

KOMISIJAS DELEĢĒTĀ REGULA (ES) Nr. 530/2014**(2014. gada 12. marts),****ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvu 2013/36/ES papildina ar regulatīviem tehniskajiem standartiem, ar kuriem definē būtiskus riska darījumus un nosaka robežvērtības iekšējām pieejām tirdzniecības portfeļa specifiskajam riskam****(Dokuments attiecas uz EEZ)**

EIROPAS KOMISIJA,

ņemot vērā Līgumu par Eiropas Savienības darbību,

ņemot vērā Eiropas Parlamenta un Padomes 2013. gada 26. jūnija Direktīvu 2013/36/ES par piekļuvi kredītiestāžu darbībai un kredītiestāžu un ieguldījumu brokeru sabiedrību prudenciālo uzraudzību, ar ko groza Direktīvu 2002/87/EK un atceļ Direktīvas 2006/48/EK un 2006/49/EK ⁽¹⁾, un jo īpaši tās 77. panta 4. punkta trešo daļu,

tā kā:

- (1) Direktīvas 2013/36/ES 77. panta 3. punktā ir minēti vienīgi “parāda instrumenti”, tāpēc specifiskā riska būtiskuma novērtējumā nebūtu iekļaujami tirdzniecības portfeļa kapitāla vērtspapīru instrumenti.
- (2) Specifiskā riska darījumu būtiskums absolūtā izteiksmē būtu jāmēra, piemērojot standartizētos noteikumus, kuri attiecas uz parāda instrumentu neto pozīciju aprēķinu. Minētajā novērtējumā būtu jāņem vērā garās un īsās neto pozīcijas, kas aprēķinātas saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 575/2013 ⁽²⁾ 327. panta 1. punktu, pirms tam saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 346. un 347. pantu veicot atskaitījumus riska ierobežošanas pozīcijām, ko veido kredītu atvasinātie instrumenti.
- (3) Direktīvas 2013/36/ES 77. panta 3. punkta pirmajā daļā, kura attiecas uz tirdzniecības portfeļa specifisko risku, minēts “liels skaits būtisku pozīciju parāda instrumentos, kam ir dažādi emitenti”. Attiecīgi šajos noteikumos, ievērojot minētās direktīvas 77. panta 4. punktu, būtu jānosaka būtiskuma robežvērtība lielam skaitam būtisku pozīciju parāda instrumentos, kam ir dažādi emitenti.
- (4) Šīs regulas pamatā ir regulatīvo tehnisko standartu projekts, ko Eiropas Banku iestāde iesniegusi Komisijai.
- (5) Eiropas Banku iestāde ir veikusi atklātu sabiedrisko apspriešanu par regulatīvo tehnisko standartu projektu, kas ir šīs regulas pamatā, izanalizējusi potenciālās saistītās izmaksas un ieguvumus un pieprasījusi atzinumu no Banku nozares ieinteresēto personu grupas, kas izveidota saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 1093/2010 ⁽³⁾ 37. pantu,

IR PIENĒMUSI ŠO REGULU.

*1. pants***“Specifiskā riska darījumu, kas ir būtiski absolūtā izteiksmē” definīcija saskaņā ar Direktīvas 2013/36/ES 77. panta 4. punktu**

Uzskata, ka iestādes parāda instrumentu specifiskā riska darījumi ir absolūtā izteiksmē būtiski, ja summa, ko veido visas neto garās un neto īsās pozīcijas, kā definēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 327. pantā, pārsniedz EUR 1 000 000 000.

⁽¹⁾ OV L 176, 27.6.2013., 338. lpp.

⁽²⁾ Eiropas Parlamenta un Padomes 2013. gada 26. jūnija Regula (ES) Nr. 575/2013 par prudenciālajām prasībām attiecībā uz kredītiestādēm un ieguldījumu brokeru sabiedrībām, un ar ko groza Regulu (ES) Nr. 648/2012 (OV L 176, 27.6.2013., 1. lpp.).

⁽³⁾ 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.).

*2. pants***“Liela skaita būtisku pozīciju parāda instrumentos, kam ir dažādi emitenti” definīcija saskaņā ar Direktīvas 2013/36/ES 77. panta 4. punktu**

Uzskata, ka iestādes specifiskā riska portfelis ietver lielu skaitu būtisku pozīciju parāda instrumentos, kam ir dažādi emitenti, ja portfelī ir vairāk nekā 100 pozīcijas un katra no tām pārsniedz EUR 2 500 000, neatkarīgi no tā, vai tās ir neto garās vai neto īsās pozīcijas, kā definēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 327. pantā.

*3. pants***Stāšanās spēkā**

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 12. martā

Komisijas vārdā –
priekšsēdētājs
José Manuel BARROSO
