

KOMISSION TÄYTÄNTÖÖNPANOASETUS (EU) 2015/2197,**annettu 27 päivänä marraskuuta 2015,****läheisesti keskenään korreloivia valuuttoja koskevista Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 575/2013 mukaisista teknisistä täytäntöönpanostandardeista****(ETA:n kannalta merkityksellinen teksti)**

EUROOPAN KOMISSIO, joka

ottaa huomioon Euroopan unionin toiminnasta tehdyn sopimuksen,

ottaa huomioon luottolaitosten ja sijoituspalveluyritysten vakavaraisuusvaatimuksista ja asetuksen (EU) N:o 648/2012 muuttamisesta 26 päivänä kesäkuuta 2013 annetun Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 575/2013⁽¹⁾ ja erityisesti sen 354 artiklan 3 kohdan,

sekä katsoo seuraavaa:

- (1) Markkinariskin standardimenetelmässä laitoksilla voi olla lievemmat valuuttakurssiriskin omien varojen vaatimukset kahden valuutan nettoutetun position osalta, kun kyseisiä valuuttoja pidetään läheisesti keskenään korreloivina asetuksen (EU) N:o 575/2013 354 artiklan 1 kohdassa säädetyn menetelmän mukaisesti.
- (2) Läheisesti keskenään korreloivien valuuttojen luettelo laadittaessa olisi sovellettava vakiintunutta markkina-käytäntöä eli pienennettävä 10 päivän enimmäistappio yhden päivän enimmäistappioon jakamalla neljän prosentin enimmäisvaluuttaliike neliöjuurella 10. Siksi kahden valuutan (valuuttaparin) suurimman sallitun päivittäisen arvonmuutoksen kynnsarvoksi olisi asetettava 1,265 prosenttia.
- (3) Päivittäiset prosenttimääräiset valuuttaliikkeet olisi määritettävä kahtena peräkkäisenä päivänä todetun valuuttaparien arvon Napierin logaritmien välisenä erotuksena.
- (4) Tulokseksi saatavan prosenttiosuuden absoluuttista arvoa olisi verrattava valuuttaparin suurimman sallitun päivittäisen arvonmuutoksen 1,265 prosentin suuruiseen kynnsarvoon. Kaikkia tämän kynnsarvon ylittäviä arvoja olisi pidettävä neljän prosentin ja 10 päivän enimmäistappion ylityksinä.
- (5) On tarpeen määrittää hyväksyttävien tappioiden enimmäismäärä, jotta tällaisen rajan ylittäviä valuuttapareja ei luokiteltaisi keskenään korreloiviksi asetuksen (EU) N:o 575/2013 354 artiklan mukaisesti. Hyväksyttävien tappioiden enimmäismäärää laskettaessa olisi otettava huomioon sekä pitkiä että lyhyitä ulkomaanvaluutan positioita. Sallittujen ylitysten määrää olisi pyöristettävä alaspäin, ja näin ollen enimmäistappioiden ylitysten enimmäismääräksi olisi asetettava seitsemän ylitystä kolmen edeltävän vuoden aikana ja 65 ylitystä viiden edeltävän vuoden aikana.
- (6) Asetuksen (EU) N:o 575/2013 354 artiklan 1 kohdassa säädetään lievemmistä omien varojen vaatimuksista ainoastaan ”keskenään relevanttien läheisesti korreloivien valuuttojen” positioiden kattamiseksi. Tämän vuoksi läheisesti keskenään korreloivien valuuttojen tunnistamisperusteiden perusteella olisi arvioitava ainoastaan sellaiset valuuttaparit, jotka on muodostettu yhdistämällä kukin eri jäsenvaltioiden valuutta lueteltujen, unionin rahoituslaitosten kannalta relevanttien kolmansien maiden valuuttojen kanssa.
- (7) Arviointiin olisi sisällytettävä myös tiettyjä muita valuuttapareja, joissa on ainoastaan kolmansien maiden valuuttoja, ottaen huomioon niiden merkitys laitosten sijoitussalkuille unionissa. Kun otetaan huomioon asetuksen (EU) N:o 575/2013 354 artiklan 1 kohdassa asetetut vaatimukset relevanteista tarkastelujaksosta, vain sellaiset valuutat, joista on saatavilla luotettavaan lähteeseen perustuvia päivittäisiä tietoja viiden vuoden ajalta, olisi otettava huomioon tarkasteltaessa sitä, mitkä valuutat olisi sisällytettävä arviointiin.
- (8) Asetuksen (EU) N:o 575/2013 354 artiklan 4 kohdassa vahvistetaan erityiskohtelu sellaisille valuuttapareille, joissa talous- ja rahaliiton toiseen vaiheeseen, jäljempänä ’ERM II’, osallistuvien jäsenvaltioiden valuuttoja yhdistetään euron kanssa tai keskenään. Kyseisiä valuuttoja sisältäviä pareja ei näin ollen tulisi pitää ’relevantteina’. ’Relevantteina’ voidaan kuitenkin pitää sellaisia pareja, joissa toisella puolella on ERM II -valuutta ja toisella puolella muu valuutta kuin euro tai muu ERM II -valuutta.

⁽¹⁾ EUVL L 176, 27.6.2013, s. 1.

- (9) Näin ollen olisi arvioitava kunkin sellaisen valuuttaparin korrelaatiota, joka on muodostettu tämän asetuksen liitteessä esitettyjen valuuttojen yhdistelmästä.
- (10) Jotta voidaan varmistaa läheisesti keskenään korreloivien valuuttojen luettelon käyttö, luetteloa olisi tarkasteltava Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 1093/2010⁽¹⁾ 29 artiklan 1 kohdan d alakohdan mukaisesti. Samoista syistä tämä tarkastelu olisi tehtävä säännöllisin väliajoin ja tarkalleen tai suunnilleen samana ajankohtana (samoina ajankohtina) vuosittain, paitsi jos markkinakehitys edellyttää tällaisen tarkastelun suorittamista poikkeuksellisesti eri aikoina.
- (11) Tämä asetus perustuu Euroopan pankkiviranomaisen komissiolle esittämiin teknisten täytäntöönpanostandardien luonnoksiin.
- (12) Euroopan pankkiviranomainen on järjestänyt avoimet julkiset kuulemiset teknisten täytäntöönpanostandardien luonnoksista, joihin tämä asetus perustuu, analysoinut niihin mahdollisesti liittyviä kustannuksia ja hyötyjä sekä pyytänyt lausunnon asetuksen (EU) N:o 1093/2010 37 artiklan mukaisesti perustetulta pankkialan osallisryhmältä,

ON HYVÄKSYNYT TÄMÄN ASETUKSEN:

1 artikla

Valuuttaparit, jotka täyttävät asetuksen (EU) N:o 575/2013 354 artiklan 1 kohdassa asetetut vaatimukset, esitetään tämän asetuksen liitteessä.

2 artikla

Tämä asetus tulee voimaan kahdentenakymmenentenä päivänä sen jälkeen, kun se on julkaistu *Euroopan unionin virallisessa lehdessä*.

Tämä asetus on kaikilta osiltaan velvoittava, ja sitä sovelletaan sellaisenaan kaikissa jäsenvaltioissa.

Tehty Brysselissä 27 päivänä marraskuuta 2015.

Komission puolesta
Puheenjohtaja
Jean-Claude JUNCKER

⁽¹⁾ Euroopan parlamentin ja neuvoston asetus (EU) N:o 1093/2010, annettu 24 päivänä marraskuuta 2010, Euroopan valvontaviranomaisen (Euroopan pankkiviranomainen) perustamisesta sekä päätöksen N:o 716/2009/EY muuttamisesta ja komission päätöksen 2009/78/EY kumoamisesta (EUVL L 331, 15.12.2010, s. 12).

LIITE

Läheisesti keskenään korreloivien valuuttojen luettelo*Osa 1 – Luettelo euron (EUR) kanssa läheisesti korreloivista valuutoista*

Albanian lek (ALL), Bosnia ja Hertsegovinan vaihdettava markka (BAM), Bulgarian lev (BGN), Tšekin koruna (CZK), Englannin punta (GBP), Kroatian kuna (HRK), Marokon dirham (MAD), Romanian leu (RON).

Osa 2 – Luettelo Arabiemiirikuntien dirhamin (AED) kanssa läheisesti korreloivista valuutoista

Angolan kwanza (AOA), Kanadan dollari (CAD), Kiinan juan renminbi (CNY), Englannin punta (GBP), Hongkongin dollari (HKD), Libanonin punta (LBP), Macaon pataca (MOP), Perun uusi sol (PEN), Filippiinien peso (PHP), Singaporen dollari (SGD), Thaimaan baht (THB), Taiwanin uusi dollari (TWD), Yhdysvaltain dollari (USD).

Osa 3 – Luettelo Albanian lekin (ALL) kanssa läheisesti korreloivista valuutoista

Bosnia ja Hertsegovinan vaihdettava markka (BAM), Bulgarian lev (BGN), Tšekin koruna (CZK), Tanskan kruunu (DKK), Kroatian kuna (HRK), Marokon dirham (MAD), Romanian leu (RON), euro (EUR).

Osa 4 – Luettelo Angolan kwanzan (AOA) kanssa läheisesti korreloivista valuutoista

Arabiemiirikuntien dirhami (AED), Kiinan juan renminbi (CNY), Hongkongin dollari (HKD), Libanonin punta (LBP), Macaon pataca (MOP), Perun uusi sol (PEN), Filippiinien peso (PHP), Singaporen dollari (SGD), Thaimaan baht (THB), Taiwanin uusi dollari (TWD), Yhdysvaltain dollari (USD).

Osa 5 – Luettelo Bosnia ja Hertsegovinan vaihdettavan markan (BAM) kanssa läheisesti korreloivista valuutoista

Albanian lek (ALL), Bulgarian lev (BGN), Tšekin koruna (CZK), Tanskan kruunu (DKK), Englannin punta (GBP), Kroatian kuna (HRK), Marokon dirham (MAD), Romanian leu (RON), euro (EUR).

Osa 6 – Luettelo Bulgarian levin (BGN) kanssa läheisesti korreloivista valuutoista

Albanian lek (ALL), Bosnia ja Hertsegovinan vaihdettava markka (BAM), Tšekin koruna (CZK), Tanskan kruunu (DKK), Englannin punta (GBP), Kroatian kuna (HRK), Marokon dirham (MAD), Romanian leu (RON), euro (EUR).

Osa 7 – Luettelo Kanadan dollarin (CAD) kanssa läheisesti korreloivista valuutoista

Arabiemiirikuntien dirhami (AED), Hongkongin dollari (HKD), Macaon pataca (MOP), Singaporen dollari (SGD), Taiwanin uusi dollari (TWD), Yhdysvaltain dollari (USD).

Osa 8 – Luettelo Kiinan juan renminbin (CNY) kanssa läheisesti korreloivista valuutoista

Arabiemiirikuntien dirhami (AED), Angolan kwanza (AOA), Englannin punta (GBP), Hongkongin dollari (HKD), Libanonin punta (LBP), Macaon pataca (MOP), Perun uusi sol (PEN), Filippiinien peso (PHP), Singaporen dollari (SGD), Thaimaan baht (THB), Taiwanin uusi dollari (TWD), Yhdysvaltain dollari (USD).

Osa 9 – Luettelo Tšekin korunan (CZK) kanssa läheisesti korreloivista valuutoista

Albanian lek (ALL), Bosnia ja Hertsegovinan vaihdettava markka (BAM), Bulgarian lev (BGN), Tanskan kruunu (DKK), Kroatian kuna (HRK), Marokon dirham (MAD), Romanian leu (RON), euro (EUR).

Osa 10 – Luettelo Tanskan kruunun (DKK) kanssa läheisesti korreloivista valuutoista

Albanian lek (ALL), Bosnia ja Hertsegovinan vaihdettava markka (BAM), Bulgarian lev (BGN), Tšekin koruna (CZK), Englannin punta (GBP), Kroatian kuna (HRK), Marokon dirham (MAD), Romanian leu (RON), Singaporen dollari (SGD).

Osa 11 – Luettelo Englannin punnan (GBP) kanssa läheisesti korreloivista valuutoista

Arabiemiirikuntien dirhami (AED), Bosnia ja Hertsegovinan vaihdettava markka (BAM), Bulgarian lev (BGN), Kiinan juan renminbi (CNY), Tanskan kruunu (DKK), Hongkongin dollari (HKD), Kroatian kuna (HRK), Libanonin punta (LBP), Marokon dirhami (MAD), Macaon pataca (MOP), Singaporen dollari (SGD), Taiwanin uusi dollari (TWD), Yhdysvaltain dollari (USD), euro (EUR).

Osa 12 – Luettelo Hongkongin dollarin (HKD) kanssa läheisesti korreloivista valuutoista

Arabiemiirikuntien dirhami (AED), Angolan kwanza (AOA), Kanadan dollari (CAD), Kiinan juan renminbi (CNY), Englannin punta (GBP), Libanonin punta (LBP), Macaon pataca (MOP), Perun uusi sol (PEN), Filippiinien peso (PHP), Singaporen dollari (SGD), Thaimaan baht (THB), Taiwanin uusi dollari (TWD), Yhdysvaltain dollari (USD).

Osa 13 – Luettelo Kroatian kunan (HRK) kanssa läheisesti korreloivista valuutoista

Albanian lek (ALL), Bosnia ja Hertsegovinan vaihdettava markka (BAM), Bulgarian lev (BGN), Tšekin koruna (CZK), Tanskan kruunu (DKK), Englannin punta (GBP), Marokon dirham (MAD), Romanian leu (RON), Singaporen dollari (SGD), euro (EUR).

Osa 14 – Luettelo Etelä-Korean wonin (KRW) kanssa läheisesti korreloivista valuutoista

Perun uusi sol (PEN), Filippiinien peso (PHP), Singaporen dollari (SGD), Taiwanin uusi dollari (TWD).

Osa 15 – Luettelo Libanonin punnan (LBP) kanssa läheisesti korreloivista valuutoista

Arabiemiirikuntien dirhami (AED), Angolan kwanza (AOA), Kiinan juan renminbi (CNY), Englannin punta (GBP), Hongkongin dollari (HKD), Macaon pataca (MOP), Perun uusi sol (PEN), Filippiinien peso (PHP), Singaporen dollari (SGD), Thaimaan baht (THB), Taiwanin uusi dollari (TWD), Yhdysvaltain dollari (USD).

Osa 16 – Luettelo Marokon dirhamin (MAD) kanssa läheisesti korreloivista valuutoista

Albanian lek (ALL), Bosnia ja Hertsegovinan vaihdettava markka (BAM), Bulgarian lev (BGN), Tšekin koruna (CZK), Tanskan kruunu (DKK), Englannin punta (GBP), Kroatian kuna (HRK), Romanian leu (RON), Singaporen dollari (SGD), Thaimaan baht (THB), Taiwanin uusi dollari (TWD), euro (EUR).

Osa 17 – Luettelo Macaon patacan (MOP) kanssa läheisesti korreloivista valuutoista

Arabiemiirikuntien dirhami (AED), Angolan kwanza (AOA), Kanadan dollari (CAD), Kiinan juan renminbi (CNY), Englannin punta (GBP), Hongkongin dollari (HKD), Libanonin punta (LBP), Perun uusi sol (PEN), Filippiinien peso (PHP), Singaporen dollari (SGD), Thaimaan baht (THB), Taiwanin uusi dollari (TWD), Yhdysvaltain dollari (USD).

Osa 18 – Luettelo Perun uuden solin (PEN) kanssa läheisesti korreloivista valuutoista

Arabiemiirikuntien dirhami (AED), Angolan kwanza (AOA), Kiinan juan renminbi (CNY), Hongkongin dollari (HKD), Etelä-Korean won (KRW), Libanonin punta (LBP), Macaon pataca (MOP), Filippiinien peso (PHP), Singaporen dollari (SGD), Thaimaan baht (THB), Taiwanin uusi dollari (TWD), Yhdysvaltain dollari (USD).

Osa 19 – Luettelo Filippiinien peson (PHP) kanssa läheisesti korreloivista valuutoista

Arabiemiirikuntien dirhami (AED), Angolan kwanza (AOA), Kiinan juan renminbi (CNY), Hongkongin dollari (HKD), Etelä-Korean won (KRW), Libanonin punta (LBP), Macaon pataca (MOP), Malesian ringgit (MYR), Perun uusi sol (PEN), Singaporen dollari (SGD), Thaimaan baht (THB), Taiwanin uusi dollari (TWD), Yhdysvaltain dollari (USD).

Osa 20 – Luettelo Romanian leun (RON) kanssa läheisesti korreloivista valuutoista

Albanian lek (ALL), Bosnia ja Hertsegovinan vaihdettava markka (BAM), Bulgarian lev (BGN), Tšekin koruna (CZK), Tanskan kruunu (DKK), Kroatian kuna (HRK), Marokon dirham (MAD), euro (EUR).

Osa 21 – Luettelo Singaporen dollarin (SGD) kanssa läheisesti korreloivista valuutoista

Arabiemiirikuntien dirhami (AED), Angolan kwanza (AOA), Kanadan dollari (CAD), Kiinan juan renminbi (CNY), Tanskan kruunu (DKK), Englannin punta (GBP), Hongkongin dollari (HKD), Kroatian kuna (HRK), Etelä-Korean won (KRW), Libanonin punta (LBP), Marokon dirham (MAD), Macaon pataca (MOP), Malesian ringgit (MYR), Perun uusi sol (PEN), Filippiinien peso (PHP), Thaimaan baht (THB), Taiwanin uusi dollari (TWD), Yhdysvaltain dollari (USD).

Osa 22 – Luettelo Thaimaan bahtin (THB) kanssa läheisesti korreloivista valuutoista

Arabiemiirikuntien dirhami (AED), Angolan kwanza (AOA), Kiinan juan renminbi (CNY), Hongkongin dollari (HKD), Libanonin punta (LBP), Marokon dirham (MAD), Macaon pataca (MOP), Perun uusi sol (PEN), Filippiinien peso (PHP), Singaporen dollari (SGD), Taiwanin uusi dollari (TWD), Yhdysvaltain dollari (USD).

Osa 23 – Luettelo Taiwanin uuden dollarin (TWD) kanssa läheisesti korreloivista valuutoista

Arabiemiirikuntien dirhami (AED), Angolan kwanza (AOA), Kanadan dollari (CAD), Kiinan juan renminbi (CNY), Englannin punta (GBP), Hongkongin dollari (HKD), Etelä-Korean won (KRW), Libanonin punta (LBP), Marokon dirham (MAD), Macaon pataca (MOP), Malesian ringgit (MYR), Perun uusi sol (PEN), Filippiinien peso (PHP), Singaporen dollari (SGD), Thaimaan baht (THB), Yhdysvaltain dollari (USD).

Osa 24 – Luettelo Yhdysvaltain dollarin (USD) kanssa läheisesti korreloivista valuutoista

Arabiemiirikuntien dirhami (AED), Angolan kwanza (AOA), Kanadan dollari (CAD), Kiinan juan renminbi (CNY), Englannin punta (GBP), Hongkongin dollari (HKD), Libanonin punta (LBP), Macaon pataca (MOP), Perun uusi sol (PEN), Filippiinien peso (PHP), Singaporen dollari (SGD), Thaimaan baht (THB), Taiwanin uusi dollari (TWD).
