE	KAPITĀLA ATBRĪVOŠANA	15	MAINĪGA	1,23	6	56
9	Y	BE201	PRIVĀTAIS SEKTORS	27 336 EUR	ND1	05.12.2017	18.07.2035	FILIĀLE	BŪVNICĪBA	27	FIKSĒTA	ND5	ND5	55
10	Y	BE201	PRIVĀTAIS SEKTORS	45 479 EUR	ND1	05.02.2011	14.08.2027	INTERNETS	BŪVNICĪBA	11	FIKSĒTA	ND5	ND5	58
11	Y	BE201	PRIVĀTAIS SEKTORS	25 322 EUR	ND1	06.09.2014	11.03.2033	INTERNETS	BŪVNICĪBA	9	MAINĪGA	1,29	6	57
12	Y	BE201	PRIVĀTAIS SEKTORS	89 267 EUR	ND1	28.03.2011	24.03.2031	FILIĀLE	PIRKUMS	14	MAINĪGA	1,73	6	37
13	Y	BE201	PRIVĀTAIS SEKTORS	97 123 EUR	ND1	16.11.2010	03.11.2032	FILIĀLE	PIRKUMS	16	MAINĪGA	1,56	6	58
14	Y	BE442	PRIVĀTAIS SEKTORS	20 948 EUR	ND1	09.11.2009	22.12.2027	FILIĀLE	PIRKUMS	13	MAINĪGA	1,08	6	39
15	Y	BE442	ND1	ND1	ND1	04.11.2009	18.09.2026	ND1	ND1	ND1	FIKSĒTA	ND5	ND5	63
16	Y	BE442	ND1	ND1	ND1	27.08.2008	08.02.2030	ND1	ND1	ND1	FIKSĒTA	ND5	ND5	64
17	Y	BE442	PUBLISKAIS SEKTORS	39 029 EUR	ND1	15.04.2017	30.10.2031	ND1	ND1	ND1	FIKSĒTA	ND5	ND5	33
18	Y	BE442	PRIVĀTAIS SEKTORS	75 081 EUR	ND1	09.07.2018	17.02.2036	ND1	ND1	ND1	FIKSĒTA	ND5	ND5	43
19	N	BE442	PRIVĀTAIS SEKTORS	52 688 EUR	ND1	25.11.2011	10.08.2028	FILIĀLE	PIRKUMS	16	MAINĪGA	1,43	6	41
20	N	BE442	PRIVĀTAIS SEKTORS	35 467 EUR	ND1	11.03.2015	26.04.2033	FILIĀLE	PIRKUMS	7	MAINĪGA	1,26	6	62
-	-	-	-	-	ND1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	ND1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	ND1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
100	Y	BE331	BEZDARBNIKS	95 741 EUR	ND1	20.05.2017	07.04.2032	FILIĀLE	PIRKUMS	8	FIKSĒTA	ND5	ND5	55

Paziņojums. Vai izvēles iespējas ND1-NDA ir atļautas šajā laukā?	NĒ	NĒ	JĀ	JĀ	JĀ	JĀ	JĀ	JĀ	JĀ	JĀ	NĒ	NĒ	NĒ	JĀ
“Nav datu” iespējas izmantošana, %	N/P	N/P	6 %	4 %	100 %	0 %	0 %	7 %	8 %	8 %	N/P	N/P	N/P	4 %

2. daļa. Pieteikuma piemērs mājokļa īpašuma veida riska darījuma ziņojuma reprezentatīvai verifikācijai četru scenāriju gadījumos

Piemērojamās robežvērtības

Riska darījuma veida ziņojums	Komerciāls nekustamais īpašums
1. robežvērtība	30
2. robežvērtība	30

Veikt 1. pārbaudi

	1. scenārijs	2. scenārijs	3. scenārijs	4. scenārijs
1. Kāda ir robežvērtības procentuālā daļa?	10 %	10 %	10 %	10 %
2. Kāds ir to atsevišķo lauku skaits, kuros “Nav datu” norādīšanas iespēju procentuālā daļa ir lielāka par 0 % / lielāka par 10 % (1. robežvērtības procentuālais gadījumu līmenis)?	10	14	31	34
3. Kāda ir 1. robežvērtība? (t. i., lauku skaits 1. pārbaudei.)	30	30	30	30

4. Vai 1. robežvērtības procentuālais gadījumu līmenis ir zemāks par 1. robežvērtību? (Jā = SEKMĪGI / Nē = NESEKMĪGI)	SEKMĪGI	SEKMĪGI	NESEKMĪGI	NESEKMĪGI
---	---------	---------	-----------	-----------

Veikt 2. pārbaudi

1. Kāda ir robežvērtības procentuālā daļa?	10 %	10 %	10 %	10 %
2. Kāds ir to atsevišķo lauku skaits, kuros "Nav datu" norādīšanas iespēju procentuālā daļa ir vienāda ar 0 % vai lielāka par 10 % (2. robežvērtības gadījumu procentuālā daļa)?	16	32	18	33
3. Kāda ir 2. robežvērtība? (T. i., lauku skaits 2. pārbaudei.)	30	30	30	30
4. Vai 2. robežvērtības procentuālais gadījumu līmenis ir zemāks par 2. robežvērtību? (Jā = SEKMĪGI / Nē = NESEKMĪGI)	SEKMĪGI	NESEKMĪGI	SEKMĪGI	NESEKMĪGI

RĪCĪBA, KAS VĒRTSPAPĪROŠANAS REPOZITORIJAM JĀVEIC SAISTĪBĀ AR IESNIEGTO DATU REPREZENTATIVITĀTES VERIFIKĀCIJU:	PIEŅEMT	ATTEIKT	ATTEIKT	ATTEIKT
---	---------	---------	---------	---------

