

KOMMISSIONENS GENOMFÖRANDEFÖRORDNING (EU) 2015/2197**av den 27 november 2015****om fastställande av tekniska genomförandestandarder med avseende på nära sammanhängande valutor i enlighet med Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 575/2013****(Text av betydelse för EES)**

EUROPEISKA KOMMISSIONEN HAR ANTAGIT DENNA FÖRORDNING

med beaktande av fördraget om Europeiska unionens funktionssätt,

med beaktande av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 575/2013 av den 26 juni 2013 om tillsynskrav för kreditinstitut och värdepappersföretag och om ändring av förordning (EU) nr 648/2012 ⁽¹⁾, särskilt artikel 354.3, och

av följande skäl:

- (1) Enligt schablonmetoden för marknadsrisk, får institut hålla lägre kapitalbaskrav för växelkursrisk för täckande av avstämde positioner i två valutor där dessa betraktas som "nära sammanhängande" i enlighet med den metod som fastställs i artikel 354.1 i förordning (EU) nr 575/2013.
- (2) När nära sammanhängande valutor listas, bör gängse marknadspraxis att trappa ned den maximala förlusten under 10 dagar till en maximal förlust för en dag, genom att dividera den maximala valutarörelsen på 4 % med kvadratroten på 10, tillämpas. Därför bör gränsen för den maximala dagliga värdeförändringen inom ett valutapar fastställas till 1,265 %.
- (3) Dagliga växelkursrörelser i procent bör bestämmas som skillnaden mellan NapLog av valutaparens värde som de observerats under två på varandra följande dagar.
- (4) Det absoluta värdet av den resulterande procentsatsen bör jämföras med tröskelvärdet för den maximala dagliga värdeförändringen inom ett valutapar på 1,265 %. Alla värden som överstiger denna tröskel bör betraktas som överträdelser av den maximala förlusten under 10 dagar på 4 %.
- (5) Det är nödvändigt att fastställa ett högsta antal acceptabla förluster, så att valutapar som överskrider en sådan gräns inte kommer att uppfylla kraven för att anses vara korrelerade i enlighet med artikel 354 i förordning (EU) nr 575/2013. Beräkningen av ett maximalt antal acceptabla förluster bör vidare beakta både långa och korta positioner i den utländska valutan. Antalet överträdelser bör avrundas nedåt och det maximala antalet överträdelser bör följaktligen fastställas till 7 överträdelser av den maximala förlusten under de senaste 3 åren och 65 överträdelser av den maximala förlusten under de senaste 5 åren.
- (6) Artikel 354.1 i förordning (EU) nr 575/2013 föreskriver endast lägre kapitalbaskrav för täckande av positioner i "relevanta nära sammanhängande valutor". Följaktligen bör endast de växelkurspar som bildats genom en kombination av var och en av de olika valutorna i medlemsstater med en förteckning över de valutor från tredjeländer som är relevanta för finansinstitut i unionen bedömas enligt kriterierna för fastställande av nära sammanhängande valutor.
- (7) Vissa andra växelkurspar som inkluderar enbart valutor från tredjeländer bör också ingå i bedömningen, mot bakgrund av deras betydelse för instituts portföljer i unionen. Vidare, med tanke på kraven i artikel 354.1 i förordning (EU) nr 575/2013 avseende de relevanta observationsperioderna, bör endast valutor för vilka det finns dagliga växelkursdataserier för de senaste 5 åren från en tillförlitlig källa beaktas när man överväger vilka valutor som ska ingå i bedömningen.
- (8) I artikel 354.4 i förordning (EU) nr 575/2013 fastställs en specifik behandling för valutapar bestående av valutor från medlemsstater som deltar i den andra etappen av den ekonomiska och monetära unionen (nedan kallad ERM II) mot euron och sinsemellan. Valutapar som inbegriper de valutorna bör därför inte anses vara "relevanta". Valutapar som består av en ERM II-valuta å ena sidan och en annan valuta än euron eller en annan ERM II-valuta å andra sidan bör dock anses vara "relevanta".

⁽¹⁾ EUTL 176, 27.6.2013, s. 1.

- (9) Därför bör sambandet mellan vart och ett av de valutapar som består av kombinationen av de valutor som anges i bilagan till denna förordning bedömas.
- (10) För att skapa säkerhet om användningen av förteckningen över nära sammanhängande valutor bör förteckningen ses över i enlighet med led d i artikel 29.1 i Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 1093/2010⁽¹⁾. Av samma skäl bör en sådan översyn göras regelbundet och årligen på eller kring samma datum, såvida inte marknadsutvecklingen gör att en sådan översyn i undantagsfall genomförs vid andra tidpunkter.
- (11) Denna förordning baseras på det förslag till tekniska genomförandestandarder som Europeiska bankmyndigheten har överlämnat till kommissionen.
- (12) Europeiska bankmyndigheten har anordnat öppna offentliga samråd om de förslag till tekniska standarder för genomförande som den här förordningen baseras på, analyserat de möjliga kostnaderna och fördelarna samt begärt ett yttrande från den bankintressentgrupp som inrättats i enlighet med artikel 37 i förordning (EU) nr 1093/2010.

HÄRIGENOM FÖRESKRIVS FÖLJANDE.

Artikel 1

De valutapar som uppfyller kraven i artikel 354.1 i förordning (EU) nr 575/2013 anges i bilagan till den här förordningen.

Artikel 2

Denna förordning träder i kraft den tjugonde dagen efter det att den har offentliggjorts i *Europeiska unionens officiella tidning*.

Denna förordning är till alla delar bindande och direkt tillämplig i alla medlemsstater.

Utfärdad i Bryssel den 27 november 2015.

På kommissionens vägnar
Jean-Claude JUNCKER
Ordförande

⁽¹⁾ Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 1093/2010 av den 24 november 2010 om inrättande av en europeisk tillsynsmyndighet (Europeiska bankmyndigheten), om ändring av beslut nr 716/2009/EG och om upphävande av kommissionens beslut 2009/78/EG (EUT L 331, 15.12.2010, s. 12).

BILAGA

Nära sammanhängande valutor*Del 1 – Förteckning över nära sammanhängande valutor mot euron (EUR)*

Albansk lek (ALL), Bosnien och Hercegovina marka (BAM), bulgarisk lev (BGN), tjeckisk koruna (CZK), brittiska pund (GBP), kroatisk kuna (HRK), marockansk dirham (MAD), rumänsk leu (RON).

Del 2 – Förteckning över nära sammanhängande valutor mot Förenade Arabemiratens dirham (AED)

Angolansk kwanza (AOA), kanadensisk dollar (CAD), kinesisk yuan (CNY), brittiska pund (GBP), Hongkong-dollar (HKD), libanesiska pund (LBP), Macaus pataca (MOP), peruansk nuevo sol (PEN), filippinsk peso (PHP), Singapore-dollar (SGD), thailändska baht (THB), Taiwan-dollar (TWD), US-dollar (USD).

Del 3 – Förteckning över nära sammanhängande valutor mot den albanska leken (ALL)

Bosnien och Hercegovina marka (BAM), bulgarisk lev (BGN), tjeckisk koruna (CZK), dansk krona (DKK), kroatisk kuna (HRK), marockansk dirham (MAD), rumänsk leu (RON), euro (EUR).

Del 4 – Förteckning över nära sammanhängande valutor mot den angolanska kwanzan (AOA)

Förenade Arabemiratens dirham (AED), kinesisk yuan (CNY), Hongkong-dollar (HKD), libanesiska pund (LBP), Macaus pataca (MOP), peruansk nuevo sol (PEN), filippinsk peso (PHP), Singapore-dollar (SGD), thailändsk baht (THB), Taiwan-dollar (TWD), US-dollar (USD).

Del 5 – Förteckning över nära sammanhängande valutor mot Bosnien och Hercegovina markan (BAM)

Albansk lek (ALL), bulgarisk lev (BGN), tjeckisk koruna (CZK), dansk krona (DKK), brittiska pund (GBP), kroatisk kuna (HRK), marockansk dirham (MAD), rumänsk leu (RON), euro (EUR).

Del 6 – Förteckning över nära sammanhängande valutor mot den bulgariska leven (BGN)

Albansk lek (ALL), Bosnien och Hercegovina marka (BAM), tjeckisk koruna (CZK), dansk krona (DKK), brittiska pund (GBP), kroatisk kuna (HRK), marockansk dirham (MAD), rumänsk leu (RON), euro (EUR).

Del 7 – Förteckning över nära sammanhängande valutor mot den kanadensiska dollarn (CAD)

Förenade Arabemiratens dirham (AED), Hongkong-dollar (HKD), Macaus pataca (MOP), Singapore-dollar (SGD), Taiwan-dollar (TWD), US-dollar (USD).

Del 8 – Förteckning över nära sammanhängande valutor mot den kinesiska yuanen (CNY)

Förenade Arabemiratens dirham (AED), angolansk kwanza (AOA), brittiska pund (GBP), Hongkong-dollar (HKD), libanesiska pund (LBP), Macaus pataca (MOP), peruansk nuevo sol (PEN), filippinsk peso (PHP), Singapore-dollar (SGD), thailändsk baht (THB), Taiwan-dollar (TWD), US-dollar (USD).

Del 9 – Förteckning över nära sammanhängande valutor mot den tjeckiska korunan (CZK)

Albansk lek (ALL), Bosnien och Hercegovina marka (BAM), bulgarisk lev (BGN), dansk krona (DKK), kroatisk kuna (HRK), marockansk dirham (MAD), rumänsk leu (RON), euro (EUR).

Del 10 – Förteckning över nära sammanhängande valutor mot den danska kronan (DKK)

Albansk lek (ALL), Bosnien och Hercegovina marka (BAM), bulgarisk lev (BGN), tjeckisk koruna (CZK), brittiska pund (GBP), kroatisk kuna (HRK), marockansk dirham (MAD), rumänsk leu (RON), Singapore-dollar (SGD).

Del 11 – Förteckning över nära sammanhängande valutor mot det brittiska pundet (GBP)

Förenade Arabemiratens dirham (AED), Bosnien och Hercegovina marka (BAM), bulgarisk lev (BGN), kinesisk yuan (CNY), dansk krona (DKK), Hongkong-dollar (HKD), kroatisk kuna (HRK), libanesiska pund (LBP), marockanska dirham (MAD), Macaus pataca (MOP), Singapore-dollar (SGD), Taiwan-dollar (TWD), US-dollar (USD), euro (EUR).

Del 12 – Förteckning över nära sammanhängande valutor mot Hongkong-dollar (CAD)

Förenade Arabemiratens dirham (AED), angolansk kwanza (AOA), kanadensisk dollar (CAD), kinesisk yuan (CNY), brittiska pund (GBP), libanesiska pund (LBP), Macaus pataca (MOP), peruansk nuevo sol (PEN), filippinsk peso (PHP), Singapore-dollar (SGD), thailändsk baht (THB), Taiwan-dollar (TWD), US-dollar (USD).

Del 13 – Förteckning över nära sammanhängande valutor mot den kroatiska kunan (HRK)

Albansk lek (ALL), Bosnien och Hercegovina marka (BAM), bulgarisk lev (BGN), tjeckisk koruna (CZK), dansk krona (DKK), brittiska pund (GBP), marockansk dirham (MAD), rumänsk leu (RON), Singapore-dollar (SGD), euro (EUR).

Del 14 – Förteckning över nära sammanhängande valutor mot den sydkoreanska wonen (KRW)

Peruanska nuevo sol (PEN), filippinsk peso (PHP), Singapore-dollar (SGD), Taiwan-dollar (TWD).

Del 15 – Förteckning över nära sammanhängande valutor mot det libanesiska pundet (LBP)

Förenade Arabemiratens dirham (AED), angolansk kwanza (AOA), kinesisk yuan (CNY), brittiska pund (GBP), Hongkong-dollar (HKD), Macaus pataca (MOP), peruansk nuevo sol (PEN), filippinsk peso (PHP), Singapore-dollar (SGD), thailändsk baht (THB), Taiwan-dollar (TWD), US-dollar (USD).

Del 16 – Förteckning över nära sammanhängande valutor mot den marockanska dirhamen (MAD)

Albansk lek (ALL), Bosnien och Hercegovina marka (BAM), bulgarisk lev (BGN), tjeckisk koruna (CZK), dansk krona (DKK), brittiska pund (GBP), kroatisk kuna (HRK), rumänsk leu (RON), Singapore-dollar (SGD), thailändsk baht (THB), Taiwan-dollar (TWD), euro (EUR).

Del 17 – Förteckning över nära sammanhängande valutor mot Macaus pataca (MOP)

Förenade Arabemiratens dirham (AED), angolansk kwanza (AOA), kanadensiska dollar (CAD), kinesiska yuan (CNY), brittiska pund (GBP), Hongkong-dollar (HKD), libanesiska pund (LBP), peruansk nuevo sol (PEN), filippinsk peso (PHP), Singapore-dollar (SGD), thailändsk baht (THB), Taiwan-dollar (TWD), US-dollar (USD).

Del 18 – Förteckning över nära sammanhängande valutor mot peruvianska nuevo sol (PEN)

Förenade Arabemiratens dirham (AED), angolansk kwanza (AOA), kinesiska yuan (CNY), Hongkong-dollar (HKD), sydkoreanska won (KRW), libanesiska pund (LBP), Macaus pataca (MOP), filippinsk peso (PHP), Singapore-dollar (SGD), thailändsk baht (THB), Taiwan-dollar (TWD), US-dollar (USD).

Del 19 – Förteckning över nära sammanhängande valutor mot den filippinska peson (PHP)

Förenade Arabemiratens dirham (AED), angolansk kwanza (AOA), kinesiska yuan (CNY), Hongkong-dollar (HKD), sydkoreanska won (KRW), libanesiska pund (LBP), Macaus pataca (MOP), Malaysisk ringgit (MYR), peruviansk nuevo sol (PEN), Singapore-dollar (SGD), thailändsk baht (THB), Taiwan-dollar (TWD), US-dollar (USD).

Del 20 – Förteckning över nära sammanhängande valutor mot den rumänska leuen (RON)

Albansk lek (ALL), Bosnien och Hercegovina marka (BAM), bulgarisk lev (BGN), tjeckisk koruna (CZK), dansk krona (DKK), kroatisk kuna (HRK), marockansk dirham (MAD), euro (EUR).

Del 21 – Förteckning över nära sammanhängande valutor mot Singapore-dollar (SGD)

Förenade Arabemiratens dirham (AED), angolansk kwanza (AOA), kanadensisk dollar (CAD), kinesiska yuan (CNY), dansk krona (DKK), brittiska pund (GBP), Hongkong-dollar (HKD), kroatisk kuna (HRK), sydkoreanska won (KRW), libanesiska pund (LBP), marockanska dirham (MAD), Macaus pataca (MOP), malaysisk ringgit (MYR), peruviansk nuevo sol (PEN), filippinsk peso (PHP), thailändsk baht (THB), Taiwan-dollar (TWD), US-dollar (USD).

Del 22 – Förteckning över nära sammanhängande valutor mot den thailändska bahten (THB)

Förenade Arabemiratens dirham (AED), angolansk kwanza (AOA), kinesiska yuan (CNY), Hongkong-dollar (HKD), libanesiska pund (LBP), marockanska dirham (MAD), Macaus pataca (MOP), peruansk nuevo sol (PEN), filippinsk peso (PHP), Singapore-dollar (SGD), Taiwan-dollar (TWD), US-dollar (USD).

Del 23 – Förteckning över nära sammanhängande valutor mot Taiwan-dollar (TWD)

Förenade Arabemiratens dirham (AED), angolansk kwanza (AOA), kanadensisk dollar (CAD), kinesiska yuan (CNY), brittiska pund (GBP), Hongkong-dollar (HKD), sydkoreanska won (KRW), libanesiska pund (LBP), marockanska dirham (MAD), Macaus pataca (MOP), malaysisk ringgit (MYR), peruviansk nuevo sol (PEN), filippinsk peso (PHP), Singapore-dollar (SGD), thailändsk baht (THB), US-dollar (USD).

Del 24 – Förteckning över nära sammanhängande valutor mot US-dollar (USD)

Förenade Arabemiratens dirham (AED), angolansk kwanza (AOA), kanadensisk dollar (CAD), kinesiska yuan (CNY), brittiska pund (GBP), Hongkong-dollar (HKD), libanesiska pund (LBP), Macaus pataca (MOP), peruansk nuevo sol (PEN), filippinsk peso (PHP), Singapore-dollar (SGD), thailändsk baht (THB), Taiwan-dollar (TWD).
