

**KOMISIJOS ĮGYVENDINIMO REGLAMENTAS (ES) 2015/2197****2015 m. lapkričio 27 d.****kuriuo pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (ES) Nr. 575/2013 nustatomi techniniai įgyvendinimo standartai dėl artimai tarpusavyje susijusių valiutų****(Tekstas svarbus EEE)**

EUROPOS KOMISIJA,

atsižvelgdama į Sutartį dėl Europos Sąjungos veikimo,

atsižvelgdama į 2013 m. birželio 26 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (ES) Nr. 575/2013 dėl pradžios reikalavimų kredito įstaigoms ir investicinėms įmonėms ir kuriuo iš dalies keičiamas Reglamentas (ES) Nr. 648/2012 <sup>(1)</sup>, ypač į jo 354 straipsnio 3 dalį,

kadangi:

- (1) rinkos rizikai taikydamos standartizuotą metodą įstaigos gali numatyti mažesnę nuosavų lėšų reikalavimą dviejų valiutų suderintų pozicijų valiutų kurso rizikai padengti, kai pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 354 straipsnio 1 dalyje nustatytą metodiką tos valiutos laikomos artimai tarpusavyje susijusiomis;
- (2) rengiant artimai tarpusavyje susijusių valiutų sąrašą turėtų būti laikomasi įprastos rinkos praktikos sumažinti maksimalų 10 dienų nuostolį iki maksimalaus vienos dienos nuostolio padalijant maksimalų 4 % valiutos pokytį iš kvadratinės šaknies iš 10. Todėl nustatyta maksimalaus dienos vertės pokyčio valiutų poroje riba turėtų būti 1,265 %;
- (3) dienos valiutos svyravimai procentais turėtų būti nustatomi kaip valiutų porų vertės Neperio logaritmų skirtumas, stebimas dvi dienas iš eilės;
- (4) gauto procentinio dydžio absoliuti vertė turėtų būti lyginama su maksimalaus dienos vertės pokyčio valiutų poroje riba – 1,265 %. Visos vertės, viršijančios šią ribą, turėtų būti laikomos 4 % 10 dienų maksimalaus nuostolio ribos pažeidimu;
- (5) būtina nustatyti maksimalų priimtinių nuostolių skaičių, kad tokią ribą viršijančios valiutų poros nebūtų laikomos tarpusavyje susijusiomis pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 354 straipsnį. Be to, apskaičiuojant maksimalų priimtinių nuostolių skaičių reikėtų atsižvelgti ir į ilgąsias, ir į trumpąsias valiutos pozicijas. Leistinių pažeidimų skaičius turėtų būti suapvalintas iki mažesnio ir atitinkamai turėtų būti nustatytas toks maksimalus pažeidimų skaičius: septyni maksimalaus nuostolio pažeidimai per paskutinius trejus metus ir 65 maksimalaus nuostolio pažeidimai per paskutinius penkerius metus;
- (6) Reglamento (ES) Nr. 575/2013 354 straipsnio 1 dalyje numatytas mažesnis nuosavų lėšų reikalavimas tik „atitinkamų artimai tarpusavyje susijusių valiutų“ pozicijoms. Todėl pagal artimai tarpusavyje susijusių valiutų nustatymo kriterijus turėtų būti vertinamos tik valiutų poros, sudarytos kiekvieną iš skirtingų valstybių narių valiutų derinant su trečiųjų šalių valiutų, svarbių Sąjungos finansų įstaigoms, sąrašu;
- (7) į vertinimą turėtų būti įtrauktos tam tikros kitos tik trečiųjų šalių valiutų poros, atsižvelgiant į jų svarbą įstaigų portfeliams Sąjungoje. Be to, atsižvelgiant į Reglamento (ES) Nr. 575/2013 354 straipsnio 1 dalies reikalavimus dėl atitinkamų stebėjimo laikotarpių, svarstant, kokias valiutas įtraukti į vertinimą, reikėtų atsižvelgti tik į valiutas, kurių penkerių metų kiekvienos dienos duomenų eilutės gautos iš patikimo šaltinio;
- (8) Reglamento (ES) Nr. 575/2013 354 straipsnio 4 dalyje nustatytas specialus valiutų porų, sudarytų iš Ekonominės ir pinigų sąjungos antrajame etape (toliau – VKM II) dalyvaujančių valstybių narių valiutų, vertinimas euro atžvilgiu ir tarpusavyje. Todėl poros, į kurias įeina tos valiutos, neturėtų būti laikomos „atitinkamomis“. Tačiau poros, kurias sudaro VKM II valiuta ir kita nei euro valiuta arba kita VKM II valiuta, turėtų būti laikomos „atitinkamomis“;

<sup>(1)</sup> OLL 176, 2013 6 27, p. 1.

- (9) todėl turėtų būti vertinama kiekvienos valiutų poros, sudarytos derinant šio reglamento priede pateikiamas valiutas, koreliacija;
- (10) siekiant užtikrinti tikrumą naudojant artimai tarpusavyje susijusių valiutų sąrašą, tas sąrašas turėtų būti peržiūrimas pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 1093/2010 <sup>(1)</sup> 29 straipsnio 1 dalies d punktą. Dėl tų pačių priežasčių tokios peržiūros turėtų būti atliekamos reguliariai, kasmet tą (tomis) pačią (-iomis) arba beveik tą (tomis) pačią (-iomis) dieną (-omis), nebent dėl rinkos pokyčių išimties tvarka tokią peržiūrą reikėtų atlikti kitu metu;
- (11) šis reglamentas grindžiamas Europos bankininkystės institucijos Komisijai pateiktais techninių įgyvendinimo standartų projektais;
- (12) Europos bankininkystės institucija dėl techninių įgyvendinimo standartų projektų, kuriais pagrįstas šis reglamentas, surengė atviras viešas konsultacijas, išnagrinėjo galimas susijusias sąnaudas ir naudą ir paprašė Bankininkystės suinteresuotųjų subjektų grupės, įsteigtos pagal Reglamento (ES) Nr. 1093/2010 37 straipsnį, pateikti savo nuomonę,

PRIĖMĖ ŠĮ REGLAMENTĄ:

*1 straipsnis*

Valiutų poros, atitinkančios Reglamento (ES) Nr. 575/2013 354 straipsnio 1 dalies reikalavimus, pateiktos šio reglamento priede.

*2 straipsnis*

Šis reglamentas įsigalioja dvidešimtą dieną po jo paskelbimo *Europos Sąjungos oficialiajame leidinyje*.

Šis reglamentas privalomas visas ir tiesiogiai taikomas visose valstybėse narėse.

Priimta Briuselyje 2015 m. lapkričio 27 d.

*Komisijos vardu*  
*Pirmininkas*  
Jean-Claude JUNCKER

---

<sup>(1)</sup> 2010 m. lapkričio 24 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 1093/2010, kuriuo įsteigiama Europos priežiūros institucija (Europos bankininkystės institucija), iš dalies keičiamas Sprendimas Nr. 716/2009/EB ir panaikinamas Komisijos sprendimas 2009/78/EB (OL L 331, 2010 12 15, p. 12).

## PRIEDAS

**Artimai tarpusavyje susijusių valiutų sąrašas***1 dalis. Artimai su euru (EUR) susijusių valiutų sąrašas*

Albanijos lekas (ALL), Bosnijos ir Hercegovinos markė (BAM), Bulgarijos levas (BGN), Čekijos krona (CZK), Didžiosios Britanijos svaras (GBP), Kroatijos kuna (HRK), Maroko dirhamas (MAD), Rumunijos lėja (RON).

*2 dalis. Artimai su Arabų Emiratų dirhamu (AED) susijusių valiutų sąrašas*

Angolos kvanza (AOA), Kanados doleris (CAD), Kinijos juanis (CNY), Didžiosios Britanijos svaras (GBP), Honkongo doleris (HKD), Libano svaras (LBP), Makao pataka (MOP), Peru naujasis solis (PEN), Filipinų pesas (PHP), Singapūro doleris (SGD), Tailando batas (THB), Taivano doleris (TWD), JAV doleris (USD).

*3 dalis. Artimai su Albanijos leku (ALL) susijusių valiutų sąrašas*

Bosnijos ir Hercegovinos markė (BAM), Bulgarijos levas (BGN), Čekijos krona (CZK), Danijos krona (DKK), Kroatijos kuna (HRK), Maroko dirhamas (MAD), Rumunijos lėja (RON), euro (EUR).

*4 dalis. Artimai su Angolos kvanza (AOA) susijusių valiutų sąrašas*

Arabų Emyratų dirhamas (AED), Kinijos juanis (CNY), Honkongo doleris (HKD), Libano svaras (LBP), Makao pataka (MOP), Peru naujasis solis (PEN), Filipinų pesas (PHP), Singapūro doleris (SGD), Tailando batas (THB), Taivano doleris (TWD), JAV doleris (USD).

*5 dalis. Artimai su Bosnijos ir Hercegovinos marke (BAM) susijusių valiutų sąrašas*

Albanijos lekas (ALL), Bulgarijos levas (BGN), Čekijos krona (CZK), Danijos krona (DKK), Didžiosios Britanijos svaras (GBP), Kroatijos kuna (HRK), Maroko dirhamas (MAD), Rumunijos lėja (RON), euro (EUR).

*6 dalis. Artimai su Bulgarijos levu (BGN) susijusių valiutų sąrašas*

Albanijos lekas (ALL), Bosnijos ir Hercegovinos markė (BAM), Čekijos krona (CZK), Danijos krona (DKK), Didžiosios Britanijos svaras (GBP), Kroatijos kuna (HRK), Maroko dirhamas (MAD), Rumunijos lėja (RON), euro (EUR).

*7 dalis. Artimai su Kanados doleriu (CAD) susijusių valiutų sąrašas*

Arabų Emyratų dirhamas (AED), Honkongo doleris (HKD), Makao pataka (MOP), Singapūro doleris (SGD), Taivano doleris (TWD), JAV doleris (USD).

*8 dalis. Artimai su Kinijos juaniu (CNY) susijusių valiutų sąrašas*

Arabų Emyratų dirhamas (AED), Angolos kvanza (AOA), Didžiosios Britanijos svaras (GBP), Honkongo doleris (HKD), Libano svaras (LBP), Makao pataka (MOP), Peru naujasis solis (PEN), Filipinų pesas (PHP), Singapūro doleris (SGD), Tailando batas (THB), Taivano doleris (TWD), JAV doleris (USD).

*9 dalis. Artimai su Čekijos krona (CZK) susijusių valiutų sąrašas*

Albanijos lekas (ALL), Bosnijos ir Hercegovinos markė (BAM), Bulgarijos levas (BGN), Danijos krona (DKK), Kroatijos kuna (HRK), Maroko dirhamas (MAD), Rumunijos lėja (RON), euro (EUR).

*10 dalis. Artimai su Danijos krona (DKK) susijusių valiutų sąrašas*

Albanijos lekas (ALL), Bosnijos ir Hercegovinos markė (BAM), Bulgarijos levas (BGN), Čekijos krona (CZK), Didžiosios Britanijos svaras (GBP), Kroatijos kuna (HRK), Maroko dirhamas (MAD), Rumunijos lėja (RON), Singapūro doleris (SGD).

*11 dalis. Artimai su Didžiosios Britanijos svaru (GBP) susijusių valiutų sąrašas*

Arabų Emyratų dirhamas (AED), Bosnijos ir Hercegovinos markė (BAM), Bulgarijos levas (BGN), Kinijos juanis (CNY), Danijos krona (DKK), Honkongo doleris (HKD), Kroatijos kuna (HRK), Libano svaras (LBP), Maroko dirhamas (MAD), Makao pataka (MOP), Singapūro doleris (SGD), Taivano doleris (TWD), JAV doleris (USD), euro (EUR).

*12 dalis. Artimai su Honkongo doleriu (HKD) susijusių valiutų sąrašas*

Arabų Emyratų dirhamas (AED), Angolos kvanza (AOA), Kanados doleris (CAD), Kinijos juanis (CNY), Didžiosios Britanijos svaras (GBP), Libano svaras (LBP), Makao pataka (MOP), Peru naujasis solis (PEN), Filipinų pesas (PHP), Singapūro doleris (SGD), Tailando batas (THB), Taivano doleris (TWD), JAV doleris (USD).

*13 dalis. Artimai su Kroatijos kuna (HRK) susijusių valiutų sąrašas*

Albanijos lekas (ALL), Bosnijos ir Hercegovinos markė (BAM), Bulgarijos levas (BGN), Čekijos krona (CZK), Danijos krona (DKK), Didžiosios Britanijos svaras (GBP), Maroko dirhamas (MAD), Rumunijos lėja (RON), Singapūro doleris (SGD), euro (EUR).

*14 dalis. Artimai su Pietų Korėjos vonu (KRW) susijusių valiutų sąrašas*

Peru naujasis solis (PEN), Filipinų pesas (PHP), Singapūro doleris (SGD), Taivano doleris (TWD).

*15 dalis. Artimai su Libano svaru (LBP) susijusių valiutų sąrašas*

Arabų Emyratų dirhamas (AED), Angolos kvanza (AOA), Kinijos juanis (CNY), Didžiosios Britanijos svaras (GBP), Honkongo doleris (HKD), Makao pataka (MOP), Peru naujasis solis (PEN), Filipinų pesas (PHP), Singapūro doleris (SGD), Tailando batas (THB), Taivano doleris (TWD), JAV doleris (USD).

*16 dalis. Artimai su Maroko dirhamu (MAD) susijusių valiutų sąrašas*

Albanijos lekas (ALL), Bosnijos ir Hercegovinos markė (BAM), Bulgarijos levas (BGN), Čekijos krona (CZK), Danijos krona (DKK), Didžiosios Britanijos svaras (GBP), Kroatijos kuna (HRK), Rumunijos lėja (RON), Singapūro doleris (SGD), Tailando batas (THB), Taivano doleris (TWD), euro (EUR).

*17 dalis. Artimai su Makao pataka (MOP) susijusių valiutų sąrašas*

Arabų Emyratų dirhamas (AED), Angolos kvanza (AOA), Kanados doleris (CAD), Kinijos juanis (CNY), Didžiosios Britanijos svaras (GBP), Honkongo doleris (HKD), Libano svaras (LBP), Peru naujasis solis (PEN), Filipinų pesas (PHP), Singapūro doleris (SGD), Tailando batas (THB), Taivano doleris (TWD), JAV doleris (USD).

*18 dalis. Artimai su Peru naujuoju soliu (PEN) susijusių valiutų sąrašas*

Arabų Emyratų dirhamas (AED), Angolos kvanza (AOA), Kinijos juanis (CNY), Honkongo doleris (HKD), Pietų Korėjos vonas (KRW), Libano svaras (LBP), Makao pataka (MOP), Filipinų pesas (PHP), Singapūro doleris (SGD), Tailando batas (THB), Taivano doleris (TWD), JAV doleris (USD).

*19 dalis. Artimai su Filipinų pesu (PHP) susijusių valiutų sąrašas*

Arabų Emyratų dirhamas (AED), Angolos kvanza (AOA), Kinijos juanis (CNY), Honkongo doleris (HKD), Pietų Korėjos vonas (KRW), Libano svaras (LBP), Makao pataka (MOP), Malaizijos ringitas (MYR), Peru naujasis solis (PEN), Singapūro doleris (SGD), Tailando batas (THB), Taivano doleris (TWD), JAV doleris (USD).

*20 dalis. Artimai su Rumunijos lėja (BGN) susijusių valiutų sąrašas*

Albanijos lekas (ALL), Bosnijos ir Hercegovinos markė (BAM), Bulgarijos levas (BGN), Čekijos krona (CZK), Danijos krona (DKK), Kroatijos kuna (HRK), Maroko dirhamas (MAD), euro (EUR).

*21 dalis. Artimai su Singapūro doleriu (SGD) susijusių valiutų sąrašas*

Arabų Emyratų dirhamas (AED), Angolos kvanza (AOA), Kanados doleris (CAD), Kinijos juanis (CNY), Danijos krona (DKK), Didžiosios Britanijos svaras (GBP), Honkongo doleris (HKD), Kroatijos kuna (HRK), Pietų Korėjos vonas (KRW), Libano svaras (LBP), Maroko dirhamas (MAD), Makao pataka (MOP), Malaizijos ringitas (MYR), Peru naujasis solis (PEN), Filipinų pesas (PHP), Tailando batas (THB), Taivano doleris (TWD), JAV doleris (USD).

*22 dalis. Artimai su Tailando batu (THB) susijusių valiutų sąrašas*

Arabų Emyratų dirhamas (AED), Angolos kvanza (AOA), Kinijos juanis (CNY), Honkongo doleris (HKD), Libano svaras (LBP), Maroko dirhamas (MAD), Makao pataka (MOP), Peru naujasis solis (PEN), Filipinų pesas (PHP), Singapūro doleris (SGD), Taivano doleris (TWD), JAV doleris (USD).

*23 dalis. Artimai su taivano doleriu (TWD) susijusių valiutų sąrašas*

Arabų Emyratų dirhamas (AED), Angolos kvanza (AOA), Kanados doleris (CAD), Kinijos juanis (CNY), Didžiosios Britanijos svaras (GBP), Honkongo doleris (HKD), Pietų Korėjos vonas (KRW), Libano svaras (LBP), Maroko dirhamas (MAD), Makao pataka (MOP), Malaizijos ringitas (MYR), Peru naujasis solis (PEN), Filipinų pesas (PHP), Singapūro doleris (SGD), Tailando batas (THB), JAV doleris (USD).

*24 dalis. Artimai su JAV doleriu (USD) susijusių valiutų sąrašas*

Arabų Emyratų dirhamas (AED), Angolos kvanza (AOA), Kanados doleris (CAD), Kinijos juanis (CNY), Didžiosios Britanijos svaras (GBP), Honkongo doleris (HKD), Libano svaras (LBP), Makao pataka (MOP), Peru naujasis solis (PEN), Filipinų pesas (PHP), Singapūro doleris (SGD), Tailando batas (THB), Taivano doleris (TWD).

---