

Projekts (1. variants)

[Datums]
Rīgā

Noteikumi Nr. [_____]

Ieguldījumu brokeru sabiedrību maksājumu nacionālajā noregulējuma fondā noteikumi

Izdoti saskaņā ar
Kredītiestāžu un ieguldījumu brokeru sabiedrību
darbības atjaunošanas un noregulējuma likuma
121.² panta pirmo daļu

I. Vispārīgie jautājumi

1. Noteikumi nosaka kārtību, kādā aprēķināmi un veicami Latvijas Republikā licencētu ieguldījumu brokeru sabiedrību, kuras atbilst Ieguldījumu brokeru sabiedrību likuma 6. panta pirmās daļas 1. vai 2. punkta prasībām, (turpmāk – sabiedrība) maksājumi nacionālajā noregulējuma fondā.

2. Lai aprēķinātu sabiedrības maksājumu nacionālajā noregulējuma fondā:

2.1. sabiedrības saistību apmēru nosaka, pamatojoties uz pēdējā pieejamā revidētā gada pārskata datiem un ņemot vērā Komisijas 2014. gada 21. oktobra deleģētās regulas (ES) 2015/63, ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes direktīvu 2014/59/ES papildina attiecībā uz *ex-ante* iemaksām noregulējuma finansēšanas mehānismos, 5. panta prasības;
2.2. korekcijas koeficientu nosaka, pamatojoties uz Latvijas Bankai iesniegtā uzraudzības pārskata, kurš sagatavots atbilstoši Komisijas 2021. gada 10. decembra īstenošanas regulai (ES) 2021/2284, ar ko nosaka īstenošanas tehniskos standartus Eiropas Parlamenta un Padomes regulas (ES) 2019/2033 piemērošanai attiecībā uz ieguldījumu brokeru sabiedrību sniegtajiem uzraudzības pārskatiem un informācijas atklāšanu (turpmāk – Regula 2021/2284), datiem par 31. decembri.

3. Nosakot korekcijas koeficientu, aprēķināto rezultātu izsaka procentos ar precizitāti līdz divām zīmēm aiz komata (ja trešais cipars aiz komata ir 5 vai lielāks, otro ciparu aiz komata noapaļo uz augšu).

4. Latvijas Banka līdz katra gada 31. maijam informē sabiedrību par ikgadējā maksājuma nacionālajā noregulējuma fondā apmēru, elektroniski nosūtot paziņojumu uz sabiedrības oficiālo elektronisko adresi.

5. Sabiedrība līdz katra gada 30. jūnijam veic maksājumu nacionālajā noregulējuma fondā, līdzekļus ieskaitot Latvijas Bankas norēķinu kontā Latvijas Bankā Nr. LV40LACB0000000022365, BIC LACBLV2X.

6. Ja sabiedrība sākusi darbību attiecīgajā kalendārajā gadā un nav datu par tās darbību iepriekšējā kalendārajā gadā, attiecīgajā kalendārajā gadā sabiedrībai piemēro vienreizēju

maksājumu nacionālajā noregulējuma fondā 1000 *euro* apmērā. Sabiedrība maksājumu nacionālajā noregulējuma fondā veic līdz 31. decembrim, līdzekļus ieskaitot šo noteikumu 5. punktā norādītajā Latvijas Bankas kontā.

II. Korekcijas koeficienta noteikšana

7. Sabiedrības maksājumam nacionālajā noregulējuma fondā piemērojamo korekcijas koeficientu nosaka saskaņā ar šo noteikumu pielikumā ietverto formulu, izmantojot kapitāla pietiekamības rādītāju (K1) un koncentrācijas riska darījumu rādītājus (R1, R2).

8. Kapitāla pietiekamības rādītāju nosaka atbilstoši Regulas 2021/2284 I pielikumā iekļautā pārskata "I 02.02 – KAPITĀLA RĀDĪTĀJI" postenim "Pašu kapitāla rādītājs" (rinda 0050).

9. Koncentrācijas riska darījumu rādītājus nosaka, izmantojot:

9.1. tirdzniecības portfeļa riska darījumu kopsummu (R1) atbilstoši Regulas 2021/2284 I pielikumā iekļautā pārskata "I 08.05 – Tirdzniecības portfeļa riska darījumi" slejai "Riska darījuma ar konkrēto darījuma partneri procentuālā daļa attiecībā pret sabiedrības pašu kapitālu (tikai tirdzniecības portfeļa pozīcijas)" (sleja 0050);

9.2. riska darījumu kopsummu (R2) atbilstoši Regulas 2021/2248 I pielikumā iekļautā pārskata "I 08.06 – Netirdzniecības portfeļa un ārpusbilances posteņi" slejai "Riska darījuma procentuālā daļa attiecībā pret sabiedrības pašu kapitālu (ieskaitot ārpusbilances aktīvus un netirdzniecības portfeļa posteņus)" (sleja 0050).

III. Maksājuma nacionālajā noregulējuma fondā aprēķināšana

10. Katras sabiedrības ikgadējo maksājumu nacionālajā noregulējuma fondā aprēķina, izmantojot šādu formulu:

$$Mi = \frac{Si}{\sum_{i=1}^n Si} \times KM \times \beta i,$$

kur:

Mi – sabiedrības ikgadējais maksājums nacionālajā noregulējuma fondā;

Si – sabiedrības kopējais saistību (izņemot pašu kapitālu) apmērs;

KM – visu sabiedrību kopējais maksājums nacionālajā noregulējuma fondā;

β – korekcijas koeficients;

n – sabiedrību skaits.

11. Šo noteikumu 10. punktā minēto visu sabiedrību kopējo maksājumu nacionālajā noregulējuma fondā aprēķina, izmantojot šādu formulu:

$$KM = \sum_{i=1}^n Si \times k,$$

kur:

KM – visu sabiedrību kopējais maksājums nacionālajā noregulējuma fondā;

Si – sabiedrības kopējais saistību (izņemot pašu kapitālu) apmērs;

k – Kredītiestāžu un ieguldījumu brokeru sabiedrību darbības atjaunošanas un noregulējuma likumā noteiktais sabiedrības ikgadējā maksājuma nacionālajā noregulējuma fondā procents no saistībām (izņemot pašu kapitālu);

n – sabiedrību skaits.

IV. Noslēguma jautājums

12. Atzīt par spēku zaudējušiem Finanšu un kapitāla tirgus komisijas 2020. gada 31. marta normatīvos noteikumus Nr. 40 "Ieguldījumu brokeru sabiedrību maksājumu nacionālajā noregulējuma fondā normatīvie noteikumi" (Latvijas Vēstnesis, 2020, Nr. 69).

**ŠIS DOKUMENTS IR ELEKTRONISKI PARAKSTĪTS AR DROŠU ELEKTRONISKO
PARAKSTU UN SATUR LAIKA ZĪMOGU**

Latvijas Bankas prezidents

M. Kazāks

Korekcijas koeficientu ietekmējošie rādītāji	Rādītājs		Rādītāja intervāls	Riska pakāpe	Nozīme	Korekcijas koeficients, % (5 x 6)
1	2	3	4	5	6	7
Kapitāla pietiekamības rādītājs:	1. Pašu kapitāla rādītājs	(K ₁)	... – 100.00 %	200 %	50 %	(β ₁)
			100.01 % – 110.00 %	180 %		
			110.01 % – 120.00 %	160 %		
			120.01 % – 130.00 %	140 %		
			130.01 % – 140.00 %	120 %		
			140.01 % – 150.00 %	100 %		
			150.01 % – ...	75 %		
			Koncentrācijas riska darījumu rādītāji:	2. Tirdzniecības portfeļa riska darījumu kopsumma		
150.00 % – 130.01 %	180 %					
130.00 % – 110.01 %	160 %					
110.00 % – 90.01 %	140 %					
90.00 % – 70.01 %	120 %					
70.00 % – 50.01 %	100 %					
... – 50.00 %	75 %					
3. Riska darījumu kopsumma (ārpusbilances aktīvi un netirdzniecības portfeļa posteņi)	(R ₂)	... – 150.01 %		200 %	25 %	(β ₃)
		150.00 % – 130.01 %		180 %		
		130.00 % – 110.01 %		160 %		
		110.00 % – 90.01 %		140 %		
		90.00 % – 70.01 %		120 %		
		70.00 % – 50.01 %		100 %		
		... – 50.00 %		75 %		
Sabiedrības maksājumam piemērojamais korekcijas koeficients $\beta = \beta_1 + \beta_2 + \beta_3$						

ŠIS DOKUMENTS IR ELEKTRONISKI PARAKSTĪTS AR DROŠU ELEKTRONISKO PARAKSTU UN SATUR LAIKA ZĪMOGU