

KOMISIJAS ĪSTENOŠANAS REGULA (ES) 2015/2197**(2015. gada 27. novembris),****ar ko nosaka īstenošanas tehniskos standartus attiecībā uz cieši korelētām valūtām saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 575/2013****(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 prudenčuālajām prasībām attiecībā uz kredītiestādēm un ieguldījumu brokeru sabiedrībām, un ar ko groza Regulu (ES) Nr. 648/2012 ⁽¹⁾, un jo īpaši tās 354. panta 3. punktu,

tā kā:

- (1) Saskaņā ar standartizēto pieeju attiecībā uz tirgus risku iestādēm var būt zemākas pašu kapitāla prasības attiecībā uz ārvalstu valūtas risku pret sakrītošām pozīcijām divās valūtās, ja tās tiek uzskatītas par "cieši korelētām" saskaņā ar metodiku, kas noteikta Regulas (ES) Nr. 575/2013 354. panta 1. punktā.
- (2) Iekļaujot sarakstā cieši korelētas valūtas, būtu jāpiemēro standarta tirgus prakse – 10 dienu maksimālo zaudējumu pārrēķināt vienas dienas maksimālajā zaudējumā, dalot maksimālo valūtas svārstību 4 % ar kvadrātsakni no 10. Tāpēc valūtu pāra vērtības maksimālās ikdienas pārmaiņas robežvērtība būtu jānosaka 1,265 %.
- (3) Valūtas ikdienas svārstības procentos būtu jānosaka kā starpība starp valūtu pāra vērtības Nepera logaritmiem, kas novērojama divas dienas pēc kārtas.
- (4) Rezultātā iegūtās procentuālās attiecības absolūtā vērtība būtu jāsalīdzina ar valūtu pāra vērtības maksimālās ikdienas pārmaiņas robežvērtību 1,265 %. Visas vērtības, kas pārsniedz šo robežvērtību, būtu jāuzskata par 4 % (10 dienu maksimālā zaudējuma) neievērošanu.
- (5) Ir jānosaka maksimālais pieņemamo zaudējumu skaits, lai valūtu pāri, kas pārsniedz šādu ierobežojumu, netiktu uzskatīti par korelētiem saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 354. pantu. Turklāt, aprēķinot maksimālo pieņemamo zaudējumu skaitu, būtu jāņem vērā gan ārvalstu valūtas garās, gan īsās pozīcijas. Atļauto pārkāpumu skaits būtu jānoapaļo, un attiecīgi maksimālais pārkāpumu skaits būtu jānosaka līdz septiņiem maksimālā zaudējuma pārkāpumiem iepriekšējo trīs gadu laikā un līdz 65 maksimālā zaudējuma pārkāpumiem iepriekšējo piecu gadu laikā.
- (6) Saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 354. panta 1. punktu zemākas pašu kapitāla prasības ir paredzētas tikai attiecībā uz "attiecgajām pozīcijām cieši korelētas valūtās". Tādējādi tikai tie valūtu maiņas kursa pāri, kurus veido, apvienojot katru no dažādajām dalībvalstu valūtām ar trešo valstu tādu valūtu sarakstu, kas ir nozīmīgas ES finanšu iestādēm, būtu jānovērtē, ņemot vērā kritērijus, pēc kuriem nosaka cieši korelētas valūtās.
- (7) Daži citi valūtu maiņas kursa pāri, kas ietver tikai trešo valstu valūtas, arī būtu jāiekļauj novērtējumā, ņemot vērā to nozīmi iestāžu portfeļos Eiropas Savienībā. Turklāt, apsverot valūtas, kuras jāiekļauj novērtējumā, saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 354. panta 1. punktā noteiktajām prasībām par attiecīgajiem novērošanas periodiem būtu jāņem vērā tikai tās valūtas, par kurām ir pieejamas ikdienas datu rindas par pieciem gadiem, kas iegūtas no uzticama avota.
- (8) Regulas (ES) Nr. 575/2013 354. panta 4. punktā ir noteikta īpaša procedūra attiecībā uz valūtu pāriem, ko veido to dalībvalstu valūtas, kuras piedalās ekonomiskās un monetārās savienības ("EMS II") otrajā posmā, attiecībā pret euro un savā starpā. Tādēļ valūtu pāri, kas ietver minētās valūtas, nebūtu jāuzskata par "nozīmīgiem". Tomēr valūtu pārus, ko veido EMS II valūta, no vienas puses, un valūta, kas nav euro vai cita EMS II valūta, no otras puses, būtu jāuzskata par "nozīmīgiem".

⁽¹⁾ OVL 176, 27.6.2013., 1. lpp.

- (9) Tāpēc būtu jānovērtē katra tāda valūtu pāra korelācija, kuru veido, apvienojot šīs regulas pielikumā minētās valūtas.
- (10) Lai nodrošinātu noteiktību par cieši korelēto valūtu saraksta izmantošanu, minētais saraksts būtu pastāvīgi jāpārskata saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 1093/2010⁽¹⁾ 29. panta 1. punkta d) apakšpunktu. Tā paša iemesla dēļ šāda pārskatīšana būtu jāveic regulāri un tajā pašā vai aptuveni tajā(-os) pašā(-os) datumā(-os) katru gadu, ja vien tirgus notikumu dēļ šāda pārskatīšana nav izņēmuma kārtā jāveic dažādos laikos.
- (11) Šīs regulas pamatā ir īstenošanas tehnisko standartu projekts, ko Eiropas Komisijai iesniegusi Eiropas Banku iestāde.
- (12) Eiropas Banku iestāde ir organizējusi atklātu sabiedrisko apspriešanu par īstenošanas tehnisko standartu projektu, kas ir šīs regulas pamatā, izvērtējusi potenciālās saistītās izmaksas un ieguvumus un pieprasījusi saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 1093/2010 37. pantu izveidotās Banku nozares ieinteresēto personu grupas atzinumu,

IR PIENĒMUSI ŠO REGULU.

1. pants

To valūtu pāri, kuri atbilst Regulas (ES) Nr. 575/2013 354. panta 1. punktā noteiktajām prasībām, ir iekļauti šīs regulas pielikumā.

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, 2015. gada 27. novembrī

*Komisijas vārdā –
priekšsēdētājs
Jean-Claude JUNCKER*

⁽¹⁾ Eiropas Parlamenta un Padomes 2010. gada 24. novembra Regula (ES) Nr. 1093/2010, 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.).

PIELIKUMS

Cieši korelēto valūtu saraksts*1. daļa – attiecībā pret euro (EUR) cieši korelēto valūtu saraksts*

Albānijas leks (ALL), Bosnijas un Hercegovinas marka (BAM), Bulgārijas leva (BGN), Čehijas krona (CZK), Lielbritānijas sterliņu mārciņa (GBP), Horvātijas kuna (HRK), Marokas dirhēms (MAD), Rumānijas leja (RON).

2. daļa – attiecībā pret Apvienoto Arābu Emirātu dirhēmu (AED) cieši korelēto valūtu saraksts

Angolas kvanza (AOA), Kanādas dolārs (CAD), Ķīnas juaņa renminbi (CNY), Lielbritānijas sterliņu mārciņa (GBP), Honkongas dolārs (HKD), Libānas mārciņa (LBP), Makao pataka (MOP), Peru jaunais sols (PEN), Filipīnu peso (PHP), Singapūras dolārs (SGD), Taizemes bāts (THB), Taivānas dolārs (TWD), ASV dolārs (USD).

3. daļa – attiecībā pret Albānijas leku (ALL) cieši korelēto valūtu saraksts

Bosnijas un Hercegovinas marka (BAM), Bulgārijas leva (BGN), Čehijas krona (CZK), Dānijas krona (DKK), Horvātijas kuna (HRK), Marokas dirhēms (MAD), Rumānijas leja (RON), euro (EUR).

4. daļa – attiecībā pret Angolas kvanzu (AOA) cieši korelēto valūtu saraksts

Apvienoto Arābu Emirātu dirhēms (AED), Ķīnas juaņa renminbi (CNY), Honkongas dolārs (HKD), Libānas mārciņa (LBP), Makao pataka (MOP), Peru jaunais sols (PEN), Filipīnu peso (PHP), Singapūras dolārs (SGD), Taizemes bāts (THB), Taivānas dolārs (TWD), ASV dolārs (USD).

5. daļa – attiecībā pret Bosnijas un Hercegovinas marku (BAM) cieši korelēto valūtu saraksts

Albānijas leks (ALL), Bulgārijas leva (BGN), Čehijas krona (CZK), Dānijas krona (DKK), Lielbritānijas sterliņu mārciņa (GBP), Horvātijas kuna (HRK), Marokas dirhēms (MAD), Rumānijas leja (RON), euro (EUR).

6. daļa – attiecībā pret Bulgārijas levu (BGN) cieši korelēto valūtu saraksts

Albānijas leks (ALL), Bosnijas un Hercegovinas marka (BAM), Čehijas krona (CZK), Dānijas krona (DKK), Lielbritānijas sterliņu mārciņa (GBP), Horvātijas kuna (HRK), Marokas dirhēms (MAD), Rumānijas leja (RON), euro (EUR).

7. daļa – attiecībā pret Kanādas dolāru (CAD) cieši korelēto valūtu saraksts

Apvienoto Arābu Emirātu dirhēms (AED), Honkongas dolārs (HKD), Makao pataka (MOP), Singapūras dolārs (SGD), Taivānas dolārs (TWD), ASV dolārs (USD).

8. daļa – attiecībā pret Ķīnas juaņu renminbi (CNY) cieši korelēto valūtu saraksts

Apvienoto Arābu Emirātu dirhēms (AED), Angolas kvanza (AOA), Lielbritānijas sterliņu mārciņa (GBP), Honkongas dolārs (HKD), Libānas mārciņa (LBP), Makao pataka (MOP), Peru jaunais sols (PEN), Filipīnu peso (PHP), Singapūras dolārs (SGD), Taizemes bāts (THB), Taivānas dolārs (TWD), ASV dolārs (USD).

9. daļa – attiecībā pret Čehijas kronu (CZK) cieši korelēto valūtu saraksts

Albānijas leks (ALL), Bosnijas un Hercegovinas marka (BAM), Bulgārijas leva (BGN), Dānijas krona (DKK), Horvātijas kuna (HRK), Marokas dirhēms (MAD), Rumānijas leja (RON), euro (EUR).

10. daļa – attiecībā pret Dānijas kronu (DKK) cieši korelēto valūtu saraksts

Albānijas leks (ALL), Bosnijas un Hercegovinas marka (BAM), Bulgārijas leva (BGN), Čehijas krona (CZK), Lielbritānijas sterliņu mārciņa (GBP), Horvātijas kuna (HRK), Marokas dirhēms (MAD), Rumānijas leja (RON), Singapūras dolārs (SGD).

11. daļa – attiecībā pret Lielbritānijas sterliņu mārciņu (GBP) cieši korelēto valūtu saraksts

Apvienoto Arābu Emirātu dirhēms (AED), Bosnijas un Hercegovinas marka (BAM), Bulgārijas leva (BGN), Ķīnas juaņa renminbi (CNY), Dānijas krona (DKK), Honkongas dolārs (HKD), Horvātijas kuna (HRK), Libānas mārciņa (LBP), Marokas dirhēms (MAD), Makao pataka (MOP), Singapūras dolārs (SGD), Taivānas dolārs (TWD), ASV dolārs (USD), euro (EUR).

12. daļa – attiecībā pret Honkongas dolāru (HKD) cieši korelēto valūtu saraksts

Apvienoto Arābu Emirātu dirhēms (AED), Angolas kvanza (AOA), Kanādas dolārs (CAD), Ķīnas juaņa renminbi (CNY), Lielbritānijas sterliņu mārciņa (GBP), Libānas mārciņa (LBP), Makao pataka (MOP), Peru jaunais sols (PEN), Filipīnu peso (PHP), Singapūras dolārs (SGD), Taizemes bāts (THB), Taivānas dolārs (TWD), ASV dolārs (USD).

13. daļa – attiecībā pret Horvātijas kunu (HRK) cieši korelēto valūtu saraksts

Albānijas leks (ALL), Bosnijas un Hercegovinas marka (BAM), Bulgārijas leva (BGN), Čehijas krona (CZK), Dānijas krona (DKK), Lielbritānijas sterliņu mārciņa (GBP), Marokas dirhēms (MAD), Rumānijas leja (RON), Singapūras dolārs (SGD), euro (EUR).

14. daļa – attiecībā pret Dienvidkorejas vonu (KRW) cieši korelēto valūtu saraksts

Peru jaunais sols (PEN), Filipīnu peso (PHP), Singapūras dolārs (SGD), Taivānas dolārs (TWD).

15. daļa – attiecībā pret Libānas mārciņu (LBP) cieši korelēto valūtu saraksts

Apvienoto Arābu Emirātu dirhēms (AED), Angolas kvanza (AOA), Ķīnas juaņa renminbi (CNY), Lielbritānijas sterliņu mārciņa (GBP), Honkongas dolārs (HKD), Makao pataka (MOP), Peru jaunais sols (PEN), Filipīnu peso (PHP), Singapūras dolārs (SGD), Taizemes bāts (THB), Taivānas dolārs (TWD), ASV dolārs (USD).

16. daļa – attiecībā pret Marokas dirhēmu (MAD) cieši korelēto valūtu saraksts

Albānijas leks (ALL), Bosnijas un Hercegovinas marka (BAM), Bulgārijas leva (BGN), Čehijas krona (CZK), Dānijas krona (DKK), Lielbritānijas sterliņu mārciņa (GBP), Horvātijas kuna (HRK), Rumānijas leja (RON), Singapūras dolārs (SGD), Taizemes bāts (THB), Taivānas dolārs (TWD), euro (EUR).

17. daļa – attiecībā pret Makao pataku (MOP) cieši korelēto valūtu saraksts

Apvienoto Arābu Emirātu dirhēms (AED), Angolas kvanza (AOA), Kanādas dolārs (CAD), Ķīnas juaņa renminbi (CNY), Lielbritānijas sterliņu mārciņa (GBP), Honkongas dolārs (HKD), Libānas mārciņa (LBP), Peru jaunais sols (PEN), Filipīnu peso (PHP), Singapūras dolārs (SGD), Taizemes bāts (THB), Taivānas dolārs (TWD), ASV dolārs (USD).

18. daļa – attiecībā pret Peru jauno solu (PEN) cieši korelēto valūtu saraksts

Apvienoto Arābu Emirātu dirhēms (AED), Angolas kvanza (AOA), Ķīnas juaņa renminbi (CNY), Honkongas dolārs (HKD), Dienvidkorejas vona (KRW), Libānas mārciņa (LBP), Makao pataka (MOP), Filipīnu peso (PHP), Singapūras dolārs (SGD), Taizemes bāts (THB), Taivānas dolārs (TWD), ASV dolārs (USD).

19. daļa – attiecībā pret Filipīnu peso (PHP) cieši korelēto valūtu saraksts

Apvienoto Arābu Emirātu dirhēms (AED), Angolas kvanza (AOA), Ķīnas juaņa renminbi (CNY), Honkongas dolārs (HKD), Dienvidkorejas vona (KRW), Libānas mārciņa (LBP), Makao pataka (MOP), Malaizijas ringits (MYR), Peru jaunais sols (PEN), Singapūras dolārs (SGD), Taizemes bāts (THB), Taivānas dolārs (TWD), ASV dolārs (USD).

20. daļa – attiecībā pret Rumānijas leju (RON) cieši korelēto valūtu saraksts

Albānijas leks (ALL), Bosnijas un Hercegovinas marka (BAM), Bulgārijas leva (BGN), Čehijas krona (CZK), Dānijas krona (DKK), Horvātijas kuna (HRK), Marokas dirhēms (MAD), euro (EUR).

21. daļa – attiecībā pret Singapūras dolāru (SGD) cieši korelēto valūtu saraksts

Apvienoto Arābu Emirātu dirhēms (AED), Angolas kvanza (AOA), Kanādas dolārs (CAD), Ķīnas juaņa renminbi (CNY), Dānijas krona (DKK), Lielbritānijas sterliņu mārciņa (GBP), Honkongas dolārs (HKD), Horvātijas kuna (HRK), Dienvidkorejas vona (KRW), Libānas mārciņa (LBP), Marokas dirhēms (MAD), Makao pataka (MOP), Malaizijas ringits (MYR), Peru jaunais sols (PEN), Filipīnu peso (PHP), Taizemes bāts (THB), Taivānas dolārs (TWD), ASV dolārs (USD).

22. daļa – attiecībā pret Taizemes bātu (THB) cieši korelēto valūtu saraksts

Apvienoto Arābu Emirātu dirhēms (AED), Angolas kvanza (AOA), Ķīnas juaņa renminbi (CNY), Honkongas dolārs (HKD), Libānas mārciņa (LBP), Marokas dirhēms (MAD), Makao pataka (MOP), Peru jaunais sols (PEN), Filipīnu peso (PHP), Singapūras dolārs (SGD), Taivānas dolārs (TWD), ASV dolārs (USD).

23. daļa – attiecībā pret Taivānas dolāru (TWD) cieši korelēto valūtu saraksts

Apvienoto Arābu Emirātu dirhēms (AED), Angolas kvanza (AOA), Kanādas dolārs (CAD), Ķīnas juaņa renminbi (CNY), Lielbritānijas sterliņu mārciņa (GBP), Honkongas dolārs (HKD), Dienvidkorejas vona (KRW), Libānas mārciņa (LBP), Marokas dirhēms (MAD), Makao pataka (MOP), Malaizijas ringits (MYR), Peru jaunais sols (PEN), Filipīnu peso (PHP), Singapūras dolārs (SGD), Taizemes bāts (THB), ASV dolārs (USD).

24. daļa – attiecībā pret ASV dolāru (USD) cieši korelēto valūtu saraksts

Apvienoto Arābu Emirātu dirhēms (AED), Angolas kvanza (AOA), Kanādas dolārs (CAD), Ķīnas juaņa renminbi (CNY), Lielbritānijas sterliņu mārciņa (GBP), Honkongas dolārs (HKD), Libānas mārciņa (LBP), Makao pataka (MOP), Peru jaunais sols (PEN), Filipīnu peso (PHP), Singapūras dolārs (SGD), Taizemes bāts (THB), Taivānas dolārs (TWD).
