**XXX PRIEDAS. Informacijos apie rinkos riziką pagal standartizuotą metodą ir vidaus metodą atskleidimo lentelės ir formos. Nurodymai**

1. Šiame priede pateikiami nurodymai, kuriais turi vadovautis įstaigos atskleisdamos Reglamento (ES) Nr. 575/2013[[1]](#footnote-2) (toliau – KRR) 435, 445 ir 455 straipsniuose nurodytą informaciją, kai pildo informacijos apie rinkos riziką atskleidimo lenteles ir formas, pateiktas EBI IT sprendimų XXIX priede.

**EU MRA lentelė. Su rinkos rizika susiję kokybinės informacijos atskleidimo reikalavimai** (laisvos formos teksto laukeliai)

1. Pildydamos XXIX priede pateiktą EU MRA lentelę įstaigos atskleidžia Reglamento (ES) Nr. 575/2013 435 straipsnio 1 dalies a–d punktuose nurodytą informaciją apie rinkos riziką, vadovaudamosi toliau šiame priede pateiktais nurodymais.

|  |  |
| --- | --- |
| **Nuorodos į teisės aktus ir nurodymai** | |
| **Eilutės numeris** | **Paaiškinimas** |
| a) | Atskleisdamos Reglamento (ES) Nr. 575/2013 435 straipsnio 1 dalies a ir d punktuose nurodytą informaciją apie rinkos rizikos valdymo tikslus ir politiką, įstaigos pateikia:   * vadovybės strateginių tikslų vykdant įmonės prekybos veiklą paaiškinimą; * 104 straipsnio 1 dalyje nurodytos politikos, pagal kurią nustatoma, kuri pozicija turi būti įtraukta į prekybos knygą, aprašymą, įskaitant ilgai laikomų pozicijų apibrėžtį ir tų pozicijų stebėsenai skirtą rizikos valdymo politiką. Be to, įstaigos aprašo atvejus, kai priemonės yra priskiriamos prekybos ar bankinei knygai, nors tai prieštarauja bendroms tų priemonių kategorijos prielaidoms, be kita ko, nurodydamos jų rinkos ir tikrąją vertę tokiais atvejais, taip pat visus jų perklasifikavimo iš vienos knygos į kitą po paskutinio ataskaitinio laikotarpio atvejus, įskaitant jų tikrąją vertę tokiais atvejais ir perklasifikavimo priežastį; * vidaus rizikos perleidimo veiklos aprašymą, nurodant vidaus rizikos perleidimo padalinio rūšis; * įgyvendinamus procesus įstaigos rinkos rizikai nustatyti, įvertinti, stebėti ir kontroliuoti; * apsidraudimo ir rizikos mažinimo politiką; * apsidraudimo priemonių nuolatinio veiksmingumo stebėsenos strategijas ir procesus. |
| b) | Atskleisdamos Reglamento (ES) Nr. 575/2013 435 straipsnio 1 dalies b punkte nurodytą informaciją apie rinkos rizikos valdymo funkcijos struktūrą ir organizavimą, įstaigos pateikia:   * rinkos rizikos valdymo struktūros, nustatytos siekiant įgyvendinti pirmiau a eilutėje aprašytas įstaigos strategijas ir procesus, aprašymą; * valdant įvairią rinkos riziką dalyvaujančių šalių ryšių ir bendravimo mechanizmų aprašymą. |
| c) | Atskleisdamos Reglamento (ES) Nr. 575/2013 435 straipsnio 1 dalies c punkte nurodytą informaciją apie informacijos apie rinkos riziką ir vertinimo sistemų apimtį ir pobūdį, įstaigos pateikia šių sistemų apimties ir pobūdžio aprašymą. |
| EU d | Atskleisdamos Reglamento (ES) Nr. 575/2013 445 straipsnio 1 dalyje nurodytą informaciją apie bendrą prekybos knygos pozicijų apžvalgą, įstaigos pateikia išsamų savo prekybos knygos pozicijų aprašymą. |

**EU MR1 forma. Rinkos rizika pagal alternatyvų standartizuotą metodą (ASA)** (nustatytasis formatas)

1. Pildydamos XXIX priede pateiktą EU MR1 formą įstaigos atskleidžia Reglamento (ES) Nr. 575/2013 445 straipsnyje nurodytą informaciją, vadovaudamosi toliau šiame priede pateiktais nurodymais. Į šią formą įstaigos neįtraukia jokių savo vidaus rizikos perleidimo padalinio duomenų.

|  |  |
| --- | --- |
| **Nuorodos į teisės aktus ir nurodymai** | |
| **Eilutės numeris** | **Paaiškinimas** |
|  | **Jautrumu grindžiamas metodas**  pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 trečios dalies IV antraštinės dalies 1a skyriaus 2 skirsnį |
| 1. | **Bendroji palūkanų normos rizika (GIRR)**  pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325c straipsnio 2 dalies a punktą ir 325d straipsnio 1 dalies i punktą |
| 2. | **Nuosavybės vertybinių popierių rizika (EQU)**  pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325c straipsnio 2 dalies a punktą ir 325d straipsnio 1 dalies v punktą |
| 3. | **Biržos prekių kainos rizika (COM)**  pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325c straipsnio 2 dalies a punktą ir 325d straipsnio 1 dalies vi punktą |
| 4. | **Užsienio valiutos kurso rizika (FX)**  pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325c straipsnio 2 dalies a punktą ir 325d straipsnio 1 dalies vii punktą |
| 5. | **Pozicijų, kurios nėra pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos, kredito maržos rizika (CSR)**  pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325c straipsnio 2 dalies a punktą ir 325d straipsnio 1 dalies ii punktą |
| 6. | **Neįtrauktos į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos kredito maržos rizika (non–ACTP CSR)**  pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325c straipsnio 2 dalies a punktą ir 325d straipsnio 1 dalies iii punktą |
| 7. | **Įtrauktos į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos kredito maržos rizika (ACTP CSR)**  pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325c straipsnio 2 dalies a punktą ir 325d straipsnio 1 dalies iv punktą |
|  | **Įsipareigojimų neįvykdymo rizika**  pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 trečios dalies IV antraštinės dalies 1a skyriaus 5 skirsnį |
| 8. | **Pozicijos, kurios nėra pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos**  pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 trečios dalies IV antraštinės dalies 1a skyriaus 5 skirsnio 1 poskirsnio 325c straipsnio 2 dalies b punktą |
| 9. | **Neįtrauktos į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos (non–ACTP)**  pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 trečios dalies IV antraštinės dalies 1a skyriaus 5 skirsnio 2 poskirsnio 325c straipsnio 2 dalies b punktą |
| 10. | **Įtrauktos į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos (ACTP)**  pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 trečios dalies IV antraštinės dalies 1a skyriaus 5 skirsnio 3 poskirsnio 325c straipsnio 2 dalies b punktą |
|  | **Likutinė rizika**  Reglamento (ES) Nr. 575/2013 trečios dalies IV antraštinės dalies 1a skyriaus 4 skirsnis |
| EU 11a | **Egzotinės pagrindinės pozicijos**  pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325c straipsnio 2 dalies c punktą ir 325u straipsnio 2 dalies a punktą |
| EU 11b | **Kita likutinė rizika**  pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325c straipsnio 2 dalies c punktą ir 325u straipsnio 2 dalies b punktą |
| 12. | **Bendra nuosavų lėšų reikalavimų suma (OFR)**  1–EU 11b eilučių verčių suma |
| **Skilties raidė** | **Paaiškinimas** |
|  | **Bendra nuosavų lėšų reikalavimų suma (OFR)** |
| a | Atskleidžiama Reglamento (ES) Nr. 575/2013 438 straipsnio d punkte nurodyta bendra pagal riziką įvertintų pozicijų suma, apskaičiuota kaip paprasta 1–EU 11b eilučių verčių suma. |

**EU MRB lentelė. Kokybinės informacijos atskleidimo reikalavimai alternatyvų vidaus modelio metodą taikančioms įstaigoms** (laisvos formos tekstas)

1. Pildydamos XXIX priede pateiktą EU MRB lentelę įstaigos atskleidžia Reglamento (ES) Nr. 575/2013 455 straipsnio a, b, c, d, e ir f punktuose nurodytą informaciją, vadovaudamosi toliau šiame priede pateiktais nurodymais.

|  |  |
| --- | --- |
| **Nuorodos į teisės aktus ir nurodymai** | |
| **Eilutės numeris** | **Paaiškinimas** |
|  | Atskleisdamos Reglamento (ES) Nr. 575/2013 455 straipsnio 1a punkte nurodytą informaciją apie alternatyvų rinkos rizikos vidaus modelių metodą, įstaigos pateikia: |
| EU a | įstaigos tikslus vykdant prekybos veiklą ir procesus, įgyvendinamus siekiant nustatyti, įvertinti, stebėti ir kontroliuoti įstaigos rinkos riziką. Šią informaciją galima nurodyti pateikiant kryžminę nuorodą į EU MRA lentelę |
| EU b | 104 straipsnio 1 dalyje nurodytą politiką, pagal kurią nustatoma, kuri pozicija turi būti įtraukta į prekybos knygą. Šią informaciją galima nurodyti pateikiant kryžminę nuorodą į EU MRA lentelę |
| EU c | rinkos rizikos valdymo funkcijos ir valdymo struktūrą ir organizavimą. |
| A) B) Bendras prekybos operacijų sąrašo struktūros ir į AIMA prekybos operacijų sąrašą pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 455 straipsnio 1 dalies c ir d punktus įtrauktų priemonių rūšių aprašymas | |
| B) a | Atskleisdamos Reglamento (ES) Nr. 575/2013 455 straipsnio 1 dalies c punkte nurodytą informaciją, įstaigos pateikia bendrą prekybos operacijų sąrašų, kuriems taikomi 325az straipsnyje nurodyti vidaus modeliai, struktūros aprašymą, įskaitant išsamų kiekvieno sąrašo verslo strategijos aprašymą, joje leidžiamas priemones ir pagrindines su tuo sąrašu susijusias rizikos rūšis. |
| Atskleisdamos Reglamento (ES) Nr. 575/2013 455 straipsnio 1 dalies d punkte nurodytą informaciją, įstaigos pateikia bendrą prekybos knygos pozicijų, kurioms netaikomi 325az straipsnyje nurodyti alternatyvūs vidaus modeliai, apžvalgą, įskaitant bendrą sąrašo struktūros ir priemonių, įtrauktų į sąrašus arba sąrašų kategorijas pagal 104b straipsnį, rūšies aprašymą. |
| B) C) E) Pagrindinių konsoliduotu lygmeniu naudojamų modelių charakteristikų, įskaitant metodus, taikomus tvirtinant modelius ir modeliavimo procesus, aprašymas | |
| B) b, c, d ir e | Atskleisdamos Reglamento (ES) Nr. 575/2013 455 straipsnio 1 dalies f punkto i papunktyje nurodytą informaciją, įstaigos pateikia: įvairių Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325az straipsnyje nurodytų vidaus modelių, naudojamų apskaičiuojant pagrindinių konsoliduotu lygmeniu naudojamų modelių rizikos pozicijų sumas, taikymo sritį, pagrindines charakteristikas ir pagrindinius modeliavimo sprendimus ir aprašymą, kiek tie vidaus modeliai atspindi visus konsoliduotu lygmeniu naudojamus modelius, įskaitant, kai taikoma: i) išsamų modeliavimo metodo, taikomo KRR 325ba straipsnio 1 dalies a punkte nurodytam tikėtinam trūkumui apskaičiuoti, aprašymą, nurodant duomenų atnaujinimo dažnumą. |
| C) a | Atskleisdamos Reglamento (ES) Nr. 575/2013 455 straipsnio 1 dalies f punkto ii papunktyje nurodytą informaciją, įstaigos atitinkamais atvejais pateikia: išsamų metodikos, naudojamos Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325ba straipsnio 1 dalies b punkte nurodytam testavimo nepalankiausiomis sąlygomis scenarijaus rizikos matui apskaičiuoti, išskyrus to reglamento 325bk straipsnio 3 dalyje numatytas specifikacijas, aprašymą. |
| D) Vidaus modelių, naudojamų apskaičiuojant kapitalo poreikį įsipareigojimų neįvykdymo rizikai padengti, aprašymas | |
| 1. b) | Atskleisdamos Reglamento (ES) Nr. 575/2013 455 straipsnio 1 dalies f punkto iii papunktyje nurodytą informaciją, įstaigos atitinkamais atvejais pateikia: išsamų modeliavimo metodo, taikomo Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325ba straipsnio 2 dalyje nurodytam kapitalo poreikiui įsipareigojimų neįvykdymo rizikai padengti apskaičiuoti, aprašymą, įskaitant duomenų atnaujinimo dažnumą. |

**EU MR2 forma. Rinkos rizika pagal alternatyvų vidaus modelio metodą (AIMA)** (nustatytasis formatas)

1. Pildydamos XXIX priede pateiktą EU MR2 formą įstaigos atskleidžia Reglamento (ES) Nr. 575/2013 455 straipsnio 2 dalyje nurodytą informaciją, vadovaudamosi toliau šiame priede pateiktais nurodymais. Į šią formą įstaigos neįtraukia jokių savo vidaus rizikos perleidimo padalinio duomenų.

|  |  |
| --- | --- |
| **Nuorodos į teisės aktus ir nurodymai** | |
| **Eilutės numeris** | **Paaiškinimas** |
| 1 | **Neriboto tikėtino trūkumo matas (UESt)**  Atskleidžiama vertė yra apskaičiuota viso portfelio lygmeniu (ne pagrindinės rizikos veiksnių kategorijos lygmeniu) pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325bb ir 325bc straipsnius. |
| 2. | **Kiekvienos pagrindinės palūkanų normos rizikos veiksnių kategorijos neriboto tikėtino trūkumo matas**  Atskleidžiama vertė yra apskaičiuota palūkanų normos rizikos kategorijos rizikos veiksniams pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325bb, 325bc ir 325bd straipsnius. |
| 3. | **Kiekvienos pagrindinės nuosavybės vertybinių popierių rizikos veiksnių kategorijos neriboto tikėtino trūkumo matas**  Atskleidžiama vertė yra apskaičiuota nuosavybės vertybinių popierių rizikos kategorijos rizikos veiksniams pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325bb, 325bc ir 325bd straipsnius. |
| 4. | **Kiekvienos pagrindinės biržos prekių rizikos veiksnių kategorijos neriboto tikėtino trūkumo matas**  Atskleidžiama vertė yra apskaičiuota biržos prekių rizikos kategorijos rizikos veiksniams pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325bb, 325bc ir 325bd straipsnius. |
| 5. | **Kiekvienos pagrindinės užsienio valiutos rizikos veiksnių kategorijos neriboto tikėtino trūkumo matas**  Atskleidžiama vertė yra apskaičiuota užsienio valiutos kurso rizikos kategorijos rizikos veiksniams pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325bb, 325bc ir 325bd straipsnius. |
| 6. | **Kiekvienos pagrindinės kredito maržos rizikos veiksnių kategorijos neriboto tikėtino trūkumo matas**  Atskleidžiama vertė yra apskaičiuota kredito maržos kategorijos rizikos veiksniams pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325bb, 325bc ir 325bd straipsnius. |
| 7. | **Pagrindinių rizikos veiksnių kategorijų neriboto tikėtino trūkumo matų suma** (∑UESit)  2–6 eilučių verčių suma |
| 8. | **Tikėtino trūkumo matas (ESt)**  Tikėtino trūkumo rizikos matas yra apskaičiuojamas pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325ba 1 dalies a punkto i papunktį. |
| 9. | **Testavimo nepalankiausiomis sąlygomis scenarijaus rizikos matas (SSt)**  Testavimo nepalankiausiomis sąlygomis scenarijaus rizikos matas yra apskaičiuojamas pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325ba 1 dalies a punkto ii papunktį. |
| 10. | **Kapitalo poreikis įsipareigojimų neįvykdymo rizikai padengti (DRCt)**  Kapitalo poreikis įsipareigojimų neįvykdymo rizikai padengti yra apskaičiuojamas pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325ba 2 dalies a punktą. |
| 11 | **PLAaddon**  Ši vertė apskaičiuojama pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325ba 3 dalį kartu su Reglamento (ES) 2022/2059 10 straipsnio 1 dalimi. |
| 12. | **OFR balansinei ir nebalansinei veiklai plius PLAaddon (AIMA + PLAaddon)**  Ši vertė apskaičiuojama pagal Reglamento (ES) 2022/2059 10 straipsnio 1 dalį. Pridedama 11 eilutės vertė. |
| 13 | **Bendra OFR suma pagal ASA prekybos operacijų sąrašams, neatitinkantiems AIMA taikymo reikalavimų (ASAnon-aima)**  Ši vertė apskaičiuojama pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325ba straipsnio 3 dalį. |
| 14 | **Skirtumas tarp OFR pagal AIMA ir ASA prekybos operacijų sąrašams, taikantiems AIMA (AIMA-ASAaima)**  Ši vertė yra lygi skirtumui tarp nuosavų lėšų reikalavimų sumos pagal AIMA prekybos operacijų sąrašams, taikantiems AIMA, (Reglamento (ES) 2022/2059 10 straipsnio 1 dalis) ir nuosavų lėšų reikalavimų sumos pagal ASA visiems AIMA prekybos operacijų sąrašams (portfelių pjūvis) (Reglamento (ES) 2022/2059 10 straipsnio 1 dalis). |
| 15 | **OFR pagal ASA visiems prekybos operacijų sąrašams (įskaitant tuos, kuriems taikomas AIMA) (ASAall portfolio)**  Ši vertė apskaičiuojama pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325ba straipsnio 3 dalį. |
| 16. | **Bendra nuosavų lėšų reikalavimų suma pagal AIMA (TotalAIMA)**  Ši vertė apskaičiuojama pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325ba straipsnio 3 dalį. |
| **Skilties raidė** | **Paaiškinimas** |
| a | Atskleidžiamas pats naujausias einamojo ketvirčio rizikos matas [1–10 eilutės] arba nuosavų lėšų reikalavimai [11–16 eilutės]. |
| b | Ankstesnių 60 darbo dienų [1–10 eilutės] arba ankstesnių 12 savaičių [10 eilutė] per einamąjį ketvirtį rizikos mato aritmetinis vidurkis |
| c | Didžiausias rizikos matas per ankstesnes 60 darbo dienų [1–6 eilutės] per einamąjį ketvirtį |
| d | Mažiausias rizikos matas per ankstesnes 60 darbo dienų [1–6 eilutės] per einamąjį ketvirtį |
| e | Nukrypimų atlikus grįžtamąjį patikrinimą skaičius [1 eilutė].  Šiame laukelyje nurodytas nukrypimų skaičius yra naudojamas nustatant papildomą mokestį pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325bf straipsnio 6 dalies b punkto 3 lentelę. Į nukrypimų skaičių neįtraukiami kompetentingai institucijai suteikus leidimą įvykę nukrypimai. |
| f | Naujausias ankstesnio ketvirčio rizikos matas [1–10 eilutės] arba nuosavų lėšų reikalavimai [11–16 eilutės] |
| g | Ankstesnių 60 darbo dienų [1–10 eilutės] arba ankstesnių 12 savaičių [10 eilutė] per ankstesnį ketvirtį rizikos mato aritmetinis vidurkis |

**EU MR3 forma. Rinkos rizika pagal supaprastintą standartizuotą metodą (SSA)** (nustatytasis formatas)

1. Pildydamos IT sprendimų XXIX priede pateiktą EU MR3 formą įstaigos atskleidžia Reglamento (ES) Nr. 575/2013 445 straipsnyje nurodytą informaciją, vadovaudamosi toliau šiame priede pateiktais nurodymais.

|  |  |
| --- | --- |
| **Nuorodos į teisės aktus ir nurodymai** | |
| **Eilutės numeris** | **Paaiškinimas** |
|  |  |
| 1 | **Palūkanų normos rizika (bendroji ir specifinė)**  Skolos priemonių, kuriomis prekiaujama, pozicijų prekybos knygoje bendroji ir specifinė rizika pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 trečios dalies IV antraštinės dalies 2 skyrių, išskyrus specifinę riziką, susijusią su pakeitimu vertybiniais popieriais |
| 2 | **Nuosavybės vertybinių popierių rizika (bendroji ir specifinė)**  Nuosavybės vertybinių popierių pozicijų prekybos knygoje bendroji ir specifinė rizika pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 trečios dalies IV antraštinės dalies 2 skyrių |
| 3. | **Biržos prekių kainos rizika**  Biržos prekių pozicijų rizika pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 trečios dalies IV antraštinės dalies 4 skyrių |
| 4. | **Užsienio valiutos kurso rizika**  Užsienio valiutos kurso pozicijų rizika pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 trečios dalies IV antraštinės dalies 3 skyrių |
| 5. | **Pakeitimas vertybiniais popieriais (specifinė rizika)**  Pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijų prekybos knygoje specifinė rizika pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 trečios dalies IV antraštinės dalies 2 skyriaus 337 ir 338 straipsnius |
| 6. | **Bendra OFR suma pagal S-SA**  Atskleidžiama Reglamento (ES) Nr. 575/2013 438 straipsnio d punkte nurodytų nuosavų lėšų reikalavimų suma, apskaičiuota kaip paprasta a skilties 1–5 eilučių suma ir paprasta b, c ir d skilčių 1–4 eilučių verčių suma. |
| **Skilties raidė** | **Paaiškinimas** |
|  | **Vienakrypčiai produktai** |
| a | Nepasirenkamų produktų, neįtraukiamų į metodus pagal techninius reguliavimo standartus, taikomus pasirinkimo sandorių ne delta rizikai naudojant standartizuotą rinkos rizikos metodą[[2]](#footnote-3), pozicijos. |
|  | **Pasirinkimo sandoriai** |
| b | **Supaprastintas metodas**  Pasirinkimo sandoriai ar varantai, kaip apibrėžta Reglamento (ES) Nr. 575/2013 trečios dalies IV antraštinės dalies 2 skyriaus 329 straipsnio 3 dalyje, kurių atžvilgiu įstaigos pagal supaprastintą metodą apskaičiuoja nuosavų lėšų reikalavimus ne delta rizikai padengti[[3]](#footnote-4) |
| c | **Delta plius metodas**  Pasirinkimo sandoriai ar varantai prekybos knygoje, kaip apibrėžta Reglamento (ES) Nr. 575/2013 trečios dalies IV antraštinės dalies 2 skyriaus 329 straipsnio 3 dalyje, kurių atžvilgiu įstaigos pagal delta plius metodą[[4]](#footnote-5) apskaičiuoja nuosavų lėšų reikalavimus ne delta rizikai padengti |
| d | **Scenarijų metodas**  Pasirinkimo sandoriai ar varantai prekybos knygoje, kaip apibrėžta Reglamento (ES) Nr. 575/2013 trečios dalies IV antraštinės dalies 2 skyriaus 329 straipsnio 3 dalyje, kurių atžvilgiu įstaigos pagal scenarijų metodą[[5]](#footnote-6) apskaičiuoja nuosavų lėšų reikalavimus ne delta rizikai padengti. |

1. 2013 m. birželio 26 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 575/2013 dėl riziką ribojančių reikalavimų kredito įstaigoms, kuriuo iš dalies keičiamas Reglamentas (ES) Nr. 648/2012, su pakeitimais, padarytais Reglamentu (ES) 2024/1623, ([OL L 176, 2013 6 27, p. 1;](https://eur-lex.europa.eu/legal-content/LT/TXT/?uri=OJ%3AL%3A2013%3A176%3ATOC) [Reglamentas (ES) 2024/1623 - LT - EUR-Lex (europa.eu)](https://eur-lex.europa.eu/legal-content/LT/TXT/?uri=OJ:L_202401623)). [↑](#footnote-ref-2)
2. Kaip apibrėžta 2014 m. kovo 12 d. KOMISIJOS DELEGUOTAJAME REGLAMENTE (ES) Nr. 528/2014, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 575/2013 papildomas nuostatomis dėl techninių reguliavimo standartų, taikomų pasirinkimo sandorių ne delta rizikai naudojant standartizuotą rinkos rizikos metodą (OL L 148, 2014 05 20, p. 29). [↑](#footnote-ref-3)
3. Kaip apibrėžta 2014 m. kovo 12 d. KOMISIJOS DELEGUOTAJAME REGLAMENTE (ES) Nr. 528/2014, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 575/2013 papildomas nuostatomis dėl techninių reguliavimo standartų, taikomų pasirinkimo sandorių ne delta rizikai naudojant standartizuotą rinkos rizikos metodą (OL L 148, 2014 05 20, p. 29). [↑](#footnote-ref-4)
4. Kaip apibrėžta 2014 m. kovo 12 d. KOMISIJOS DELEGUOTAJAME REGLAMENTE (ES) Nr. 528/2014, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 575/2013 papildomas nuostatomis dėl techninių reguliavimo standartų, taikomų pasirinkimo sandorių ne delta rizikai naudojant standartizuotą rinkos rizikos metodą (OL L 148, 2014 05 20, p. 29). [↑](#footnote-ref-5)
5. Kaip apibrėžta 2014 m. kovo 12 d. KOMISIJOS DELEGUOTAJAME REGLAMENTE (ES) Nr. 528/2014, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 575/2013 papildomas nuostatomis dėl techninių reguliavimo standartų, taikomų pasirinkimo sandorių ne delta rizikai naudojant standartizuotą rinkos rizikos metodą (OL L 148, 2014 05 20, p. 29). [↑](#footnote-ref-6)