



2025/2159

31.10.2025.

**KOMISIJAS ĪSTENOŠANAS REGULA (ES) 2025/2159**

**(2025. gada 27. oktobris),**

**ar ko groza Īstenošanas regulā (ES) 2021/2284 noteiktos īstenošanas tehniskos standartus attiecībā uz ieguldījumu brokeru sabiedrību sniegtajiem uzraudzības pārskatiem un informācijas atklāšanu**

**(Dokuments attiecas uz EEZ)**

EIROPAS KOMISIJA,

ņemot vērā Līgumu par Eiropas Savienības darbību,

ņemot vērā Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) 2019/2033 (2019. gada 27. novembris) par prudenciālajām prasībām ieguldījumu brokeru sabiedrībām un ar ko groza Regulas (ES) Nr. 1093/2010, (ES) Nr. 575/2013, (ES) Nr. 600/2014 un (ES) Nr. 806/2014 <sup>(1)</sup> un jo īpaši tās 54. panta 3. punktu,

tā kā:

- (1) Ar Komisijas Īstenošanas regulu (ES) 2021/2284 <sup>(2)</sup> tika ieviests tiesiskais regulējums pārskatu sniegšanai, ko ieguldījumu brokeru sabiedrības veic saskaņā ar Regulā (ES) 2019/2033 noteikto prudenciālās uzraudzības režīmu. Īstenošanas regulas (ES) 2021/2284 5. pantā par formātu un biežumu, kādā ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas nav nelielas un savstarpēji nesaistītas ieguldījumu brokeru sabiedrības, sniedz pārskatus, ir atsauce uz Komisijas Īstenošanas regulu (ES) 2021/451 <sup>(3)</sup>.
- (2) Ņemot vērā izmaiņas, kas ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) 2024/1623 <sup>(4)</sup> ieviestas Eiropas Parlamenta un Padomes Regulā (ES) Nr. 575/2013 <sup>(5)</sup>, ir pārskatīts Īstenošanas regulā (ES) 2021/451 noteiktais pārskatu sniegšanas regulējums. Tā rezultātā minētā īstenošanas regula ir atcelta un aizstāta ar Komisijas Īstenošanas regulu (ES) 2024/3117 <sup>(6)</sup>.
- (3) Lai ieguldījumu brokeru sabiedrībām dotu pietiekami daudz laika pielāgot savu iekšējo sistēmu un izpildīt pārskatītās pārskatu sniegšanas prasības, būtu jānosaka atkāpe, ar ko pirmā ceturkšņa pārskatu sniegšanas pienākuma nosūtīšanas datumu atliktu pēc šīs regulas piemērošanas dienas.
- (4) Daži ar Īstenošanas regulu (ES) 2024/3117 ieviestie pārskatīšanas elementi būtu jāatspoguļo ieguldījumu brokeru sabiedrībām piemērojamajās pārskatu sniegšanas prasībās, savukārt citi elementi nav jāgroza. Proti, gan ieguldījumu brokeru sabiedrībām, kas izvēlas piemērot attiecīgos Regulas (ES) Nr. 575/2013 noteikumus, gan kredītiestādēm pārskats par darījuma partnera kredītrisku un kredīta vērtības risku būtu jāsniedz vienādi. Turpretī, kredītiestādēm un ieguldījumu brokeru sabiedrībām pārskats par pašu kapitāla prasībām attiecībā uz tirgus risku, attiecīgi K-faktora

<sup>(1)</sup> OV L 314, 5.12.2019., 1. lpp., ELI: <http://data.europa.eu/eli/reg/2019/2033/oj>.

<sup>(2)</sup> Komisijas Īstenošanas regula (ES) 2021/2284 (2021. gada 10. decembris), 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 (OV L 458, 22.12.2021., 48. lpp., ELI: [http://data.europa.eu/eli/reg\\_impl/2021/2284/oj](http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2021/2284/oj)).

<sup>(3)</sup> Komisijas Īstenošanas regula (ES) 2021/451 (2020. gada 17. decembris), ar ko nosaka īstenošanas tehniskos standartus Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 575/2013 piemērošanai attiecībā uz iestāžu sniegtajiem uzraudzības pārskatiem un atceļ Īstenošanas regulu (ES) Nr. 680/2014 (OV L 97, 19.3.2021., 1. lpp., ELI: [http://data.europa.eu/eli/reg\\_impl/2021/451/oj](http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2021/451/oj)).

<sup>(4)</sup> Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) 2024/1623 (2024. gada 31. maijs), ar ko Regulu (ES) Nr. 575/2013 groza attiecībā uz prasībām kredītriskam, kredīta vērtības korekcijas riskam, operacionālajam riskam, tirgus riskam un riska darījumu vērtības minimālajai robežvērtībai (OV L, 2024/1623, 19.6.2024., ELI: <http://data.europa.eu/eli/reg/2024/1623/oj>).

<sup>(5)</sup> 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 (OV L 176, 27.6.2013., 1. lpp., ELI: <http://data.europa.eu/eli/reg/2013/575/oj>).

<sup>(6)</sup> Komisijas Īstenošanas regula (ES) 2024/3117 (2024. gada 29. novembris), ar ko nosaka īstenošanas tehniskos standartus Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 575/2013 piemērošanai attiecībā uz iestāžu sniegtajiem uzraudzības pārskatiem un atceļ Komisijas Īstenošanas regulu (ES) 2021/451 (OV L, 2024/3117, 27.12.2024., ELI: [http://data.europa.eu/eli/reg\\_impl/2024/3117/oj](http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2024/3117/oj)).

“neto pozīcijas risku” (K-NPR), būtu jāsniedz atšķirīgi, ņemot vērā grozījumus, kas attiecībā uz kredītiestādēm ieviesti ar Īstenošanas regulu (ES) 2024/3117, piemēram, reizināšanas koeficientu un citu nelielu korekciju ieviešanu. Ieguldījumu brokeru sabiedrībām būtu jāpiemēro pašu kapitāla prasības attiecībā uz tirgus risku un jāziņo par tām, kā noteikts Regulas (ES) Nr. 575/2013 Trešās daļas IV sadaļā redakcijā, kas bija spēkā 2019. gada 26. jūnijā pirms grozījumiem, kuri ieviesti ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) 2019/876 <sup>(7)</sup>.

- (5) Lai nodrošinātu saskaņotību starp kredītiestāžu pārskatu sniegšanas regulējumu un ieguldījumu brokeru sabiedrību pārskatu sniegšanas regulējumu gadījumiem, kad tām piemērotais tiesiskais regulējums ir vienāds, un paredzētu īpašus noteikumus gadījumiem, kad ieguldījumu brokeru sabiedrībām un kredītiestādēm piemērojama tiesiskais regulējums atšķiras, būtu jāgroza Īstenošanas regulas (ES) 2021/2284 5. pants.
- (6) Lai atvieglotu atbilstību pārskatu sniegšanas prasībām, Īstenošanas regulas (ES) 2021/2284 8. pantā noteiktā minimuma precizitātes prasība būtu jāpielāgo.
- (7) Tāpēc Īstenošanas regula (ES) 2021/2284 būtu attiecīgi jāgroza.
- (8) Šīs regulas pamatā ir īstenošanas tehnisko standartu projekts, ko Komisijai iesniedusi Eiropas Banku iestāde (EBI).
- (9) Ņemot vērā to, ka Īstenošanas regulas (ES) 2021/2284 grozījumu pamatā ir Īstenošanas regula (ES) 2024/3117 un tie neietver nozīmīgas izmaiņas pēc būtības, saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 1093/2010 <sup>(8)</sup> 15. panta 1. punkta otro daļu EBI nav veikusi atklātu sabiedrisko apspriešanu, nav analizējusi potenciālās saistītās izmaksas un ieguvumus vai pieprasījusi saskaņā ar minētās regulas 37. pantu izveidotās Banku nozares ieinteresēto personu grupas atzinumu, ņemot vērā, ka tas būtu ļoti nesamērīgi ar attiecīgo īstenošanas tehnisko standartu projektu darbības jomu un ietekmi,

IR PIEŅĒMUSI ŠO REGULU.

### 1. pants

Īstenošanas regulu (ES) 2021/2284 groza šādi:

- 1) regulas 2. panta 1. punktā pievieno šādu otro daļu:

“Atkāpjoties no šā panta pirmās daļas, ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas nav nelielas un savstarpēji nesaistītas ieguldījumu brokeru sabiedrības, vēlākais līdz 2026. gada 30. jūnijam iesniedz Komisijas Īstenošanas regulas (ES) 2024/3117 <sup>(\*)</sup> I pielikuma C 25.01. veidnē noteikto informāciju par visiem atsaucē datumiem laikposmā no 2026. gada janvāra līdz aprīlim.

<sup>(\*)</sup> Komisijas Īstenošanas regula (ES) 2024/3117 (2024. gada 29. novembris), ar ko nosaka īstenošanas tehniskos standartus Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 575/2013 piemērošanai attiecībā uz iestāžu sniegtajiem uzraudzības pārskatiem un atceļ Komisijas Īstenošanas regulu (ES) 2021/451 (OV L, 2024/3117, 27.12.2024., ELI: [http://data.europa.eu/eli/reg\\_impl/2024/3117/oj](http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2024/3117/oj)).”;

<sup>(7)</sup> Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) 2019/876 (2019. gada 20. maijs), ar ko groza Regulu (ES) Nr. 575/2013 attiecībā uz sviras rādītāju, neto stabila finansējuma rādītāju, prasībām pašu kapitālam un atbilstīgajām saistībām, darījuma partnera kredītrisku, tirgus risku, riska darījumiem ar centrālajiem darījumu partneriem, riska darījumiem ar kolektīvo ieguldījumu uzņēmumiem, lieliem riska darījumiem, pārskatu sniegšanas un informācijas atklāšanas prasībām un Regulu (ES) Nr. 648/2012 (OV L 150, 7.6.2019., 1. lpp., ELI: <http://data.europa.eu/eli/reg/2019/876/oj>).

<sup>(8)</sup> Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) Nr. 1093/2010 (2010. gada 24. novembris), 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., ELI: <http://data.europa.eu/eli/reg/2010/1093/oj>).

- 2) 5. panta 2., 3. un 4. punktu aizstāj ar šādu:

“2. Ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas nav nelielas un savstarpēji nesaistītas ieguldījumu brokeru sabiedrības un kas saskaņā ar Regulas (ES) 2019/2033 21. panta 1. punktu ar tirgu saistīto risku (RtM) K-faktora prasību nosaka, pamatojoties uz K-NPR, šīs regulas X pielikuma C 18.00.–C 24.00. veidnē norādīto informāciju sniedz reizi ceturksnī saskaņā ar norādījumiem, kas izklāstīti šīs regulas XI pielikumā.

3. Ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas nav nelielas un savstarpēji nesaistītas ieguldījumu brokeru sabiedrības un kas izmanto Regulas (ES) 2019/2033 25. panta 4. punktā noteikto atkāpi, Īstenošanas regulas (ES) 2024/3117 I pielikuma C 34.02. veidnē norādīto informāciju – izņemot informāciju par riska darījumu vērtības minimālo robežvērtību – sniedz reizi ceturksnī saskaņā ar piemērojamajiem norādījumiem.

4. Ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas nav nelielas un savstarpēji nesaistītas ieguldījumu brokeru sabiedrības un kas izmanto Regulas (ES) 2019/2033 25. panta 5. punkta otrajā daļā noteikto atkāpi, Īstenošanas regulas (ES) 2024/3117 I pielikuma C 25.01. veidnē norādīto informāciju sniedz reizi ceturksnī saskaņā ar piemērojamajiem norādījumiem.”;

- 3) regulas 8. pantā 1. punkta b) apakšpunkta i) punktu aizstāj ar šādu:

“i) datu punktus ar datu tipu “monetārs” paziņo, izmantojot minimuma precizitāti, kas ir vienāda ar desmit tūkstošiem vienību.”.

- 4) Šīs regulas I pielikuma tekstu pievieno kā X pielikumu.

- 5) Šīs regulas II pielikuma tekstu pievieno regulai kā XI pielikumu.

## 2. pants

Šī regula stājas spēkā divdesmitajā dienā pēc tās publicēšanas Eiropas Savienības Oficiālajā Vēstnesī.

Šī regula uzliek saistības kopumā un ir tieši piemērojama visās dalībvalstīs.

Briselē, 2025. gada 27. oktobrī

Komisijas vārdā –  
priekšsēdētāja  
Ursula VON DER LEYEN

I PIELIKUMS

"X PIELIKUMS

## PĀRSKATU SNIEGŠANA – RĒM K-FAKTORA PRASĪBA, PAMATOJOTIES UZ K-NPR

IEGULDĪJUMU BROKERU SABIEDRĪBU VEIDNES			
Veidnes numurs	Veidnes kods	Veidnes/veidņu grupas nosaukums	Saīsinātais nosaukums
		<b>TIRGUS RISKS</b>	<b>MKR</b>
18	C 18.00	TIRGUS RISKS: STANDARTIZĒTĀ PIEEJA ATTIECĪBĀ UZ POZĪCIJAS RISKIEM TIRGOTAJOS PARĀDA INSTRUMENTOS	MKR SA TDI
19	C 19.00	TIRGUS RISKS: STANDARTIZĒTĀ PIEEJA ATTIECĪBĀ UZ VĒRTSPAPĪROŠANAS SPECIFISKO RISKU	MKR SA SEC
20	C 20.00	TIRGUS RISKS: STANDARTIZĒTĀ PIEEJA ATTIECĪBĀ UZ KORELĀCIJAS TIRDZNIECĪBAS PORTFEĻA SPECIFISKO RISKU	MKR SA CTP
21	C 21.00	TIRGUS RISKS: STANDARTIZĒTĀ PIEEJA ATTIECĪBĀ UZ KAPITĀLA VĒRTSPAPĪRU POZĪCIJAS RISKU	MKR SA EQU
22	C 22.00	TIRGUS RISKS: STANDARTIZĒTĀS PIEEJAS ATTIECĪBĀ UZ ĀRVALSTU VALŪTAS RISKU	MKR SA FX
23	C 23.00	TIRGUS RISKS: STANDARTIZĒTĀS PIEEJAS ATTIECĪBĀ UZ PRECĒM	MKR SA COM
24	C 24.00	TIRGUS RISKA IEKŠĒJIE MODEĻI	MKR IM

**C 18.00 – TIRGUS RISKS: STANDARTIZĒTĀ PIEEJA ATTIECĪBĀ UZ POZĪCIJAS RISKIEM TIRGOTAJOS PARĀDA INSTRUMENTOS (MKR SA TDI)**

Valūta:

		POZĪCIJAS					PAŠU KAPITĀLA PRASĪBAS	KOPĒJĀ RISKĀ DARĪJUMU VĒRTĪBA
		VISAS POZĪCIJAS		NETO POZĪCIJAS		POZĪCIJAS, UZ KURĀM ATTIECAS KAPITĀLA PRASĪBA		
		GARĀS	ĪSĀS	GARĀS	ĪSĀS			
0010	TIRGOTIE PARĀDA INSTRUMENTI TIRDZNIECĪBAS PORTFELĪ							Šūna saistīta ar CA2
0011	Vispārējais risks							
0012	Atvasinātie instrumenti							
0013	Citi aktīvi un saistības							
0020	Termiņa metode							
0030	1. zona							
0040	0 ≤ 1 mēnesi							
0050	> 1 ≤ 3 mēnešiem							
0060	> 3 ≤ 6 mēnešiem							
0070	> 6 ≤ 12 mēnešiem							
0080	2. zona							
0090	> 1 ≤ 2 (1,9 kuponam, kas mazāks par 3 %) gadiem							
0100	> 2 ≤ 3 (> 1,9 ≤ 2,8 kuponam, kas mazāks par 3 %) gadiem							
0110	> 3 ≤ 4 (> 2,8 ≤ 3,6 kuponam, kas mazāks par 3 %) gadiem							
0120	3. zona							
0130	> 4 ≤ 5 (>3,6 ≤ 4,3 kuponam, kas mazāks par 3 %) gadiem							

		POZĪCIJAS					PAŠU KAPITĀLA PRASĪBAS	KOPĒJĀ RISKĀ DARĪJUMU VĒRTĪBA
		VISAS POZĪCIJAS		NETO POZĪCIJAS		POZĪCIJAS, UZ KURĀM ATTIECAS KAPITĀLA PRASĪBA		
		GARĀS	ĪSĀS	GARĀS	ĪSĀS			
0140	> 5 ≤ 7 (> 4,3 ≤ 5,7 kuponam, kas mazāks par 3 %) gadiem							
0150	> 7 ≤ 10 (> 5,7 ≤ 7,3 kuponam, kas mazāks par 3 %) gadiem							
0160	> 10 ≤ 15 (> 7,3 ≤ 9,3 kuponam, kas mazāks par 3 %) gadiem							
0170	> 15 ≤ 20 (> 9,3 ≤ 10,6 kuponam, kas mazāks par 3 %) gadiem							
0180	> 20 (> 10,6 ≤ 12,0 kuponam, kas mazāks par 3 %) gadiem							
0190	(> 12,0 ≤ 20,0 kuponam, kas mazāks par 3 %) gadiem							
0200	(> 20 kuponam, kas mazāks par 3 %) gadiem							
0210	Ilguma metode							
0220	1. zona							
0230	2. zona							
0240	3. zona							
0250	Specifiskais risks							
0251	Pašu kapitāla prasība parāda instrumentiem, kas nav vērtspapīrošanas pozīcijas							
0260	Parāda vērtspapīri saskaņā ar 1. tabulas pirmo kategoriju							
0270	Parāda vērtspapīri saskaņā ar 1. tabulas otro kategoriju							
0280	Ar atlikušo termiņu ≤ 6 mēnešiem							
0290	Ar atlikušo termiņu > 6 mēnešiem un ≤ 24 mēnešiem							
0300	Ar atlikušo termiņu > 24 mēnešiem							

		POZĪCIJAS					PAŠU KAPITĀLA PRASĪBAS	KOPĒJĀ RISKĀ DARĪJUMU VĒRTĪBA
		VISAS POZĪCIJAS		NETO POZĪCIJAS		POZĪCIJAS, UZ KURĀM ATTIECAS KAPITĀLA PRASĪBA		
		GARĀS	ĪSĀS	GARĀS	ĪSĀS			
		0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070
0310	Parāda vērtspapīri saskaņā ar 1. tabulas trešo kategoriju							
0320	Parāda vērtspapīri saskaņā ar 1. tabulas ceturto kategoriju							
0321	N-tā saistību nepildīšanas gadījuma kredītu atvasinātie instrumenti ar reitingu							
0325	Pašu kapitāla prasība vērtspapīrošanas instrumentiem							
0330	Pašu kapitāla prasība korelācijas tirdzniecības portfelim							
0350	Papildu prasības attiecībā uz iespējas līgumiem (riski, kas nav delta riski)							
0360	Vienkāršotā metode							
0370	Delta plus pieeja – papildu prasības attiecībā uz gamma risku							
0380	Delta plus pieeja – papildu prasības attiecībā uz vega risku							
0385	Delta plus pieeja – iespējas līgumi un garantijas, kuri nav nepārtraukti							
0390	Scenāriju matricas pieeja							

IV OV L, 31.10.2025.

[illegible]



C 20.00 — TIRGUS RISKS: STANDARTIZĒTĀ PIEEJA ATTIECĪBĀ UZ KORELĀCIJAS TIRDZniecības PORTFEĻA SPECIFISKO RISKU (MKR SA CTP)

		VISAS POZĪCIJAS		(-) POZĪCIJAS, KAS ATSKAITĪTAS NO PAŠU KAPITĀLA		NETO POZĪCIJAS		(GARO) NETO POZĪCIJU SADALĪJUMS PA RISKĀ SVĒRUMIEM														(ĪSO) NETO POZĪCIJU SADALĪJUMS PA RISKĀ SVĒRUMIEM														NETO POZĪCIJU SADALĪJUMS PA PIEEJĀM						PIRMS MAKSIMĀLĀS ROBEŽVĒRTĪBAS		PĒC MAKSIMĀLĀS ROBEŽVĒRTĪBAS		KOPEJĀS PAŠU KAPITĀLA PRASĪBAS																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																				
		GARĀS	ĪSĀS	(-) GARĀS	(-) ĪSĀS	GARĀS	ĪSĀS	[0-10 %]	[10-12 %]	[12-20 %]	[20-40 %]	[40-100 %]	[100-250 %]	[250-350 %]	[350-425 %]	[425-650 %]	[650-1 250 %]	1 250%	[0-10 %]	[10-12 %]	[12-20 %]	[20-40 %]	[40-100 %]	[100-250 %]	[250-350 %]	[350-425 %]	[425-650 %]	[650-1 250 %]	1 250%	SEC-IRBA	SEC-SA	SEC-ERBA	ĪEKŠĒJĀ NOVĒRTĒJUMA PIEEJA	ĪPAŠS REŽĪMS ATBILSTĪGAS INRD VĒRTSPĀPĪROŠANAS AUGSTĀKĀS PRIORITĀTES LAIDĪENIEM	CITS (RW= 1 250 %)	SVĒRTĀS NETO GARĀS POZĪCIJAS	SVĒRTĀS NETO ĪSĀS POZĪCIJAS	SVĒRTĀS NETO GARĀS POZĪCIJAS	SVĒRTĀS NETO ĪSĀS POZĪCIJAS																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																											
0010	KOPEJĀ RISKĀ DARĪJUMU VĒRTĪBA																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																	

## C 21.00 — TIRGUS RISKS: STANDARTIZĒTĀ PIEEJA ATTIECĪBĀ UZ KAPITĀLA VĒRTSPAPĪRU POZĪCIJAS RISKU (MKR SA EQU)

Valsts tirgus:

		POZĪCIJAS					PAŠU KAPITĀLA PRASĪBAS	KOPĒJĀ RISKĀ DARĪJUMU VĒRTĪBA
		VISAS POZĪCIJAS		NETO POZĪCIJAS		POZĪCIJAS, UZ KURĀM ATTIECAS KAPITĀLA PRASĪBA		
		GARĀS	ĪSĀS	GARĀS	ĪSĀS			
		0010	0020	0030	0040			
0010	TIRDZNIECĪBAS PORTFELĪ IEKĻAUTIE KAPITĀLA VĒRTSPAPĪRI							Šūna saistīta ar CA
0020	Vispārējais risks							
0021	Atvasinātie instrumenti							
0022	Citi aktīvi un saistības							
0030	Plaši diversificēti, biržā tirgoti akciju indeksa nākotnes līgumi, kuriem piemēro īpašu pieeju							
0040	Citi kapitāla vērtspapīri, kas nav plaši diversificēti, biržā tirgoti akciju indeksa nākotnes līgumi							
0050	Specifiskais risks							
0090	Papildu prasības attiecībā uz iespējas līgumiem (riski, kas nav delta riski)							
0100	Vienkāršotā metode							
0110	Delta plus pieeja – papildu prasības attiecībā uz gamma risku							
0120	Delta plus pieeja – papildu prasības attiecībā uz vega risku							
0125	Delta plus pieeja – iespējas līgumi un garantijas, kuri nav nepārtraukti							
0130	Scenāriju matricas pieeja							

**C 22.00 — TIRGUS RISKS: STANDARTIZĒTĀS PIEEJAS ATTIECĪBĀ UZ ĀRVALSTU VALŪTAS RISKU (MKR SA FX)**

		VISAS POZĪCIJAS		NETO POZĪCIJAS		POZĪCIJAS, UZ KURĀM ATTIECAS KAPITĀLA PRASĪBA (ieskaitot pārdali attiecībā uz nesakrītošajām pozīcijām valūtās, kuras nav pārskata sniegšanas valūta, ar īpašu režīmu attiecībā uz sakrītošajām pozīcijām)			PAŠU KAPITĀLA PRASĪBAS	KOPĒJĀ RISKA DARĪJUMU VĒRTĪBA
		GARĀS	ĪSĀS	GARĀS	ĪSĀS	GARĀS	ĪSĀS	SAKRĪ- TOŠĀS		
		0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080		
0010	<b>KOPĒJĀS POZĪCIJAS</b>									Šūna saistīta ar CA
0020	Cieši korelētas valūtas									
0025	tostarp: pārskata sniegšanas valūta									
0030	Visas citas valūtas (tostarp KIU, ko pielīdzina atšķirīgām valūtām)									
0040	Zelts									
0050	Papildu prasības attiecībā uz iespējas līgumiem (riski, kas nav delta riski)									
0060	Vienkāršotā metode									
0070	Delta plus pieeja – papildu prasības attiecībā uz gamma risku									
0080	Delta plus pieeja – papildu prasības attiecībā uz vega risku									
0085	Delta plus pieeja – iespējas līgumi un garantijas, kuri nav nepārtraukti									
0090	Scenāriju matricas pieeja									
<b>KOPĒJO POZĪCIJU SADALĪJUMS (TOSTARP PĀRSKATA SNIEGŠANAS VALŪTĀ) PA RISKA DARĪJUMU VEIDIEM</b>										
0100	Citi aktīvi un saistības, kas nav ārpusbilances posteņi un atvasinātie instrumenti									
0110	Ārpusbilances posteņi									
0120	Atvasinātie instrumenti									

		VISAS POZĪCIJAS		NETO POZĪCIJAS		POZĪCIJAS, UZ KURĀM ATTIECAS KAPITĀLA PRASĪBA (ieskaitot pārdali attiecībā uz nesakrītošajām pozīcijām valūtās, kuras nav pārskata sniegšanas valūta, ar īpašu režīmu attiecībā uz sakrītošajām pozīcijām)			PAŠU KAPITĀLA PRASĪBAS	KOPĒJĀ RISKA DARĪJUMU VĒRTĪBA
		GARĀS	ĪSĀS	GARĀS	ĪSĀS	GARĀS	ĪSĀS	SAKRĪ- TOŠĀS		
		0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080		
Izziņas posteņi: VALŪTAS POZĪCIJAS										
0130	Euro									
0140	Leks									
0150	Argentīnas peso									
0160	Austrālijas dolārs									
0170	Brazīlijas reāls									
0180	Bulgārijas leva									
0190	Kanādas dolārs									
0200	Čehijas krona									
0210	Dānijas krona									
0220	Ēģiptes mārciņa									
0230	Sterliņu mārciņa									
0240	Forints									
0250	Jena									
0280	Denārs									
0290	Meksikas peso									
0300	Zlots									
0310	Rumānijas leja									
0320	Krievijas rublis									
0330	Serbijas dinārs									
0340	Zviedrijas krona									
0350	Šveices franks									

		VISAS POZĪCIJAS		NETO POZĪCIJAS		POZĪCIJAS, UZ KURĀM ATTIECAS KAPITĀLA PRASĪBA (ieskaitot pārdali attiecībā uz nesakrītošajām pozīcijām valūtās, kuras nav pārskata sniegšanas valūta, ar īpašu režīmu attiecībā uz sakrītošajām pozīcijām)			PAŠU KAPITĀLA PRASĪBAS	KOPĒJĀ RISKA DARĪJUMU VĒRTĪBA
		GARĀS	ĪSĀS	GARĀS	ĪSĀS	GARĀS	ĪSĀS	SAKRĪ- TOŠĀS		
		0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080		
0360	Turcijas lira									
0370	Grivna									
0380	ASV dolārs									
0390	Islandes krona									
0400	Norvēģijas krona									
0410	Honkongas dolārs									
0420	Jaunais Taivānas dolārs									
0430	Jaunzēlandes dolārs									
0440	Singapūras dolārs									
0450	Vona									
0460	Juaņa renminbi									
0470	Citi									

**C 23.00 — TIRGUS RISKS: STANDARTIZĒTĀS PIEEJAS ATTIECĪBĀ UZ PRECĒM (MKR SA COM)**

		VISAS POZĪCIJAS		NETO POZĪCIJAS		POZĪCIJAS, UZ KURĀM ATTIECAS KAPITĀLA PRASĪBA	PAŠU KAPITĀLA PRASĪBAS	KOPĒJĀ RISKA DARĪJUMU VĒRTĪBA
		GARĀS	ĪSĀS	GARĀS	ĪSĀS			
		0010	0020	0030	0040		0060	0070
0010	<b>KOPĒJĀS PREČU POZĪCIJAS</b>							Šūna saistīta ar CA
0020	Dārgmetāli (izņemot zeltu)							
0030	Parastie metāli							
0040	Lauksaimniecības produkti (īslaicīgie)							
0050	Citi							
0060	t. sk.: enerģijas produkti (nafta, gāze)							
0070	Termiņu sadalījuma pieeja							
0080	Paplašinātā termiņu sadalījuma pieeja							
0090	Vienkāršotā pieeja: visas pozīcijas							
0100	Papildu prasības attiecībā uz iespējas līgumiem (riski, kas nav delta riski)							
0110	Vienkāršotā metode							
0120	Delta plus pieeja – papildu prasības attiecībā uz gamma risku							
0130	Delta plus pieeja – papildu prasības attiecībā uz vega risku							
0135	Delta plus pieeja – iespējas līgumi un garantijas, kuri nav nepārtraukti							
0140	Scenāriju matricas pieeja							

C 24.00 — TIRGUS RISKĀ IEKŠĒJIE MODEĻI (MKR IM)

		VaR		VaR SPRIEDZES APSTĀKĻOS		INKREMENTĀLĀ SAISTĪBU NEPILDĪŠANAS UN MIGRĀCIJAS RISKĀ KAPITĀLA PRASĪBA		VISU CENAS RISKU KAPITĀLA PRASĪBA ATTIECĪBĀ UZ KTP			PAŠU KAPITĀLA PRASĪBAS	KOPĒJĀ RISKĀ DARĪJUMU VĒRTĪBA	Pārsniegumu skaits Pārsniegumu skaits iepriekšējās 250 darb-dienās	VaR reizināšanas koefi-cients ( $m_c$ )	SVaR reizināšanas koefi-cients ( $m_s$ )	PIENĒMĒTĀ PRASĪBA ATTIECĪBĀ UZ KTP MINIMUMU – SVĒRTĀS NETO GARĀS POZĪCIJAS PĒC MAKSIMĀLĀS ROBEŽVĒRTĪBAS	PIENĒMĒTĀ PRASĪBA ATTIECĪBĀ UZ KTP MINIMUMU – SVĒRTĀS NETO ĪSĀS POZĪCIJAS PĒC MAKSIMĀLĀS ROBEŽVĒRTĪBAS
		REIZINĀŠANAS KOEFICIENTS ( $m_e$ ) x IEPRĪEKŠĒJO 60 DARBDIENU VIDĒJAIS RĀDĪTĀJS ( $VaR_{avg}$ )	IEPRĪEKŠĒJĀS DIENĀS VaR ( $VaR_{t-1}$ )	REIZINĀŠANAS KOEFICIENTS ( $m_e$ ) x IEPRĪEKŠĒJO 60 DARBA DIENU VIDĒJAIS RĀDĪTĀJS ( $SVaR_{avg}$ )	JAUNĀKAIS PIEEJAMAIS RĀDĪTĀJS ( $SVaR_{t-1}$ )	12 NEDĒĻU VIDĒJAIS RĀDĪTĀJS	PĒDĒJAIS RĀDĪTĀJS	MINIMUMS	12 NEDĒĻU VIDĒJAIS RĀDĪTĀJS	PĒDĒJAIS RĀDĪTĀJS							
		0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110						0170	0180
0010	KOPĒJĀS POZĪCIJAS											Šūna saistīta ar CA					
Izziņas posteņi: TIRGUS RISKĀ SADALĪJUMS																	
0020	Tirgotie parāda instrumenti																
0030	TPI – vispārējais risks																
0040	TPI – specifiskais risks																
0050	Kapitāla vērtspapīri																
0060	Kapitāla vērtspapīri – vispārējais risks																
0070	Kapitāla vērtspapīri – specifiskais risks																
0080	Ārvalstu valūtas risks																

		VaR		VaR SPRIEDZES APSTĀKĻOS		INKREMENTĀLĀ SAISTĪBU NEPILDĪŠANAS UN MIGRĀCIJAS RISKĀ KAPITĀLA PRASĪBA		VISU CENAS RISKU KAPITĀLA PRASĪBA ATTIECĪBĀ UZ KTP			PAŠU KAPITĀLA PRASĪBAS	KOPĒJĀ RISKĀ DARĪJUMU VĒRTĪBA	Pārsniegumu skaits Pārsniegumu skaits iepriekšējās 250 darb- dienās	VaR reizināša- nas koefi- cients ( $m_t$ )	SVaR reizināša- nas koefi- cients ( $m_s$ )	PIEŅEMTĀ PRASĪBA ATTIECĪBĀ UZ KTP MINIMUMU – SVĒRTĀS NETO GARĀS POZĪCIJAS PĒC MAKSIMĀLĀS ROBEŽVĒRTĪBAS	PIEŅEMTĀ PRASĪBA ATTIECĪBĀ UZ KTP MINIMUMU – SVĒRTĀS NETO ĪSĀS POZĪCIJAS PĒC MAKSIMĀLĀS ROBEŽVĒRTĪBAS
		REIZINĀŠANAS KOEFICIENTS ( $m_t$ ) x IEPRIEKŠĒJO 60 DARBDIENU VIDĒJAIS RĀDĪTĀJS ( $VaR_{avg}$ )	IEPRIEKŠĒJĀS DIENAS VaR ( $VaR_{t-1}$ )	REIZINĀŠANAS KOEFICIENTS ( $m_s$ ) x IEPRIEKŠĒJO 60 DARBA DIENU VIDĒJAIS RĀDĪTĀJS ( $SVaR_{avg}$ )	JAUNĀKAIS PIEEJAMAIS RĀDĪTĀJS ( $SVaR_{t-1}$ )	12 NEDĒĻU VIDĒJAIS RĀDĪTĀJS	PĒDĒJAIS RĀDĪTĀJS	MINIMUMS	12 NEDĒĻU VIDĒJAIS RĀDĪTĀJS	PĒDĒJAIS RĀDĪTĀJS							
		0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110						0170	0180
0090	Preču risks																
0100	Kopējā vērtība attiecībā uz vispārējo risku																
0110	Kopējā vērtība attiecībā uz specifisko risku”																



## II PIELIKUMS

## "XI PIELIKUMS

## NORĀDĪJUMI VEIDNES "RĒM K-FAKTORA PRASĪBA, PAMATOJOTIES UZ K-NPR" AIZPILDĪŠANAI

## Saturs

<b>I DAĻA. VISPĀRĪGAS NORĀDES</b>	18
1. <b>PIEŅEMTĀ PRAKSE</b>	18
1.1. <b>Pieņemtā prakse attiecībā uz numerāciju</b>	18
1.2. <b>Pieņemtā prakse attiecībā uz zīmēm</b>	18
1.3. <b>Atsauces uz Regulu (ES) Nr. 575/2013</b>	18
<b>II DAĻA. NORĀDES SAISTĪBĀ AR VEIDNI: TIRGUS RISKĀ VEIDNES</b>	18
1. <b>Vispārīgas piezīmes</b>	18
2. <b>C 18.00 – Tirgus risks: Standartizētā pieeja attiecībā uz pozīcijas riskiem tirgotajos parāda instrumentos (MKR SA TDI)</b>	18
2.1. <b>Vispārīgas piezīmes</b>	18
2.2. <b>Norādes attiecībā uz konkrētām pozīcijām</b>	19
3. <b>C 19.00 – TIRGUS RISKS: STANDARTIZĒTĀ PIEEJA ATTIECĪBĀ UZ VĒRTSPAPIROŠANAS SPECIFISKO RISKU (MKR SA SEC)</b>	20
3.1. <b>Vispārīgas piezīmes</b>	20
3.2. <b>Norādes attiecībā uz konkrētām pozīcijām</b>	21
4. <b>C 20.00 – TIRGUS RISKS: STANDARTIZĒTĀ PIEEJA ATTIECĪBĀ UZ KORELĀCIJAS TIRDZNIECĪBAS PORTEĻA POZĪCIJU SPECIFISKO RISKU (MKR SA CTP)</b>	22
4.1. <b>Vispārīgas piezīmes</b>	22
4.2. <b>Norādes attiecībā uz konkrētām pozīcijām</b>	23
5. <b>C 21.00 – Tirgus risks: standartizētā pieeja attiecībā uz kapitāla vērtspapīru pozīcijas risku (MKR SA EQU)</b>	24
5.1. <b>Vispārīgas piezīmes</b>	24
5.2. <b>Norādes attiecībā uz konkrētām pozīcijām</b>	24
6. <b>C 22.00 – Tirgus risks: standartizētā pieeja attiecībā uz ārvalstu valūtas risku (MKR SA FX)</b>	26
6.1. <b>Vispārīgas piezīmes</b>	26
6.2. <b>Norādes attiecībā uz konkrētām pozīcijām</b>	26
7. <b>C 23.00 – Tirgus risks: standartizētās pieejas attiecībā uz precēm (MKR SA COM)</b>	28
7.1. <b>Vispārīgas piezīmes</b>	28
7.2. <b>Norādes attiecībā uz konkrētām pozīcijām</b>	28
8. <b>C 24.00 – Tirgus riska iekšējais modelis (MKR IM)</b>	29
8.1. <b>Vispārīgas piezīmes</b>	29
8.2. <b>Norādes attiecībā uz konkrētām pozīcijām</b>	29

**I DAĻA. VISPĀRĪGAS NORĀDES****1. PIEŅEMTĀ PRAKSE****1.1. Pieņemtā prakse attiecībā uz numerāciju**

1. Atsaucoties uz veidņu slejām, rindām un šūnām, dokumentā izmanto pieņemto praksi attiecībā uz apzīmējumiem, kas norādīta 2.–5. punktā. Minētos ciparu kodus plaši izmanto validācijas noteikumos.
2. Norādēs izmantots šāds vispārējs apzīmējums: {Veidne; Rinda; Sleja}.
3. Ja validāciju veic veidnē, kurā izmantoti tikai minētās veidnes datu punkti, apzīmējumi neattiecas uz veidni: {Rinda; Sleja}.
4. Ja veidnēs ir tikai viena sleja, atsaucas vienīgi uz rindām: {Veidne; Rinda}.
5. Zvaigznītes zīmi izmanto, lai norādītu, ka validāciju veic attiecībā uz iepriekš norādītām rindām vai slejām.

**1.2. Pieņemtā prakse attiecībā uz zīmēm**

6. Jebkuru summu, kas palielina pašu kapitālu vai kapitāla prasības, uzrāda kā pozitīvu skaitli. Turpretim summu, kas samazina kopējās pašu kapitāla vai kapitāla prasības, uzrāda kā negatīvu skaitli. Ja pirms kāda posteņa apzīmējuma ir mīnuszīme (-), paredzēts, ka minēto posteni neuzrāda kā pozitīvu skaitli.

**1.3. Atsauces uz Regulu (ES) Nr. 575/2013**

7. Visas atsauces uz Regulas (ES) 575/2013 325. līdz 377. pantu lasa kā atsauces uz minētās regulas redakciju, kas bija spēkā 2019.gada 26. jūnijā.

**II DAĻA. NORĀDES SAISTĪBĀ AR VEIDNI: TIRGUS RISKĀ VEIDNES****1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES**

8. Šīs norādes attiecas uz veidnēm, kurās uzrāda pašu kapitāla prasību aprēķinu saskaņā ar standartizēto pieeju attiecībā uz ārvalstu valūtas risku (MKR SA FX), preču risku (MKR SA COM) procentu likmju risku (MKR SA TDI, MKR SA SEC, MKR SA CTP) un kapitāla vērtspapīru risku (MKR SA EQU). Papildus tam šajā daļā ir iekļautas norādes par pārskatu sniegšanu attiecībā uz pašu kapitāla prasību aprēķinu saskaņā ar iekšējo modeļu pieeju (MKR IM).
9. Tirgots parāda instrumentu vai kapitāla vērtspapīru (vai parāda vai kapitāla vērtspapīru atvasināto instrumentu) pozīcijas risku sadala divos komponentos, lai aprēķinātu kapitālu, kas vajadzīgs pozīcijas riska segšanai. Pirmais komponents sedz tā specifisko risku – tas ir risks, kura cēlonis ir cenu izmaiņas attiecīgajā instrumentā tā emitenta dēļ, vai, atvasināta instrumenta gadījumā, to pamatā esošā instrumenta emitenta dēļ. Otrais komponents ir pozīcijas vispārējais risks – minētais risks, kura cēlonis ir cenu izmaiņas instrumentā procentu likmju līmeņa izmaiņu dēļ (ja tas ir tirgotais parāda instruments vai parāda atvasinātais instruments) vai kapitāla vērtspapīru tirgus lielu pārmaiņu dēļ (ja tas ir kapitāla vērtspapīrs vai kapitāla vērtspapīru atvasinātais instruments), kas nav saistīts ar atsevišķu vērtspapīru īpašām iezīmēm. Konkrētiem instrumentiem piemērotais vispārējais režīms un savstarpējo prasījumu ieskaita procedūras ir noteiktas Regulas (ES) Nr. 575/2013 326.–333. pantā.

**2. C 18.00 – TIRGUS RISKS: STANDARTIZĒTĀ PIEEJA ATTIECĪBĀ UZ POZĪCIJAS RISKIEM TIRGOTAJOS PARĀDA INSTRUMENTOS (MKR SA TDI)****2.1. Vispārīgas piezīmes**

10. Šajā veidnē atspoguļo pozīcijas un saistītās pašu kapitāla prasības attiecībā uz pozīcijas riskiem tirgotajiem parāda instrumentiem saskaņā ar standartizēto pieeju (Regulas (ES) Nr. 575/2013 325. panta 2. punkta a) apakšpunkts). Rindās ir ņemti vērā dažādie riski un saskaņā ar Regulu (ES) Nr. 575/2013 pieejamās metodes. Specifisko risku, kas saistīts ar riska darījumiem, kuri iekļauti MKR SA SEC un MKR SA CTP, uzrāda tikai MKR SA TDI kopējā veidnē. Šajās veidnēs uzrādītās pašu kapitāla prasības pārnes attiecīgi uz 0325;0060 šūnu (vērtspapīrošana) un 0330;0060 šūnu (CTP).

11. Šo veidni aizpilda atsevišķi par posteni "Kopā", kā arī par iepriekš noteiktu sarakstu ar šādām valūtām: EUR, ALL, BGN, CZK, DKK, EGP, GBP, HUF, ISK, JPY, MKD, NOK, PLN, RON, RUB, RSD, SEK, CHF, TRY, UAH, USD un par vienu atsevišķu veidni ar visām citām valūtām.

## 2.2. Norādes attiecībā uz konkrētām pozīcijām

Slejas	
0010-0020	<b>VISAS POZĪCIJAS (GARĀS UN ĪSĀS)</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 102. pants un 105. panta 1. punkts. Tās ir bruto pozīcijas, kurām nav veikts savstarpējo prasījumu ieskaits pa instrumentiem, bet kuras neietver sākotnējās izvietojanas pozīcijas, uz ko pieteikušies vai kam pakārtotu sākotnējo izvietojanu veic trešās puses, saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 345. panta 1. punkta pirmās daļas otro teikumu. Attiecībā uz atšķirību starp garajām un īsajām pozīcijām, kas arī ir piemērojamas šīm bruto pozīcijām, sk. minētās regulas 328. panta 2. punktu.
0030-0040	<b>NETO POZĪCIJAS (GARĀS UN ĪSĀS)</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 327. līdz 329. pants un 334. pants. Attiecībā uz atšķirību starp garajām un īsajām pozīcijām, sk. minētās regulas 328. panta 2. punktu.
0050	<b>POZĪCIJAS, UZ KURĀM ATTIECAS KAPITĀLA PRASĪBA</b> Tās neto pozīcijas, uz kurām saskaņā ar dažādajām pieejām, kas minētas Regulas (ES) Nr. 575/2013 Trešās daļas IV sadaļas 2. nodaļā, attiecas kapitāla prasība.
0060	<b>PAŠU KAPITĀLA PRASĪBAS</b> Kapitāla prasība attiecībā uz jebkuru attiecīgo pozīciju saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 Trešās daļas IV sadaļas 2. nodaļu.
0070	<b>KOPĒJĀ RISKĀ DARĪJUMU VĒRTĪBA</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 92. panta 6. punkta b) apakšpunkts. Aprēķina, pašu kapitāla prasības reizinot ar 12,5.
Rindas	
0010-0350	<b>TIRGOTIE PARĀDA INSTRUMENTI TIRDZNICĪBAS PORTFELĪ</b> Pozīcijas tirgotajos parāda instrumentos tirdzniecības portfeli un to atbilstīgās pašu kapitāla prasības attiecībā uz pozīcijas risku saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 92. panta 4. punkta b) apakšpunkta i) punktu un minētās regulas Trešās daļas IV sadaļas 2. nodaļu uzrāda atkarībā no riska kategorijas, termiņa un izmantotās pieejas.
0011	<b>VISPĀRĒJAIS RISKS</b>
0012	<b>Atvasinātie instrumenti</b> Atvasinātie instrumenti, kas iekļauti tirdzniecības portfeļa pozīciju procentu likmju riska aprēķināšanā, attiecīgā gadījumā ņemot vērā Regulas (ES) Nr. 575/2013 328.–331. pantu.
0013	<b>Citi aktīvi un saistības</b> Instrumenti, kas nav atvasinātie instrumenti un kas ietverti tirdzniecības portfeļa pozīciju procentu likmju riska aprēķinā.
0020-0200	<b>TERMIŅA METODE</b> Pozīcijas tirgotajos parāda instrumentos, kam piemēro termiņa metodi, kā minēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 339. panta 1.–8. punktā, un to atbilstīgās pašu kapitāla prasības, kas aprēķinātas saskaņā ar minētās regulas 339. panta 9. punktu. Pozīciju sadala 1., 2. un 3. zonā, un minētās zonas sadala pēc instrumentu termiņiem.
0210-0240	<b>VISPĀRĒJAIS RISKS. ILGUMA METODE</b> Pozīcijas tirgotajos parāda instrumentos, kam piemēro ilguma metodi, kā minēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 340. panta 1.–6. punktā, un to atbilstīgās pašu kapitāla prasības, kas aprēķinātas saskaņā ar minētās regulas 340. panta 7. punktu. Pozīciju sadala 1., 2. un 3. zonā.

0250	<p><b>SPECIFISKAIS RISKS</b></p> <p>0251., 0325. un 0330. rindā uzrādīto vērtību summa.</p> <p>Pozīcijas tirgotajos parāda instrumentos, kam piemēro īpašās riska kapitāla prasības, un to attiecīgās kapitāla prasības saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 92. panta 3. punkta b) apakšpunktu, 335. pantu, 336. panta 1., 2. un 3. punktu un 337. un 338. pantu. Jāņem vērā arī minētās regulas 327. panta 1. punkta pēdējais teikums.</p>
0251-0321	<p><b>Pašu kapitāla prasība parāda instrumentiem, kas nav vērtspapīrošanas pozīcijas</b></p> <p>260.–321. rindā uzrādīto vērtību summa.</p> <p>Ārēji nevērtētu n-tā saistību nepildīšanas gadījuma kredīta atvasināto instrumentu pašu kapitāla prasību aprēķina, saskaitot atsaucies sabiedrību riska svērumus (Regulas (ES) Nr. 575/2013 332. panta 1. punkta e) apakšpunkts un 332. panta 1. punkta otrā daļa – “caurskatīšana”). Ārēji novērtētus n-tā saistību nepildīšanas gadījuma kredīta atvasinātos instrumentus (Regulas (ES) Nr. 575/2013 332. panta 1. punkta trešā daļa) atsevišķi uzrāda 321. rindā.</p> <p>Informācijas sniegšana par pozīcijām, kurām piemēro Regulas (ES) Nr. 575/2013 336. panta 3. punktu: Pastāv īpašs režīms attiecībā uz obligācijām, kas ir atbilstīgas, lai tām saskaņā ar minētās regulas 129. panta 3. punktu piemērotu 10 % riska svērumu banku portfeli (segtās obligācijas). Īpašās pašu kapitāla prasības ir puse no Regulas (ES) Nr. 575/2013 336. panta 1. tabulā minētās otrās kategorijas procentu attiecības. Minētās pozīcijas iedala 0280.-0300. rindā atbilstoši atlikušajam laikam līdz beigu termiņam.</p> <p>Ja procentu likmju pozīciju vispārējo risku ierobežo ar kredītu atvasināto instrumentu, tad piemēro Regulas (ES) Nr. 575/2013 346. un 347. pantu.</p>
0325	<p><b>Pašu kapitāla prasība vērtspapīrošanas instrumentiem</b></p> <p>Kopējās pašu kapitāla prasības, kas uzrādītas MKR SA SEC veidnes 0601. slejā. Minētās kopējās pašu kapitāla prasības uzrāda tikai MKR SA TDI kopējā līmenī.</p>
0330	<p><b>Pašu kapitāla prasība korelācijas tirdzniecības portfelim</b></p> <p>Kopējās pašu kapitāla prasības, kas uzrādītas MKR SA CTP veidnes 0450. slejā. Minētās kopējās pašu kapitāla prasības uzrāda tikai MKR SA TDI kopējā līmenī.</p>
0350-0390	<p><b>PAPILDU PRASĪBAS ATTIECĪBĀ UZ IESPĒJAS LĪGUMIEM (RISKI, KAS NAV DELTA RISKI)</b></p> <p>Regulas (ES) Nr. 575/2013 329. panta 3. punkts.</p> <p>Papildu prasības attiecībā uz iespējas līgumiem, kas saistīti ar riskiem, kuri nav delta riski, uzrāda sadalījumā pa šim aprēķinam izmantotajām metodēm.</p>

### 3. C 19.00 – TIRGUS RISKS: STANDARTIZĒTĀ PIEEJA ATTIECĪBĀ UZ VĒRTSPAPĪROŠANAS SPECIFISKO RISKU (MKR SA SEC)

#### 3.1. Vispārīgas piezīmes

12. Šajā veidnē pieprasīta informācija par pozīcijām (visām/neto un garajām/īsajām) un saistītajām pašu kapitāla prasībām attiecībā uz vērtspapīrošanas /atkārtotās vērtspapīrošanas pozīcijas riska specifisko risku komponentu tirdzniecības portfeli (neatbilst korelācijas tirdzniecības portfelim) saskaņā ar standartizēto pieeju.
13. MKR SA SEC veidnē ir sniegtas pašu kapitāla prasības tikai attiecībā uz vērtspapīrošanas pozīciju specifisko risku saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 335. pantu saistībā ar 337. pantu. Ja vērtspapīrošanas pozīciju risks tirdzniecības portfeli ir ierobežots ar kredītu atvasinātajiem instrumentiem, piemēro Regulas (ES) Nr. 575/2013 346. un 347. pantu. Visām tirdzniecības portfeļa pozīcijām ir tikai viena veidne neatkarīgi no pieejas, ko ieguldījumu brokeru sabiedrības piemēro, lai noteiktu katras pozīcijas riska svērumu saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 Trešās daļas II sadaļas 5. nodaļu. Pašu kapitāla prasības attiecībā uz minēto pozīciju vispārējo risku uzrāda MKR SA TDI vai MKR IM veidnē.

14. Pozīcijas, kam piemēro 1 250 % riska svērumu, var alternatīvi atskaitīt no pirmā līmeņa pamata kapitāla (sk. Regulas (ES) Nr. 575/2013 244. panta 1. punkta b) apakšpunktu, 245. panta 1. punkta b) apakšpunktu un 253. pantu). Šīs pozīcijas uzrāda šajā veidnē pat tad, ja iestāde izmanto atskaitīšanas iespēju.

### 3.2. Norādes attiecībā uz konkrētām pozīcijām

Slejas	
0010-0020	<b>VISAS POZĪCIJAS (GARĀS UN ĪSĀS)</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 102. pants un 105. panta 1. punkts saistībā ar minētās regulas 337. pantu (vērtspapīrošanas pozīcijas). Attiecībā uz atšķirību starp garajām un īsajām pozīcijām, kas arī ir piemērojamas šīm bruto pozīcijām, sk. minētās regulas 328. panta 2. punktu.
0030-0040	<b>(-) POZĪCIJAS, KAS ATSKAITĪTAS NO PAŠU KAPITĀLA (GARĀS UN ĪSĀS)</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 244. panta 1. punkta b) apakšpunkts, 245. panta 1. punkta b) apakšpunkts un 253. pants.
0050-0060	<b>NETO POZĪCIJAS (GARĀS UN ĪSĀS)</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 327., 328., 329. un 334. pants. Attiecībā uz atšķirību starp garajām un īsajām pozīcijām, sk. minētās regulas 328. panta 2. punktu.
0061-0104	<b>NETO POZĪCIJU SADALĪJUMS PA RISKĀ SVĒRUMIEM</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 259. līdz 262. pants, 263. panta 1. un 2. tabula, 264. panta 3. un 4. tabula un 266. pants. Sadalījumu veic atsevišķi garajām un īsajām pozīcijām.
0402-0406	<b>NETO POZĪCIJU SADALĪJUMS PA PIEEJĀM</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 254. pants
0402	<b>SEC-IRBA</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 259. un 260. pants.
0403	<b>SEC-SA</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 261. un 262. pants.
0404	<b>SEC-ERBA</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 263. un 264. pants.
0405	<b>IEKŠĒJĀ NOVĒRTĒJUMA PIEEJA</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 254. un 265. pants un 266. panta 5. punkts.
0900	<b>ĪPAŠS REŽĪMS ATBILSTĪGAS INRD VĒRTSPAPĪROŠANAS AUGSTĀKAS PRIORITĀTES LAIDIENIEM</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 269.a panta 3. punkts.
0406	<b>CITS (RW = 1 250 %)</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 254. panta 7. punkts.
0530-0540	<b>VISPĀRĒJĀ IETEKME (KOREKCIJA) REGULAS (ES) 2017/2402 2. NODAĻAS PĀRKĀPUMA DĒĻ</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 270.a pants.
0570	<b>PIRMS MAKSIMĀLĀS ROBEŽVĒRTĪBAS</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 337. pants, ņemot vērā minētās regulas 335. pantā paredzēto rīcības brīvību, kas iestādei ļauj noteikt maksimālo robežvērtību produkta svērumam un neto pozīcijai maksimāli iespējamā ar saistību nepildīšanas risku saistītā zaudējuma līmenī.
0601	<b>PĒC MAKSIMĀLĀS ROBEŽVĒRTĪBAS / KOPĒJĀM PAŠU KAPITĀLA PRASĪBĀM</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 337. pants, ņemot vērā minētās regulas 335. pantā paredzēto rīcības brīvību.

Rindas	
0010	<b>KOPĒJĀ RISKĀ DARĪJUMU VĒRTĪBA</b> Nenokārtotu (tirdzniecības portfeli turētu) vērtspapīrošanas un atkārtotas vērtspapīrošanas darījumu kopsumma, ko uzrāda iestāde, kura ir iniciatora vai ieguldītāja, vai sponsora lomā.
0040, 0070 un 0100	<b>VĒRTSPAPĪROŠANAS POZĪCIJAS</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 4. panta 1. punkta 62) apakšpunkts.
0020, 0050, 0080 un 0110	<b>ATKĀRTOTAS VĒRTSPAPĪROŠANAS POZĪCIJAS</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 4. panta 1. punkta 64) apakšpunkts.
0041, 0071 un 0101	<b>T. SK.: VAR PIEMĒROT DIFERENCĒTU REŽĪMU ATTIECĪBĀ UZ KAPITĀLU</b> Tādu vērtspapīrošanas pozīciju kopējā summa, kas atbilst Regulas (ES) Nr. 575/2013 243. pantā vai 270. pantā minētajiem kritērijiem un kas tāpēc ir atbilstīgas, lai tām piemērotu diferencētu kapitāla režīmu.
0030-0050	<b>INICIATORS</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 4. panta 1. punkta 13) apakšpunkts.
0060-0080	<b>IEGULDĪTĀJS</b> Kreditēstāde, kas vērtspapīrošanas darījumā tur vērtspapīrošanas pozīciju un kas nav šā darījuma iniciators vai sponsors, vai sākotnējais aizdevējs.
0090-0110	<b>SPONSORS</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 4. panta 1. punkta 14) apakšpunkts. Sponsors, kas arī vērtspapīro savus pašu aktīvus, iniciatora rindās norāda informāciju par saviem pašu vērtspapīrotajiem aktīviem.

4. C 20.00 – TIRGUS RISKS: STANDARTIZĒTĀ PIEEJA ATTIECĪBĀ UZ KORELĀCIJAS TIRDZniecības PORTFEĻA POZĪCIJU SPECIFISKO RISKU (MKR SA CTP)

4.1. Vispārīgas piezīmes

15. Šajā veidnē pieprasīta informācija par korelācijas tirdzniecības portfela (KTP) pozīcijām (kas ietver vērtspapīrošanu, n-tā saistību nepildīšanas gadījuma kredītu atvasinātos instrumentus un citas KTP pozīcijas, kas iekļautas saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 338. panta 3. punktu) un attiecīgajām pašu kapitāla prasībām saskaņā ar standartizēto pieeju.
16. MKR SA CTP veidnē ir uzrādītas pašu kapitāla prasības tikai attiecībā uz KTP pozīciju specifisko risku saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 335. pantu saistībā ar 338. panta 2. un 3. punktu. Ja KTP pozīciju risks tirdzniecības portfeli ir ierobežots ar kredītu atvasinātajiem instrumentiem, piemēro Regulas (ES) Nr. 575/2013 346. un 347. pantu. Visām tirdzniecības portfela KTP pozīcijām ir tikai viena veidne neatkarīgi no pieejas, ko iestādes piemēro, lai noteiktu katras pozīcijas riska svērumu saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 Trešās daļas II sadaļas 5. nodaļu. Pārskatu par pašu kapitāla prasībām attiecībā uz minēto pozīciju vispārējo risku sniedz MKR SA TDI vai MKR IM veidnē.
17. Šī veidne atdala vērtspapīrošanas pozīcijas, n-tās saistību nepildīšanas gadījuma kredītu atvasinātos instrumentus un citas KTP pozīcijas. Vērtspapīrošanas pozīcijas vienmēr uzrāda 0030., 0060. vai 0090. rindā (atkarībā no iestādes lomas vērtspapīrošanā). N-tās saistību nepildīšanas gadījuma kredītu atvasinātos instrumentus vienmēr uzrāda 0110. rindā. "Citas KTP pozīcijas" ir tādas pozīcijas, kas nav ne vērtspapīrošanas pozīcijas, ne n-tā saistību nepildīšanas gadījuma kredītu atvasinātie instrumenti (sk. Regulas (ES) Nr. 575/2013 338. panta 3. punktu), bet tās ir tieši "saistītas" (riskā ierobežošanas nolūkā) ar vienu no šīm divām pozīcijām.
18. Pozīcijas, kam piemēro 1 250 % riska svērumu, var alternatīvi atskaitīt no pirmā līmeņa pamata kapitāla (sk. Regulas (ES) Nr. 575/2013 244. panta 1. punkta b) apakšpunktu, 245. panta 1. punkta b) apakšpunktu un 253. pantu). Šīs pozīcijas uzrāda šajā veidnē pat tad, ja iestāde izmanto atskaitīšanas iespēju.

## 4.2. Norādes attiecībā uz konkrētām pozīcijām

Slejas	
0010-0020	<b>VISAS POZĪCIJAS (GARĀS UN ĪSĀS)</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 102. pants un 105. panta 1. punkts saistībā ar minētās regulas 338. panta 2. un 3. punktu (pozīcijas, kas piešķirtas korelācijas tirdzniecības portfelim). Attiecībā uz atšķirību starp garajām un īsajām pozīcijām, kas arī ir piemērojamas šīm bruto pozīcijām, sk. Regulas (ES) Nr. 575/2013 328. panta 2. punktu.
0030-0040	<b>(-) POZĪCIJAS, KAS ATSKAITĪTAS NO PAŠU KAPITĀLA (GARĀS UN ĪSĀS)</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 253. pants
0050-0060	<b>NETO POZĪCIJAS (GARĀS UN ĪSĀS)</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 327., 328., 329. un 334. pants. Attiecībā uz atšķirību starp garajām un īsajām pozīcijām, sk. minētās regulas 328. panta 2. punktu.
0071-0097	<b>NETO POZĪCIJU SADALĪJUMS PA RISKĀ SVĒRUMIEM</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 259. līdz 262. pants, 263. panta 1. un 2. tabula, 264. panta 3. un 4. tabula un 266. pants.
0402-0406	<b>NETO POZĪCIJU SADALĪJUMS PA PIEEJĀM</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 254. pants
0402	<b>SEC-IRBA</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 259. un 260. pants.
0403	<b>SEC-SA</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 261. un 262. pants.
0404	<b>SEC-ERBA</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 263. un 264. pants.
0405	<b>IEKŠĒJĀ NOVĒRTĒJUMA PIEEJA</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 254. un 265. pants un 266. panta 5. punkts.
0900	<b>ĪPAŠS REŽĪMS ATBILSTĪGAS INRD VĒRTSPAPĪROŠANAS AUGSTĀKAS PRIORITĀTES LAIDIENIEM</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 269.a panta 3. punkts.
0406	<b>CITS (RW = 1 250 %)</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 254. panta 7. punkts.
0410-0420	<b>PIRMS MAKSIMĀLĀS ROBEŽVĒRTĪBAS – SVĒRTĀS NETO GARĀS/ĪSĀS POZĪCIJAS</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 338. pants, ņemot vērā minētās regulas 335. pantā paredzēto rīcības brīvību.
0430-0440	<b>PĒC MAKSIMĀLĀS ROBEŽVĒRTĪBAS – SVĒRTĀS NETO GARĀS/ĪSĀS POZĪCIJAS</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 338. pants, ņemot vērā minētās regulas 335. pantā paredzēto rīcības brīvību.
0450	<b>KOPĒJĀS PAŠU KAPITĀLA PRASĪBAS</b> Pašu kapitāla prasību nosaka kā lielāko no šādiem lielumiem: a) specifiskā riska prasība, kas būtu piemērojama tikai neto garajām pozīcijām (0430. sleja); b) specifiskā riska prasība, kas būtu piemērojama tikai neto īsajām pozīcijām (0440. sleja).
Rindas	
0010	<b>KOPĒJĀ RISKĀ DARĪJUMU VĒRTĪBA</b> Nenokārtotu (korelācijas tirdzniecības portfeli turētu) pozīciju kopsumma, ko uzrāda iestāde, kura ir iniciatora, ieguldītāja vai sponsora lomā.
0020-0040	<b>INICIATORS</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 4. panta 1. punkta 13) apakšpunkts.

0050-0070	<b>IEGULDĪTĀJS</b> Kreditēstāde, kas vērtspapīrošanas darījumā tur vērtspapīrošanas pozīciju un kas nav šā darījuma iniciators vai sponsors, vai sākotnējais aizdevējs.
0080-0100	<b>SPONSORS</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 4. panta 1. punkta 14) apakšpunkts. Sponsors, kas arī vērtspapīro savus pašu aktīvus, iniciatora rindās norāda informāciju par saviem pašu vērtspapīrotajiem aktīviem.
0030, 0060 un 0090	<b>VĒRTSPAPĪROŠANAS POZĪCIJAS</b> Korelācijas tirdzniecības portfeli ir ietverta vērtspapīrošana, n-tā saistību nepildīšanas gadījuma kredītu atvasinātie instrumenti un, iespējams, citas riska ierobežošanas pozīcijas, kas atbilst Regulas (ES) Nr. 575/2013 338. panta 2. un 3. punktā noteiktajiem kritērijiem. Vērtspapīrošanas riska darījumu atvasinātos instrumentus, kas nodrošina proporcionālas tiesības, kā arī pozīcijas, kuras ierobežo KTP pozīciju risku, iekļauj rindā "Citas KTP pozīcijas".
0110	<b>N-TĀ SAISTĪBU NEPILDĪŠANAS GADĪJUMA KREDĪTU ATVASINĀTIE INSTRUMENTI</b> Šeit uzrāda n-tā saistību nepildīšanas gadījuma kredītu atvasinātos instrumentus, kuru risks ierobežots ar n-tā saistību nepildīšanas gadījuma kredīta atvasinātajiem instrumentiem saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 347. pantu. Pozīcijas iniciators, ieguldītājs un sponsors nav attiecināms uz n-tā saistību nepildīšanas gadījuma kredītu atvasinātajiem instrumentiem. Līdz ar to n-tā saistību nepildīšanas gadījuma kredītu atvasinātos instrumentus nesadala tā kā vērtspapīrošanas pozīcijas.
0040, 0070, 0100 un 0120	<b>CITAS KTP POZĪCIJAS</b> Ietilpst šādas pozīcijas: a) vērtspapīrošanas riska darījumu atvasinātie instrumenti, kas nodrošina proporcionālas tiesības, kā arī pozīcijas, kuras ierobežo KTP pozīciju risku; b) KTP pozīcijas, kuru risks saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 346. pantu ierobežots ar kredītu atvasinātajiem instrumentiem; c) citas pozīcijas, kas atbilst Regulas (ES) Nr. 575/2013 338. panta 3. punktam.

5. C 21.00 – TIRGUS RISKS: STANDARTIZĒTĀ PIEEJA ATTIECĪBĀ UZ KAPITĀLA VĒRTSPAPĪRU POZĪCIJAS RISKU (MKR SA EQU)

5.1. Vispārīgas piezīmes

19. Šajā veidnē pieprasīta informācija par pozīcijām un attiecīgajām pašu kapitāla prasībām attiecībā uz kapitāla vērtspapīru pozīcijas risku tirdzniecības portfeli, kam piemērota standartizētā pieeja.
20. Šo veidni aizpilda atsevišķi par posteni "Kopā", kā arī par statistiku, iepriekš noteiktu sarakstu ar šādiem tirgiem: Bulgārija, Čehijas Republika, Dānija, Ēģipte, Ungārija, Islande, Lihtenšteina, Norvēģija, Polija, Rumānija, Zviedrija, Apvienotā Karaliste, Albānija, Japāna, Bijusī Dienvidslāvijas Maķedonijas Republika, Krievijas Federācija, Serbija, Šveice, Turcija, Ukraina, ASV, eurozona, un par vienu atsevišķu veidni ar visiem citiem tirgiem. Šīs pārskatu sniegšanas prasības nolūkā termins "tirgus" saprotams kā "valsts" (izņemot valstis, kas ir eurozonas valstis, sk. Komisijas Deleģēto regulu (ES) Nr. 525/2014 <sup>(1)</sup>).

5.2. Norādes attiecībā uz konkrētām pozīcijām

Slejas	
0010-0020	<b>VISAS POZĪCIJAS (GARĀS UN ĪSĀS)</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 102. pants un 105. panta 1. punkts. Tās ir bruto pozīcijas, kurām nav veikts savstarpējo prasījumu ieskaits pa instrumentiem, bet kuras neietver sākotnējās izvietojuma pozīcijas, uz ko pieteikušās vai kam pakārtotu sākotnējo izvietojumu veic trešās puses, kā minēts minētās regulas 345. panta 1. punkta pirmās daļas otrajā teikumā.

<sup>(1)</sup> Komisijas Deleģētā regula (ES) Nr. 525/2014 (2014. gada 12. marts), ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 575/2013 attiecībā uz regulatīviem tehniskajiem standartiem par tirgus definīciju (OV L 148, 20.5.2014., 15. lpp., ELI: [http://data.europa.eu/eli/reg\\_del/2014/525/oj](http://data.europa.eu/eli/reg_del/2014/525/oj)).



0030-0040	<b>NETO POZĪCIJAS (GARĀS UN ĪSĀS)</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 327., 329., 332., 341. un 345. pants.
0050	<b>POZĪCIJAS, UZ KURĀM ATTIECAS KAPITĀLA PRASĪBA</b> Tās neto pozīcijas, uz kurām saskaņā ar dažādaļām pieejām, kas aplūkotas Regulas (ES) Nr. 575/2013 Trešās daļas IV sadaļas 2. nodaļā, attiecas kapitāla prasība. Kapitāla prasību katram valsts tirgum aprēķina atsevišķi. Šajā slejā neietver pozīcijas biržā tirgotu akciju indeksa nākotnes līgumos, kā minēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 344. panta 4. punkta otrajā teikumā.
0060	<b>PAŠU KAPITĀLA PRASĪBAS</b> Pašu kapitāla prasība saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 Trešās daļas IV sadaļas 2. nodaļu attiecībā uz jebkuru attiecīgo pozīciju.
0070	<b>KOPĒJĀ RISKĀ DARĪJUMU VĒRTĪBA</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 92. panta 6. punkta b) apakšpunkts. Aprēķina, pašu kapitāla prasības reizinot ar 12,5.

## Rindas

0010-0130	<b>TIRDZniecības PORTFELĪ IEKĻAUTIE KAPITĀLA VĒRTSPAPĪRI</b> Pašu kapitāla prasības attiecībā uz pozīcijas risku, kā minēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 92. panta 3. punkta b) apakšpunkta i) punktā un Trešās daļas IV sadaļas 2. nodaļas 3. iedaļā.
0020-0040	<b>VISPĀRĒJAIS RISKS</b> Kapitāla vērtspapīru pozīcijas, kas pakļautas vispārējam riskam (Regulas (ES) Nr. 575/2013 343. pants), un to attiecīgās pašu kapitāla prasības saskaņā ar minētās regulas Trešās daļas IV sadaļas 2. nodaļas 3. iedaļu. Abi sadalījumi (0021./0022. rindas, kā arī 0030./0040. rindas) ir saistīti ar visām visas pozīcijām, kuras pakļautas vispārējam riskam. 0021. un 0022. rindā pieprasīta informācija par sadalījumu pa instrumentiem. Tikai sadalījumu 0030. un 0040. rindā izmanto kā pamatu pašu kapitāla prasību aprēķinam.
0021	<b>Atvasinātie instrumenti</b> Atvasinātie instrumenti, kas iekļauti tirdzniecības portfeļa pozīciju kapitāla vērtspapīru riska aprēķinā, attiecīgā gadījumā ņemot vērā Regulas (ES) Nr. 575/2013 329. un 332. pantu.
0022	<b>Citi aktīvi un saistības</b> Instrumenti, kas nav atvasinātie instrumenti un kas ietverti tirdzniecības portfeļa pozīciju kapitāla vērtspapīru riska aprēķinā.
0030	<b>Plaši diversificēti biržā tirgoti akciju indeksa nākotnes līgumi, kuriem piemēro īpašu pieeju</b> Plaši diversificēti, biržā tirgoti akciju indeksa nākotnes līgumi, kuriem piemēro īpašu pieeju saskaņā ar Komisijas Īstenošanas regulu (ES) Nr. 945/2014 <sup>(2)</sup> . Minētās pozīcijas ir pakļautas tikai vispārējam riskam, un tās attiecīgi neuzrāda 0050. rindā.
0040	<b>Citi kapitāla vērtspapīri, kas nav plaši diversificēti, biržā tirgoti akciju indeksa nākotnes līgumi</b> Citas kapitāla vērtspapīru pozīcijas, kuras pakļautas specifiskajam riskam un attiecīgās pašu kapitāla prasības saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 343. pantu, tostarp to regulētā tirgū tirgotu akciju indeksa nākotnes līgumu pozīcijas, kuriem piemērota minētās regulas 344. panta 3. punktā minētā procedūra.

<sup>(2)</sup> Komisijas Īstenošanas regula (ES) Nr. 945/2014 (2014. gada 4. septembris), ar ko nosaka īstenošanas tehniskos standartus attiecībā uz attiecīgajiem pienācīgi diversificētiem indeksiem saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 575/2013. (OV L 265, 5.9.2014, 3. lpp., ELI: [http://data.europa.eu/eli/reg\\_impl/2014/945/oj](http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2014/945/oj)).

0050	<b>SPECIFISKAIS RISKS</b> Pozīcijas kapitāla vērtspapīros, kuras pakļautas specifiskam riskam, un attiecīgās pašu kapitāla prasības saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 342. pantu, izņemot to regulētā tirgū tirgotu akciju indeksa nākotnes līgumu pozīcijas, kuriem piemērota minētās regulas 344. panta 4. punkta otrajā teikumā minētā procedūra.
0090-0130	<b>PAPILDU PRASĪBAS ATTIECĪBĀ UZ IESPĒJAS LĪGUMIEM (RISKI, KAS NAV DELTA RISKI)</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 329. panta 2. un 3. punkts. Papildu prasības attiecībā uz iespējas līgumiem, kas saistīti ar riskiem, kuri nav delta riski, uzrāda saskaņā ar šim aprēķinam izmantotajām metodēm.

6. C 22.00 – TIRGUS RISKS: STANDARTIZĒTĀ PIEEJA ATTIECĪBĀ UZ ĀRVALSTU VALŪTAS RISKU (MKR SA FX)

6.1. Vispārīgas piezīmes

21. Ieguldījumu brokeru sabiedrības uzrāda informāciju par pozīcijām katrā valūtā (tostarp pārskata sniegšanas valūtā) un attiecīgās pašu kapitāla prasības attiecībā uz ārvalstu valūtas risku, kam piemērota standartizētā pieeja. Pozīciju aprēķina attiecībā uz katru valūtu (tostarp EUR), zeltu un pozīcijām KIU.
22. Šīs veidnes 0100.–0470. rindu uzrāda, ja ieguldījumu brokeru sabiedrībām ir atļauja veikt Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvas 2014/65/ES<sup>(\*)</sup> I pielikuma A iedaļas 3. vai 6. punktā minētās darbības, pat ja minētajām ieguldījumu brokeru sabiedrībām nav jāaprēķina pašu kapitāla prasības attiecībā uz ārvalstu valūtas risku saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 351. pantu. Minētajos izziņas posteņos 0100. līdz 0470. rindā iekļauj visas pozīcijas pārskata sniegšanas valūtā neatkarīgi no tā, vai tās ņem vērā Regulas (ES) Nr. 575/2013 354. panta vajadzībām. Veidnes izziņas posteņu 0130.–0470. rindu aizpilda atsevišķi par visām Savienības dalībvalstu valūtām un šādām valūtām: GBP, USD, CHF, JPY, RUB, TRY, AUD, CAD, RSD, ALL, UAH, MKD, EGP, ARS, BRL, MXN, HKD, ICK, TWD, NZD, NOK, SGD, KRW, CNY un visām citām valūtām.

6.2. Norādes attiecībā uz konkrētām pozīcijām

Slejas	
0020-0030	<b>VISAS POZĪCIJAS (GARĀS UN ĪSĀS)</b> Bruto pozīcijas saistībā ar aktīviem, visām nākotnē saņemamajām summām un līdzīgiem posteņiem, kas minēti Regulas (ES) Nr. 575/2013 352. panta 1. punktā. Saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 352. panta 2. punktu un kompetento iestāžu atļauju pozīcijas, ko iestāde uzņēmusies, lai ierobežotu valūtas kursa negatīvu ietekmi uz tās rādītājiem atbilstīgi minētās regulas 92. panta 1. punktam, un pozīcijas, kas saistītas ar posteņiem, kuri jau atskaitīti, aprēķinot pašu kapitālu, nav jāuzrāda.
0040-0050	<b>NETO POZĪCIJAS (GARĀS UN ĪSĀS)</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 352. panta 3. punkts un 352. panta 4. punkta pirmie divi teikumi un 353. pants. Neto pozīcijas aprēķina katrā valūtā saskaņā ar minētās regulas 352. panta 1. punktu. Tādējādi vienlaikus var uzrādīt gan garās, gan īsās pozīcijas.
0060-0080	<b>POZĪCIJAS, UZ KURĀM ATTIECAS KAPITĀLA PRASĪBA</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 352. panta 4. punkta trešais teikums un 353. un 354. pants.

(\*) Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīva 2014/65/ES (2014. gada 15. maijs) par finanšu instrumentu tirgiem un ar ko groza Direktīvu 2002/92/ES un Direktīvu 2011/61/ES (OV L 173, 12.6.2014., 349. lpp., ELI: <http://data.europa.eu/eli/dir/2014/65/oj>).

0060-0070	<b>POZĪCIJAS, UZ KURĀM ATTIECAS KAPITĀLA PRASĪBA (GARĀS UN ĪSĀS)</b> Garās un īsās neto pozīcijas attiecībā uz katru valūtu aprēķina, no garo pozīciju kopsummas atskaitot īso pozīciju kopsummu. Garās neto pozīcijas attiecībā uz katru valūtā veiktu operāciju saskaita, lai iegūtu garo neto pozīciju attiecīgajā valūtā. Īsās neto pozīcijas attiecībā uz katru valūtā veiktu operāciju saskaita, lai iegūtu īso neto pozīciju attiecīgajā valūtā. Nesakrītošās pozīcijas valūtās, kurās nesniedz pārskatus, pieskaita pozīcijām, uz kurām attiecas kapitāla prasība citām valūtām (030. rinda) 060. vai 070. slejā atkarībā no tā, vai tās ir īsās vai garās pozīcijas.
0080	<b>POZĪCIJAS, UZ KURĀM ATTIECAS KAPITĀLA PRASĪBA (SAKRĪTOŠĀS)</b> Sakrītošās pozīcijas cieši korelētās valūtās.
0090	<b>PAŠU KAPITĀLA PRASĪBAS</b> Kapitāla prasība attiecībā uz jebkuru attiecīgo pozīciju saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 Trešās daļas IV sadaļas 3. nodaļu.
0100	<b>KOPĒJĀ RISKĀ DARĪJUMU VĒRTĪBA</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 92. panta 6. punkta b) apakšpunkts. Aprēķina, pašu kapitāla prasības reizinot ar 12,5.

## Rindas

0010	<b>KOPĒJĀS POZĪCIJAS</b> Visas pozīcijas valūtās, kurās nesniedz pārskatus, un tās pozīcijas pārskata sniegšanas valūtā, ko ņem vērā Regulas (ES) Nr. 575/2013 354. panta vajadzībām un to attiecīgās pašu kapitāla prasības ārvalstu valūtas riskam, kas minēts minētās regulas 92. panta 3. punkta c) apakšpunkta i) punktā, ņemot vērā Regulas (ES) Nr. 575/2013 352. panta 2. un 4. punktu (konvertēšanai pārskata valūtā).
0020	<b>CIEŠI KORELĒTAS VALŪTAS</b> Pozīcijas un to attiecīgās pašu kapitāla prasības attiecībā uz cieši korelētām valūtām, kā minēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 354. pantā.
0025	<b>Cieši korelētās valūtas: t. sk.: pārskata sniegšanas valūta</b> Tās pozīcijas pārskata sniegšanas valūtā, kuras veicina kapitāla prasību aprēķināšanu saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 354. pantu.
0030	<b>VISAS CITAS VALŪTAS (tostarp tādas ārvalstu valūtas pozīcijas KIU, ko pielīdzina atšķirīgām valūtām)</b> Pozīcijas un to attiecīgās pašu kapitāla prasības valūtām, kam piemēro Regulas (ES) Nr. 575/2013 351. pantā un 352. panta 2. un 4. punktā minēto vispārējo procedūru. Ziņojums par KIU, ko pielīdzina atsevišķām valūtām saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 353. pantu. Lai attiecībā uz tām ārvalstu valūtas pozīcijām KIU, ko pielīdzina atsevišķām valūtām, aprēķinātu kapitāla prasības, piemēro divus dažādus režīmus: a) modificēto zelta metodi, ja KIU ieguldījuma virziens nav zināms (šīs ārvalstu valūtas pozīcijas KIU pieskaita iestādes kopējai neto ārvalstu valūtas pozīcijai); b) ja KIU ieguldījuma virziens ir zināms, šīs ārvalstu valūtas pozīcijas KIU pieskaita kopējai atvērtajai ārvalstu valūtas pozīcijai (atkarībā no KIU virziena – garajai vai īsajai). Pārskatu par šīm ārvalstu valūtas pozīcijām KIU sniedz atbilstoši kapitāla prasību aprēķinam.
0040	<b>ZELTS</b> Pozīcijas un to attiecīgās pašu kapitāla prasības valūtām, kam piemēro Regulas (ES) Nr. 575/2013 351. pantā un 352. panta 2. un 4. punktā minēto vispārējo procedūru.

0050 - 0090	<b>PAPILDU PRASĪBAS ATTIECĪBĀ UZ IESPĒJAS LĪGUMIEM (RISKI, KAS NAV DELTA RISKI)</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 352. panta 5. un 6. punkts. Papildu prasības attiecībā uz iespējas līgumiem, kas saistīti ar riskiem, kuri nav delta riski, uzrāda sadalījumā pa šim aprēķinam izmantotajām metodēm.
0100-0120	<b>Kopējo pozīciju sadalījums (tostarp pārskata sniegšanas valūtā) pa riska darījumu veidiem</b> Kopējās pozīcijas sadala atbilstoši to atvasinātajiem instrumentiem, citiem aktīviem un saistībām, un ārpusbilances posteņiem.
0100	<b>Citi aktīvi un saistības, kas nav ārpusbilances posteņi un atvasinātie instrumenti</b> Šajā kategorijā ietver pozīcijās, kas nav ietvertas 0110. un 0120. rindā.
0110	<b>Ārpusbilances posteņi</b> Tādi Regulas (ES) Nr. 575/2013 352. panta darbības jomā ietvertie posteņi neatkarīgi no denominācijas valūtas, kas ir ietverti minētās regulas I pielikumā, izņemot posteņus, kuri ietverti kā vērtspapīru finansēšanas darījumi un ilgstošo norēķinu darījumi vai izrietoši no dažādu produktu savstarpējo prasījumu līgumiskā ieskaista.
0120	<b>Atvasinātie instrumenti</b> Pozīcijas, kas novērtētas saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 352. pantu.
0130-0470	<b>IZZIŅAS POSTEŅI: VALŪTAS POZĪCIJAS</b> Veidnes izziņas posteņus aizpilda atsevišķi par visām Savienības dalībvalstu valūtām un par GBP, USD, CHF, JPY, RUB, TRY, AUD, CAD, RSD, ALL, UAH, MKD, EGP, ARS, BRL, MXN, HKD, ICK, TWD, NZD, NOK, SGD, KRW, CNY un visām citām valūtām. 0470. rindā iekļauj zelta pozīcijas un KIU pozīcijas, ko pielīdzina atsevišķai valūtai saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 353. panta 3. punktu.

7. C 23.00 – TIRGUS RISKS: STANDARTIZĒTĀS PIEEJAS ATTIECĪBĀ UZ PRECĒM (MKR SA COM)

7.1. Vispārīgas piezīmes

23. Šajā veidnē pieprasīta informācija par preču pozīcijām un attiecīgajām pašu kapitāla prasībām, kam piemērota standartizētā pieeja.

7.2. Norādes attiecībā uz konkrētām pozīcijām

Slejas	
0010-0020	<b>VISAS POZĪCIJAS (GARĀS UN ĪSĀS)</b> Bruto garās/īsās pozīcijas, kas saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 357. panta 4. punktu ņemtas vērā attiecībā uz vienu un to pašu preci (sk. arī minētās regulas 359. panta 1. punktu).
0030-0040	<b>NETO POZĪCIJAS (GARĀS UN ĪSĀS)</b> Kā minēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 357. panta 3. punktā.
0050	<b>POZĪCIJAS, UZ KURĀM ATTIECAS KAPITĀLA PRASĪBA</b> Tās neto pozīcijas, uz kurām saskaņā ar dažādajām pieejām, kas aplūkotas Regulas (ES) Nr. 575/2013 Trešās daļas IV sadaļas 4. nodaļā, attiecas kapitāla prasība.
0060	<b>PAŠU KAPITĀLA PRASĪBAS</b> Pašu kapitāla prasība, kas aprēķināta saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 Trešās daļas IV sadaļas 4. nodaļu attiecībā uz jebkuru attiecīgo pozīciju.
0070	<b>KOPĒJĀ RISKĀ DARĪJUMU VĒRTĪBA</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 92. panta 6. punkta b) apakšpunkts. Aprēķina, pašu kapitāla prasības reizinot ar 12,5.

Rindas	
0010	<b>KOPĒJĀS PREČU POZĪCIJAS</b> Preču pozīcijas un to attiecīgās pašu kapitāla prasības attiecībā uz tirgus risku, kas aprēķinātas saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 92. panta 4. punkta c) apakšpunktu un minētās regulas Trešās daļas IV sadaļas 4. nodaļu.
0020-0060	<b>POZĪCIJAS PĒC PRECES KATEGORIJAS</b> Pārskatu sniegšanas nolūkā preces ir sagrupētas četrās preču grupās, kas minētas Regulas (ES) Nr. 575/2013 361. panta 2. tabulā.
0070	<b>TERMIŅU SADALĪJUMA PIEEJA</b> Preču pozīcijas, kam piemēro Regulas (ES) Nr. 575/2013 359. pantā minēto termiņu sadalījuma pieeju.
0080	<b>PAPLAŠINĀTĀ TERMIŅU SADALĪJUMA PIEEJA</b> Preču pozīcijas, kam piemēro Regulas (ES) Nr. 575/2013 361. pantā minēto paplašināto termiņu sadalījuma pieeju.
0090	<b>VIENKĀRŠOTĀ PIEEJA</b> Preču pozīcijas, kam piemēro Regulas (ES) Nr. 575/2013 360. pantā minēto vienkāršoto pieeju.
0100-0140	<b>PAPILDU PRASĪBAS ATTIECĪBĀ UZ IESPĒJAS LĪGUMIEM (RISKI, KAS NAV DELTA RISKI)</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 358. panta 4. punkts. Papildu prasības attiecībā uz iespējas līgumiem, kas saistīti ar riskiem, kuri nav delta riski, uzrāda saskaņā ar šim aprēķinam izmantotajām metodēm.

## 8. C 24.00 – TIRGUS RISKĀ IEKŠĒJAIS MODELIS (MKR IM)

## 8.1. Vispārīgas piezīmes

24. Šajā veidnē sniegts riskam pakļautās vērtības (VaR) un riskam pakļautās vērtības spriedzes apstākļos (sVaR) datu sadalījums pa dažādiem tirgus riskiem (parāda instrumentu, kapitāla vērtspapīru, ārvalstu valūtas, preču) un cita informācija, kas ir būtiska pašu kapitāla prasību aprēķināšanai.
25. Parasti tas, vai vispārējā un specifiskā riska datus var noteikt un uzrādīt atsevišķi vai tikai kopā, ir atkarīgs no ieguldījumu brokeru sabiedrību modeļa struktūras. Tas pats attiecas uz VaR / sVaR sadalīšanu riska kategorijās (procentu likmju risks, kapitāla vērtspapīru risks, preču risks un ārvalstu valūtas risks). Iestāde var atturēties no minēto sadalījumu uzrādīšanas, ja attiecīgā iestāde pierāda, ka pārskatu sniegšana par minētajiem datiem būtu pārmērīgi apgrūtinājoša.

## 8.2. Norādes attiecībā uz konkrētām pozīcijām

Slejas	
0030-0040	<b>Riskam pakļautā vērtība (VaR)</b> VaR ir maksimālie iespējamie zaudējumi, kurus ar noteiktu varbūtību konkrētā laika periodā radītu cenu izmaiņas.
0030	<b>Reizināšanas koeficients (mc) x iepriekšējo 60 darbdienu VaR vidējais rādītājs (VaRavg)</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 364. panta 1. punkta a) apakšpunkta ii) punkts un 365. panta 1. punkts.
0040	<b>Iepriekšējās dienas VaR (VaRt-1)</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 364. panta 1. punkta a) apakšpunkta i) punkts un 365. panta 1. punkts.
0050-0060	<b>VaR spriedzes apstākļos</b> VaR spriedzes apstākļos ir maksimālie iespējamie zaudējumi, kurus ar noteiktu varbūtību konkrētā laika periodā radītu cenu izmaiņas un kuri iegūti, ievades datiem izmantojot vēsturiskos datus par nepārtrauktu 12 mēnešu laika posmu, kurā iestādes portfelis bijis pakļauts ievērojamai finansiālai spriedzei.

0050	<b>Reizināšanas koeficients (ms) x iepriekšējo 60 darbdienu vidējais rādītājs (SVaRavg)</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 364. panta 1. punkta b) apakšpunkta ii) punkts un 365. panta 1. punkts.
0060	<b>Pēdējā pieejamā (SVaRt-1)</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 364. panta 1. punkta b) apakšpunkta i) punkts un 365. panta 1. punkts.
0070-0080	<b>INKREMENTĀLĀ SAISTĪBU NEPILDĪŠANAS UN MIGRĀCIJAS RISKA KAPITĀLA PRASĪBA</b> Inkrementālā saistību nepildīšanas un migrācijas riska kapitāla prasība ir maksimālie iespējamie zaudējumi, kurus radītu cenu izmaiņas, kas saistītas ar saistību nepildīšanas un migrācijas riskiem, kuri aprēķināti saskaņā ar 364. panta 2. punkta b) apakšpunktu saistībā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 Trešās daļas IV sadaļas 5. nodaļas 4. iedaļu.
0070	<b>12 nedēļu vidējais rādītājs</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 364. panta 2. punkta b) apakšpunkta ii) punkts saistībā ar Trešās daļas IV sadaļas 5. nodaļas 4. iedaļu.
0080	<b>Pēdējais rādītājs</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 364. panta 2. punkta b) apakšpunkta i) punkts saistībā ar Trešās daļas IV sadaļas 5. nodaļas 4. iedaļu.
0090-0110	<b>VISU CENAS RISKU KAPITĀLA PRASĪBA ATTIECĪBĀ UZ KTP</b>
0090	<b>MINIMUMS</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 364. panta 3. punkta c) apakšpunkts. 8 % no kapitāla prasības, kas saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 338. panta 1. punktu tiktu aprēķināta attiecībā uz visām pozīcijām "visu cenas risku" kapitāla prasībā.
0100-0110	<b>12 NEDĒĻU VIDĒJAIS RĀDĪTĀJS UN PĒDĒJAIS RĀDĪTĀJS</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 364. panta 3. punkta b) apakšpunkts.
0110	<b>PĒDĒJAIS RĀDĪTĀJS</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 364. panta 3. punkta a) apakšpunkts.
0120	<b>PAŠU KAPITĀLA PRASĪBAS</b> Pašu kapitāla prasības, kā minēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 364. pantā, attiecībā uz visiem riska faktoriem, attiecīgā gadījumā ņemot vērā korelācijas ietekmi, kā arī inkrementālo saistību nepildīšanas un migrācijas risku, un visus cenas riskus attiecībā uz KTP, taču izņemot vērtspapīrošanas kapitāla prasību attiecībā uz vērtspapīrošanu un n-tā saistību nepildīšanas gadījuma kredīta atvasinātos instrumentus saskaņā ar minētās regulas 364. panta 2. punktu.
0130	<b>KOPĒJĀ RISKA DARĪJUMU VĒRTĪBA</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 92. panta 6. punkta b) apakšpunkts. Aprēķina, pašu kapitāla prasības reizinot ar 12,5.
0140	<b>Pārsniegumu skaits iepriekšējās 250 darbdienās</b> Norādīts Regulas (ES) Nr. 575/2013 366. pantā. Uzrāda pārsniegumu skaitu, pamatojoties uz kuriem ir noteikts saskaitāmais. Ja ieguldījumu brokeru sabiedrībām ir atļauts izslēgt noteiktus pārsniegumus no otrā saskaitāmā aprēķina saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 500.c pantu, šajā slejā uzrādīto pārsniegumu skaits neietver minētos izslēgtos pārsniegumus.
0150-0160	<b>VaR reizināšanas koeficients (mc) un SVaR reizināšanas koeficients (ms)</b> Kā minēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 366. pantā. Uzrāda reizinājuma koeficientus, kuri ir faktiski piemērojami pašu kapitāla prasības aprēķināšanai; attiecīgā gadījumā pēc Regulas (ES) Nr. 575/2013 500.c panta piemērošanas.
0170-0180	<b>PIENĒMTĀ PRASĪBA ATTIECĪBĀ UZ KTP MINIMUMU – SVĒRTĀS NETO GARĀS/ĪSĀS POZĪCIJAS PĒC MAKSIMĀLĀS ROBEŽVĒRTĪBAS</b> Uzrādītā summa, kas saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 364. panta 3. punkta c) apakšpunktu ir visu cenu risku kapitāla prasības minimuma aprēķina pamatā, ņemot vērā minētās regulas 335. pantā paredzēto rīcības brīvību, kurā norādīts, ka iestāde var noteikt maksimālo robežvērtību produkta svērumam un neto pozīcijai maksimāli iespējamā ar saistību nepildīšanas risku saistītā zaudējumu līmenī.

Rindas	
0010	<b>KOPĒJĀS POZĪCIJAS</b> Atbilst pozīcijas, ārvalstu valūtas un preču riska daļai, kas minēta Regulas (ES) Nr. 575/2013 363. panta 1. punktā un saistīta ar minētās regulas 367. panta 2. punktā precizētajiem riska faktoriem. Attiecībā uz 0030.–0060. sleju ( <i>VaR</i> un <i>sVaR</i> ) rādītāji kopsummas rindā nav vienādi ar rādītāju sadalījumu attiecīgajiem riska komponentiem <i>VaR</i> / <i>sVaR</i> .
0020	<b>TIRGOTIE PARĀDA INSTRUMENTI</b> Atbilst pozīcijas riska daļai, kas minēta Regulas (ES) Nr. 575/2013 363. panta 1. punktā un kas saistīta ar minētās regulas 367. panta 2. punkta a) apakšpunktā precizētajiem procentu likmju riska faktoriem.
0030	<b>TPI – VISPĀRĒJAIS RISKS</b> Vispārējā riska komponents, kā minēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 362. pantā.
0040	<b>TPI – SPECIFISKAIS RISKS</b> Specifiskā riska komponents, kā minēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 362. pantā.
0050	<b>KAPITĀLA VĒRTSPAPĪRI</b> Atbilst pozīcijas riska daļai, kas minēta Regulas (ES) Nr. 575/2013 363. panta 1. punktā un kas saistīta ar kapitāla vērtspapīru riska faktoriem, kā precizēts minētās regulas 367. panta 2. punkta c) apakšpunktā.
0060	<b>KAPITĀLA VĒRTSPAPĪRI – VISPĀRĒJAIS RISKS</b> Vispārējā riska komponents, kā minēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 362. pantā.
0070	<b>KAPITĀLA VĒRTSPAPĪRI – SPECIFISKAIS RISKS</b> Specifiskā riska komponents, kā minēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 362. pantā.
0080	<b>ĀRVALSTU VALŪTAS RISKS</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 363. panta 1. punkts un 367. panta 2. punkta b) apakšpunkts.
0090	<b>PREČU RISKS</b> Regulas (ES) Nr. 575/2013 363. panta 1. punkts un 367. panta 2. punkta d) apakšpunkts.
0100	<b>KOPĒJĀ VĒRTĪBA ATTIECĪBĀ UZ VISPĀRĒJO RISKU</b> Tirgus risks, ko rada tirgots parāda instrumentu, kapitāla vērtspapīru, ārvalstu valūtas un preču vispārējās tirgus tendences. Visu riska faktoru vispārējā riska <i>VaR</i> (attiecīgā gadījumā ņemot vērā korelācijas ietekmi).
0110	<b>KOPĒJĀ VĒRTĪBA ATTIECĪBĀ UZ SPECIFISKO RISKU</b> Tirgots parāda instrumentu un kapitāla vērtspapīru specifiskā riska komponents. Tirdzniecības portfeļa kapitāla vērtspapīru un tirgots parāda instrumentu specifiskā riska <i>VaR</i> (attiecīgā gadījumā ņemot vērā korelācijas ietekmi).