

EBA/GL/2022/10

---

29.07.2022.

---

## Pamatnostādnes

par kritērijiem ieguldījumu brokeru sabiedrību atbrīvošanai no likviditātes prasībām saskaņā ar Regulas (ES) 2019/2033 43. panta 4. punktu.

# 1. Atbilstība un ziņošanas prasības

---

## Šo pamatnostādņu statuss

1. Šis dokuments ietver pamatnostādnes, kas izdotas saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 1093/2010<sup>1</sup> 16. pantu. Kompetentajām iestādēm saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 1093/2010 16. panta 3. punktu jādara viss iespējamais, lai ievērotu šīs pamatnostādnes.
2. Pamatnostādnēs izklāstīts EBI skatījums uz attiecīgām uzraudzības praksēm Eiropas finanšu uzraudzības sistēmā jeb par to, kā konkrētā jomā ir jāpiemēro Savienības tiesību akti. Kompetentajām iestādēm, kas minētas Regulas (ES) Nr. 1093/2010 4. panta 2. punktā un uz kurām šīs pamatnostādnes attiecas, tās jāpiemēro savā uzraudzības pieejā (piemēram, veicot grozījumus savā tiesiskajā regulējumā vai uzraudzības procesos), tostarp gadījumos, kad pamatnostādnes ir paredzētas galvenokārt iestādēm.

## Prasības sniegt ziņojumus

3. Saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 1093/2010 16. panta 3. punktu kompetentajām iestādēm līdz 28.11.2022 jāpaziņo EBI, vai tās ievēro vai paredz ievērot šīs pamatnostādnes, vai arī jānorāda to neievērošanas iemesli. Ja attiecīgajā termiņā šāds paziņojums nebūs saņemts, EBI uzskatīs, ka kompetentās iestādes neievēro šīs pamatnostādnes. Paziņojumi jānosūta, iesniedzot EBI tīmekļa vietnē pieejamo veidlapu ar norādi "EBA/GL/2022/10". Personām, kuras iesniedz paziņojumus, ir jābūt pilnvarotām to pārstāvēto kompetento iestāžu vārdā ziņot par prasību izpildi. Par jebkurām izmaiņām atbilstības statusā arī ir jāpaziņo EBI.
4. Saskaņā ar 16. panta 3. punktu paziņojumi tiks publicēti EBI tīmekļa vietnē.

---

<sup>1</sup> 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.).

## 2. Priekšmets, piemērošanas joma un definīcijas

---

### Priekšmets

5. Šajās pamatnostādnēs tiek konkretizēti kritēriji, ko kompetentās iestādes var ņemt vērā, atbrīvojot Regulas (ES) 2019/2033 12. panta 1. punktā minētās ieguldījumu brokeru sabiedrības no likviditātes prasībām saskaņā ar Regulas (ES) 2019/2033 43. pantu.

### Piemērošanas joma

6. Šīs pamatnostādnes individuāli tiek piemērotas ieguldījumu brokeru sabiedrībām Regulas (ES) 2019/2033 43. pantā noteiktajā darbības jomā.

### Adresāti

7. Šīs pamatnostādnes ir adresētas kompetentajām iestādēm, kā noteikts Regulas (ES) Nr. 1093/2010 4. panta 2. punkta i) apakšpunktā un 2. punkta viii) apakšpunktā, un finanšu iestādēm, kas minētas Regulas (ES) Nr. 1093/2010 4. panta 1. punktā, ja tās ir ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas atbilst Regulas (ES) 2019/2033 12. panta 1. punktā izklāstītajiem nosacījumiem, lai tās kvalificētu kā mazas un savstarpēji nesaistītas ieguldījumu brokeru sabiedrības.

### Definīcijas

8. Ja nav norādīts citādi, Direktīvā (ES) 2019/2034 vai Regulā (ES) 2019/2033 lietotajiem un definētajiem terminiem ir tāda pati nozīme arī šajās pamatnostādnēs.

## 3. Īstenošana

---

### Piemērošanas datums

9. Šo pamatnostādņu piemērošana sākas 28.11.2022.

## 4. Pamatnostādnes

---

### 4.1 Vispārīgie noteikumi

10. Kompetentās iestādes var atbrīvot ieguldījumu brokeru sabiedrību, kas atbilst Regulas (ES) 2019/2033 12. panta 1. punktā izklāstītajiem nosacījumiem, lai to kvalificētu par mazu un savstarpēji nesaistītu ieguldījumu brokeru sabiedrību, no Regulas (ES) 2019/2033 43. panta 1. punktā noteiktajām likviditātes prasībām, ja attiecīgā ieguldījumu brokeru sabiedrība atbilst šajās pamatnostādnēs noteiktajiem atbrīvojuma kritērijiem.
11. Ja kompetentā iestāde ieguldījumu brokeru sabiedrībai ir noteikusi īpašas likviditātes prasības saskaņā ar Direktīvas (ES) 2019/2034 42. pantu, šādu ieguldījumu brokeru sabiedrību var atbrīvot no likviditātes prasībām tikai tad, ja uz to vairs neattiecas minētās īpašas likviditātes prasības saskaņā ar Direktīvas (ES) 2019/2034 42. pantu.
12. Kompetentajām iestādēm jāatbrīvo ieguldījumu brokeru sabiedrība no likviditātes prasībām saskaņā ar Regulas (ES) 2019/2033 43. panta 1. punktu, tikai pamatojoties uz pašas ieguldījumu brokeru sabiedrības iesniegtu atbrīvošanas pieprasījumu. Kopā ar šādu pieprasījumu ieguldījumu brokeru sabiedrībai jāiesniedz visa informācija, kas kompetentajai iestādei nepieciešama, lai varētu novērtēt šo pamatnostādņu prasību izpildi. Minētajā informācijā jāiekļauj apraksts par ieguldījumu brokeru sabiedrības darbību un to, kā ieguldījumu brokeru sabiedrība izpilda atbrīvojuma prasības.

### 4.2 Ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas ir tiesīgas saņemt atbrīvojumu

13. Atbrīvojums no likviditātes prasībām saskaņā ar Regulas (ES) 2019/2033 43. panta 1. punktu kompetentajām iestādēm jāpiešķir tikai tādām ieguldījumu brokeru sabiedrībām, kas nodrošina šādu ierobežotu ieguldījumu pakalpojumu diapazonu:
  - i) rīkojumu pieņemšana un pārsūtīšana attiecībā uz vienu vai vairākiem finanšu instrumentiem, kā minēts Direktīvas 2014/65/ES I pielikuma A iedaļas 1. punktā;
  - ii) rīkojumu izpilde klientu vārdā, kā minēts Direktīvas 2014/65/ES I pielikuma A iedaļas 2. punktā;
  - iii) portfeļa pārvaldība, kā minēts Direktīvas 2014/65/ES I pielikuma A iedaļas 4. punktā;
  - iv) ieguldījumu konsultācijas, kā minēts Direktīvas 2014/65/ES I pielikuma A iedaļas 5. punktā;

- v) finanšu instrumentu izvietošana bez stingrām saistībām, kā minēts Direktīvas 2014/65/ES I pielikuma A iedaļas 7. punktā.
14. Kompetentajām iestādēm jāizvērtē, vai ieguldījumu brokeru sabiedrības sniegtie papildpakalpojumi rada likviditātes risku. Ieguldījumu brokeru sabiedrība, kas iesaistās tādās darbībās kā kredītu vai aizdevumu piešķiršana ieguldītājiem, ir pakļauta lielākam likviditātes riskam, tādēļ šādu ieguldījumu brokeru sabiedrību nedrīkst atbrīvot no likviditātes prasībām.
  15. Kompetentajām iestādēm arī jāizvērtē, vai citi ieguldījumu brokeru sabiedrības sniegtie pakalpojumi nerada likviditātes risku, kad tā sniedz garantijas klientiem vai trešām personām, jo arī uz tiem attiecas lielākas likviditātes prasības saskaņā ar Regulas (ES) 2019/2033 45. pantu. Tāds pats novērtējums jāveic attiecībā uz ieguldījumu brokeru sabiedrību, kas nodarbojas ar vērtspapīru aizdošanu, jo tāda ieguldījumu brokeru sabiedrība būs pakļauta likviditātes riskam tādēļ, ka aizņēmējs var nespēt laikus vai pēc pieprasījuma atgriezt vērtspapīrus ieguldījumu brokeru sabiedrībai.
  16. Kompetentajām iestādēm jāņem vērā bilances un ārpusbilances pozīcijas, tostarp ārpusirdzniecības portfeļa atvasināto instrumentu pozīcijas, kas tiek turētas riska ierobežošanas nolūkos, kad tās atbrīvo ieguldījumu brokeru sabiedrību no likviditātes prasībām, jo ieguldījumu brokeru sabiedrība, kurai ir ievērojams daudzums šādu ārpusbilances posteņu, var būt pakļauta būtiskam likviditātes riskam.
  17. Kompetentās iestādes nedrīkst piešķirt atbrīvojumu, ja ieguldījumu brokeru sabiedrība būtiski iesaistās darījumos ar ārvalstu valūtām un spriedzes apstākļos var tikt traucēta ieguldījumu brokeru sabiedrības spēja veikt valūtas mijmaiņas darījumus un apgrūtināta tās piekļuve attiecīgajiem ārvalstu valūtu tirgiem.

### 4.3 Atbrīvojuma kritēriji

18. Pēc pieprasījuma saņemšanas no ieguldījumu brokeru sabiedrības kompetentajām iestādēm jāizvērtē, vai šo ieguldījumu brokeru sabiedrību var atbrīvot no likviditātes prasībām, pamatojoties uz ieguldījumu brokeru sabiedrības vajadzībām pēc finanšu resursiem, lai varētu pienācīgi veikt likvidāciju vai pārstrukturēšanu.
19. Lai veiktu 18. punktā minēto izvērtējumu, kompetentajām iestādēm jāņem vērā ieguldījumu brokeru sabiedrības riski attiecībā uz klientiem un pašu sabiedrību, tās darbību veids, apjoms un sarežģītība, kā arī sabiedrības veikto darbību veidi un jebkuri saskaņā ar Direktīvas (ES) 2019/2034 36. pantu veiktas uzraudzības pārbaudes un izvērtējuma rezultāti, ja tādi ir pieejami.

20. Kompetentās iestādes var piešķirt atbrīvojumu ieguldījumu brokeru sabiedrībai, kas pastāvīgi sniedz portfeļa pārvaldības vai ieguldījumu konsultāciju pakalpojumus, ja minētā ieguldījumu brokeru sabiedrība pārvalda aktīvus, ko tai deleģējušas citas finanšu iestādes.
21. Novērtējums par vajadzībām pēc likvīdiem finanšu resursiem jāveic gan normālos, gan spriedzes apstākļos, kas palielina aizplūstošo un ieplūstošo līdzekļu nesakritības risku, jo īpaši attiecībā uz maksājumiem, kas saistīti ar ārpusbilances pozīcijām vai tiesāšanās izdevumiem.

#### 4.4 Sniedzamā informācija

22. Lai novērtētu vajadzību pēc atbrīvojuma, kompetentajām iestādēm jāizmanto visa attiecīgā informācija, kas ir pieejama, piemēram: i) tiesību aktos paredzētie ziņojumi, ii) grāmatvedības un finanšu pārskati, iii) ieguldījumu brokeru sabiedrības iekšējie pārskati, iv) *ILAAP* un *ICAAP* secinājumi, v) ieguldījumu brokeru sabiedrības darbības izbeigšanas plāni.
23. Kompetentajām iestādēm jāpieprasa jebkura papildu informācija vai pierādījumi, lai pārliecinātos, ka ieguldījumu brokeru sabiedrība, kas vēlas saņemt atbrīvojumu, nav pakļauta likviditātes riskam.
24. Ja būtiski izmainās informācija, kas iesniegta kopā ar pieprasījumu piešķirt atbrīvojumu, ieguldījumu brokeru sabiedrībai nekavējoties atkārtoti jāiesniedz grozītā informācija.

#### 4.5 Atbrīvojuma grozījumi un atsaukšana

25. Kompetentās iestādes nedrīkst piešķirt atbrīvojumu ieguldījumu brokeru sabiedrībai, ja tās uzskata, ka šī ieguldījumu brokeru sabiedrība neatbilst atbrīvojuma piešķiršanas kritērijiem pieprasījuma iesniegšanas brīdī vai, visticamāk, neatbildīs tiem vēlākā posmā.
26. Kompetentajām iestādēm jānodrošina, ka ieguldījumu brokeru sabiedrība informē kompetento iestādi, ja ieguldījumu brokeru sabiedrības darbības apstākļos ir notikušas izmaiņas, kas attiecas uz atbilstību atbrīvojuma kritērijiem.
27. Kompetentajām iestādēm jāatsauc atbrīvojums, ja tās uzskata, ka ieguldījumu brokeru sabiedrība vairs neatbilst šajās pamatnostādņēs noteiktajiem atbrīvojuma kritērijiem, vai ja kompetentā iestāde kādā brīdī atzīst, ka atbrīvojums jāatsauc tādai ieguldījumu brokeru sabiedrībai, kas jau ir saņēmusi atbrīvojumu no likviditātes prasību izpildes tās iespējamo nākotnes likviditātes vajadzību dēļ. Kompetentajām iestādēm nekavējoties jāinformē ieguldījumu brokeru sabiedrība par lēmumu atsaukt atbrīvojumu.

28. Kompetentajām iestādēm jāpārlicinās, ka ieguldījumu brokeru sabiedrība atbilst 43. panta 1. punktā noteiktajām likviditātes prasībām, vēlākais, 90 dienu laikā pēc dienas, kad tiek paziņots par kompetentās iestādes lēmumu atsaukt atbrīvojumu.