**XXX PIELIKUMS – Tabulas un veidnes informācijas atklāšanai par tirgus riska standartizēto un iekšējo pieeju: norādījumi**

1. Šajā pielikumā ir sniegti norādījumi, ko iestādes ievēro, atklājot Regulas (ES) Nr. 575/2013[[1]](#footnote-2) (“*CRR*”) 435., 445. un 455. pantā minēto informāciju, lai aizpildītu EBI IT risinājumu XXIX pielikumā ietvertās tabulas un veidnes informācijas atklāšanai par tirgus risku.

**Tabula EU MRA – Kvalitatīvās informācijas atklāšanas prasības saistībā ar tirgus risku.** Brīva formāta tekstlogi.

1. Iestādes atklāj Regulas (ES) Nr. 575/2013 435. panta 1. punkta a)–d) apakšpunktā minēto informāciju par tirgus risku, ievērojot turpmāk šajā pielikumā sniegtos norādījumus, lai aizpildītu EBI IT risinājumu XXIX pielikumā ietverto tabulu EU MRA.

|  |  |
| --- | --- |
| **Atsauces uz tiesību aktiem un norādījumi** | |
| **Rindas numurs** | **Paskaidrojums** |
| a) | Atklājot Regulas (ES) Nr. 575/2013 435. panta 1. punkta a) un d) apakšpunktā minēto informāciju par riska pārvaldības mērķiem un tirgus riska pārvaldības politiku, iestādes iekļauj:   * skaidrojumu par to vadības stratēģiskajiem mērķiem tirdzniecības darbību īstenošanā, * aprakstu par 104. panta 1. punktā minētajām politikām, ar ko nosaka, kura pozīcija jāiekļauj tirdzniecības portfelī, tajā skaitā inertu pozīciju definīciju un riska pārvaldības politiku šo pozīciju uzraudzībai. Turklāt iestādes apraksta gadījumus, kad instrumenti iekļauti tirdzniecības vai banku portfelī pretēji to instrumentu kategorijas vispārējiem pieņēmumiem, tajā skaitā to tirgus un patieso vērtību šādos gadījumos, kā arī apraksta pārklasificēšanu no viena portfeļa uz otru kopš pēdējā pārskata perioda, tajā skaitā šādu gadījumu patieso vērtību un pārklasificēšanas iemeslu, * aprakstu par iekšējām riska pārvešanas darbībām, tajā skaitā par iekšējo riska pārvešanas nodaļu veidiem, * procesus, kas ieviesti, lai apzinātu, novērtētu, uzraudzītu un kontrolētu iestādes tirgus riskus, * riska ierobežošanas un mazināšanas politiku, * stratēģijas un procesus riska ierobežošanas pozīciju pastāvīgas efektivitātes kontrolei. |
| b) | Atklājot Regulas (ES) Nr. 575/2013 435. panta 1. punkta b) apakšpunktā minēto informāciju par tirgus riska pārvaldības funkcijas struktūru un organizāciju, iestādes iekļauj:   * aprakstu par tirgus riska pārvaldības struktūru, kas izveidota, lai īstenotu iestādes stratēģijas un procesus, kā minēts a) rindā iepriekš, * aprakstu par attiecībām un saziņas mehānismiem starp dažādām pusēm, kas iesaistītas tirgus riska pārvaldībā. |
| c) | Atklājot Regulas (ES) Nr. 575/2013 435. panta 1. punkta c) apakšpunktā minēto informāciju par tirgus riska ziņošanas un novērtēšanas sistēmu tvērumu un raksturu, iestādes sniedz aprakstu par tirgus riska ziņošanas un novērtēšanas sistēmu tvērumu un raksturu. |
| EU d) | Atklājot Regulas (ES) Nr. 575/2013 445. panta 1. punktā minēto informāciju par vispārēju pārskatu par tirdzniecības portfeļa pozīcijām, iestādes sniedz augsta līmeņa aprakstu par to tirdzniecības portfeļa pozīcijām. |

**Veidne EU MR1 – Tirgus risks saskaņā ar alternatīvu standartizēto pieeju (*ASA*)**. Fiksēts formāts.

1. Iestādes atklāj Regulas (ES) Nr. 575/2013 445. pantā minēto informāciju, ievērojot turpmāk šajā pielikumā sniegtos norādījumus, lai aizpildītu veidni EU MR1, kas ietverta EBI IT risinājumu XXIX pielikumā. Iestādes šajā veidnē nenorāda datus par savu iekšējo riska pārvešanas (*IRT*) nodaļu.

|  |  |
| --- | --- |
| **Atsauces uz tiesību aktiem un norādījumi** | |
| **Rindas numurs** | **Paskaidrojums** |
|  | **Uz jutīgumu balstīta metode**  Saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 trešās daļas IV sadaļas 1.a nodaļas 2. iedaļu. |
| 1. | **Vispārīgais procentu likmju risks (*GIRR*)**  Saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.c panta 2. punkta a) apakšpunktu un 325.d panta 1. punkta i) apakšpunktu. |
| 2. | **Kapitāla vērtspapīru risks (*EQU*)**  Saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.c panta 2. punkta a) apakšpunktu un 325.d panta 1. punkta v) apakšpunktu. |
| 3. | **Preču risks (*COM*)**  Saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.c panta 2. punkta a) apakšpunktu un 325.d panta 1. punkta vi) apakšpunktu. |
| 4. | **Ārvalstu valūtas risks (*FX*)**  Saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.c panta 2. punkta a) apakšpunktu un 325.d panta 1. punkta vii) apakšpunktu. |
| 5. | **Nevērtspapīrošanas kredītriska starpības risks (*CSR*)**  Saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.c panta 2. punkta a) apakšpunktu un 325.d panta 1. punkta ii) apakšpunktu. |
| 6. | **Alternatīvā korelācijas tirdzniecības portfelī neiekļautas vērtspapīrošanas kredītriska starpības risks (*non-ACTP CSR*)**  Saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.c panta 2. punkta a) apakšpunktu un 325.d panta 1. punkta iii) apakšpunktu. |
| 7. | **Alternatīvā korelācijas tirdzniecības portfelī iekļautas vērtspapīrošanas kredītriska starpības risks (*ACTP CSR*)**  Saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.c panta 2. punkta a) apakšpunktu un 325.d panta 1. punkta iv) apakšpunktu. |
|  | **Saistību neizpildes risks**  Saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 trešās daļas IV sadaļas 1.a nodaļas 5. iedaļu. |
| 8. | **Nevērtspapīrošana**  Saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.c panta 2. punkta b) apakšpunktu un trešās daļas IV sadaļas 1.a nodaļas 5. iedaļas 1. apakšiedaļu. |
| 9. | **Vērtspapīrošana, kas nav iekļauta alternatīvajā korelācijas tirdzniecības portfelī (*non-ACTP*)**  Saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.c panta 2. punkta b) apakšpunktu un trešās daļas IV sadaļas 1.a nodaļas 5. iedaļas 2. apakšiedaļu. |
| 10. | **Vērtspapīrošana, kas iekļauta alternatīvajā korelācijas tirdzniecības portfelī (*ACTP*)**  Saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.c panta 2. punkta b) apakšpunktu un trešās daļas IV sadaļas 1.a nodaļas 5. iedaļas 3. apakšiedaļu. |
|  | **Atlikušais risks**  Regulas (ES) Nr. 575/2013 trešās daļas IV sadaļas 1.a nodaļas 4. iedaļa. |
| EU 11.a | **Eksotiski pamatā esošie riska darījumi**  Saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.c panta 2. punkta c) apakšpunktu un 325.u panta 2. punkta a) apakšpunktu. |
| EU 11.b | **Citi atlikušie riski**  Saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.c panta 2. punkta c) apakšpunktu un 325.u panta 2. punkta b) apakšpunktu. |
| 12. | **Kopējās pašu kapitāla prasības (*OFR*)**  1.–EU 11.b rindas summa. |
| **Ailes burts** | **Paskaidrojums** |
|  | **Kopējās pašu kapitāla prasības (*OFR*)** |
| a | Jāatklāj informācija par pašu kapitāla prasībām, kas minētas Regulas (ES) Nr. 575/2013 438. panta d) punktā un kas aprēķināta kā vienkārša iepriekš 1.–EU 11.b rindā minēto vērtību summa. |

**Tabula EU MRB – Kvalitatīvās informācijas atklāšanas prasības iestādēm, kas izmanto alternatīvo iekšējā modeļa pieeju.** Brīvteksta formāts.

1. Iestādes atklāj Regulas (ES) Nr. 575/2013 455. panta a)–f) punktā minēto informāciju, ievērojot turpmāk šajā pielikumā sniegtos norādījumus, lai aizpildītu XXIX pielikumā ietverto tabulu EU MRB.

|  |  |
| --- | --- |
| **Atsauces uz tiesību aktiem un norādījumi** | |
| **Rindas numurs** | **Paskaidrojums** |
|  | Atklājot Regulas (ES) Nr. 575/2013 455. panta 1.a punktā minēto informāciju par alternatīviem tirgus riska iekšējiem modeļiem, iestādes apraksta: |
| EU (a) | vadības mērķus attiecībā uz tirdzniecības darbībām, kā arī īstenotos procesus, ar kuriem nosaka, novērtē, uzrauga un kontrolē iestādes tirgus risku. Šo informāciju var sniegt, sniedzot mijnorādes uz tabulu EU MRA; |
| EU (b) | politiku, kas minēta 104. panta 1. punktā, attiecībā uz to, kā noteikt, kura pozīcija jāiekļauj tirdzniecības portfelī. Šo informāciju var sniegt, sniedzot mijnorādes uz tabulu EU MRA; |
| EU (c) | tirgus riska pārvaldības funkcijas un pārvaldības struktūru un organizāciju; |
| (A) (B) Vispārīgs apraksts par tirdzniecības nodaļas struktūru un *AIMA* tirdzniecības nodaļā iekļauto instrumentu veidiem saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 455. panta 1. punkta c) un d) apakšpunktu. | |
| B (a) | Atklājot Regulas (ES) Nr. 575/2013 455. panta 1. punkta c) apakšpunktā minēto informāciju, iestādes sniedz vispārīgu aprakstu par to tirdzniecības nodaļu struktūru, uz kurām attiecas 325.az pantā minētie iekšējie modeļi, tajā skaitā par katru nodaļu – vispārīgu aprakstu par nodaļas darījumdarbības stratēģiju, tajā atļautajiem instrumentiem un galvenajiem riska veidiem saistībā ar minēto nodaļu. |
| Atklājot Regulas (ES) Nr. 575/2013 455. panta 1. punkta d) apakšpunktā minēto informāciju, iestādes sniedz vispārēju pārskatu par tirdzniecības portfeļa pozīcijām, uz kurām neattiecas 325.az pantā minētie iekšējie modeļi, tajā skaitā vispārīgu aprakstu par nodaļas struktūru un instrumentu veidiem, kas iekļauti nodaļās vai nodaļu kategorijās saskaņā ar 104.b pantu. |
| B) C) E) Konsolidētā līmenī izmantoto modeļu galveno raksturlielumu apraksts, tajā skaitā modeļu un modelēšanas procesu validēšanā izmantotās pieejas. | |
| B (b) (c) (d) (e) | Atklājot Regulas (ES) Nr. 575/2013 455. panta 1. punkta f) apakšpunkta i) punktā minēto informāciju, iestādes sniedz: aprakstu par dažādu Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.az pantā minēto iekšējo modeļu darbības jomu, galvenās iezīmes un galvenās modelēšanas izvēles, ko izmanto, lai aprēķinātu riska darījumu vērtības galvenajiem konsolidētajā līmenī izmantotajiem modeļiem, un aprakstu par to, cik lielā mērā šie iekšējie modeļi atspoguļo visus konsolidētajā līmenī izmantotos modeļus, tajā skaitā attiecīgā gadījumā: i) vispārīgu aprakstu par modelēšanas pieeju, ko izmanto, lai aprēķinātu *CRR* 325.ba panta 1. punkta a) apakšpunktā minēto sagaidāmo iztrūkumu, tajā skaitā datu atjaunināšanas biežumu. |
| C (a) | Atklājot informāciju par riska darījumiem, kas minēti Regulas (ES) Nr. 575/2013 455. panta 1. punkta f) apakšpunkta ii) punktā, iestādes attiecīgā gadījumā sniedz: vispārīgu aprakstu par Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.ba panta 1. punkta b) apakšpunktā minētā stresa scenārija riska mēra aprēķināšanai izmantoto metodiku, izņemot Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.bk panta 3. punktā minētās specifikācijas. |
| D) Iekšējo modeļu apraksts saistību nepildīšanas riska kapitāla prasības aprēķināšanai | |
| 1. b) | Atklājot informāciju, kas minēta Regulas (ES) Nr. 575/2013 455. panta 1. punkta f) apakšpunkta iii) punktā, iestāde attiecīgā gadījumā iekļauj: vispārīgu aprakstu par modelēšanas pieeju, ko izmanto, lai aprēķinātu Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.ba panta 2. punktā minēto saistību nepildīšanas riska kapitāla prasību, tajā skaitā norādot datu atjaunināšanas biežumu. |

**Veidne EU MR2 – Tirgus risks atbilstoši alternatīvu iekšējo modeļu pieejai (*AIMA*).** Fiksēts formāts.

1. Iestādes atklāj Regulas (ES) Nr. 575/2013 455. panta 2. punktā minēto informāciju, ievērojot turpmāk šajā pielikumā sniegtos norādījumus, lai aizpildītu veidni EU MR2, kas ietverta EBI IT risinājumu XXIX pielikumā. Iestādes šajā veidnē nenorāda datus par savu iekšējo riska pārvešanas (*IRT*) nodaļu.

|  |  |
| --- | --- |
| **Atsauces uz tiesību aktiem un norādījumi** | |
| **Rindas numurs** | **Paskaidrojums** |
| 1. | **Neierobežotais sagaidāmā iztrūkuma mērs (*UESt*)**  Atklāto vērtību aprēķina kopējā portfeļa līmenī, nevis plašas riska kategorijas līmenī saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.bb un 325.bc pantu. |
| 2. | **Neierobežotais sagaidāmā iztrūkuma mērs procentu likmes riska kategorijas riska faktoram**  Procentu likmes riska kategorijas riska faktoru atklāto vērtību aprēķina saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.bb, 325.bc un 325.bd pantu. |
| 3. | **Neierobežotais sagaidāmā iztrūkuma mērs kapitāla vērtspapīru riska kategorijas riska faktoram**  Kapitāla vērtspapīru riska kategorijas riska faktoru atklāto vērtību aprēķina saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.bb, 325.bc un 325.bd pantu. |
| 4. | **Neierobežotais sagaidāmā iztrūkuma mērs preču riska kategorijas riska faktoram**  Preču riska kategorijas riska faktoru atklāto vērtību aprēķina saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.bb, 325.bc un 325.bd pantu. |
| 5. | **Neierobežotais sagaidāmā iztrūkuma mērs ārvalstu valūtas riska kategorijas riska faktoram**  Ārvalstu valūtas riska kategorijas riska faktoru atklāto vērtību aprēķina saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.bb, 325.bc un 325.bd pantu. |
| 6. | **Neierobežotais sagaidāmā iztrūkuma mērs kredītriska starpības riska kategorijas riska faktoram**  Kredītriska starpības riska kategorijas riska faktoru atklāto vērtību aprēķina saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.bb, 325.bc un 325.bd pantu. |
| 7. | **Neierobežotā sagaidāmā iztrūkuma mēra summa vispārīgām riska faktoru kategorijām** (∑UESit)  2.–6. rindas summa. |
| 8. | **Sagaidāmā iztrūkuma mērs (ESt)**  Sagaidāmā iztrūkuma riska mēru aprēķina saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.ba panta 1. punkta a) apakšpunkta i) punktu. |
| 9. | **Stresa scenārija riska mērs (SSt)**  Stresa scenārija riska mēru aprēķina saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.ba panta 1. punkta a) apakšpunkta ii) punktu. |
| 10. | **Saistību nepildīšanas riska kapitāla prasība (DRCt)**  Saistību nepildīšanas riska kapitāla prasību aprēķina saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.ba panta 2. punkta a) apakšpunktu. |
| 11. | **Peļņas un zaudējumu attiecinājuma papildinājums *PLAaddon*)**  Šo vērtību aprēķina saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.ba panta 3. punktu saistībā ar Regulas (ES) 2022/2059 10. panta 1. punktu. |
| 12. | **Kopējās pašu kapitāla prasības (*OFR*) bilances un ārpusbilances darījumiem plus *PLAaddon* (*AIMA* + *PLAaddon*)**  Šo vērtību aprēķina saskaņā ar Regulas (ES) 2022/2059 10. panta 1. punktu. Pievieno 11. rindas vērtību. |
| 13. | **Kopējās *ASA OFR* tirdzniecības nodaļām, kas nav tiesīgas izmantot *AIMA* (*ASAnon-aima*)**  Šo vērtību aprēķina tā, kā minēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.ba panta 3. punktā. |
| 14. | ***AIMA* tirdzniecības nodaļu *OFR* atšķirība atbilstīgi *AIMA* un *ASA* (*AIMA-ASAaima*)**  Šo vērtību aprēķina kā starpību starp *AIMA* pašu kapitāla prasībām *AIMA* nodaļām (Regulas (ES) 2022/2059 10. panta 1. punkts) un *ASA* pašu kapitāla prasību vērtību visām *AIMA* nodaļām (portfeļa līmenī) (Regulas (ES) 2022/2059 10. panta 1. punkts). |
| 15. | ***ASA OFR* visām tirdzniecības nodaļām (arī tām, uz kurām attiecas *AIMA*) (*ASAall* portfelis)**  Šo vērtību aprēķina tā, kā minēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.ba panta 3. punktā. |
| 16. | **Kopējās pašu kapitāla prasības *AIMA* (*TotalAIMA*)**  Šo vērtību aprēķina tā, kā minēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.ba panta 3. punktā. |
| **Ailes burts** | **Paskaidrojums** |
| a | Informācijas atklāšana par jaunāko aprēķināto riska mēru [1.–10. rinda] vai pašu kapitāla prasībām [11.–16. rinda] kārtējā ceturksnī. |
| b | Riska mēra vidējā vērtība [1.–10. rinda] iepriekšējo 60 darbdienu laikā [1.–9. rinda] vai iepriekšējo 12 nedēļu laikā [10. rinda] kārtējā ceturksnī. |
| c | Lielākā riska mērs iepriekšējo 60 darbdienu laikā [1.–6. rinda] kārtējā ceturksnī. |
| d | Zemākā riska mērs iepriekšējo 60 darbdienu laikā [1.–6. rinda] kārtējā ceturksnī. |
| e | Atpakaļejošās pārbaudēs noteikto pārsniegumu skaits [1. rinda]  Šajā šūnā ziņotais pārsniegumu skaits ir skaits, kas izmantots palielinājuma noteikšanā saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.bf panta 6. punkta b) apakšpunktā sniegto 3. tabulu. Neiekļauj pārsniegumus, kas ir izslēgti ar kompetentās iestādes atļauju. |
| f | Jaunākais aprēķinātais riska mērs [1.–10. rinda] vai pašu kapitāla prasības [11.–16. rinda] iepriekšējā ceturksnī. |
| g | Riska mēra vidējā vērtība [1.–10. rinda] iepriekšējo 60 darbdienu laikā [1.–9. rinda] vai iepriekšējo 12 nedēļu laikā [10. rinda] iepriekšējā ceturksnī. |

**Veidne EU MR3 – Tirgus risks saskaņā ar vienkāršotu standartizēto pieeju (*SSA*).** Fiksēts formāts.

1. Iestādes atklāj Regulas (ES) Nr. 575/2013 445. pantā minēto informāciju, ievērojot turpmāk šajā pielikumā sniegtos norādījumus, lai aizpildītu veidni EU MR3, kas ietverta EBI IT risinājumu XXIX pielikumā.

|  |  |
| --- | --- |
| **Atsauces uz tiesību aktiem un norādījumi** | |
| **Rindas numurs** | **Paskaidrojums** |
|  |  |
| 1. | **Procentu likmju risks (vispārējais un specifiskais)**  Tirdzniecības portfelī ietilpstošo tirgoto parāda instrumentu pozīciju vispārējais un specifiskais risks saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 trešās daļas IV sadaļas 2. nodaļu, izņemot specifisko risku, kas saistīts ar vērtspapīrošanu. |
| 2. | **Kapitāla vērtspapīru risks (vispārējais un specifiskais)**  Tirdzniecības portfelī ietilpstošo kapitāla vērtspapīru pozīciju vispārējais un specifiskais risks saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 trešās daļas IV sadaļas 2. nodaļu. |
| 3. | **Preču risks**  Preču pozīciju risks saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 trešās daļas IV sadaļas 4. nodaļu. |
| 4. | **Ārvalstu valūtas risks**  Ārvalstu valūtas pozīciju risks saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 trešās daļas IV sadaļas 3. nodaļu. |
| 5. | **Vērtspapīrošana (specifiskais risks)**  Tirdzniecības portfelī ietverto vērtspapīrošanas pozīciju specifiskais risks saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 trešās daļas IV sadaļas 2. nodaļas 337. un 338. pantu. |
| 6. | **Kopējās *OFR S-SA***  Informācijas atklāšana par Regulas (ES) Nr. 575/2013 438. panta d) punktā minētajām pašu kapitāla prasībām, ko aprēķina kā iepriekš a ailes 1.–5. rindā norādīto vērtību vienkāršu summu un aprēķina kā b, c un d ailes 1.–4. rindā norādīto vērtību vienkāršu summu. |
| **Ailes burts** | **Paskaidrojums** |
|  | **Tiešie produkti** |
| a | Pozīcijas produktos, kas nav saistīti ar iespējām un nav iekļauti RTS pieejās iespējas līgumu riskiem, kas nav delta riski saskaņā ar standartizēto tirgus riska pieeju[[2]](#footnote-3). |
|  | **Iespējas līgumi** |
| b | **Vienkāršotā pieeja**  Iespējas līgumi vai garantijas, kā definēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 trešās daļas IV sadaļas 2. nodaļas 329. panta 3. punktā, attiecībā uz kuriem iestādes aprēķina pašu kapitāla prasības saistībā ar risku, kas nav delta risks, izmantojot vienkāršoto pieeju[[3]](#footnote-4). |
| c | **Delta plus pieeja**  Iespējas līgumi vai garantijas tirdzniecības portfelī, kā definēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 trešās daļas IV sadaļas 2. nodaļas 329. panta 3. punktā, attiecībā uz kuriem iestādes aprēķina pašu kapitāla prasības saistībā ar risku, kas nav delta risks, izmantojot delta plus pieeju[[4]](#footnote-5). |
| d | **Scenāriju pieeja**  Iespējas līgumi vai garantijas tirdzniecības portfelī, kā definēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 trešās daļas IV sadaļas 2. nodaļas 329. panta 3. punktā, attiecībā uz kuriem iestādes aprēķina pašu kapitāla prasības saistībā ar risku, kas nav delta risks, izmantojot scenāriju pieeju[[5]](#footnote-6). |

1. Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) Nr. 575/2013 (2013. gada 26. jūnijs) par prudenciālajām prasībām attiecībā uz kredītiestādēm, un ar ko groza Regulu (ES) Nr. 648/2012, kas grozīta ar Regulu (ES) 2024/1623 ([OV L 176, 27.6.2013., 1. lpp.](https://eur-lex.europa.eu/legal-content/LV/AUTO/?uri=OJ:L:2013:176:TOC); [Regula – ES – 2024/1623 – LV – EUR-Lex (europa.eu)](https://eur-lex.europa.eu/legal-content/LV/TXT/?uri=OJ:L_202401623)). [↑](#footnote-ref-2)
2. Kā definēts KOMISIJAS DELEĢĒTAJĀ REGULĀ (ES) Nr. 528/2014 (2014. gada 12. marts), ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 575/2013 attiecībā uz regulatīviem tehniskajiem standartiem par iespējas līgumu riskiem, kuri nav delta riski, saskaņā ar standartizēto tirgus riska pieeju (OV L 148, 20.5.2014., 29. lpp.). [↑](#footnote-ref-3)
3. Kā definēts KOMISIJAS DELEĢĒTAJĀ REGULĀ (ES) Nr. 528/2014 (2014. gada 12. marts), ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 575/2013 attiecībā uz regulatīviem tehniskajiem standartiem par iespējas līgumu riskiem, kuri nav delta riski, saskaņā ar standartizēto tirgus riska pieeju (OV L 148, 20.5.2014., 29. lpp.). [↑](#footnote-ref-4)
4. Kā definēts KOMISIJAS DELEĢĒTAJĀ REGULĀ (ES) Nr. 528/2014 (2014. gada 12. marts), ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 575/2013 attiecībā uz regulatīviem tehniskajiem standartiem par iespējas līgumu riskiem, kuri nav delta riski, saskaņā ar standartizēto tirgus riska pieeju (OV L 148, 20.5.2014., 29. lpp.). [↑](#footnote-ref-5)
5. Kā definēts KOMISIJAS DELEĢĒTAJĀ REGULĀ (ES) Nr. 528/2014 (2014. gada 12. marts), ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 575/2013 attiecībā uz regulatīviem tehniskajiem standartiem par iespējas līgumu riskiem, kuri nav delta riski, saskaņā ar standartizēto tirgus riska pieeju (OV L 148, 20.5.2014., 29. lpp.). [↑](#footnote-ref-6)