

**Поправка на Делегиран регламент (ЕС) 2022/2059 на Комисията от 14 юни 2022 година за допълнение на Регламент (ЕС) № 575/2013 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на регулаторните технически стандарти, с които се уточняват техническите характеристики във връзка с бек-тестовите и изискванията за разпределение на печалбата и загубата съгласно членове 325бе и 325бж от Регламент (ЕС) № 575/2013**

(Официален вестник на Европейския съюз L 276 от 26 октомври 2022 г.)

На страница 48 в съображение 13

*вместо:* „Разпоредбите на настоящия регламент са тясно свързани помежду си, тъй като всички се отнасят до елементи, които трябва да бъдат включени в промените в стойността на портфейла на бюрото за търгуване за целите на изчисляването на капиталовите изисквания за пазарни рискове чрез алтернативния подход на вътрешните модели.“

*да се чете:* „Разпоредбите на настоящия регламент са тясно свързани помежду си, тъй като всички се отнасят до елементи, които трябва да бъдат включени в промените в стойността на портфейла на бюрото за търгуване за целите на изчисляването на капиталовите изисквания за **пазарен риск** чрез алтернативния подход на вътрешните модели.“

На страница 56 в член 10, параграф 1

*вместо:*

„ $SA_{ima}$  = капиталовите изисквания за пазарни рискове, изчислени съгласно алтернативния стандартизиран подход по трета част, дял IV, глава 1а от Регламент (ЕС) № 575/2013 за портфейла от всички позиции, отнесени към бюрата за търгуване, за които институциите изчисляват капиталовите изисквания за пазарен риск съгласно алтернативния подход на вътрешните модели по трета част, дял IV, глава 1б от Регламент (ЕС) № 575/2013;

$IMA_{ima}$  = капиталовите изисквания за пазарни рискове, изчислени съгласно алтернативния подход на вътрешните модели по трета част, дял IV, глава 1б от Регламент (ЕС) № 575/2013 за портфейла от всички позиции, отнесени към бюрата за търгуване, за които институциите изчисляват капиталовите изисквания в съответствие с трета част, дял IV, глава 1б от Регламент (ЕС) № 575/2013.“

*да се чете:*

„ $SA_{ima}$  = капиталовите изисквания за пазарен риск, изчислени съгласно алтернативния стандартизиран подход по трета част, дял IV, глава 1а от Регламент (ЕС) № 575/2013 за портфейла от всички позиции, отнесени към бюрата за търгуване, за които институциите изчисляват капиталовите изисквания за пазарен риск съгласно алтернативния подход на вътрешните модели по трета част, дял IV, глава 1б от Регламент (ЕС) № 575/2013;

$IMA_{ima}$  = капиталовите изисквания за пазарен риск, изчислени съгласно алтернативния подход на вътрешните модели по трета част, дял IV, глава 1б от Регламент (ЕС) № 575/2013 за портфейла от всички позиции, отнесени към бюрата за търгуване, за които институциите изчисляват капиталовите изисквания в съответствие с трета част, дял IV, глава 1б от Регламент (ЕС) № 575/2013.“

На страница 56 в член 10, параграф 2

*вместо:*

- „ $SA_i$  = капиталовите изисквания за пазарни рискове, изчислени съгласно алтернативния стандартизиран подход по трета част, дял IV, глава 1а от Регламент (ЕС) № 575/2013 за всички позиции, отнесени към бюро за търгуване „i“;
- $I \in NG$  = индексите на всички бюра за търгуване, които в съответствие с член 9 от настоящия регламент са категоризирани като бюро от червена, оранжева или жълта зона измежду тези, за които капиталовите изисквания за пазарни рискове са изчислени съгласно алтернативния подход на вътрешните модели по трета част, дял IV, глава 1б от Регламент (ЕС) № 575/2013;
- $i \in ima$  = индексите на всички бюра за търгуване, за които капиталовите изисквания за пазарни рискове са изчислени съгласно алтернативния подход на вътрешните модели по трета част, дял IV, глава 1б от Регламент (ЕС) № 575/2013.“

*да се чете:*

- „ $SA_i$  = капиталовите изисквания за пазарен риск, изчислени съгласно алтернативния стандартизиран подход по трета част, дял IV, глава 1а от Регламент (ЕС) № 575/2013 за всички позиции, отнесени към бюро за търгуване „i“;
- $i \in NG$  = индексите на всички бюра за търгуване, които в съответствие с член 9 от настоящия регламент са категоризирани като бюро от червена, оранжева или жълта зона измежду тези, за които капиталовите изисквания за пазарен риск са изчислени съгласно алтернативния подход на вътрешните модели по трета част, дял IV, глава 1б от Регламент (ЕС) № 575/2013;
- $i \in ima$  = индексите на всички бюра за търгуване, за които капиталовите изисквания за пазарен риск са изчислени съгласно алтернативния подход на вътрешните модели по трета част, дял IV, глава 1б от Регламент (ЕС) № 575/2013.“

На страница 56 в член 10, параграф 3

*вместо:* „3. Институциите, които изчисляват капиталовите изисквания за пазарни рискове съгласно алтернативния подход на вътрешните модели по трета част, дял IV, глава 1б от Регламент (ЕС) № 575/2013 за позициите, отнесени към бюро за търгуване, които са категоризирани като бюро от червена или оранжева зона в съответствие с член 9 от настоящия регламент, информират за това компетентния орган, когато докладват резултатите от изискването за разпределение на печалбата и загубата в съответствие с член 325ащ, параграф 2, буква г) от Регламент (ЕС) № 575/2013.“

*да се чете:* „3. Институциите, които изчисляват капиталовите изисквания за пазарен риск съгласно алтернативния подход на вътрешните модели по трета част, дял IV, глава 1б от Регламент (ЕС) № 575/2013 за позициите, отнесени към бюро за търгуване, които са категоризирани като бюро от червена или оранжева зона в съответствие с член 9 от настоящия регламент, информират за това компетентния орган, когато докладват резултатите от изискването за разпределение на печалбата и загубата в съответствие с член 325ащ, параграф 2, буква г) от Регламент (ЕС) № 575/2013.“

На страници 58 и 59 в член 16

*вместо:* „Институциите, които изчисляват капиталовите изисквания за пазарни рискове съгласно алтернативния подход на вътрешните модели по трета част, дял IV, глава 1б от Регламент (ЕС) № 575/2013 за позициите, отнесени към някои от техните бюра за търгуване, изчисляват капиталовите изисквания за всички позиции в търговския си портфейл и за всички позиции в банковия си портфейл, генериращи валутен или стоков риск, като сбор от резултатите от формулите, посочени в букви а) и б), както следва:

$$а) \min\{IMA_{ima} + Capitalsurcharge + C_U ; SA_{alldesks}\}$$

$$б) \max\{IMA_{ima} - SA_{ima}; 0\}$$

Където:

$IMA_{ima}$  =  $IMA_{ima}$  съгласно посоченото в член 10 от настоящия регламент;

$SA_{ima}$  =  $SA_{ima}$  съгласно посоченото в член 10 от настоящия регламент;

*Capital surcharge* = допълнителното капиталово изискване, изчислено в съответствие с член 10 от настоящия регламент;

$C_U$  = капиталовите изисквания, изчислени съгласно трета част, дял IV, глава 1а от Регламент (ЕС) № 575/2013 за портфейла от всички позиции, които не са отнесени към бюрата за търгуване, за които институциите изчисляват капиталовите изисквания за пазарен риск съгласно алтернативния подход на вътрешните модели по трета част, дял IV, глава 1б от Регламент (ЕС) № 575/2013;

$SA_{alldesks}$  = капиталовите изисквания за пазарни рискове за всички позиции в търговския портфейл и всички позиции от банковия портфейл, генериращи валутен или стоков риск, съгласно алтернативния подход на вътрешните модели по трета част, дял IV, глава 1а от Регламент (ЕС) № 575/2013.“

*да се чете:* „Институциите, които изчисляват капиталовите изисквания за пазарен риск съгласно алтернативния подход на вътрешните модели по трета част, дял IV, глава 1б от Регламент (ЕС) № 575/2013 за позициите, отнесени към някои от техните бюра за търгуване, изчисляват капиталовите изисквания за всички позиции в търговския си портфейл и за всички позиции в банковия си портфейл, генериращи валутен или стоков риск, като сбор от резултатите от формулите, посочени в букви а) и б), както следва:

$$а) \min\{IMA_{ima} + Capitalsurcharge + C_U ; SA_{alldesks}\}$$

$$б) \max\{IMA_{ima} - SA_{ima}; 0\}$$

Където:

$IMA_{ima}$  =  $IMA_{ima}$  съгласно посоченото в член 10 от настоящия регламент;

$SA_{ima}$  =  $SA_{ima}$  съгласно посоченото в член 10 от настоящия регламент;

*Capital surcharge* = допълнителното капиталово изискване, изчислено в съответствие с член 10 от настоящия регламент;

$C_U$  = капиталовите изисквания, изчислени съгласно трета част, дял IV, глава 1а от Регламент (ЕС) № 575/2013 за портфейла от всички позиции, които не са отнесени към бюрата за търгуване, за които институциите изчисляват капиталовите изисквания за пазарен риск съгласно алтернативния подход на вътрешните модели по трета част, дял IV, глава 1б от Регламент (ЕС) № 575/2013;

$SA_{alldesks}$  = капиталовите изисквания за пазарен риск за всички позиции в търговския портфейл и всички позиции от банковия портфейл, генериращи валутен или стоков риск, съгласно алтернативния подход на вътрешните модели по трета част, дял IV, глава 1а от Регламент (ЕС) № 575/2013.“