LV

II PIELIKUMS

“II PIELIKUMS

**NORĀDES PĀRSKATU SNIEGŠANAI PAR PAŠU KAPITĀLU UN PAŠU KAPITĀLA PRASĪBĀM**

Satura rādītājs

I DAĻA. VISPĀRĪGI NORĀDĪJUMI

1. STRUKTŪRA UN KONVENCIJAS

1.1. STRUKTŪRA

1.2. PIEŅEMTĀ PRAKSE ATTIECĪBĀ UZ NUMERĀCIJU

1.3. PIEŅEMTĀ PRAKSE ATTIECĪBĀ UZ ZĪMĒM

II DAĻA. NORĀDES SAISTĪBĀ AR VEIDNI

1. PĀRSKATS PAR KAPITĀLA PIETIEKAMĪBU (CA)

1.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

1.2. C 01.00 – PAŠU KAPITĀLS (CA1)

1.2.1. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

1.3. C 02.00 – PAŠU KAPITĀLA PRASĪBAS (CA2)

1.3.1. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

1.4. C 03.00 — KAPITĀLA RĀDĪTĀJI UN KAPITĀLA LĪMEŅI (CA3)

1.4.1. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

1.5. C 04.00 — IZZIŅAS POSTEŅI (CA4)

1.5.1. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

1.6. PĀREJAS NOTEIKUMI UN INSTRUMENTI, ATTIECĪBĀ UZ KURIEM PIEMĒROTAS TIESĪBAS SAGLABĀT IEPRIEKŠ SPĒKĀ ESOŠOS NOSACĪJUMUS: INSTRUMENTI, KAS NAV UZSKATĀMI PAR VALSTS ATBALSTU (CA 5)

1.6.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

1.6.2. C 05.01 – PĀREJAS NOTEIKUMI (CA5.1)

1.6.2.1. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

1.6.3. C 05.02 — INSTRUMENTI, ATTIECĪBĀ UZ KURIEM PIEMĒROTAS TIESĪBAS SAGLABĀT IEPRIEKŠ SPĒKĀ ESOŠOS NOSACĪJUMUS: INSTRUMENTI, KAS NAV UZSKATĀMI PAR VALSTS ATBALSTU (CA5.2.)

1.6.3.1. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

2. GRUPAS MAKSĀTSPĒJA: INFORMĀCIJA PAR SAISTĪTĀM SABIEDRĪBĀM (GS)

2.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

2.2. DETALIZĒTA INFORMĀCIJA PAR GRUPAS MAKSĀTSPĒJU

2.3. INFORMĀCIJA PAR INDIVIDUĀLU SABIEDRĪBU DEVUMU GRUPAS MAKSĀTSPĒJĀ

2.4. C 06.01 – GRUPAS MAKSĀTSPĒJA: INFORMĀCIJA PAR SAISTĪTĀM SABIEDRĪBĀM (GS KOPĀ)

2.5. C 06.02 – GRUPAS MAKSĀTSPĒJA: INFORMĀCIJA PAR SAISTĪTĀM SABIEDRĪBĀM (GS)

3. KREDĪTRISKA VEIDNES

3.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

3.1.1. PĀRSKATU SNIEGŠANA PAR KREDĪTRISKA MAZINĀŠANAS (KRM) METODĒM AR AIZSTĀŠANAS EFEKTU

3.1.2. PĀRSKATU SNIEGŠANA PAR DARĪJUMA PARTNERA KREDĪTRISKU

3.2. C 07.00 – KREDĪTRISKS UN DARĪJUMA PARTNERA KREDĪTRISKS, UN NEAPMAKSĀTAS PIEGĀDES: STANDARTIZĒTA PIEEJA KAPITĀLA PRASĪBĀM (CR SA)

3.2.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

3.2.2. CR SA VEIDNES TVĒRUMS

3.2.3. RISKA DARĪJUMU IEDALĪŠANA RISKA DARĪJUMU KATEGORIJĀS SASKAŅĀ AR STANDARTIZĒTO PIEEJU

3.2.4. SKAIDROJUMI PAR DAŽU TĀDU KONKRĒTU RISKA DARĪJUMU KATEGORIJU TVĒRUMU, KAS MINĒTAS REGULAS (ES) Nr. 575/2013 112. PANTĀ

3.2.4.1. RISKA DARĪJUMU KATEGORIJA “IESTĀDES”

3.2.4.2. RISKA DARĪJUMU KATEGORIJA “SEGTĀS OBLIGĀCIJAS”

3.2.4.3. RISKA DARĪJUMU KATEGORIJA “KOLEKTĪVO IEGULDĪJUMU UZŅĒMUMI”

3.2.5. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

3.3. KREDĪTRISKS UN DARĪJUMA PARTNERA KREDĪTRISKS, UN NEAPMAKSĀTAS PIEGĀDES: IRB PIEEJA PAŠU KAPITĀLA PRASĪBĀM (CR IRB)

3.3.1. CR IRB VEIDNES TVĒRUMS

3.3.2. CR IRB VEIDNES SADALĪJUMS

3.3.3.1. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

3.3.4. C 08.02 – KREDĪTRISKS UN DARĪJUMA PARTNERA KREDĪTRISKS, UN NEAPMAKSĀTAS PIEGĀDES: KREDĪTRISKS UN NEAPMAKSĀTAS PIEGĀDES: IRB PIEEJA KAPITĀLA PRASĪBĀM — IRB PIEEJA KAPITĀLA PRASĪBĀM – SADALĪJUMS PA PARĀDNIEKU KATEGORIJĀM VAI PORTFEĻIEM (CR IRB 2 VEIDNE)

3.3.1. C 08.03. KREDĪTRISKS UN NEAPMAKSĀTAS PIEGĀDES: IRB PIEEJA KAPITĀLA PRASĪBĀM (SADALĪJUMS PA PD DIAPAZONIEM (CR IRB 3))

3.3.1.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

3.3.1.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

3.3.2. C 08.04. KREDĪTRISKS UN NEAPMAKSĀTAS PIEGĀDES: IRB PIEEJA KAPITĀLA PRASĪBĀM (RWEA PLŪSMAS PĀRSKATI (CR IRB 4))

3.3.2.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

3.3.2.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

3.3.3. C 08.05. KREDĪTRISKS UN NEAPMAKSĀTAS PIEGĀDES: IRB PIEEJA KAPITĀLA PRASĪBĀM: PD ATPAKAĻEJOŠAS PĀRBAUDES (CR IRB 5)

3.3.3.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

3.3.3.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

3.3.4. C 08.05.1. KREDĪTRISKS UN NEAPMAKSĀTAS PIEGĀDES: IRB PIEEJA KAPITĀLA PRASĪBĀM — PD ATPAKAĻEJOŠAS PĀRBAUDES SASKAŅĀ AR REGULAS (ES) Nr. 575/2013 180. PANTA 1. PUNKTA F) APAKŠPUNKTU (CR IRB 5B).

3.3.4.1. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

3.3.5. C 08.06. KREDĪTRISKS UN NEAPMAKSĀTAS PIEGĀDES: IRB PIEEJA KAPITĀLA PRASĪBĀM (SPECIALIZĒTĀS KREDITĒŠANAS IEDALĪJUMA PIEEJA (CR IRB 6))

3.3.5.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

3.3.5.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

3.3.6. C 08.07. KREDĪTRISKS UN NEAPMAKSĀTAS PIEGĀDES: IRB PIEEJA KAPITĀLA PRASĪBĀM (IRB UN SP PIEEJU IZMANTOŠANAS TVĒRUMS (CR IRB 7))

3.3.6.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

3.3.6.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

3.4. KREDĪTRISKS UN DARĪJUMA PARTNERA KREDĪTRISKS, UN NEAPMAKSĀTAS PIEGĀDES: INFORMĀCIJA AR ĢEOGRĀFISKO SADALĪJUMU

3.4.1. C 09.01 – RISKA DARĪJUMU ĢEOGRĀFISKAIS SADALĪJUMS PĒC PARĀDNIEKA REZIDENCES VIETAS: SA RISKA DARĪJUMI (CR GB 1)

3.4.1.1. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

3.4.2. C 09.02. – RISKA DARĪJUMU ĢEOGRĀFISKAIS SADALĪJUMS PĒC PARĀDNIEKA REZIDENCES VIETAS: IRB RISKA DARĪJUMI (CR GB 2)

3.4.2.1. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

3.4.3. C 09.04. - TO KREDĪTRISKA DARĪJUMU SADALĪJUMS, KURI IR NOZĪMĪGI PRETCIKLISKO REZERVJU APRĒĶINĀŠANAI, PA VALSTĪM UN IESTĀDES SPECIFISKO PRETCIKLISKO REZERVJU (CCB) NORMĀM

3.4.3.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

3.4.3.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

3.5A. C 10.00. – KREDĪTRISKS UN DARĪJUMA PARTNERA KREDĪTRISKS, UN NEAPMAKSĀTAS PIEGĀDES: IRB RISKA DARĪJUMI, KURIEM PIEMĒRO PAŠU KAPITĀLA MINIMĀLO ROBEŽVĒRTĪBU

3.5A.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

3.5A.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

3.5. C 10.01 UN C 10.02 — KAPITĀLA VĒRTSPAPĪRU RISKA DARĪJUMI ATBILSTOŠI UZ IEKŠĒJIEM REITINGIEM BALSTĪTAJAI PIEEJAI (CR EQU IRB 1 UN CR EQU IRB 2)

3.5.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

3.5.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM (PIEMĒRO GAN CR EQU IRB 1, GAN CR EQU IRB 2)

3.6. C 11.00 — NORĒĶINU/PIEGĀDES RISKS (CR SETT)

3.6.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

3.6.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

3.7. C 13.01 KREDĪTRISKS — VĒRTSPAPĪROŠANA (CR SEC)

3.7.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

3.7.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

3.8. DETALIZĒTA INFORMĀCIJA PAR VĒRTSPAPĪROŠANU (SEC DETAILS)

3.8.1. SEC DETAILS VEIDNES TVĒRUMS

3.8.2. SEC DETAILS VEIDNES SADALĪJUMS

3.8.3. C 14.00. – DETALIZĒTA INFORMĀCIJA PAR VĒRTSPAPĪROŠANU (SEC DETAILS)

3.8.4. C 14.01. — DETALIZĒTA INFORMĀCIJA PAR VĒRTSPAPĪROŠANU (SEC DETAILS 2)

3.9. DARĪJUMA PARTNERA KREDĪTRISKS

3.9.1. DARĪJUMA PARTNERA KREDĪTRISKA VEIDŅU TVĒRUMS

3.9.2. C 34.01. – ATVASINĀTO INSTRUMENTU DARĪJUMU APMĒRS

3.9.2.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

3.9.2.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

3.9.3. C 34.02. - CCR RISKA DARĪJUMI DALĪJUMĀ PA PIEEJĀM

3.9.3.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

3.9.3.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

3.9.4. C 34.03 – CCR RISKA DARĪJUMI PĒC STANDARTIZĒTĀM PIEEJĀM: SA-CCR VAI VIENKĀRŠOTĀ SA-CCR

3.9.4.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

3.9.4.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

3.9.5. C 34.04. – CCR RISKA DARĪJUMI PĒC SĀKOTNĒJĀS DARĪJUMU VĒRTĪBAS METODES (OEM)

3.9.5.1. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

3.9.6. C 34.05. – CCR RISKA DARĪJUMI PĒC IEKŠĒJĀ MODEĻA METODES (IMM)

3.9.6.1. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

3.9.7. C 34.06. – DIVDESMIT LIELĀKIE DARĪJUMA PARTNERI

3.9.7.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

3.9.7.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

3.9.8. C 34.07 - IRB PIEEJA – CCR RISKA DARĪJUMI DALĪJUMĀ PA RISKA DARĪJUMU KATEGORIJĀM UN PD DIAPAZONIEM

3.9.8.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

3.9.8.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

3.9.9. C 34.08 - CCR RISKA DARĪJUMU NODROŠINĀJUMA SASTĀVS

3.9.9.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

3.9.9.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

3.9.10. C 34.09 - KREDĪTU ATVASINĀTIE INSTRUMENTI

3.9.10.1. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

3.9.11. C 34.10 - RISKA DARĪJUMI AR CCP

3.9.11.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

3.9.11.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

3.9.12. C 34.11 - RISKA DARĪJUMU RISKA SVĒRTO VĒRTĪBU (RWEA) PLŪSMU PĀRSKATS PAR CCR RISKA DARĪJUMIEM SASKAŅĀ AR IMM

3.9.12.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

3.9.12.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

4. OPERACIONĀLĀ RISKA VEIDNES

4.1. C 16.00. – OPERACIONĀLAIS RISKS (OPR)

4.1.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

4.1.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

4.2. OPERACIONĀLAIS RISKS: DETALIZĒTA INFORMĀCIJA PAR ZAUDĒJUMIEM PĒDĒJĀ GADĀ (OPR DETAILS)

4.2.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

4.2.2. C 17.01.: OPERACIONĀLAIS RISKS: PĒDĒJĀ GADA ZAUDĒJUMI UN ZAUDĒJUMU ATLĪDZINĀJUMI PĒC DARBĪBAS JOMĀM UN ZAUDĒJUMU NOTIKUMU VEIDIEM (OPR DETAILS 1)

4.2.2.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

4.2.2.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

4.2.3. C 17.02. OPERACIONĀLAIS RISKS: DETALIZĒTA INFORMĀCIJA PAR LIELĀKO ZAUDĒJUMU NOTIKUMIEM PĒDĒJĀ GADĀ (OPR DETAILS 2)

4.2.3.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

4.2.3.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

5. TIRGUS RISKA VEIDNES

5.1. C 18.00. – TIRGUS RISKS: STANDARTIZĒTĀ PIEEJA ATTIECĪBĀ UZ POZĪCIJAS RISKIEM TIRGOTAJOS PARĀDA INSTRUMENTOS (MKR SA TDI)

5.1.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

5.1.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

5.2. C 19.00. — TIRGUS RISKS: STANDARTIZĒTĀ PIEEJA ATTIECĪBĀ UZ VĒRTSPAPĪROŠANAS SPECIFISKO RISKU (MKR SA SEC)

5.2.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

5.2.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

5.3. C 20.00. — TIRGUS RISKS: STANDARTIZĒTĀ PIEEJA ATTIECĪBĀ UZ KORELĀCIJAS TIRDZNIECĪBAS PORTFEĻA POZĪCIJU SPECIFISKO RISKU (MKR SA CTP)

5.3.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

5.3.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

5.4. C 21.00. — TIRGUS RISKS: STANDARTIZĒTĀ PIEEJA ATTIECĪBĀ UZ KAPITĀLA VĒRTSPAPĪRU POZĪCIJAS RISKU (MKR SA EQU)

5.4.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

5.4.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

5.5. C 22.00. — TIRGUS RISKS: STANDARTIZĒTĀ PIEEJA ATTIECĪBĀ UZ ĀRVALSTU VALŪTAS RISKU (MKR SA FX)

5.5.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

5.5.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

5.6. C 23.00. — TIRGUS RISKS: STANDARTIZĒTĀS PIEEJAS ATTIECĪBĀ UZ PRECĒM (MKR SA COM)

5.6.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

5.6.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

5.7. C 24.00. — TIRGUS RISKA IEKŠĒJAIS MODELIS (MKR IM)

5.7.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

5.7.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

5.8. C 25.00. — KREDĪTA VĒRTĪBAS KOREKCIJAS RISKS (CVA)

5.8.1. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

6. PIESARDZĪGA VĒRTĒŠANA (PRUVAL)

6.1. C 32.01 – PIESARDZĪGA VĒRTĒŠANA: PĒC PATIESĀS VĒRTĪBAS VĒRTĒTI AKTĪVI UN SAISTĪBAS (PRUVAL 1)

6.1.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

6.1.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

6.2. C 32.02. – PIESARDZĪGA VĒRTĒŠANA: PAMATPIEEJA (PRUVAL 2)

6.2.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

6.2.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

6.3. C 32.03. – PIESARDZĪGA VĒRTĒŠANA: MODEĻA RISKA PVK (PRUVAL 3)

6.3.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

6.3.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

6.4. C 32.04. – PIESARDZĪGA VĒRTĒŠANA: KONCENTRĒTU POZĪCIJU PVK (PRUVAL 4)

6.4.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

6.4.2. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

7. C 33.00. – RISKA DARĪJUMI AR VISPĀRĒJĀM VALDĪBĀM (GOV)

7.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

7.2. RISKA DARĪJUMU AR “VISPĀRĒJĀM VALDĪBĀM” VEIDNES TVĒRUMS

7.3. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

8. IEŅĒMUMUS NENESOŠO RISKA DARĪJUMU RADĪTO ZAUDĒJUMU SEGUMS (NPE LC)

8.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

8.2. C 35.01. – ATSKAITĪJUMU APRĒĶINS IEŅĒMUMUS NENESOŠIEM RISKA DARĪJUMIEM (NPE LC1)

8.2.1. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

8.3. C 35.02. – NPE SEGUMA MINIMUMA PRASĪBAS UN VĒRTĪBAS, ATSKAITOT PĀRSKATĪTOS RISKA DARĪJUMUS, UZ KURIEM ATTIECAS REGULAS (ES) NR. 575/2013 47.C PANTA 6. PUNKTS (NPE LC2)

8.3.1. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

8.4. C 35.03. – PĀRSKATĪTO INRD, UZ KURIEM ATTIECAS Regulas (ES) NR. 575/2013 47.C PANTA 6. PUNKTS, SEGUMA MINIMUMA PRASĪBAS UN VĒRTĪBAS (NPE LC3)

8.4.1. NORĀDES ATTIECĪBĀ UZ KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

9. TIRDZNIECĪBAS PORTFEĻA UN TIRGUS RISKA ROBEŽVĒRTĪBAS, ROBEŽA STARP TIRDZNIECĪBAS PORTFELI UN NETIRDZNIECĪBAS PORTFELI UN PĀRKLASIFICĒŠANA

9.1. C 90.00. TIRDZNIECĪBAS PORTFEĻA UN TIRGUS RISKA ROBEŽVĒRTĪBAS (TBT)

9.2. ROBEŽA STARP TIRDZNIECĪBAS PORTFELI UN NETIRDZNIECĪBAS PORTFELI (BOU)

9.2.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

9.2.2. C 90.05. - ROBEŽA: TIRDZNIECĪBAS PORTFELIS (BOU1)

9.2.2.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

9.2.2.2. NORĀDES PAR KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

9.2.3. C 90.06. - ROBEŽA: NETIRDZNIECĪBAS PORTFELIS (BOU2)

9.2.3.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

9.2.3.2. NORĀDES PAR KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

9.3 C 24.01. - TIRDZNIECĪBAS PORTFEĻA ROBEŽA - PĀRKLASIFICĒŠANA STARP PORTFEĻIEM (MOV)

10. C 36.00. - RISKA DARĪJUMI AR KRIPTOAKTĪVIEM

10.1. VISPĀRĪGAS PIEZĪMES

10.2. – NORĀDES PAR KONKRĒTĀM POZĪCIJĀM

## I DAĻA. VISPĀRĪGI NORĀDĪJUMI

1. STRUKTŪRA UN KONVENCIJAS

1.1. STRUKTŪRA

1. Kopumā šis regulējums attiecas uz sešiem tematiem:

a) kapitāla pietiekamība, pārskats par regulējošām prasībām atbilstošu kapitālu, kopējā riska darījumu vērtība; piesardzīga vērtēšana; ieņēmumus nenesošo riska darījumu radīto zaudējumu segums;

b) grupas maksātspēja, pārskats par visu to individuālo sabiedrību maksātspējas prasību izpildi, kuras iekļautas pārskatu sniedzošās sabiedrības konsolidācijas tvērumā;

c) kredītrisks (tostarp darījuma partnera kredītrisks, atgūstamās vērtības samazinājuma risks un norēķinu risks);

d) tirgus risks (tostarp pozīcijas risks tirdzniecības portfelī, ārvalstu valūtas risks, preču risks un kredīta vērtības korekcijas (CVA) risks);

e) operacionālais risks;

f) vispārējo valdību riska darījumi;

g) riska darījumi ar kriptoaktīviem.

2. Attiecībā uz katru veidni ir sniegtas atsauces uz tiesību aktiem. Šajā šīs īstenošanas regulas daļā ir iekļauta detalizētāka informācija par vispārīgākiem pārskatu sniegšanas aspektiem attiecībā uz katru veidņu bloku, norādes par konkrētām pozīcijām, kā arī validācijas noteikumi.

3. Iestādēm atkarībā no pieejas, kas izmantota, lai noteiktu pašu kapitāla prasības, ir jāiesniedz tikai tās veidnes, kuras ir būtiskas.

1.2. Numerācijas konvencijas

4. Atsaucoties uz veidņu slejām, rindām un šūnām, dokumentā izmanto pieņemto praksi attiecībā uz apzīmējumiem, kas norādīta 5.–8. punktā. Minētos ciparu kodus plaši izmanto validācijas noteikumos.

5. Norādījumos izmantots šāds vispārējs apzīmējums: {Veidne; Rinda; Sleja}.

6. Ja validāciju veic veidnē, kurā izmantoti tikai minētās veidnes datu punkti, apzīmējumi neattiecas uz veidni: {Rinda; Sleja}.

7. Ja veidnēs ir tikai viena sleja, atsaucas vienīgi uz rindām: {Veidne; Rinda}

8. Zvaigznītes zīmi izmanto, lai norādītu, ka validāciju veic attiecībā uz iepriekš norādītām rindām vai slejām.

1.3. Pieņemtā prakse attiecībā uz zīmēm

9. Jebkuru summu, kas palielina pašu kapitālu vai kapitāla prasības, uzrāda kā pozitīvu skaitli. Turpretim summu, kas samazina kopējo pašu kapitālu vai kapitāla prasības, uzrāda kā negatīvu skaitli. Ja pirms kāda posteņa apzīmējuma ir mīnuszīme (–), šim postenim nav paredzamas pozitīvas vērtības.

10. [ieraksta nav].