

## II

(Nelegislatīvi akti)

## REGULAS

## KOMISIJAS DELEĢĒTĀ REGULA (ES) 2015/585

(2014. gada 18. decembris),

ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 575/2013 attiecībā uz regulatīviem tehniskajiem standartiem par maržinālo riska periodu noteikšanu

(Dokuments attiecas uz EEZ)

EIROPAS KOMISIJA,

ņemot vērā Līgumu par Eiropas Savienības darbību,

ņemot vērā Eiropas Parlamenta un Padomes 2013. gada 26. jūnija Regulu (ES) Nr. 575/2013 par prudenciālajām prasībām attiecībā uz kredītiestādēm un ieguldījumu brokeru sabiedrībām, un ar ko groza Regulu (ES) Nr. 648/2012 <sup>(1)</sup>, un jo īpaši ņemot vērā tās 304. panta 5. punkta ceturto daļu,

tā kā:

- (1) Maržinālo riska periodu (MRP) aprēķināšanas regulējumam, ko izmanto, lai aprēķinātu tīrvērtes dalībnieku pašu kapitāla prasības attiecībā uz riska darījumiem ar to klientiem, vajadzētu būt piemērotam gan attiecībā uz iestādēm, kas izmanto iekšējā modeļa metodi (IMM), gan attiecībā uz iestādēm, kuras izmanto standartizētas metodes. Tam būtu arī jāatspoguļo izmaiņas tirgus apstākļos, lai veidotu prudenciāli atbilstīgu pieeju, kas tajā pašā laikā minēto iestāžu darbībai neradītu pārmērīgu slogu.
- (2) Lai gan likvidācijas periodu definīcija, ko izmanto centrālie darījumu partneri (CCP), nav identiska MRP definīcijai, kuru izmanto tīrvērtes dalībnieki, lai aprēķinātu savas pašu kapitāla prasības attiecībā uz riska darījumiem ar to klientiem, minētās definīcijas tomēr ir ļoti līdzīgas pēc būtības. Likvidācijas periodi patiešām atspoguļo izmaiņas tirgus apstākļos un ņem vērā līgumu un darījumu noslēguma periodus. Tāpēc centrālo darījumu partneru aplēses par likvidācijas periodiem būtu jāizmanto kā MRP aplēstās vērtības, lai aprēķinātu tīrvērtes dalībnieku pašu kapitāla prasības attiecībā uz riska darījumiem ar to klientiem.
- (3) Likvidācijas periodu izmantošana arī nodrošinātu visaptverošu segumu visiem Regulas (ES) Nr. 575/2013 301. panta 1. punktā noteiktajiem produktu un darījumu veidiem, kam tīrvērtē veikta, izmantojot centrālos darījumu partnerus, turklāt likvidācijas periodu papildu priekšrocība būtu tāda, ka šo deleģēto regulu nebūtu nepieciešams atjaunināt katru reizi, kad centrālais darījumu partneris uzsāk jauna veida produkta vai darījuma tīrvērti.
- (4) Atšķirībā no MRP likvidācijas periodiem, par ko centrālie darījumu partneri atklājuši informāciju, dažkārt ietver papildu periodus, lai tīrvērtes dalībniekam, kas nav saistību nepildītājs, ļautu veikt pozīciju pārjaunošanu. Tā kā minētie papildu periodi ir raksturīgi likvidācijas periodiem un neatspoguļo nekādu atšķirību starp riskiem, kam pakļauti tīrvērtes dalībnieki, tos nav vajadzības pievienot MRP, ko iestādes, kad tās rīkojas kā tīrvērtes dalībnieki, var izmantot, lai aprēķinātu pašu kapitāla prasības attiecībā uz saviem riska darījumiem ar klientu.

<sup>(1)</sup> OVL 176, 27.6.2013., 1. lpp.

- (5) Lai nodrošinātu, ka šādām aplēsēm tiek piemērots uzraudzības iestāžu apstiprinājums, aprēķinot tīrvērtes dalībnieku pašu kapitāla prasības attiecībā uz riska darījumiem ar to klientiem, kā MRP aplēses vērtības būtu jāļauj izmantot tikai tos likvidācijas periodus, ko aplēsuši atbilstīgi centrālie darījumu partneri, kā definēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 4. panta 1. punkta 88. apakšpunktā.
- (6) Tā kā MRP mērķis ir atspoguļot darījumu savstarpējo prasījumu ieskaita kopas tirgus vērtības izmaiņas laikposmā no pēdējās apmaiņas ar nodrošinājumu, kas sedz minēto savstarpējo prasījumu ieskaita kopu ar saistības nepildošu darījuma partneri, līdz darījuma noslēguma un atlikušā tirgus riska atkārtotas ierobežošanas brīdim, un tā kā tirgi noteiktās kalendāra dienās var būt slēgti, MRP būtu jāizsaka darba dienu izteiksmē. Tādējādi tiks nodrošināts, ka minēto darījumu pašu kapitāla prasības pilnībā atspoguļo riskus, kuriem iestāde ir pakļauta MRP laikā. Tāpēc ir lietderīgi noteikt, ka minimālais MRP, ko izmanto Regulas (ES) Nr. 575/2013 304. panta 3. punkta vajadzībām, ir vienāds ar piecām darba dienām, proti, ilgāks par minētajā pantā noteikto piecu dienu minimumu. Tādējādi arī minimālais MRP tiktu saskaņots ar noteikumiem, kas izklāstīti Regulas (ES) Nr. 575/2013 Trešās daļas II sadaļas 6. nodaļas 6. iedaļā un attiecas uz IMM izmantošanas prasībām.
- (7) Saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 304. panta 3. un 4. punktu īsākie MRP, ko iestādes var piemērot, aprēķinot pašu kapitāla prasības attiecībā uz saviem riska darījumiem ar klientu, ir piemērojami tikai tad, ja iestādes darbojas kā tīrvērtes dalībnieki. Tādēļ noteikumus par MRP, ko iestādes var izmantot saskaņā ar minētajiem nosacījumiem, nepiemēro, ja iestādes aprēķina pašu kapitāla prasības attiecībā uz riska darījumiem ar klientu, bet nedarbojas kā minētā riska darījuma tīrvērtes dalībnieki. Iepriekšminētais nosacījums nav atkarīgs no tā, vai šīs iestādes piemēro IMM un vai attiecīgajiem riska darījumiem ar klientiem tiek veikta centralizēta tīrvērte.
- (8) Šīs regulas pamatā ir regulatīvo tehnisko standartu projekts, ko Eiropas Banku iestāde iesniegusi Komisijai.
- (9) Eiropas Banku iestāde ir veikusi atklātu sabiedrisko apspriešanu par regulatīvo tehnisko standartu projektu, kas ir šīs regulas pamatā, izvērtējusi potenciālās saistītās izmaksas un ieguvumus un pieprasījusi Banku nozares ieinteresēto personu grupas, kas izveidota saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 1093/2010 37. pantu <sup>(1)</sup>, atzinumu,

IR PIENĒMUSI ŠO REGULU.

### 1. pants

1. Savstarpējo prasījumu ieskaita kopas, ko iestādes var izmantot Regulas (ES) Nr. 575/2013 304. panta 3. un 4. punkta vajadzībām, maržinālos riska periodus (MRP) nosaka saskaņā ar šā panta 2. un 3. punktu.

2. Ja attiecīgajā savstarpējo prasījumu ieskaita kopā ietverti darījumi, kam tīrvērte veikta, izmantojot atbilstīgu centrālo darījumu partneri, kā definēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 4. panta 1. punkta 88. apakšpunktā, iestādes var izmantot MRP, kuri ir ilgāki par:

a) piecām darba dienām;

b) savstarpējo prasījumu ieskaita kopā iekļauto līgumu vai darījumu ilgāko likvidācijas periodu, par ko atbilstīgais centrālais darījumu partneris, kurš veic minēto līgumu vai darījumu tīrvērti, atklājis informāciju saskaņā ar Komisijas Deleģētās regulas (ES) Nr. 153/2013 10. panta 1. punkta b) apakšpunkta vi) punktu <sup>(2)</sup>.

Šā panta 2. punkta b) apakšpunkta vajadzībām gadījumā, ja likvidācijas periods, par kuru atklāta informācija, ietver papildu periodu tīrvērtes dalībnieka, kas nav saistību nepildītājs, pozīciju pārjaunošanai, iestādes kā MRP izmanto periodu, kurš neietver minēto papildu periodu.

3. Ja attiecīgajā savstarpējo prasījumu ieskaita kopā ietverti darījumi, kam tīrvērti neveic, izmantojot atbilstīgu centrālo darījumu partneri, kā definēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 4. panta 1. punkta 88. apakšpunktā, iestādes var izmantot vismaz desmit darba dienas ilgu MRP.

<sup>(1)</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.).

<sup>(2)</sup> Komisijas 2012. gada 19. decembra Deleģētā regula (ES) Nr. 153/2013, ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 648/2012 attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par prasībām centrālajiem darījumu partneriem (OV L 52, 23.2.2013., 41. lpp.).

---

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, 2014. gada 18. decembrī

*Komisijas vārdā –*  
*priekšsēdētājs*  
Jean-Claude JUNCKER

---