РЕГЛАМЕНТ ЗА ИЗПЪЛНЕНИЕ (ЕС) 2025/379 НА КОМИСИЯТА

от 26 февруари 2025 година

за изменение на въведените с Регламент за изпълнение (ЕС) 2016/2070 технически стандарти за изпълнение по отношение на сравнителните портфейли, образците за докладване и указанията за докладване, приложими в Съюза за целите на докладването по член 78, параграф 2 от Директива 2013/36/ЕС на Европейския парламент и на Съвета

(текст от значение за ЕИП)

ЕВРОПЕЙСКАТА КОМИСИЯ,

като взе предвид Договора за функционирането на Европейския съюз,

като взе предвид Директива 2013/36/ЕС на Европейския парламент и на Съвета от 26 юни 2013 г. относно достъпа до осъществяването на дейност от кредитните институции и относно пруденциалния надзор върху кредитните институции, за изменение на Директива 2002/87/ЕО и за отмяна на директиви 2006/48/ЕО и 2006/49/ЕО ([1]), и по-специално член 78, параграф 8, трета алинея от нея,

като има предвид, че:

(1) Съгласно член 78, параграф 1 от Директива 2013/36/ЕС от институциите, на които е разрешено да използват вътрешни подходи, се изисква да предоставят на съответния им компетентен орган — с подходящи честота и най-малко веднъж годишно — данни за своите рисково претеглени експозиции или капиталови изисквания, изчислени съгласно вътрешните им подходи за експозициите или позициите, включени в сравнителните портфейли, за да може компетентният орган да оцени качеството на тези вътрешни подходи („сравнителен анализ“). Съгласно член 78, параграф 3, втора алинея от същата директива Европейският банков орган (ЕБО) изготвя въз основа на резултатите от сравнителния анализ доклад, който да послужи на компетентните органи при оценката на качеството на вътрешните подходи на институциите. Изискванията за докладване по отношение на сравнителния анализ са определени в Регламент за изпълнение (ЕС) 2016/2070 на Комисията ([2]), който беше неколкократно изменен. За да се отразят промените във фокуса на оценките на компетентните органи и на докладите на ЕБО, както и с оглед на законодателните промени в областта на пазарния риск, е необходимо отново да се актуализират сравнителните портфейли, заедно с изискванията за докладване, определени в посочения регламент за изпълнение.

(2) С оглед на сравнителния анализ на кредитния риск следва да бъдат променени указанията, за да се уточни задължителният характер на рисковите параметри за докладване на вероятността от неизпълнение и загубата при неизпълнение по отношение на компонентите на степента на консервативност, регулаторната надбавка и „икономическия спад“, които могат да са причина за променливост в моделите. Освен това следва да се уточни, че от институциите се изисква да докладват определения от компетентния орган идентификационен код на моделите, като по този начин се опростява оперативното разпределение на данните за целите на докладването.

(3) С Делегиран регламент (ЕС) 2024/2795 на Комисията ([3]) се отлага датата на прилагане на новите капиталови изисквания за пазарен риск. Поради това образците за съществуващия подход на вътрешните модели не се заменят на настоящия етап. Успоредно с това образците за утвърждаване на стандартизирания подход следва да бъдат разширени, така че да включват допълнителни портфейли, спрямо анализа за 2024 г., в чийто обхват попаднаха само лихвени инструменти. Целта е да се осигури подходящ надзор и безпроблемно прилагане на новия стандартизиран подход, който се използва за изчисляване на долната граница на капиталовото изискване.

([1]) ОВ L 176, 27.6.2013 г., стр. 338, ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2013/36/oj.

([2]) Регламент за изпълнение (ЕС) 2016/2070 на Комисията от 14 септември 2016 г. за определяне на технически стандарти за изпълнение за образците, дефинициите и информационнотехнологичните решения, които институциите да използват при докладването до Европейския банков орган и до компетентните органи съгласно член 78, параграф 2 от Директива 2013/36/ЕС на Европейския парламент и на Съвета (ОВ L 328, 2.12.2016 г., стр. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2016/2070/oj).

([3]) Делегиран регламент (ЕС) 2024/2795 на Комисията от 24 юли 2024 година за изменение на Регламент (ЕС) № 575/2013 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на датата на прилагане на капиталовите изисквания за пазарен риск (ОВ L, 2024/2795, 31.10.2024 г., ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2024/2795/oj).

(4) Поради това Регламент за изпълнение (ЕС) 2016/2070 следва да бъде съответно изменен.

(5) Настоящият регламент е изготвен въз основа на проекта на технически стандарти за изпълнение, представени на Комисията от ЕБО.

(6) ЕБО проведе открити обществени консултации по проекта на технически стандарти за изпълнение, въз основа на които е изготвен настоящият регламент, анализира потенциалните разходи и ползи и поиска становище от Групата на участниците от банковия сектор, създадена по силата на член 37 от Регламент (ЕС) № 1093/2010 на Европейския парламент и на Съвета ([4]),

ПРИЕ НАСТОЯЩИЯ РЕГЛАМЕНТ:

Член 1

Регламент за изпълнение (ЕС) 2016/2070 се изменя, както следва:

(1) Приложение IV се заменя с текста в приложение I към настоящия регламент.

(2) Приложение V се заменя с текста в приложение II към настоящия регламент.

(3) Приложение VI се заменя с текста в приложение III към настоящия регламент.

(4) Приложение VII се заменя с текста в приложение IV към настоящия регламент.

(5) Приложение X се заменя с текста в приложение V към настоящия регламент.

Член 2

Настоящият регламент влиза в сила на двадесетия ден след деня на публикуването му в *Официален вестник на Европейския съюз*.

Настоящият регламент е задължителен в своята цялост и се прилага пряко във всички държави членки.

Съставено в Брюксел на 26 февруари 2025 година.

За Комисията
Председател
Ursula VON DER LEYEN

([4]) Регламент (ЕС) № 1093/2010 на Европейския парламент и на Съвета от 24 ноември 2010 г. за създаване на Европейски надзорен орган (Европейски банков орган), за изменение на Решение № 716/2009/ЕО и за отмяна на Решение 2009/78/ЕО на Комисията (ОВ L 331 15.12.2010 г., стр. 12, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2010/1093/oj).

ПРИЛОЖЕНИЕ I

„ПРИЛОЖЕНИЕ IV

РЕЗУЛТАТИ ОТ СРАВНИТЕЛНИТЕ ПОРТФЕЙЛИ ЗА ЦЕЛИТЕ НА НАДЗОРА

ЧАСТ I: ОБЩИ УКАЗАНИЯ

ЧАСТ II: УКАЗАНИЯ ОТНОСНО ОБРАЗЦИТЕ

С 101 — Данни за експозициите в портфейли с нисък риск от неизпълнение на задълженията по контрагенти

С 102 — Данни за експозициите в портфейли с нисък риск от неизпълнение на задълженията

С 103 — Данни за експозициите в портфейли с висок риск от неизпълнение на задълженията

С 105.01 — Дефиниране на вътрешните модели

С 105.02 — Разпределяне на вътрешните модели по портфейли

С 105.03 — Разпределяне на вътрешните модели по държави

ЧАСТ I: ОБЩИ УКАЗАНИЯ

1. Предоставя се информация само за тези контрагенти и портфейли, за които към референтната дата съществува действителна експозиция под формата на първоначална експозиция или експозиция след редуциране на кредитния риск (РКР). Контрагентите и портфейлите, за които към референтната дата не съществува експозиция, не се представят.

2. Предоставя се информация само за тези експозиции, за които компетентният орган е одобрил вътрешен модел за изчисляване на рисково претеглените експозиции (рисково претеглени активи). В образец С 101 не се докладват завършващите на „STDA“ кодове на контрагент. За останалите кодове на контрагент в образец С 101 от приложение I и за посочените в образци С 102 и С 103 сравнителни портфейли се изключват експозициите по стандартизирания подход и експозициите, за които съответният компетентен орган е разрешил, временно или постоянно, частично използване на стандартизирания подход.

3. Полетата, в които се събира информация, която е недостатъчно уточнена или не е приложима, се оставят празни или се вписва „NULL“. Същото се отнася и за претеглените според експозицията при неизпълнение количества или параметри, които не могат да бъдат изчислени. Аналогично полетата, чието докладване не е задължително, могат да не се попълват или да се вписва „NULL“ в тях. Стойност нула се попълва само с цел да се докладва нулево количество или нулева стойност на даден параметър. За докладване на нулеви количества не се използват обозначения като „празно“ или „NULL“.

4. Паричните стойности се докладват по същия начин, по който са докладвани за изчисляването на капиталовите изисквания на конкретна референтна дата в съответствие с Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451 на Комисията ([1])

([1]) Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451 на Комисията от 17 декември 2020 г. за определяне на техническите стандарти за изпълнение за прилагането на Регламент (ЕС) № 575/2013 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на предоставянето на информация от институциите на надзорните органи и за отмяна на Регламент за изпълнение (ЕС) № 680/2014 (ОВ L 97, 19.3.2021 г., стр. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2021/451/oj).

ЧАСТ II: УКАЗАНИЯ ОТНОСНО ОБРАЗЦИТЕ

С 101 — Данни за експозициите в портфейли с нисък риск от неизпълнение на задълженията по контрагенти

Експозициите по специализирано кредитиране се изключват.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0010	Код на контрагента	Образец C 101, колона 0010 от приложение I	Докладва се кодът в колона 0010 на образец C 101 от приложение I, с който се обозначава контрагентът, включен в извадката от портфейли с нисък риск от неизпълнение на задълженията. Този код представлява идентификационният номер на съответния ред и е различен за всеки ред в образеца.
0020	Клас експозиции	Точка 76 от приложение II към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451	Всеки контрагент се отнася към някой от следните класове експозиции: а) „Централни банки и централни правителства“; б) „Институции“; в) „Предприятия — МСП“ (малки и средни предприятия); г) „Предприятия — специализирано кредитиране“; д) „Предприятия — други“; е) „Експозиции на дребно — обезпечени с недвижими имоти — МСП“; ж) „Експозиции на дребно — обезпечени с недвижими имоти — субекти, различни от МСП“; з) „Експозиции на дребно — квалифицирани револвиращи“; и) „Експозиции на дребно — други — МСП“; й) „Експозиции на дребно — други — субекти, различни от МСП“; к) не се прилага „Не се прилага“ се използва, когато не е приложим нито един от изброените в списъка класове, например когато експозициите към даден контрагент принадлежат към няколко класа, като нито един от тях не преобладава явно.
0040	Рейтинг		Докладва се рангът на вътрешния рейтинг, присъден на контрагента, по приложимата вътрешна рейтингова скала на институцията. Той се номерира с поредни числа 1, 2, 3 и т.н. — от най-ниския до най-високия риск, като тук не се включват неизпълненията с вероятност от 100 %. Когато институцията използва непрекъсната рейтингова скала в съответствие с член 169, параграф 3 от Регламент (ЕС) № 575/2013 ([2]), се посочват рейтинговите степени, докладвани в колона 0005 на образец C 08.02 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451 на Комисията. Когато на експозициите към даден контрагент са присъдени няколко рейтингови степени при условията на член 172, параграф 1, буква д), подточка i) или iii) от Регламент (ЕС) № 575/2013, се посочва степен нула (0).

([2]) Регламент (ЕС) № 575/2013 на Европейския парламент и на Съвета от 26 юни 2013 година относно пруденциалните изисквания за кредитните институции и инвестиционните посредници и за изменение на Регламент (ЕС) № 648/2012 (ОВ L 176, 27.6.2013 г., стр. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2013/575/oj).

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0050	Дата, на която е определен най-новият рейтинг на контрагента		Посочва се датата, на която е определен най-новият рейтинг на контрагента.
0060	Вероятност от неизпълнение	Образец C 08.01, колона 0010 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451	Докладва се определената за контрагента вероятност от неизпълнение (PD), която е използваната за изчисляването на рисково претеглените активи вероятност от неизпълнение, без да се отчита ефектът от мерките по член 458 от Регламент (ЕС) № 575/2013. Вероятността от неизпълнение се изразява като стойност между 0 и 1.
0070	Статус по отношение на неизпълнението		Докладва се статусът на контрагента по отношение на неизпълнението. В съответствие с член 178 от Регламент (ЕС) № 575/2013 той може да бъде: а) в неизпълнение; б) не в неизпълнение.
0080	Първоначална експозиция преди прилагането на конверсионните коефициенти	Образец C 08.01, колона 0020 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451	Докладва се първоначалната стойност на експозицията, преди да се вземат под внимание евентуалните корекции на стойността, провизии, ефект на техники за редуциране на кредитния риск и конверсионни коефициенти.
0090	Експозиция след ефект на заместването поради редуциране на кредитния риск преди прилагане на конверсионните коефициенти	Образец C 08.01, колона 0090 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451	Докладва се стойността, към която са приложени конверсионни коефициенти (ККК), за да се получи експозицията при неизпълнение (колона 0110). При това се вземат под внимание методите за редуциране на кредитния риск с ефект на заместване върху експозицията.
0100	Кредитен конверсионен коефициент	Член 166, параграф 8 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Докладват се среднопретеглените стойности на ККК. Използваните тегла са стойностите, към които се прилагат ККК, за да се получи експозицията при неизпълнение. За контрагентите, чиито инструменти съответстват изключително на изброените в член 166, параграф 8 от Регламент (ЕС) № 575/2013 елементи, среднопретеглената стойност на ККК се определя въз основа на всички инструменти. За контрагентите, чиито инструменти не попадат сред изброените в член 166, параграф 8 от Регламент (ЕС) № 575/2013 елементи, ККК не се попълва или се вписва „NULL“.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
			За контрагентите, чиито инструменти съответстват на посочените в член 166, параграф 8 от Регламент (ЕС) № 575/2013 елементи, и инструменти, които не спадат към елементите, посочени в член 166, параграф 8 от същия регламент, докладваната среднопретеглена стойност на ККК се определя въз основа само на инструментите, съответстващи на елементите, посочени в член 166, параграф 8 от Регламент (ЕС) № 575/2013. В изчисленията конкретно не се взимат предвид инструментите, които представляват някой от елементите, посочени в член 166, параграф 10 от същия регламент. Когато институцията прилага собствени оценки на ККК за елементите, посочени в член 166, параграф 8 от Регламент (ЕС) № 575/2013, тези ККК се използват за изчисляване на среднопретеглената стойност на ККК. Когато институцията не прилага собствени оценки на ККК за елементите, посочени в член 166, параграф 8 от Регламент (ЕС) № 575/2013, се използват регулаторните ККК, посочени в член 166, параграф 8 от Регламент (ЕС) № 575/2013. ККК се изразява като стойност между 0 и 1.
0110	Експозиции при неизпълнение	Образец C 08.01, колона 0110 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451	Докладва се стойността на експозицията.
0120	Стойност на обезпечението	Образец C 08.01, колони 0150—0210 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451	Докладва се пазарната стойност на обезпечението.
0130	Хипотетични собствени оценки на загубата при неизпълнение за първостепенни необезпечени експозиции без ограничителна клауза по отношение на залога	Член 161 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Докладва се хипотетичната собствена оценка на загубата при неизпълнение, която институцията би приложила към експозициите си към контрагента предвид следното: а) обхватът на експозициите е същият като за стойността на загубата при неизпълнение, докладвана в колона 0150; б) експозициите са първостепенни и необезпечени; в) не е налице ограничителна клауза по отношение на залога. Ограничителна клауза по отношение на залога означава клауза, съгласно която заемополучателят или емитентът на дългови инструменти няма право да залага активите си в полза на друга страна.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0140	Хипотетични собствени оценки на загубата при неизпълнение за първостепенни необезпечени експозиции с ограничителна клауза по отношение на залога	Член 161 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Докладва се хипотетичната собствена оценка на загубата при неизпълнение, която институцията би приложила към експозициите си към контрагента предвид следното: а) обхватът на експозициите е същият като за стойността на загубата при неизпълнение, докладвана в колона 0150; б) експозициите са първостепенни и необезпечени; в) налице е ограничителна клауза по отношение на залога. Ограничителна клауза по отношение на залога означава клауза, съгласно която заемополучателят или емитентът на дългови инструменти няма право да залага активите си в полза на друга страна.
0150	Загуба при неизпълнение	Образец C 08.01, колони 0230 и 0240 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451	Докладват се среднопретеглените според експозициите при неизпълнение стойности на загубата при неизпълнение за експозициите към контрагента. Загубите при неизпълнение са използваните за изчисляването на рисково претеглените активи. По-специално, ако компетентният орган е разрешил на институцията да използва собствени оценки на загубата при неизпълнение, стойностите ѝ се основават на тези собствени оценки, а иначе – на регулаторните стойности на загубата при неизпълнение при отчитане на приложимото редуциране на риска. Включва се загубата при неизпълнение за големите регулирани предприятия от финансовия сектор и нерегулираните финансови субекти. Ефектът от мерките, въведени в съответствие с член 458 от Регламент (ЕС) № 575/2013, не следва да се взима под внимание. Загубата при неизпълнение се изразява като стойност между 0 и 1.
0160	Падеж	Образец C 08.01, колона 0250 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451	Докладва се претегленият според експозициите при неизпълнение срок до падежа за експозициите към контрагента. Изразява се в брой дни.
0170	Рисково претеглени активи	Образец C 08.01, колона 0260 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451	Докладват се рисково претеглените активи след прилагането на коефициентите за подпомагане (на МСП и инфраструктурни проекти). Рисково претеглените активи не включват ефекта от потенциални мерки по член 458 от Регламент (ЕС) № 575/2013.

С 102 — Данни за експозициите в портфейли с нисък риск от неизпълнение на задълженията

При портфейлите, чийто обезпечителен статус в приложение I не е „Не се прилага“, и ако при одобрения модел не се изчислява отделно загубата при неизпълнение за обезпечените и необезпечените части на дадена експозиция, може да се пропусне следната информация: загубата при неизпълнение (колона 0130), загубата при неизпълнение без надзорни мерки (колона 0131), загубата при неизпълнение без степен на консервативност и надзорни мерки (колона 0132), загубата при неизпълнение без степен на консервативност, надзорни мерки и компонента „икономически спад“ (колона 0133), очакваната стойност на загубата (колона 0150) и рисково претеглените активи (колона 0170).

При портфейлите по регулаторния подход, дефинирани като „Разграничителни критерии във връзка със специализираното кредитиране“, се пропуска следната информация: вероятността от неизпълнение (колона 0060), вероятността от неизпълнение без надзорни мерки (колона 0061), вероятността от неизпълнение без степен на консервативност и надзорни мерки (колона 0062), загубата при неизпълнение (колона 0130), загубата при неизпълнение без надзорни мерки (колона 0131), загубата при неизпълнение без степен на консервативност и надзорни мерки (колона 0132), загубата при неизпълнение без степен на консервативност, надзорни мерки и компонента „икономически спад“ (колона 0133).

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0010	Идентификационен код на портфейла	Образец С 102, колона 0010 от приложение I	Докладва се идентификационният код на портфейла от образец С 102, колона 0010 от приложение I. Това е идентификационният номер на съответния ред и е различен за всеки ред в образеца. Експозициите могат да бъдат отнесени към повече от един идентификационен код на портфейла: експозициите или частите от експозиции се докладват по всеки приложим идентификационен код на портфейл.
0040	Брой на длъжниците		Докладва се броят на длъжниците. Той се определя въз основа на длъжниците, за които докладваната в колона 0080 или 0090 стойност е строго положителна. Когато се прилага пълно заместване поради техника за редуциране на кредитния риск, първоначалният длъжник се добавя към „Брой длъжници“ на първоначалния му портфейл, а гарантът — към „Брой длъжници“ на портфейла на гаранта.
0060	Вероятност от неизпълнение	Образец С 08.01, колона 0010 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451	Вероятността от неизпълнение е използваната за изчисляването на рисково претеглените активи, без да се отчита ефектът от евентуалните мерки, въведени в съответствие с член 458 от Регламент (ЕС) № 575/2013. За портфейлите, съответстващи на отделна категория или група, се докладва вероятността от неизпълнение, определена за тази категория или група длъжници. За портфейлите, съответстващи на обобщените по различни категории или групи длъжници, се докладва среднопретеглената според експозициите при неизпълнение стойност на вероятностите от неизпълнение, определени за включените в обобщението експозиции. Вероятността от неизпълнение се изразява като стойност между 0 и 1.
0061	Вероятност от неизпълнение, без да се включват надзорните мерки		Вероятността от неизпълнение, без да се включват надзорните мерки, е основаващата се на разпоредбите на членове 179 и 180 от Регламент (ЕС) № 575/2013, която включва добавената от институцията степен на консервативност, но изключва наложените от компетентните органи мерки (мултипликатори, добавки, прагове или подобни мерки, които пряко увеличават вероятността от неизпълнение). За портфейлите, съответстващи на отделна категория или група, се отчита вероятността от неизпълнение за тази степен, която включва степента на консервативност, но не включва надзорните мерки. За портфейлите, съответстващи на обобщени по различни категории или групи длъжници, се докладва среднопретеглената според експозициите при неизпълнение стойност на вероятностите от неизпълнение за съответните експозиции, която включва степента на консервативност, но не включва надзорните мерки. Вероятността от неизпълнение, без да се включват надзорните мерки, се изразява като стойност между 0 и 1. В случай че институцията не е в състояние да изолира съответните консервативни корекции, се прилага част I, точка 3.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0062	Вероятност от неизпълнение, без да се включват степента на консервативност и надзорните мерки		Вероятността от неизпълнение, без да се включват степента на консервативност и надзорните мерки, е вероятността от неизпълнение, която не включва добавената от институцията в съответствие с член 179, параграф 1, буква е) и член 180, параграф 1, буква д) от Регламент (ЕС) № 575/2013 степен на консервативност, нито ефекта от наложените от компетентните органи мерки (мултипликатори, добавки, прагове или подобни мерки, които пряко увеличават вероятността от неизпълнение). За портфейлите, съответстващи на отделна категория или група, докладваната вероятност от неизпълнение за тази категория не включва степента на консервативност, нито надзорните мерки. За портфейлите, съответстващи на обобщени по различни категории или групи длъжници, се докладва среднопретеглената според експозициите при неизпълнение стойност на вероятностите от неизпълнение за съответните експозиции, която не включва степените на консервативност, нито надзорните мерки. Загубата при неизпълнение, без да се включват степента на консервативност и надзорните мерки, се изразява като стойност между 0 и 1. В случай че институцията не е в състояние да изолира съответните консервативни корекции, се прилага част I, точка 3.
0080	Първоначална експозиция преди прилагането на конверсионните коефициенти	Образец C 08.01, колона 0020 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451	Докладва се първоначалната стойност на експозицията, преди да се вземат под внимание евентуалните корекции на стойността, провизии, ефект на техники за редуциране на кредитния риск и конверсионни коефициенти.
0090	Експозиция след ефект на заместването поради редуциране на кредитния риск преди прилагане на конверсионните коефициенти	Образец C 08.01, колона 0090 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451	Докладва се стойността, към която са приложени конверсионни коефициенти (ККК), за да се получи експозицията при неизпълнение (колона 0110). При това се вземат под внимание методите за редуциране на кредитния риск с ефект на заместване върху експозицията.
0100	Кредитен конверсионен коефициент	Член 166, параграф 8 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Докладват се среднопретеглените стойности на ККК. Използваните тегла са стойностите, към които се прилагат ККК, за да се получи експозицията при неизпълнение. За портфейлите, в които са включени инструменти, представляващи изключително някой от изброените в член 166, параграф 8 от Регламент (ЕС) № 575/2013 елементи, среднопретеглената стойност на ККК се определя въз основа на всички инструменти. За портфейлите, в които не са включени инструменти, представляващи някой от изброените в член 166 от Регламент (ЕС) № 575/2013 елементи, ККК не се попълва или се вписва „NULL“. За портфейлите, в които са включени инструменти, съответстващи на посочените в член 166, параграф 8 от Регламент (ЕС) № 575/2013 елементи, и инструменти, които не спадат към елементите, посочени в член 166, параграф 8 от същия регламент, докладваната среднопретеглена стойност на ККК се определя въз основа само на инструментите, съответстващи на елементите, посочени в член 166, параграф 8 от Регламент (ЕС) № 575/2013. В изчисленията конкретно не се взимат предвид

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
			инструментите, които представляват някой от елементите, посочени в член 166, параграф 10 от същия регламент. Когато институцията прилага собствени оценки на ККК за елементите, посочени в член 166, параграф 8 от Регламент (ЕС) № 575/2013, тези ККК се използват за изчисляване на среднопретеглената стойност на ККК. Когато институцията не прилага собствени оценки на ККК за елементите, посочени в член 166, параграф 8 от Регламент (ЕС) № 575/2013, се използват регулаторните ККК, посочени в член 166, параграф 8 от Регламент (ЕС) № 575/2013. ККК се изразява като стойност между 0 и 1.
0110	Експозиции при неизпълнение	Образец C 08.01, колона 0110 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451	Докладва се стойността на експозицията.
0120	Стойност на обезпечението	Образец C 08.01, колони 0150—0210 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451	Докладва се пазарната стойност на обезпечението.
0130	Загуба при неизпълнение	Образец C 08.01, колони 0230 и 0240 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451	Докладват се среднопретеглените според експозициите при неизпълнение стойности на загубата при неизпълнение на експозициите в съответния портфейл. Загубите при неизпълнение са използваните за изчисляването на рисково претеглените активи. По-специално, ако компетентният орган е разрешил на институцията да използва собствени оценки на загубата при неизпълнение, стойностите ѝ се основават на тези собствени оценки, а иначе – на регулаторните стойности на загубата при неизпълнение при отчитане на приложимото редуциране на риска. Включват се експозициите и съответните загуби при неизпълнение за големите регулирани предприятия от финансовия сектор и нерегулираните финансови субекти. Ефектът от мерките, въведени в съответствие с член 458 от Регламент (ЕС) № 575/2013, не следва да се взима под внимание. Загубата при неизпълнение се изразява като стойност между 0 и 1.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0131	Загуба при неизпълнение, без да се включват надзорните мерки		Загубата при неизпълнение, без да се включват надзорните мерки, е основаващата се на разпоредбите на членове 179 и 181 от Регламент (ЕС) № 575/2013 загуба при неизпълнение, която включва добавената от институцията степен на консервативност, но изключва наложените от компетентните органи мерки (мултипликатори, добавки, прагове или подобни мерки, които пряко увеличават загубата при неизпълнение). За портфейлите, съответстващи на отделна категория или група, докладваната загуба при неизпълнение за тази категория включва степента на консервативност, но не включва надзорните мерки. За портфейлите, съответстващи на обобщени по различни категории или групи длъжници, се докладва среднопретеглената според експозициите при неизпълнение стойност на загубите при неизпълнение за съответните експозиции, която включва степента на консервативност, но не включва надзорните мерки. Загубата при неизпълнение, без да се включват надзорните мерки, се изразява като стойност между 0 и 1. В случай че институцията не е в състояние да изолира съответните консервативни корекции, се прилага част I, точка 3.
0132	Загуба при неизпълнение, без да се включват степента на консервативност и надзорните мерки		Загубата при неизпълнение, без да се включват степента на консервативност и надзорните мерки, е загубата при неизпълнение, която не включва добавената от институцията в съответствие с член 179, параграф 1, буква е) и член 181 от Регламент (ЕС) № 575/2013 степен на консервативност, нито ефекта от наложените от компетентните органи мерки (мултипликатори, добавки, прагове или подобни мерки, които пряко увеличават загубата при неизпълнение). За портфейлите, съответстващи на отделна категория или група, докладваната загуба при неизпълнение за тази категория не включва степента на консервативност, нито надзорните мерки. За портфейлите, съответстващи на обобщени по различни категории или групи длъжници, се докладва среднопретеглената според експозициите при неизпълнение стойност на загубите при неизпълнение за съответните експозиции, която не включва степените на консервативност, нито надзорните мерки. Загубата при неизпълнение, без да се включват степента на консервативност и надзорните мерки, се изразява като стойност между 0 и 1. В случай че институцията не е в състояние да изолира съответните консервативни корекции, се прилага част I, точка 3.
0133	Загуба при неизпълнение, без да се включват степента на консервативност, надзорните мерки и компонент „икономически спад“		Загубата при неизпълнение, без да се включват степента на консервативност, надзорните мерки и компонентът „икономически спад“, е загубата при неизпълнение, която не включва добавената от институцията в съответствие с член 179, параграф 1, буква е) и член 181 от Регламент (ЕС) № 575/2013 степен на консервативност, ефекта от наложените от компетентните органи мерки (мултипликатори, добавки, прагове или подобни мерки, които пряко увеличават загубата при неизпълнение), нито компонента „икономически спад“, изискван по силата на член 181, параграф 1, буква б) от същия регламент. За портфейлите, съответстващи на отделна категория или група, докладваната загуба при неизпълнение за тази категория не включва степента на консервативност, надзорните мерки, нито компонента „икономически спад“. За портфейлите, съответстващи на обобщени по различни категории или групи длъжници, се докладва среднопретеглената според експозициите при неизпълнение стойност на загубите при неизпълнение за съответните експозиции, която не включва степента на консервативност, надзорните мерки и компонента „икономически спад“.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
			Загубата при неизпълнение, без да се включват степента на консервативност, надзорните мерки и компонент „икономически спад“, се изразява като стойност между 0 и 1. В случай че институцията не е в състояние да изолира съответните консервативни корекции, се прилага част I, точка 3.
0140	Падеж	Образец C 08.01, колона 0250 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451	Докладва се претегленият според експозициите при неизпълнение срок до падежа. Изразява се в брой дни. Тази информация не се докладва за експозициите, при които срокът до падежа не е елемент в изчисляването на рисково претеглените активи. По-специално, срокът до падежа не се докладва за портфейлите, които представляват експозиции от клас „Експозиции на дребно“.
0150	Размер на очакваната загуба	Образец C 08.01, колона 0280 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451	Докладва се размерът на очакваната загуба.
0160	Провизии за експозиции в неизпълнение	Образец C 09.02, колони 0050, 0055 и 0060 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451	Докладват се провизиите за експозициите в неизпълнение. Те включват всички корекции за общ и специфичен кредитен риск при експозициите в неизпълнение, както е посочено в член 110 от Регламент (ЕС) № 575/2013. (Еднократните) корекции за кредитен риск, които институцията прилага във връзка с промените в прилагането на дефиницията за неизпълнение, се докладват като записани в базата данни на институцията..
0170	Рисково претеглени активи	Образец C 08.01, колона 0260 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451	Докладват се рисково претеглените активи след прилагането на коефициентите за подпомагане (на МСП и инфраструктурни проекти). Рисково претеглените активи не включват ефекта от потенциални мерки по член 458 от Регламент (ЕС) № 575/2013.
0180	Рисково претеглени активи — стандартизиран подход	Част трета, дял II, глава 2 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Рисково претеглени активи — стандартизиран подход — е хипотетичната стойност на рисково претеглените активи, получена чрез прилагане на стандартизирания подход за кредитен риск към експозициите вместо вътрешнорейтинговия подход.

С 103 — Данни за експозициите в портфейли с висок риск от неизпълнение на задълженията

При портфейлите, чийто обезпечителен статус в приложение I не е „Не се прилага“ и ако при одобрения модел не се изчислява отделно загубата при неизпълнение за обезпечените и необезпечените части на дадена експозиция, може да се пропусне следната информация: загубата при неизпълнение (колона 0130), загубата при неизпълнение без надзорни мерки (колона 0131), загубата при неизпълнение без степен на консервативност и надзорни мерки (колона 0132), загубата при неизпълнение без степен на консервативност, надзорни мерки и компонента „икономически спад“ (колона 0133), очакваната стойност на загубата (колона 0150), рисково претеглените активи (колона 0170), процентът на загуба през последната година (колона 0210) и процентът на загуба през последните 5 години (колона 0220).

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0010	Идентификационен код на портфейла		Докладва се идентификационният код на портфейла от образец С 103, колона 0010 от приложение I. Това е идентификационният номер на съответния ред и е различен за всеки ред в образеца. Експозициите могат да бъдат отнесени към повече от един идентификационен код на портфейла: експозициите или частите от експозиции се докладват по всеки приложим идентификационен код на портфейл.
0040	Брой на длъжниците		Прилагат се указанията за образец С 102, колона 0040 от приложение I.
0060	Вероятност от неизпълнение		Прилагат се указанията за образец С 102, колона 0060 от приложение I.
0061	Вероятност от неизпълнение, без да се включват надзорните мерки		Прилагат се указанията за образец С 102, колона 0061 от приложение I.
0062	Вероятност от неизпълнение, без да се включват степента на консервативност и надзорните мерки		Прилагат се указанията за образец С 102, колона 0062 от приложение I.
0080	Първоначална експозиция преди прилагането на конверсионните коефициенти		Прилагат се указанията за образец С 102, колона 0080 от приложение I.
0090	Експозиция след ефект на заместването поради редуциране на кредитния риск преди прилагане на конверсионните коефициенти		Прилагат се указанията за образец С 102, колона 0090 от приложение I.
0100	Кредитен конверсионен коефициент		Прилагат се указанията за образец С 102, колона 0100 от приложение I.
0110	Експозиции при неизпълнение		Прилагат се указанията за образец С 102, колона 0110 от приложение I.
0120	Стойност на обезпечението		Прилагат се указанията за образец С 102, колона 0120 от приложение I.
0130	Загуба при неизпълнение		Прилагат се указанията за образец С 102, колона 0130 от приложение I.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0131	Загуба при неизпълнение, без да се включват надзорните мерки		Прилагат се указанията за образец C 102, колона 0131 от приложение I.
0132	Загуба при неизпълнение, без да се включват степента на консервативност и надзорните мерки		Прилагат се указанията за образец C 102, колона 0132 от приложение I.
0133	Загуба при неизпълнение, без да се включват степента на консервативност, надзорните мерки и компонент „икономически спад“		Прилагат се указанията за образец C 102, колона 0133 от приложение I.
0140	Падеж		Прилагат се указанията за образец C 102, колона 0140 от приложение I.
0150	Размер на очакваната загуба		Прилагат се указанията за образец C 102, колона 0150 от приложение I.
0160	Провизии за експозиции в неизпълнение		Прилагат се указанията за образец C 102, колона 0160 от приложение I.
0170	Рисково претеглени активи		Прилагат се указанията за образец C 102, колона 0170 от приложение I.
0180	Рисково претеглени активи — стандартизиран подход		Прилагат се указанията за образец C 102, колона 0180 от приложение I.
0190	Процент на неизпълнение през последната година		Докладва се процентът на неизпълнение за последната година. За тази цел процентът на неизпълнение се определя като отношението между следните стойности: а) сбора на експозициите (първоначалната експозиция (колона 0080), измерена на референтната дата минус една година), които не са били в неизпълнение точно една година преди референтната дата и които са преминали в неизпълнение в периода между референтната дата минус една година и референтната дата; б) сбора на експозициите (първоначалната експозиция (колона 0080), измерена на референтната дата минус една година), които не са били в неизпълнение на референтната дата минус една година. Не се включват новите експозиции, генерирани през годината, предшестваща референтната дата. Експозициите, които в рамките на годината, предшестваща референтната дата, са преминали в неизпълнение, което е било коригирано, трябва да се включат както в числителя, така и в знаменателя. При повече от един случай на неизпълнение от страна на един и същ длъжник, неизпълнението се включва само веднъж.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
			Тази информация се докладва само за идентификационните кодове на портфейлите с експозиции, които не са в неизпълнение; тя се изразява като стойност между 0 и 1. Неизпълненията и датите на неизпълнение са записаните съгласно валидната към момента на събитието дефиниция за неизпълнение: институциите считат, че е настъпило неизпълнение, съгласно прилаганата от тях към момента на регистриране на събитието дефиниция за неизпълнение. Промените в дефиницията за неизпълнение се разглеждат само за периодите след датата на въвеждането им, т.е. не се използва ретроспективно прилагане на промените в дефиницията за неизпълнение след разглежданото настъпване на неизпълнение (симулация със задна дата).
0200	Процент на неизпълнение през последните 5 години		Докладва се среднопретеглената стойност на процентите на неизпълнение, наблюдавани през последните пет години, които предшестват референтната дата. Прилага се дефиницията за процент на неизпълнение, посочена в колона 0190. Тегловните коефициенти, които трябва да се използват, са експозициите, които не са в неизпълнение и които са използвани при изчисляването на процента на неизпълнение в съответствие с колона 0190. Когато по силата на член 180, параграф 1, буква з) или член 180, параграф 2, буква д) от Регламент (ЕС) № 575/2013 институцията не е длъжна да изчисли процента на неизпълнение за последните пет години, предшестващи референтната дата, тя създава заместващ показател, като за неговите данни използва възможно най-дългия период до петте години преди референтната дата и представя на съответния компетентен орган подробно описание на начина на изчисляването му. Тази информация се докладва само за идентификационните кодове на портфейлите с експозиции, които не са в неизпълнение; тя се изразява като стойност между 0 и 1. Неизпълненията и датите на неизпълнение са записаните съгласно валидната към момента на събитието дефиниция за неизпълнение: институциите считат, че е настъпило неизпълнение, съгласно прилаганата от тях към момента на регистриране на събитието дефиниция за неизпълнение. Промените в дефиницията за неизпълнение се разглеждат само за периодите след датата на въвеждането им, т.е. не се използва ретроспективно прилагане на промените в дефиницията за неизпълнение след разглежданото настъпване на неизпълнение (симулация със задна дата).
0210	Процент на загуба през последната година		Процентът на загуба, наблюдаван през последната година, се докладва за идентификационните кодове само на портфейлите с експозиции „не в неизпълнение“ и „в неизпълнение“. За портфейлите, които не са в неизпълнение, процентът на загубата е сборът от корекциите за кредитен риск и отписванията в рамките на годината, предшестваща референтната дата, извършени спрямо експозициите, които не са били в неизпълнение точно една година преди референтната дата и които са преминали в неизпълнение през годината, предшестваща референтната дата, разделен на сбора на експозициите при неизпълнение, измерени точно една година преди референтната дата, за експозициите, които не са били в неизпълнение, но са преминали в неизпълнение през годината, предшестваща референтната дата.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
			Числителят на процента на загуба включва всички корекции за кредитен риск и отписвания, свързани с експозициите, които са преминали в неизпълнение в рамките на годината, предшестваща референтната дата, включително корекциите за кредитен риск, прилагани преди датата на неизпълнение. Не се включват новите експозиции, възникнали през годината, предшестваща референтната дата. Експозициите, които в рамките на годината, предшестваща референтната дата, са преминали в неизпълнение, което е било коригирано, трябва да се включат в знаменателя на процента на загуба, а корекциите за кредитен риск и отписванията за тези експозиции — в числителя на процента на загуба. При повече от един случай на неизпълнение от страна на един и същ длъжник неизпълнението се докладва само веднъж. За портфейлите в неизпълнение, процентът на загубите отчита експозициите, които са били в неизпълнение точно една година преди референтната дата. Това е сборът на: а) корекциите за кредитен риск на тези експозиции една година преди референтната дата и б) корекциите за кредитен риск и отписванията, приложени през годината, предхождаща референтната дата, разделен на общата стойност на експозициите при неизпълнение, измерена точно една година преди референтната дата на разглежданите експозиции. Не се включват случаите на неизпълнение, възникнали през годината, предшестваща референтната дата. Експозициите, чието неизпълнение е било коригирано в рамките на годината, предшестваща референтната дата, трябва да се включат в знаменателя на процента на загуба, а корекциите за кредитен риск и отписванията за тези експозиции — в числителя на процента на загуба. При повече от един случай на неизпълнение от страна на един и същ длъжник, неизпълнението се включва само веднъж. Процентът на загуба се изразява като стойност между 0 и 1. Неизпълненията и датите на неизпълнение са записаните съгласно валидната към момента на събитието дефиниция за неизпълнение: институциите считат, че е настъпило неизпълнение, съгласно прилаганата от тях към момента на регистриране на събитието дефиниция за неизпълнение. Промените в дефиницията за неизпълнение се разглеждат само за периодите след датата на въвеждането им, т.е. не се използва ретроспективно прилагане на промените в дефиницията за неизпълнение след разглежданото настъпване на неизпълнение (симулация със задна дата).
0220	Процент на загуба през последните 5 години		Среднопретеглената според експозициите при неизпълнение стойност на процентите на загуба, наблюдавани през последните пет години, предшестващи референтната дата, се докладва за идентификационните кодове само на портфейлите с експозиции „не в неизпълнение“ и „в неизпълнение“. Прилага се дефиницията за процент на загуба в колона 0210. Процентът на загуба за последните пет години се основава на годишните проценти на загуба за последните пет години, когато тези проценти на годишна загуба са определени по аналогия с дефиницията за процента на загуба в колона 0210; по-специално, годишните проценти на загуба не включват допълнителните промени в корекциите за кредитен риск и отписванията, настъпили след периода на наблюдение (календарна година) на всеки годишен процент на загуба. Когато по силата на член 181, параграф 2, последната алинея от Регламент (ЕС) № 575/2013 институцията не е длъжна да използва данни за последните пет години, предшестващи референтната дата, тя създава заместващ показател, като за неговите данни използва възможно най-дългия период до петте години преди референтната дата и представя на съответния компетентен орган подробно описание на начина на изчисляването му. Процентът на загуба се изразява като стойност между 0 и 1. Неизпълненията и датите на неизпълнение са записаните съгласно валидната към момента на събитието дефиниция за неизпълнение: институциите считат, че е настъпило неизпълнение, съгласно прилаганата от тях към момента на регистриране на събитието дефиниция за неизпълнение. Промените в дефиницията за неизпълнение се разглеждат само за периодите след датата на въвеждането им, т.е. не се използва ретроспективно прилагане на промените в дефиницията за неизпълнение след разглежданото настъпване на неизпълнение (симулация със задна дата).

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0250	Рисково претеглени активи-		Институциите изчисляват и докладват „Рисково претеглени активи-“ за посочените в приложение I, образец 103 портфейли със следния идентификационен код: CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL „Рисково претеглените активи-“ са хипотетичните рисково претеглени активи след коефициентите за подпомагане, получени в резултат на прилагането, за всяка експозиция, на стойностите на „вероятността от неизпълнение-“ вместо стойностите на „вероятността от неизпълнение“ на институцията. Останалите необходими за изчислението параметри не се променят. „Вероятността от неизпълнение-“ се основава на изчисление, което е извършено поотделно за всяка категория длъжници. Използват се категориите длъжници, докладвани в колона 0005 на образец C 08.02 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451 на Комисията (за указания вж. образец C 08.01, колона 0010 и образец C 08.02 от приложение II към същия регламент). За всяка категория длъжници p^{-} е най-малката положителна стойност, която удовлетворява уравнението $$p^{-} + \Phi^{-1}(q) \bullet \sqrt{\frac{p^{-} \bullet (1 - p^{-})}{n}} \geq DR_{1y}$$ където $DR_{1y} > 0$, и $p^{-} = 0$, където $DR_{1y} = 0$. Тук Φ^{-1} = обратната функция на стандартното нормално (кумулативно) разпределение; q = гаранционна вероятност от 90 %; DR_{1y} = претегленият според случаите на неизпълнение процент на неизпълнение през годината, предшестваща референтната дата, т.е. броят на длъжниците, които не са били в неизпълнение и са били разпределени в съответната категория длъжници точно една година преди референтната дата, но са преминали в състояние на неизпълнение през последната година, разделен на броя на длъжниците, които не са били в неизпълнение и са били разпределени в съответната категория длъжници точно една година преди референтната дата; n = броят на длъжниците, които не са били в неизпълнение и са били разпределени в съответната категория длъжници точно една година преди референтната дата. За всеки длъжник „вероятността от неизпълнение-“ е равна на p^{-}, където p^{-} се изчислява в съответствие с посочената в четвърта алинея формула за категорията, към която е причислен длъжникът.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0260	Рисково претеглени активи+		Институциите изчисляват и докладват „рисково претеглени активи+“ за посочените в приложение I, образец 103 портфейли със следния идентификационен код: CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL „Рисково претеглените активи+“ са хипотетичните рисково претеглени активи след коефициентите за подпомагане, получени в резултат на прилагането, за всяка експозиция, на стойностите на „вероятността от неизпълнение+“ вместо стойностите за „вероятността от неизпълнение“ на институцията. Останалите необходими за изчислението параметри не се променят. „Вероятността от неизпълнение+“ се основава на изчисление, което е извършено поотделно за всяка категория длъжници. Използват се категориите длъжници, докладвани в колона 0005 на образец C 08.02 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451 на Комисията (за указания вж. образец C 08.01, колона 0010 и образец C 08.02 от приложение II към същия регламент). За всяка категория длъжници p^+ е най-малката положителна стойност, която удовлетворява уравнението $$p^+ - \Phi^{-1}(q) \bullet \sqrt{\frac{p^+ \bullet (1-p^+)}{n}} \leq DR_{1y}$$ В това уравнение Φ^{-1} = обратната функция на стандартното нормално (кумулативно) разпределение; q = гаранционна вероятност от 90 %; DR_{1y} = претегленият според случаите на неизпълнение процент на неизпълнение през годината, предшестваща референтната дата, т.е. броят на длъжниците, които не са били в неизпълнение и са били разпределени в съответната категория длъжници точно една година преди референтната дата, но са преминали в състояние на неизпълнение през последната година, разделен на броя на длъжниците, които не са били в неизпълнение и са били разпределени в съответната категория длъжници точно една година преди референтната дата; n = броят на длъжниците, които не са били в неизпълнение и са били разпределени в съответната категория длъжници точно една година преди референтната дата. За всеки длъжник „вероятността от неизпълнение+“ е равна на p^+, където p^+ се изчислява в съответствие с посочената в четвърта алинея формула за категорията, към която е причислен длъжникът.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0270	Рисково претеглени активи–		Институциите изчисляват и докладват „рисково претеглени активи–“ за посочените в приложение I, образец 103 портфейли със следния идентификационен код: CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL „Рисково претеглените активи–“ са хипотетичните рисково претеглени активи след коефициентите за подпомагане, получени в резултат на прилагането, за всяка експозиция, на стойностите на „вероятността от неизпълнение–“ вместо стойностите на „вероятността от неизпълнение“ на институцията. Останалите необходими за изчислението параметри не се променят. „Вероятността от неизпълнение–“ се основава на изчисление, което е извършено поотделно за всяка категория длъжници. Използват се категориите длъжници, докладвани в колона 0005 на образец C 08.02 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451 на Комисията (за указания вж. образец C 08.01, колона 0010 и образец C 08.02 от приложение II към същия регламент). За всяка категория длъжници p^{--} е най-малката положителна стойност, която удовлетворява уравнението $$p^{--} + \Phi^{-1}(q) \bullet \sqrt{\frac{p^{--} \bullet (1 - p^{--})}{n}} \geq DR_{5y}$$ където $DR_{5y} > 0$, и $p^{--} = 0$, където $DR_{5y} = 0$ Тук Φ^{-1} = обратната функция на стандартното нормално (кумулативно) разпределение; q = гаранционна вероятност от 90 %; DR_{5y} = процентът на неизпълнение за последните 5 години за категорията длъжник, изчислен като средна стойност от пет едногодишни проценти на неизпълнение, претеглени според случаите на неизпълнение; n = броят на длъжниците, които не са били в неизпълнение и са били разпределени в съответната категория длъжници точно една година преди референтната дата. За всеки длъжник „вероятността от неизпълнение–“ е равна на p^{--}, където p^{--} се изчислява в съответствие с посочената в четвърта алинея формула за категорията, към която е причислен длъжникът.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0280	Рисково претеглени активи++		Институциите изчисляват и докладват „рисково претеглени активи++“ за посочените в приложение I, образец 103 портфейли със следния идентификационен код: CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL „Рисково претеглените активи++“ са хипотетичните рисково претеглени активи след коефициентите за подпомагане, получени в резултат на прилагането, за всяка експозиция, на стойностите на „вероятността от неизпълнение++“ вместо стойностите на „вероятността от неизпълнение“ на институцията. Останалите необходими за изчислението параметри не се променят. „Вероятността от неизпълнение++“ се основава на изчисление, което е извършено поотделно за всяка категория длъжници. Използват се категориите длъжници, докладвани в колона 0005 на образец C 08.02 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451 на Комисията (за указания вж. образец C 08.01, колона 0010 и образец C 08.02 от приложение II към същия регламент). За всяка категория длъжници p^{++} е най-малката положителна стойност, която удовлетворява уравнението $$p^{++} - \Phi^{-1}(q) \bullet \sqrt{\frac{p^{++} \bullet (1 - p^{++})}{n}} \leq DR_{5y}$$ където: Φ^{-1} = обратната функция на стандартното нормално (кумулативно) разпределение; q = гаранционна вероятност от 90 %; DR_{5y} = процентът на неизпълнение за последните 5 години за категорията длъжник, изчислен като средна стойност от пет едногодишни проценти на неизпълнение, претеглени според случаите на неизпълнение; n = броят на длъжниците, които не са били в неизпълнение и са били разпределени в съответната категория длъжници точно една година преди референтната дата. За всеки длъжник „вероятността от неизпълнение++“ е равна на p^{++}, където p^{++} се изчислява в съответствие с посочената в четвърта алинея формула за категорията, към която е причислен длъжникът.

С 105.01 —Дефиниране на вътрешните модели

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0010	Идентификационен код на вътрешния модел		Институцията докладва опредения от компетентния орган идентификационен код на вътрешния модел. Ако такъв не е наличен, институцията посочва определения от нея идентификационен код на вътрешния модел. Идентификационният код на вътрешния модел се отнася единствено до вътрешен модел, одобрен от компетентния орган и използван за изчисляването на рисково претеглените активи. Това е идентификационният номер на съответния ред и е различен за всеки ред в образеца.
0020	Наименование на модела		Посочва се определеното от докладващата институция наименование на вътрешния модел.
0030	Рисков параметър според вътрешнорейтинговия подход		Рисковият параметър според вътрешнорейтинговия подход е един от следните: а) вероятност от неизпълнение; б) загуба при неизпълнение; в) кредитен конверсионен коефициент. При вътрешен модел за експозициите „Предприятия — специализирано кредитиране“ по член 153, параграф 5 от Регламент (ЕС) № 575/2013 („Критерии за разграничаване при специализираното кредитиране“), полето не се попълва или се вписва „NULL“.
0040	Експозиции при неизпълнение	Образец С 08.01, колона 0110 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451	Докладва се съвкупната стойност на обхванатите от дадения модел експозиции.
0050	Среднопретеглен според експозициите при неизпълнение процент на неизпълнение, използван за калибриране		Докладва се среднопретеглената според експозициите при неизпълнение стойност на годишните проценти на неизпълнение, която е използвана за калибрирането на моделите на вероятността от неизпълнение. Тази информация се попълва само за моделите за вероятността от неизпълнение. Посочват се данните, използвани при калибрирането на параметрите на модела. Ако не съществуват вътрешни данни и калибрирането се основава на външни данни, се докладват външните данни.
0060	Среднопретеглен според броя на случаите на неизпълнение процент на неизпълнение, използван за калибриране		Докладва се средната стойност на претеглените според броя на случаите годишни проценти на неизпълнение, използвана за калибрирането на моделите на вероятността от неизпълнение. Тази информация се попълва само за моделите за вероятността от неизпълнение. Посочват се данните, използвани при калибрирането на параметрите на модела. Ако не съществуват вътрешни данни и калибрирането се основава на външни данни, се докладват външните данни.
0070	Вероятност от неизпълнение в дългосрочен план		Докладва се централната тенденция, използвана от институцията при калибрирането на моделите, което включва всички консервативни корекции на среднопретеглената според броя на случаите на неизпълнение стойност на годишните проценти на неизпълнение, използвана за калибрирането на моделите на вероятността от неизпълнение. Тази информация се попълва само за моделите за вероятността от неизпълнение.
0080	Дял на възстановяване при активите в неизпълнение		Процентът на възстановяване при активите в неизпълнение е процентът на активите в неизпълнение, които в 12-месечен срок са си възвърнали статуса „не в неизпълнение“. Институция, която не изчислява проценти на възстановяване за даден модел, трябва да изчисли заместващ показател на процентите на възстановяване в съответствие с предоставената дефиниция. Институцията докладва пред компетентния орган, че използва заместващ показател. Тази информация се попълва само за моделите за загубата при неизпълнение.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0090	Процент на събиране на вземанията при принудително иззетите невъзстановени активи		Докладва се среднопретегленият според броя на случаите на неизпълнение процент на събиране на вземанията при невъзстановените неизпълнения, включени в динамичните редове, които институцията използва, за да калибрира моделите на загубата при неизпълнение при активите, които не са в неизпълнение. Посочват се данните, използвани при калибрирането на параметрите на модела. Ако не съществуват вътрешни данни и калибрирането се основава на външни данни, се докладват външните данни. Институция, която не разполага с конкретен процент на събиране на вземанията по невъзстановени неизпълнения поради неприключила процедура по събирането, изчислява заместващ показател, като вземе предвид наблюдаваните възстановявания и прогнозните оценки за възстановяванията по неприключилите процедури. Институцията докладва пред компетентния орган, че използва заместващ показател. Тази информация се попълва само за моделите за загубата при неизпълнение.
0100	Продължителност на периода на събиране на вземанията при принудително иззетите невъзстановени активи		Докладва се среднопретеглената според броя на случаите на неизпълнение продължителност на периода на събиране на вземанията (от възникването на статус „в неизпълнение“ до крайната дата на процедурите по събиране на вземанията) при невъзстановени неизпълнения, включени в динамичните редове, които институцията използва, за да калибрира моделите на загубата при неизпълнение по отношение на активите, които не са в неизпълнение. Среднопретеглената според броя на случаите на неизпълнение продължителност се изразява в брой дни. Посочват се данните, използвани при калибрирането на параметрите на модела. Ако не съществуват вътрешни данни и калибрирането се основава на външни данни, се докладват външните данни. Институция, която не разполагат с данни за конкретната продължителност на периода на събиране на вземанията при невъзстановените неизпълнения поради неприключила процедура по събирането, трябва да изчисли заместващ показател в съответствие с предоставената дефиниция. Институцията докладва пред компетентния орган, че използва заместващ показател. Тази информация се попълва само за моделите за загубата при неизпълнение.
0110	Съвместно решение	Член 20, параграф 2, буква а) от Регламент (ЕС) № 575/2013;	Институцията докладва дали между консолидиращия компетентен орган и компетентните органи на приемащата държава има взето съвместно решения относно пруденциалните изисквания, що се отнася до разрешението при изчисляването на пруденциалните изисквания за експозициите, държани от дъщерни предприятия на институциите в докладваните сравнителни портфейли, да се използва вътрешнорейтинговият подход.
0120	Консолидиращ надзорник	Член 20 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Посочва се кодът по ISO на държавата на произход на компетентния орган, отговарящ за консолидирания надзор върху институцията, която използва вътрешнорейтингов подход.
0130	Рисково претеглени активи	Образец C 08.01, колона 0260 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451	Докладва се, за обхванатите от дадения рейтингов модел експозиции, съвкупната стойност на рисково претеглените активи след прилагането на коефициентите за подпомагане (на МСП и инфраструктурни проекти).

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0140	Добавки към рисково претеглените активи		Добавките към рисково претеглените активи представляват подпозиция („в т.ч.“) на рисково претеглените активи (колона 0130 на образец C 105.01) и включват: а) евентуалните рисково претеглени активи, които се добавят към рисково претеглените активи в резултат на прилагането на рисковите параметри на модела, дължащи се на допълнителни вътрешни мерки за консервативност, прилагани пряко спрямо рисково претеглените активи; б) евентуалните рисково претеглени активи, които се добавят към рисково претеглените активи в резултат на прилагането на рисковите параметри на модела, дължащи се на надзорни мерки, прилагани пряко спрямо рисково претеглените активи. Стойностите по букви а) и б) не включват мерките, които вече са отразени при вероятността от неизпълнение (колона 0060 от образец C 102 и колона 0060 от образец C 103), КЖК (колона 0100 от образци C 102 и C 103) или загубата при неизпълнение (колона 0130 от образци C 102 и C 103), а само мерките, които се прилагат пряко спрямо рисково претеглените активи и, ако е приложимо, в допълнение към степента на консервативност и надзорните мерки (мултипликатори, добавки, прагове или подобни мерки), които увеличават рисковите параметри. Добавките към рисково претеглените активи не включват ефекта от потенциални мерки по член 458 от Регламент (ЕС) № 575/2013. В случай че институцията не е в състояние да изолира съответните консервативни корекции, се прилага част I, точка 3.

C 105.02 — Разпределяне на вътрешните модели по портфейли

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0010	Идентификационен код на портфейла	Образец C102, колони 0010 и образец C103, колона 0010	Докладва се идентификационният код на портфейла, служещ за еднозначно идентифициране на портфейла съгласно образци C 102 и C 103 от приложение I. Колони 0010 и 0020 формират съставен идентификационен код на реда и трябва заедно да са различни за всеки ред от този образец.
0020	Идентификационен код на вътрешния модел	Образец C 105.01, колона 0010	Посочва се определеният от докладващата институция идентификационен код на вътрешния модел. Колони 0010 и 0020 формират съставен идентификационен код на реда и комбинацията им трябва да е различна за всеки ред от образец C 105.02.
0030	Експозиции при неизпълнение	Образец C 08.01, колона 0110 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451	Докладва се съвкупната стойност на експозициите, включени в портфейла, определен в колона 0010, и обхванати от рейтинговия модел, определен в колона 0020. Когато за всички експозиции в даден портфейл се използва само един модел, стойността на експозицията е същата като докладваната за същия портфейл в колона 0110 съответно на образец C 102 или C 103.
0040	Рисково претеглени активи	Образец C 08.01, колона 0260 от приложение I към Регламент за изпълнение (ЕС) 2021/451	Докладват се съвкупните рисково претеглени активи след коефициенти за подпомагане за експозициите, включени в портфейла, определен в колона 0010, и обхванати от рейтинговия модел, определен в колона 0020. Когато за всички експозиции в даден портфейл се използва само един модел, стойността на рисково претеглените активи е същата като докладваната за същия портфейл в колона 0170 съответно на образец C 102 или C 103.

С 105.03 — Разпределяне на вътрешните модели по държави

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0005	Ред		Този код представлява идентификационният номер на съответния ред и е различен за всеки ред в образеца. Той следва поредността на номерата 1, 2, 3 и т.н.
0010	Идентификационен код на вътрешния модел	Образец C105.01, колона 0010	Посочва се определеният от докладващата институция идентификационен код на вътрешния модел. Когато идентификационният код на даден вътрешен модел е свързан с няколко държави, всяка комбинация от „Идентификационен код на вътрешния модел“ и „Местонахождение на институцията“ се докладва на отделен ред. Колони 0010 и 0020 формират съставен идентификационен номер на реда и комбинацията им трябва да е различна за всеки ред от таблицата.
0020	Местонахождение на институцията	Член 20 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Посочва се кодът по ISO на държавата по местонахождение на всяко дъщерно дружество, в което се докладват експозициите по вътрешнорейтинговия подход за всеки сравнителен портфейл, независимо от наличието на предоставено от надзорника в приемащата държава разрешение за прилагане на вътрешнорейтингов подход.“

ПРИЛОЖЕНИЕ II

„„ПРИЛОЖЕНИЕ V

РЕФЕРЕНТНИ ИНСТРУМЕНТИ И ПОРТФЕЙЛИ ЗА ПАЗАРЕН РИСК

Раздел 1: Указания

Раздел 2: Инструменти

Раздел 3: Индивидуални портфейли — отделен инструмент

Раздел 4: Индивидуални портфейли — няколко инструмента

Раздел 5: Агрегирани портфейли

Раздел 6: Допълнителни спецификации за инструментите

Раздел 7: Портфейли за валидиране по метода за изчисляване на чувствителностите

Раздел 1: Указания

а) За целите на настоящото приложение се прилага следното:

i) „дата на включване“ означава датата и часът, на които институциите включват сделките за целите на сравнителния анализ;

ii) „първоначална пазарна оценка (ППО)“ означава пазарната стойност на инструментите, посочени в раздел 2 от настоящото приложение, към референтната дата и час на ППО;

iii) „референтна дата на ППО“ означава датата и часът, спрямо които институциите определят ППО на сделките в сравнителния портфейл;

iv) „дата за подаване на информация за ППО“ означава датата, до която институциите подават резултатите за ППО на сделките в сравнителния портфейл;

v) „VaR“ (value at risk) означава стойността под риск;

vi) „sVaR“ („stressed VaR“) означава стресираната стойност под риск;

vii) „IRC“ (incremental risk charge) означава капиталовото изискване за допълнителен риск;

viii) „CTP“ (correlation trading portfolio) означава портфейлът за корелационно търгуване;

ix) „APR“ (all price risk) означава показателят за всички ценови рискове, изчислен в съответствие с член 377, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 575/2013;

x) „показатели за измерване на риска“ (RM) означава стойността на VaR, sVaR и при необходимост IRC и APR за портфейлите, както е посочено в раздели 3, 4 и 5 от настоящото приложение, между началната и крайната референтна дата за показателите за измерване на риска;

xi) „начална референтна дата за показателите за измерване на риска“ означава датата, на която институциите започват да изчисляват стойностите на показателите за измерване на риска;

xii) „крайна референтна дата за показателите за измерване на риска“ означава датата, на която институциите спират да изчисляват стойностите на показателите за измерване на риска;

xiii) „дата за подаване на информация за показателите за измерване на риска“ означава датата, до която институциите подават резултатите за показателите за измерване на риска на сделките в сравнителния портфейл;

xiv) „настояща стойност“ (PV) означава пазарната стойност на портфейлите, посочени в раздел 3 от настоящото приложение, към крайната референтна дата за показателите за измерване на риска;

xv) „ATM“ (at the money), т.е. „на пари“, се използва за относителната позиция на текущата или бъдещата цена на базовия актив на деривата спрямо цената на упражняването на този дериват;

xvi) „OTM“ (out of the money), т.е. „извън пари“, се използва за относителната позиция на текущата или бъдещата цена на базовия актив на деривата спрямо цената на упражняването на този дериват;

xvii) „ITM“ (in the money), т.е. „в пари“, се използва за относителната позиция на текущата или бъдещата цена на базовия актив на деривата спрямо цената на упражняването на този дериват;

xviii) „дълга“ означава „закупена“, а „къса“ — „продадена“ позиция;

xix) „CDS“ (credit default swaps) означава суапове за кредитно неизпълнение;

xx) при суаповете за кредитно неизпълнение „дълга“ позиция означава „закупена защита“, а „къса“ – „продадена защита“;

xxi) „млн.“ означава милиони;

xxii) „OTC“ (over-the-counter) означава извънборсова търговия;

xxiii) „ASA“ (alternative standardised approach) означава алтернативният стандартизиран подход, посочен в част трета, дял IV, глава 1a, раздел 1 от Регламент (ЕС) № 575/2013;

xxiv) „SBM“ (sensitivities-based method) означава методът за изчисляване на чувствителностите, посочен в част трета, дял IV, глава 1a, раздел 2 от Регламент (ЕС) № 575/2013;

xxv) „DRC“ (default Risk requirement) означава изискването за риск от неизпълнение, посочено в част трета, дял IV, глава 1a, раздел 5 от Регламент (ЕС) № 575/2013;

xxvi) „RRAO“ (residual risk add-on) означава добавката за остатъчен риск, посочена в част трета, дял IV, глава 1a, раздел 4 от Регламент (ЕС) № 575/2013.

б) За целите на сравнителния анализ се прилагат следните дати:

i) датата на включване е 30 януари 2025 г.;

ii) референтната дата на ППО (и на първоначалното подаване на стойностите по метода за изчисляване на чувствителностите) е 6 февруари 2025 г. (17:30 ч. централноевропейско време);

iii) датата за подаване на информация за ППО (и за първоначалното подаване на стойностите и валидиране по метода за изчисляване на чувствителностите) е 28 февруари 2025 г.;

iv) първоначалната референтна дата за показателите за измерване на риска е 2 юни 2025 г.;

v) крайната референтна дата за показателите за измерване на риска (и за окончателния алтернативен стандартизиран подход) е 13 юни 2025 г.;

vi) датата за подаване на информация за показателите за измерване на риска (и за окончателния алтернативен стандартизиран подход) е 18 юли 2025 г.

в) Освен ако в раздел 2 от настоящото приложение не е изрично посочено друго, всички позиции се включват на датата на включване, посочена в буква б), подточка i) от настоящия раздел. След като позициите бъдат включени, всеки портфейл остава непроменен за срока на сравнителния анализ и се изчислява въз основа на допускането, че докато трае сравнителният анализ, институцията няма да предприеме никакви действия за управление на портфейла по какъвто и да било начин. Освен ако в спецификациите на конкретния инструмент не е изрично посочено друго, цените на упражняване на опционните позиции се определят спрямо цените на базовия актив, наблюдавани при затварянето на пазара на датата на включване.

г) За целите на първоначалната пазарна оценка оценката на всеки инструмент се представя на компетентния по отношение на институцията орган до датата за подаване на информация за ППО. До тази дата институцията представя съпътстваща резултатите обяснителна бележка в съответствие с буква д). По възможност се предоставя ППО, която е в съответствие с оценката на фронт-офиса на институцията. В случай че ППО не се предоставя от нейния фронт-офис, институцията посочва в обяснителната бележка кой е източникът на данни за ППО.

д) Обяснителната бележка, която институциите трябва да представят заедно с ППО, включва всички изброени по-долу елементи за всеки инструмент:

i) рисковите фактори, използвани за изчисляване на ППО на инструмента;

ii) модела на ценообразуване, използван за изчисляване на ППО на инструмента, и описание на този модел на ценообразуване;

iii) рисковите фактори, включени в модела на стойността под риск за инструмента;

iv) рисковите фактори, включени в модела на стойността под риск за инструмента, които представляват също входящи данни за ППО на инструмента;

v) специфичните особености на модела на стойността под риск във връзка с инструмента;

vi) наличните референтни данни за инструмента в използвания от институцията формат;

vii) елементите, посочени в букви з), и), к), м), н), о), х), ц), ш), жж) и кк) от настоящия раздел.

е) За целите на буква д), подточка v) се докладват всички изброени по-долу елементи:

i) кратки описания на моделите на стойността под риск;

ii) приложените методи за преоценка;

iii) функционална форма, прилагана за моделиране на възвръщаемостта (като абсолютни стойности, относителни стойности, други методи);

iv) качествена информация за динамичните редове, използвани за калибриране на модела на стойността под риск във връзка с инструмента (като източник, методология за нормализиране, приложени групи, друга информация, която институциите считат за подходяща за разясняване на представените резултати).

ж) При всяко повторно подаване на данни посочената в буква г) обяснителна бележка се актуализира, за да се отразят промените между подадените данни. Обяснителната бележка съдържа раздел, в който се изброяват всички дати на подаване и причините за повторно подаване.

з) Рисковете на позициите се изчисляват, без да се вземат предвид разходите за финансиране. Когато е приложимо, институциите използват лихвения процент по овърнайт депозитите във валутата на инструмента като сконтов процент. За деривативните инструменти, посочени в раздел 2 от настоящото приложение, се счита, че има споразумение за предоставяне на обезпечение. Когато това не е възможно, съответните причини се посочват в обяснителната бележка по буква г).

и) Кредитният риск от контрагента и рискът от корекция на кредитната оценка (ККО) не се вземат предвид при оценката на рисковете на портфейлите. Когато това не е възможно, съответните причини се посочват в обяснителната бележка по буква г) от настоящия раздел. Институциите докладват случаите, в които в ППО са включени други видове корекции на оценката, като в обяснителната бележка, посочена в буква г) от настоящия раздел, разясняват за всеки финансов инструмент съответната методика и въздействие.

й) За сделките, които включват дълги позиции в суапове за кредитно неизпълнение, институциите приемат, че е платена незабавна предварителна такса за откриване на позицията съгласно пазарните стандарти и конвенции. Датата на падежа за всички суапове за кредитно неизпълнение съответства на конвенционалните тримесечни дати на прекратяване.

к) Допълнителните спецификации, необходими за извършване на изчисленията във връзка с ценообразуването на позициите в суапове за кредитно неизпълнение, следват обичайно използваните пазарни стандарти и конвенции и са разяснени в обяснителната бележка по буква г) от настоящия раздел.

л) Датата на падеж гарантира, че сделката е възможно най-близко до посочения срок до падежа в съответствие с пазарните стандарти и конвенции.

м) По отношение на данните за инструментите, които не са посочени в раздел 2 от настоящото приложение, институциите представят, заедно с резултатите в обяснителната бележка, посочена в буква г) от настоящия раздел, и съответните си допускания, в т.ч. относно конвенцията за отчитане на дните и избора на търгуем и ликвиден инструмент, когато това е позволено.

н) Институциите, които считат, че освен посочените в настоящия раздел съществуват и други допускания, имащи отношение към тълкуването на резултатите от сравнителния анализ, включително относно края на работния ден, изместване на датите за купонните плащания, съпоставяне спрямо индекси и т.н., представят описание на тези допускания в обяснителната бележка по буква г) от настоящия раздел.

о) Обяснителната бележка по буква г) от настоящия раздел съдържа обяснения за рисковете, които не са обхванати от модела за инструментите, посочени в раздел 2 от настоящото приложение.

п) Освен ако изрично не е посочено друго, всички опции трябва да се третират така, сякаш се търгуват извънборсово.

р) При извънборсовите опции се следват стандартните конвенции за отчитане на времето. Срокът до падежа за n-месечна опция е n месеца. Когато опциите изтичат в ден, в който не се провежда търговска сесия, институциите коригират датата на изтичане към съответния работен ден съгласно пазарните стандарти и конвенции.

с) Всички извънборсови опции се третират, както следва:

i) като американски — при капиталови инструменти на едно лице и при стоки;

ii) като европейски — при капиталови индекси, валути и суапции.

т) Всички извънборсови опции се считат за непокрити, т.е. премията трябва да се изключва от първоначалната пазарна оценка.

у) По отношение на портфейлите за корелационно търгуване институциите, на които е позволено да използват модел за всички ценови рискове за тези портфейли, трябва да представят подробна информация за най-важните допускания, пазарни стандарти и конвенции по отношение на посочените в раздел 2 от настоящото приложение инструменти в портфейлите за корелационно търгуване, включително съотношенията за хеджиране, които са изчислили, за да осигурят тяхната неутрална стойност CS01 към датата на включване.

ф) За всеки инструмент се посочва ППО в определената от ЕБО валута на инструмента съгласно раздел 2 от настоящото приложение.

х) За портфейлите, съставени от един или повече инструменти, деноминирани във валути на инструменти на ЕБО, които са различни от валутата на портфейла на ЕБО, полученият резултат трябва да се конвертира в отчетената валута на портфейла на ЕБО, като се използва спот валутният курс на ЕЦБ от съответната дата. Конвертираният резултат се обяснява в обяснителната бележка по буква г) от настоящия раздел.

ц) При включването на позиции институциите спазват съответните пазарни конвенции, освен ако не е посочено друго в инструкциите в описанията на инструментите (раздел 2 от настоящото приложение).

ч) Когато даден инструмент или базов инструмент на дериват е обект на корпоративно действие, което касае сравнителния анализ, например изкупуване от страна на емитента, неизпълнение или други подобно действие, институцията изключва този инструмент от анализа, заедно с всички свързани с него суапове за кредитно неизпълнение или опции.

ш) По отношение на серията на индекса, „най-актуална“ означава най-ликвидната и търгуема серия от конкретния индекс, налична на пазара. В придружаващата обяснителна бележка по буква г) от настоящия раздел институциите обясняват избора си на „най-актуална“ серия заедно със съответните резултати.

щ) При осчетоводяването на посочените в раздел 2 от настоящото приложение инструменти институциите прилагат за лихвения процент Регламента на ЕС за бенчмарковете, ако не е посочено друго. Институциите посочват прилагания лихвен процент, освен посочените в раздел 2 от настоящото приложение, в обяснителната бележка, посочена в буква г) от настоящите указания.

аа) Показателите за измерване на риска за портфейлите, посочени в раздели 3, 4 и 5, заедно с настоящата стойност, се изчисляват от „началната референтна дата за показателите за измерване на риска“ до „крайната референтна дата за показателите за измерване на риска“. Показателите за измерване на риска по алтернативния стандартизиран подход съгласно ОПТП (SBM, DRC и RRAO) се прилагат по отношение на „крайната референтна дата за показателите за измерване на риска“. Институциите представят резултатите от тези изчисления на своя компетентен орган до датата за подаване на информация за показателите за измерване на риска. За всеки инструмент се докладват ППО и методът за изчисляване на чувствителностите. За всеки портфейл, както индивидуален, така и агрегиран, се докладват показателите за измерване на риска, SBM, DRC, RRAO и настоящата стойност, когато е приложимо. Когато е приложимо, SBM, DRC и RRAO се докладват най-малко за същите портфейли, за които се докладват показателите за измерване на риска.

бб) За портфейлите, посочени в раздел 7, институциите докладват резултатите от SBM и ги подават в съответствие с датите за докладване на подаването на ППО.

вв) Само институциите, на които е било разрешено моделирането на специфичния риск по дългови инструменти, докладват портфейлите с кредитен спред. За лихвените портфейли, които включват риск като част от определени инструменти, индивидуалните и агрегираните портфейли се моделират от институциите, на които е било разрешено моделирането на общия лихвен риск, както и от институциите, на които е било разрешено моделирането на общия и специфичния лихвен риск.

гг) Резултатите за индивидуалните и за агрегираните портфейли се представят само когато се представят и резултатите от инструментите, които са включени в тях.

дд) В раздел 2 от настоящото приложение (Инструменти) година „T“ означава 2025 г., а година „T+X“ означава „2025 г. +X“ , като X е посочено в раздел 2.

ее) В раздел 2 от настоящото приложение (Инструменти) институциите определят деня на изтичане/падеж в съответствие със следните указания:

i) използва се конкретната дата, която е посочена;

ii) когато не е посочена дата, се използват действащите общоприети пазарни практики. Ако например е общоприета пазарна практика денят на изтичане/падеж да е 3-тият петък на месеца, тогава „юни в година T“ означава 3-тият петък на този месец в година T;

iii) краят на месеца (когато е посочено „краят на“) означава последният календарен ден от месеца;

iv) за фиксиран период от време след „датата на включване“, ако периодът е определен като брой дни, това е последният ден от този период. Ако периодът е определен в седмици, месеци или години, това е същият ден на следващата седмица, месец или година спрямо датата на включване или, ако последният месец или година от периода е по-кратък, последният ден от този месец или година; ако „датата на включване + период x“ е почивен ден, се избира следващият работен ден.

v) Ако не е посочено друго, се използват следните допускания: конвенция за отчитане на дните: „ACT/360“, календар на неработните дни: „Target2“.

жж) Освен ако изрично не е посочено друго, за всички суапове за кредитно неизпълнение в раздел 2 от настоящото приложение (Инструменти) се прилагат следните изисквания:

i) Честота на купона: тримесечна;

ii) Купон (базисни пункта): 100;

iii) Отчитане на дните: ACT/360;

iv) Година на определенията на ISDA: 2014;

v) Клауза за преструктуриране: модифицирано-модифицирано преструктуриране (Modified-Modified Restructuring/MMR);

vi) Падеж: декември година T+4;

vii) Вид дълг: първостепенен;

viii) Срок до падежа: 5 години;

ix) Началната дата е датата на включване;

x) Използваните сконтова крива и процент на събиране на вземанията се обясняват в обяснителната бележка по буква г) от настоящото приложение.

зз) ППО на облигационните инструменти включва начислената лихва.

ии) Институциите предоставят информацията, свързана с момента на определяне на настоящата стойност, като посочват времето в обяснителната бележка по буква г) от настоящия раздел. Когато е възможно, настоящата стойност се изчислява към края на работния ден.

йй) Показателите за измерване на риска на портфейлите се изчисляват в същата валута като валутата на портфейла, без да се включва валутният риск, също и във връзка с отчетната валута на институциите. Валутният риск се взима предвид само когато е вътрешноприсъщ на инструментите. Когато за стойностите по алтернативния стандартизиран подход се докладват резултати от анализа както в отчетната валута, така и във валутата на портфейла, резултатите, изчислени в отчетната валута на институцията, се преизчисляват във валутата на портфейла на ЕБО чрез спот конвертиране, като се използва спот валутният курс на ЕЦБ от датата на изчислението. Преизчисляването във валутата на портфейла на ЕБО не предполага промяна на валутните рискови фактори.

кк) Когато се прилага член 325p, параграф 7 от Регламент (ЕС) № 575/2013 („подход на основната валута“), при извършване на изчисленията и докладване на чувствителностите по SBM институциите вземат предвид валутните рискови фактори, произтичащи от прилагането на подхода на основната валута. Стойности не се докладват в избраната основна валута, а в отчетната валута на институцията чрез спот конвертиране, като се използва спот валутният курс на ЕЦБ от съответната дата.

Раздел 2: Инструменти

Институциите предоставят ППО в съответствие с указанията в раздел 1 от настоящото приложение за следните финансови инструменти, за които институциите предоставят мерки за измерване на риска и настоящата стойност на портфейлите, посочени в раздели 3 и 4:

КАПИТАЛОВИ ИНСТРУМЕНТИ

101. Дълга позиция от фючърси, индекс EURO STOXX 50 (Код: FESX).

Условна стойност: стойността на индекса, умножена по 1 000 EUR

Фондова борса: Eurex

Дата на изтичане на срока: юни година T

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

102. Дълга позиция от акции, 10 000 BAYER (Код: BAYN GR).

Фондова борса: Xetra

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

103. Къса позиция от фючърси, BAYER (Код: BAYN GR).

Условна стойност: стойността на 10 000 акции от базовия актив

Фондова борса: Eurex

Дата на изтичане на срока: юни година T

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

104. Къса позиция от фючърси, STELLANTIS (Код: STLA FP).

Условна стойност: стойността на 10 000 акции от базовия актив

Фондова борса: Euronext

Дата на изтичане на срока: юни година T

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

105. Къса позиция от фючърси, ALLIANZ (Код: ALV GR).

Условна стойност: стойността на 10 000 акции от базовия актив

Фондова борса: Eurex

Дата на изтичане на срока: юни година T

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

106. Къса позиция от фючърси, BARCLAYS (Код: BARC LN).

Условна стойност: стойността на 10 000 акции от базовия актив

Фондова борса: Eurex

Дата на изтичане на срока: юни година T

Валута на инструмента на ЕБО: GBP

107. Къса позиция от фючърси, DEUTSCHE BANK (Код: DBK GR).

Условна стойност: стойността на 10 000 акции от базовия актив

Фондова борса: Eurex

Дата на изтичане на срока: юни година T

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

108. Къса позиция от фючърси, CRÉDIT AGRICOLE (Код: ACA FP).

Условна стойност: стойността на 10 000 акции от базовия актив

Фондова борса: Euronext

Дата на изтичане на срока: юни година T

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

109. Дълга позиция кол опции. Базов инструмент BAYER (Код: BAYN GR), ATM (1 договор = 100 акции).

Условна стойност: стойността на 10 000 акции от базовия актив

Дата на изтичане на срока: юни година T

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

110. Къса позиция кол опции. Базов инструмент BAYER (Код: BAYN GR), ATM (1 договор = 100 акции).

Условна стойност: стойността на 10 000 акции от базовия актив

Дата на изтичане на срока: декември година T

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

111. Дълга позиция кол опции. Базов инструмент PFIZER (Код: PFE US), 10 % OTM (1 договор = 100 акции).

Условна стойност: стойността на 10 000 акции от базовия актив

Дата на изтичане на срока: юни година T

Валута на инструмента на ЕБО: USD

112. Дълга позиция пут опции. Базов инструмент PFIZER (Код: PFE US), 10 % OTM (1 договор = 100 акции).

Условна стойност: стойността на 10 000 акции от базовия актив

Дата на изтичане на срока: юни година T

Валута на инструмента на ЕБО: USD

113. Дълга позиция кол опции. Базов инструмент BAYER (Код: BAYN GR), 10 % OTM (1 договор = 100 акции).

Условна стойност: стойността на 10 000 акции от базовия актив

Дата на изтичане на срока: декември година T

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

114. Къса позиция кол опции. Базов инструмент BAYER (Код: BAYN GR), 10 % OTM (1 договор = 100 акции).

Условна стойност: стойността на 10 000 акции от базовия актив

Дата на изтичане на срока: юни година T

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

115. Дълга позиция кол опции. Базов инструмент AVIVA (Код: AV/LN), 10 % OTM (1 договор = 100 акции).

Условна стойност: стойността на 10 000 акции от базовия актив

Дата на изтичане на срока: декември година T

Валута на инструмента на ЕБО: GBP

116. Дълга позиция пут опции. Базов инструмент AVIVA (Код: AV/LN), 10 % OTM (1 договор = 100 акции).

Условна стойност: стойността на 10 000 акции от базовия актив

Дата на изтичане на срока: декември година T

Валута на инструмента на ЕБО: GBP

117. Къса позиция фючърси, NIKKEI 225 (Код NKY).

Условна стойност: стойността на индекса, умножена по 20 000 JPY

Фондова борса: CME

Дата на изтичане на срока: юни година T

Валута на инструмента на ЕБО: JPY

118. Капиталов продукт с автоматично обратно изкупуване.

Дълга позиция

Включване на „датата на включване“

Условна стойност („капитал“): 1 000 000 EUR

Базов инструмент: Индекс EURO STOXX 50 (Код: SX5E)

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

Падеж: 5 години

Годишно изплащане и годишно наблюдение („Дата на включване + 1 година“, „Дата на включване + 2 години“, „Дата на включване + 3 години“, „Дата на включване + 4 години“, „Дата на включване + 5 години“). Изплащането се извършва 10 дни след референтната дата.

Купон: 6 %

Равнище на автоматично обратно изкупуване („първоначална стойност“): Дата на включване в края на деня + 1 месец

Бариерното купонно плащане е 60 % от равнището на автоматичното обратно изкупуване.

Защитна бариера: 55 % от равнището на автоматичното обратно изкупуване

— Капиталът не е гарантиран, ако индексът е под защитната бариера (възвърнат през 5-тата година капитал ще бъде пропорционален, когато равнището е под защитната бариера: например, ако SX5E = 40 % от първоначалното си равнище, тогава възвърнатият капитал е 40 %);

— ако SX5E ≥ 60 % (бариерен купон) от първоначалната стойност в края на която и да е година, тогава изплатеният купон е 6 %;

— ако SX5E ≥ 100 % от първоначалната стойност в края на която и да е година, тогава продуктът се изкупува обратно и изплатената сума е купонът плюс капиталът (100 %);

— ако SX5E < 60 % (бариерен купон) от първоначалната стойност в края на която и да е година, тогава не се изплаща купон;

— ако SX5E < 55 % (защитна бариера) от първоначалната стойност в края на 5-тата година, тогава капиталът се изплаща пропорционално. Или ако SX5E >= 55 % (защитна бариера) от първоначалната стойност в края на 5-тата година, тогава капиталът се изплаща изцяло.

119. Дълга позиция кол опции. Базов инструмент индекс EURO STOXX 50 (Код: SX5E), ATM.

Условна стойност: стойността на индекса, умножена по 1 000 EUR

Дата на изтичане на срока: юни година T

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

120. Дълга позиция кол опции. Базов инструмент индекс EURO STOXX 600 (Код: SXXP), ATM.

Условна стойност: стойността на индекса, умножена по 10 000 EUR

Дата на изтичане на срока: юни година T

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

121. Дълга позиция кол опции. Базов инструмент VIX (CBOE), ATM.

Условна стойност: стойността на индекса, умножена по 100 000 USD

Дата на изтичане на срока: юни година T

Валута на инструмента на ЕБО: USD

ЛИХВЕН ПРОЦЕНТ

201. 5-годишен лихвен суап в евро — получава се фиксиран лихвен процент и се плаща плаващ лихвен процент.

Компонент с фиксиран лихвен процент: получава се годишно

Плаващ лихвен процент: 6-месечен EURIBOR, плаща се два пъти годишно Отчитане на дните: ACT/360

Условна стойност: 10 000 000 EUR

Конвенция за изместване на датите и календар: стандартни

Началната дата е датата на включване (т.е. трябва да се използват лихвените проценти, които са били в сила при затварянето на пазара на датата на включване).

Падеж: септември година T+4.

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

202. 2-годишна суапция в евро върху 5-годишен лихвен суап в евро — плаща се фиксиран лихвен процент и се получава плаващ лихвен процент.

Условна стойност: 10 000 000 EUR.

Институцията е продавачът на опцията върху суапа. Контрагентът на институцията купува правото да сключи договор за суап с институцията; ако упражни правото си, контрагентът получава фиксирания лихвен процент, а институцията — плаващия лихвен процент.

Суапция с двегодишен падеж (дата на включване + 2 години) върху лихвен суап, определен, както следва: Фиксиран компонент – плаща се годишно; Плаващ лихвен процент: 6-месечен EURIBOR, плаща се два пъти годишно Условна стойност: 10 000 000 EUR; Конвенция за изместване на датите и календар: стандартни; Начална дата сила на базисния суап: Дата на включване + 2 години.

Падеж на базисния суап: Дата на включване + 7 години

Премията се изплаща на датата на включване (дата на включване). Уреждане с парично плащане

Цената на упражняване се основава на курс ATM на суапа с форуърдно начало, определен по този инструмент

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

203. Петгодишен лихвен суап в USD. Получава се фиксиран лихвен процент и се плаща плаващ лихвен процент.

Фиксиран лихвен процент: получава се годишно

Плаващ лихвен процент: 3-месечен USD SOFR, изплаща се на тримесечие

Условна стойност: 1 000 000 USD

Конвенция за изместване на датите и календар: стандартни

Началната дата е датата на включване (т.е. трябва да се използват лихвените проценти, които са били в сила при затварянето на пазара на датата на включване).

Дата на падежа: септември година T+4.

Валута на инструмента на ЕБО: USD

204. Двегодишен лихвен суап в GBP. Получава се фиксиран лихвен процент и се плаща плаващ лихвен процент.

Фиксиран лихвен процент: получава се годишно

Плаващ лихвен процент: SONIA (овърнайт) лихвен процент, натрупан и плащан на тримесечие. Отчитане на дните: ACT/365

Условна стойност: 10 000 000 GBP

Конвенция за изместване на датите и календар: стандартни

Началната дата е датата на включване (т.е. трябва да се използват лихвените проценти, които са били в сила при затварянето на пазара на датата на включване).

Падеж: Дата на включване + 2 години

Валута на инструмента на ЕБО: GBP

205. Облигация с плаващ лихвен процент и 10-годишен лихвен диапазон (collar), продавана от UBS.

Условна сума (главница): 1 000 000 USD.

Облигациите с плаващ лихвен процент („облигациите“) са първостепенни необезпечени задължения на UBS AG (UBS).

Валута на инструмента на ЕБО: USD

— Облигациите носят годишна лихва в размер на тримесечния SOFR в USD плюс 1,5 % годишно („плаващ лихвен процент“), при максимален лихвен процент от 7,5 % годишно („горна лихвена граница“) и минимален лихвен процент от 2,5 % годишно („долна лихвена граница“).

— Всяко плащане по облигациите, включително лихвите и главницата на падежа, зависи от кредитоспособността на UBS AG. От институциите се изисква да използват подходяща крива на дисконтиране, като това е обосновано в обяснителната бележка.

— Доход: По облигациите ще се изплаща на тримесечна база лихва в размер на плаващия лихвен процент, при условие че, ако на дадена дата за определяне на купона: i) плаващият лихвен процент е под долната граница, тогава приложимият лихвен процент за съответния лихвен период ще бъде равен на долната лихвена граница, или ii) плаващият лихвен процент е над горната граница, тогава приложимият лихвен процент за съответния лихвен период ще бъде равен на горната лихвена граница.

Размер на лихвеното плащане	Размерът на лихвата, която следва да се заплаща по облигациите за даден лихвен период, е равен на произведението на: размера на главницата по облигациите, б) приложимия лихвен процент за този лихвен период и в) дроб с числител — броя на дните на лихвения период (изчислени при година с 360 дни и 12 месеца по 30 дни), и знаменател 360.
Дата на сделката и дата на сетълмента	„Дата на включване“
Дати на лихвеното плащане	На тримесечие — на датата на включване + 3 месеца, датата на включване + 6 месеца, датата на включване + 9 месеца и датата на включване + 1 година, като се започва от датата на включване + 3 месеца, по време на срока на облигациите (подлежи на коригиране съгласно предвиденото).
Дата на падеж	Дата на включване + 10 години
Валута	USD
Конвенция за отчитане на дните	30/360
Конвенция за работните дни	Following Unadjusted (първи следващ, без изместване)
Определяне на купона	За всеки лихвен период това е вторият работен ден за банките в Лондон, предшестващ непосредствено съответната дата за плащане на лихвата.
Дата	„Работен ден за банките в Лондон“ (London Banking Day) е всеки ден, на който търговските банки в Лондон извършват обичайната си дейност (включително сделки в чуждестранна валута и депозити в чуждестранна валута) и на който на Лондонския междубанков пазар се осъществяват сделки в щатски долари.

206. Дълга позиция GERMANY GOVT (Inflation) 1 000 000 EUR (ISIN DE0001030583).

Падеж: 15 април 2033 г.

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

207. Къса позиция GERMANY GOVT 1 000 000 EUR (ISIN DE0001030708)

Падеж: 15 август 2030 г.

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

208. Дълга позиция ITALY GOVT (Inflation) 1 000 000 EUR (ISIN IT0005138828)

Падеж: 15 септември2032 г.

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

209. Дълга позиция ITALY GOVT 1 000 000 EUR (ISIN IT0005340929)

Падеж: 1 декември 2028 г.

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

210. Дълга позиция SPAIN GOVT 1 000 000 EUR (ISIN ES00000127A2)

Падеж: 30 юли2030 г.

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

211. Къса позиция FRANCE GOVT 1 000 000 EUR (ISIN FR0012993103)

Падеж: 25 май2031 г.

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

212. Къса позиция GERMANY GOVT 1 000 000 EUR (ISIN DE0001135176)

Падеж: 4 януари2031 г.

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

213. Дълга позиция UNITED KINGDOM GOVT 1 000 000 GBP (ISIN GB0004893086)

Падеж: 7 юни2032 г.

Валута на инструмента на ЕБО: GBP

214. Дълга позиция PORTUGAL GOVT 1 000 000 EUR (ISIN PTOTEXOE0024)

Падеж: 15 юни2029 г.

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

215. Къса позиция UNITED STATES GOVT 1 000 000 USD (ISIN US91282CAV37)

Падеж: 15 ноември 2030 г.

Валута на инструмента на ЕБО: USD

216. Дълга позиция BRAZIL GOVT (с право на обратно изкупуване) 1 000 000 USD (ISIN US105756BZ27)

Падеж: 13 януари2028 г.

Валута на инструмента на ЕБО: USD

217. Дълга позиция MEXICO GOVT (с право на обратно изкупуване) 1 000 000 USD (ISIN US91087BAT70)

Падеж: 19 май 2033 г.

Валута на инструмента на ЕБО: USD

218. 10-годишен лихвен суап в EUR — получава се плаващ лихвен процент и се плаща фиксиран лихвен процент.

Компонент с фиксиран лихвен процент: плаща се годишно

Плаващ лихвен процент: 3-месечен EURIBOR – получава се на тримесечие. Отчитане на дните: ACT/360

Условна стойност: 10 000 000 EUR

Конвенция за изместване на датите и календар: стандартни

Началната дата е датата на включване в търговския портфейл (т.е. трябва да се използват лихвените проценти, които са били в сила при затварянето на пазара на датата на включване).

Падеж: Дата на включване + 10 години

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

219. 5-годишен лихвен суап в EUR — получава се плаващ лихвен процент и се плаща фиксиран лихвен процент.

Компонент с фиксиран лихвен процент: плаща се годишно

Плаващ лихвен процент: 6 -месечен EURIBOR, получава се на всеки 6 месеца Отчитане на дните: ACT/360

Условна стойност: 10 000 000 EUR

Конвенция за изместване на датите и календар: стандартни

Началната дата е датата на включване в търговския портфейл (т.е. трябва да се използват лихвените проценти, които са били в сила при затварянето на пазара на датата на включване).

Падеж: Дата на включване + 5 години

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

220. Петгодишен кръстосан валутен суап EUR/USD по пазарна стойност. Получават се USD и се плащат EUR.

EUR: 3-месечен ESTER, плаща се тримесечен съставен процент със забавяне на плащането от 2 дни Отчитане на дните: ACT/360

USD: 3-месечен SOFR, получава се тримесечен съставен процент със забавяне на плащането от 2 дни Отчитане на дните: ACT/360

Рамо 1 – USD: Условна стойност: еквивалент от 10 000 000 EUR, коригирана на тримесечие

Рамо 2 – EUR: Условна стойност: 10 000 000 EUR

Конвенция за изместване на датите и календар: стандартни

Началната дата е датата на включване в търговския портфейл + 6 месеца

Падеж: Дата на включване + 5,5 години

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

Вж. също раздел 6 от настоящото приложение – Допълнителни спецификации за инструменти

221. 10-годишен лихвен суап в EUR — получава се ESTER и се плаща EURIBOR.

Рамо ESTER: получава се ежегодно. Отчитане на дните: ACT/360

Рамо EURIBOR: 3-месечен EURIBOR + база, плаща се на тримесечие Отчитане на дните: ACT/360

Условна стойност: 10 000 000 EUR

Конвенция за изместване на датите и календар: стандартни

Началната дата е датата на включване (т.е. трябва да се използват лихвените проценти, които са били в сила при затварянето на пазара на датата на включване).

Падеж: септември година T + 9 години

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

222. Дълга позиция ITALY GOVT (Inflation) 1 000 000 EUR (ISIN IT0005387052)

Падеж: 15 май 2030 г.

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

223. 5-годишен суап в евро с нулев купон за инфлация – получава се индексирана с инфлацията доходност и се плаща фиксиран лихвен процент (r).

Индекс на инфлацията: ИПЦ (HICPxT)

Фиксиран компонент (плаща се фиксиран лихвен процент): $[(1+r)^5 - 1]$

Получава се индексирана с инфлацията доходност: $\left[\left(\frac{CPI \text{ at the end (maturity) date}}{CPI \text{ at the start date}}\right) - 1\right]$

Условна стойност: 10 000 000 EUR

Дата за определяне на базата: юни година T-1

Окончателно фиксиране: август година T+4

Падеж: септември година T+4.

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

224. Двугодишна суапция в евро върху 5-годишен лихвен суап в евро — получава се фиксиран лихвен процент и се плаща плаващ лихвен процент

Условна стойност: 10 000 000 EUR.

Институцията е продавачът на опцията върху суапа. Контрагентът на институцията купува правото да сключи договор за суап с институцията; ако упражни правото си, контрагентът получава плаващия лихвен процент, а институцията — фиксирания лихвен процент.

Суапция с двегодишен падеж (дата на включване + 2 години) върху лихвен суап, определен, както следва: Фиксиран компонент – получава се годишно; Плаващ лихвен процент: 6 -месечен EURIBOR – плаща се на всеки 6 месеца; Условна стойност: 10 000 000 EUR; Конвенция за изместване на датите и календар: стандартни; Начална дата сила на базисния суап: Дата на включване + 2 години.

Падеж на базисния суап: Дата на включване + 7 години

Премията се изплаща на датата на включване (дата на включване). Уреждане с парично плащане

Цената на упражняване се основава на курс ATM на суапа с форуърдно начало, определен по този инструмент, + 100 базисни пункта

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

ВАЛУТНИ СДЕЛКИ (FX)

301. 6-месечен форуърд USD/EUR. Уреждане с парично плащане. Дълга позиция в USD – къса позиция в EUR; Условна стойност: 10 000 000 USD; Форуърдна цена на упражняване: равна на 100 % от съответния спот референтен лихвен процент на ЕЦБ към края на датата на включване.

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

302. 6-месечен форуърд EUR/GBP. Уреждане с парично плащане. Дълга позиция в EUR — къса позиция в GBP; условна стойност 10 000 000 GBP; Форуърдна цена на упражняване: равна на 100 % от съответния спот референтен лихвен процент на ЕЦБ към края на датата на включване.

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

303. Дълга парична позиция 10 000 000 USD.

Парична позиция. Счита се, че е с присъщ валутен риск, както е описано в буква кк)

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

304. Дълга кол опция EUR/USD (дълга позиция в EUR, къса позиция в USD). Уреждане с парично плащане. Условна стойност: 10 000 000 EUR. Еквивалентна сума въз основа на референтния спот курс EUR/USD на ЕЦБ към края на датата на включване в търговския портфейл.

Цена на упражняване: 110 % от референтния курс EUR/USD на ЕЦБ към края на датата на включване.

Дата на изтичане на срока: Дата на включване + 1 година

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

305. Дълга кол опция EUR/USD (дълга позиция в EUR, къса позиция в USD). Уреждане с парично плащане. Условна стойност: 10 000 000 EUR. Еквивалентна сума въз основа на референтния спот курс EUR/USD на ЕЦБ към края на датата на включване в търговския портфейл.

Цена на упражняване: 90 % от референтния курс EUR/USD на ЕЦБ към края на датата на включване.

Дата на изтичане на срока: Дата на включване + 1 година

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

306. Къса кол опция EUR/USD (къса позиция в EUR, дълга позиция в USD). Уреждане с парично плащане. Условна стойност: 10 000 000 EUR. Еквивалентна сума въз основа на референтния спот курс EUR/USD на ЕЦБ към края на датата на включване в търговския портфейл.

Цена на упражняване: 100 % от референтния курс EUR/USD на ЕЦБ към края на датата на включване.

Дата на изтичане на срока: Дата на включване + 1 година

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

307. Къса кол опция EUR/GBP (къса позиция в EUR, дълга позиция в GBP). Уреждане с парично плащане. Условна стойност: 10 000 000 EUR. Еквивалентна сума въз основа на референтния спот курс EUR/GBP на ЕЦБ към края на датата на включване в търговския портфейл.

Цена на упражняване: 110 % от референтния курс EUR/GBP на ЕЦБ към края на датата на включване.

Дата на изтичане на срока: Дата на включване + 1 година

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

308. Дълга пут опция EUR/JPY (къса позиция в EUR, дълга позиция в JPY). Уреждане с парично плащане. Условна стойност: 10 000 000 EUR. Еквивалентна сума въз основа на референтния спот курс EUR/JPY на ЕЦБ към края на датата на включване в търговския портфейл.

Цена на упражняване: 110 % от референтния курс EUR/JPY на ЕЦБ към края на датата на включване.

Дата на изтичане на срока: Дата на включване + 1 година

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

309. Къса пут опция EUR/AUD (дълга позиция в EUR, къса позиция в AUD). Уреждане с парично плащане. Условна стойност: 10 000 000 EUR. Еквивалентна сума въз основа на референтния спот курс EUR/AUD на ЕЦБ към края на датата на включване в търговския портфейл.

Цена на упражняване: 110 % от референтния курс EUR/AUD на ЕЦБ към края на датата на включване.

Дата на изтичане на срока: Дата на включване + 1 година

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

310. 6-месечен форуърд EUR/DKK (дълга позиция в EUR, къса позиция в DKK). Уреждане с парично плащане. Условна стойност: 10 000 000 EUR; Референтният спот курс EUR/DKK на ЕЦБ към края на датата на включване, за да се определи форуърдният лихвен процент.

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

311. 6-месечен форуърд без доставка EUR/BRL (дълга позиция в EUR, къса позиция в BRL). Условна стойност: 10 000 000 EUR; Референтният спот курс EUR/BRL на ЕЦБ към края на датата на включване, за да се определи форуърдният лихвен процент.

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

СТОКИ

401. Дълъг 6-месечен форуърд
3 500 тройунции London Gold (дълга позиция в злато, къса позиция в USD). Уреждане с парично плащане. Цена на упражняване: 6-месечна форуърдна цена към края на деня на датата на включване

Валута на инструмента на ЕБО: USD

402. Къс 12-месечен форуърд 3 500 тройунции London Gold (къса позиция в злато, дълга позиция в USD). Уреждане с парично плащане. Цена на упражняване: 12-месечна форуърдна цена към края на деня на датата на включване

Валута на инструмента на ЕБО: USD

403. Дълга кол опция 30 000 барела Brent Crude Oil (дълга позиция в WTI, къса позиция в USD). Уреждане с парично плащане. Цена на упражняване: 12-месечна форуърдна цена към края на деня на датата на включване. Дата на изтичане на срока: дата на включване + 6 месеца

Валута на инструмента на ЕБО: USD

404. Къса пут опция 30 000 барела Brent Crude Oil (дълга позиция в WTI, къса позиция в USD). Уреждане с парично плащане. Цена на упражняване: 12-месечна форуърдна цена към края на деня на датата на включване. Дата на изтичане на срока: дата на включване + 6 месеца

Валута на инструмента на ЕБО: USD

405. Дълга кол опция 5 000 тройунции London Gold (дълга позиция в злато, къса позиция в USD). Уреждане с парично плащане. Цена на упражняване: 18-месечна форуърдна цена към края на деня на датата на включване. Дата на изтичане на срока: дата на включване + 18 месеца

Валута на инструмента на ЕБО: USD

КРЕДИТЕН СПРЕД

501. Дълга позиция (т.е. купува се защита) от 1 000 000 USD в суапове за кредитно неизпълнение върху задължения на ПОРТУГАЛИЯ.

Клауза за преструктуриране: ПЪЛНО

Валута на инструмента на ЕБО: USD

502. Дълга позиция (т.е. купува се защита) от 1 000 000 USD в суапове за кредитно неизпълнение върху задължения на ИТАЛИЯ.

Клауза за преструктуриране: ПЪЛНО

Валута на инструмента на ЕБО: USD

503. Къса позиция (т.е. продава се защита) от 1 000 000 USD в суапове за кредитно неизпълнение върху задължения на ИСПАНИЯ.

Клауза за преструктуриране: ПЪЛНО

Валута на инструмента на ЕБО: USD

504. Дълга позиция (т.е. купува се защита) от 1 000 000 USD в суапове за кредитно неизпълнение върху задължения на МЕКСИКО.

Клауза за преструктуриране: ПЪЛНО

Валута на инструмента на ЕБО: USD

505. Дълга позиция (т.е. купува се защита) от 1 000 000 USD в суапове за кредитно неизпълнение върху задължения на БРАЗИЛИЯ.

Клауза за преструктуриране: ПЪЛНО

Валута на инструмента на ЕБО: USD

506. Дълга позиция (т.е. купува се защита) от 1 000 000 USD в суапове за кредитно неизпълнение върху задължения на ОБЕДИНЕНОТО КРАЛСТВО.

Клауза за преструктуриране: ПЪЛНО

Валута на инструмента на ЕБО: USD

507. Къса позиция (т.е. продава се защита) от 1 000 000 EUR в суапове за кредитно неизпълнение върху задължения на Telefonica (код: TEF SM).

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

508. Дълга позиция (т.е. купува се защита) от 1 000 000 EUR в суапове за кредитно неизпълнение върху задължения на Telefonica (код: TEF SM).

Падеж: декември година T+2

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

509. Къса позиция (т.е. продава се защита) от 1 000 000 EUR в суапове за кредитно неизпълнение върху задължения на Aviva (код: AV LN).

Година на определенията на ISDA: 2003 г.

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

510. Дълга позиция (т.е. купува се защита) от 1 000 000 EUR в суапове за кредитно неизпълнение върху задължения на Aviva (код: AV LN).

Година на определенията на ISDA: 2003 г.

Падеж: декември година T+2

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

511. Къса позиция (т.е. продава се защита) от 1 000 000 EUR в суапове за кредитно неизпълнение върху задължения на Vodafone (код: VOD LN).

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

512. Къса позиция (т.е. продава се защита) от 1 000 000 EUR в суапове за кредитно неизпълнение върху задължения на ENI SpA (код: ENI IM).

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

513. Къса позиция (т.е. продава се защита) от 1 000 000 USD в суапове за кредитно неизпълнение върху задължения на Eli Lilly (код: LLY US).

Клауза за преструктуриране: Без преструктуриране (XR14)

Валута на инструмента на ЕБО: USD

514. Къса позиция (т.е. продава се защита) от 1 000 000 EUR в суапове за кредитно неизпълнение върху задължения на Unilever (код: UNA NA).

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

515. Дълга позиция (т.е. купува се защита) от 1 000 000 EUR в суапове за кредитно неизпълнение върху задължения на Total SA (код: FP FP).

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

516. Дълга позиция (т.е. купува се защита) от 1 000 000 EUR в суапове за кредитно неизпълнение върху задължения на Volkswagen Group (код: VOW GR).

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

517. Дълга позиция от 1 000 000 USD в държавни ценни книжа на ТУРЦИЯ (ISIN US900123CT57).

Падеж: 26 април 2029 г.

Валута на инструмента на ЕБО: USD

518. Дълга позиция (т.е. купува се защита) от 1 000 000 USD в суапове за кредитно неизпълнение върху задължения на ТУРЦИЯ. Началната дата е датата на включване в търговския портфейл.

Клауза за преструктуриране: ПЪЛНО

Валута на инструмента на ЕБО: USD

519. Дълга позиция от 1 000 000 EUR в облигации на Telefonica (ISIN XS1681521081).

Падеж: 12 януари2028 г.

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

520. Дълга позиция от 1 000 000 EUR в облигации на Volkswagen Group (ISIN XS2234567233).

Падеж: 22 септември 2028 г.

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

521. Къса позиция от 1 000 000 EUR в облигации на Volkswagen Group (ISIN XS1167667283).

Падеж: 16 януари 2030 г.

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

522. Дълга позиция от 1 000 000 EUR в облигации на Total SA (ISIN XS1856281834).

Падеж: 11 юли 2033 г.

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

523. Дълга позиция от 1 000 000 EUR в държавни ценни книжа на АВСТРИЯ (ISIN AT0000A04967).

Падеж: 15 март 2037 г.

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

524. Дълга позиция (т.е. купува се защита) от 1 000 000 USD в суапове за кредитно неизпълнение върху задължения на АВСТРИЯ.

Падеж: юни година T+15

Валута на инструмента на ЕБО: USD

525. Дълга позиция от 1 000 000 EUR в държавни ценни книжа на НИДЕРЛАНДИЯ (ISIN NL0013552060).

Падеж: 15 януари 2040 г.

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

526. Дълга позиция (т.е. купува се защита) от 1 000 000 USD в суапове за кредитно неизпълнение върху задължения на НИДЕРЛАНДИЯ.

Падеж: юни година T+20

Валута на инструмента на ЕБО: USD

527. Дълга позиция от 1 000 000 EUR в държавни ценни книжа на БЕЛГИЯ (ISIN BE0000348574).

Падеж: 22 юни 2050 г.

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

528. Дълга позиция (т.е. купува се защита) от 1 000 000 USD в суапове за кредитно неизпълнение върху задължения на БЕЛГИЯ.

Падеж: юни година T+30

Валута на инструмента на ЕБО: USD

529. Дълга позиция (купува се защита) от 10 000 000 EUR в суапове за кредитно неизпълнение върху индекса iTraxx Europe, най-актуални (*on-the-run*) серии.

Падеж: юни година T+4

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

530. Къса пут опция. 10 000 000 EUR. Базов инструмент: най-актуални серии на индекса iTraxx Europe (същият инструмент като в т. 529).

Цена на упражняване: ATM

Дата на изтичане на срока: дата на включване + 6 месеца

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

531. Дълга позиция от 1 000 000 EUR в облигации на AXA SA (с право на обратно изкупуване) (ISIN XS1799611642).

Падеж: 28 май 2049 г.

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

532. Дълга позиция от 1 000 000 USD в облигации на AT&T (с право на обратно изкупуване) (ISIN US00206RFW79).

Падеж: 15 август 2037 г.

Валута на инструмента на ЕБО: USD

533. Дълга позиция от 1 000 000 EUR в облигации на BAYER AG (с право на обратно изкупуване) (ISIN XS2199266268).

Падеж: 6 януари 2030 г.

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

534. Дълга позиция от 1 000 000 EUR в облигации на ORANGE SA (с право на обратно изкупуване) (ISIN FR0013323870).

Падеж: 20 март 2028 г.

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

ПОРТФЕЙЛИ ЗА КОРЕЛАЦИОННО ТЪРГУВАНЕ

601. Къса позиция (т.е. продава се защита) в индекса iTraxx Europe, най-актуални серии.

Начална точка на загуба: 3 %

Крайна точка на загуба: 6 %

Условна стойност: 5 000 000 EUR

Падеж: 5 години

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

602. Дълга позиция (купува се защита) от 5 000 000 EUR в суапове за кредитно неизпълнение върху най-актуални серии на индекса iTraxx Europe.

Падеж: юни година T+4

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

Коригирана условна стойност за пълно хеджиране на CS01 от т. 601, без да се изисква повторно хеджиране

603. Дълга позиция (т.е. купува се защита) в най-актуални серии на индекса iTraxx Europe.

Начална точка на загуба: 3 %

Крайна точка на загуба: 6 %

Условна стойност: 5 000 000 EUR

Падеж: 5 години

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

604. Къса позиция (т.е. продава се защита) от 5 000 000 EUR в суапове за кредитно неизпълнение върху най-актуални серии на индекса iTraxx Europe.

Падеж: юни година T+4

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

Коригирана условна стойност за пълно хеджиране на CS01 от т. 603, без да се изисква повторно хеджиране

605. Къса позиция (т.е. продава се защита) в индекса iTraxx Europe, най-актуални серии.

Начална точка на загуба: 12 %

Крайна точка на загуба: 100 %

Условна стойност: 5 000 000 EUR

Падеж: 5 години

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

606. Дълга позиция (купува се защита) от 5 000 000 EUR в суапове за кредитно неизпълнение върху най-актуални серии на индекса iTraxx Europe.

Падеж: юни година T+4

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

Коригирана условна стойност за пълно хеджиране на CS01 от т. 605, без да се изисква повторно хеджиране

607. Дълга позиция (т.е. купува се защита) в най-актуални серии на индекса iTraxx Europe.

Начална точка на загуба: 12 %

Крайна точка на загуба: 100 %

Условна стойност: 5 000 000 EUR

Падеж: 5 години

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

608. Къса позиция (т.е. продава се защита) от 5 000 000 EUR в суапове за кредитно неизпълнение върху най-актуални серии на индекса iTraxx Europe.

Падеж: юни година T+4

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

Коригирана условна стойност за пълно хеджиране на CS01 от т. 607, без да се изисква повторно хеджиране

609. Къса позиция (т.е. продава се защита) в индекса iTraxx Europe, най-актуални серии.

Начална точка на загуба: 3 %

Крайна точка на загуба: 6 %

Условна стойност: 5 000 000 EUR

Падеж: 5 години

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

Процент на събиране на вземанията: 40 % фиксиран.

610. Дълга позиция (купува се защита) от 5 000 000 EUR в суапове за кредитно неизпълнение върху най-актуални серии на индекса iTraxx Europe.

Падеж: юни година T+4

Валута на инструмента на ЕБО: EUR

Коригирана условна стойност за пълно хеджиране на CS01 от т. 609, без да се изисква повторно хеджиране

Раздел 3: Индивидуални портфейли — отделен инструмент

Институциите представят изискваните показатели за измерване на риска, както и настоящата стойност за следните индивидуални портфейли:

Портфейл	*Колбинация от инструменти:* Първата цифра представлява инструмента (както е посочено в раздел 2 от настоящото приложение). Втората цифра представлява количеството на всеки инструмент или броя на договорите, според случая.	Валутата на портфейла на ЕБО	Изисквани показатели за измерване на риска
1001	101 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1002	102 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1003	103 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1004	104 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1005	105 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1006	106 – 1 инструмент	GBP	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1007	107 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1008	108 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1009	109 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1010	110 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1011	111 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1012	112 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1013	113 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1014	114 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1015	115 – 1 инструмент	GBP	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1016	116 – 1 инструмент	GBP	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1017	117 – 1 инструмент	JPY	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1018	118 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO

1019	119 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1020	120 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1021	121 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
2001	201 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
2002	202 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
2003	203 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
2004	204 – 1 инструмент	GBP	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
2005	205 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2006	206 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2007	207 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2008	208 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2009	209 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
2010	210 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
2011	211 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
2012	212 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
2013	213 – 1 инструмент	GBP	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2014	214 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2015	215 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
2016	216 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2017	217 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2018	218 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2019	219 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2020	220 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
2021	221 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
2022	222 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO

2023	223 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
2024	224 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
3001	301 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
3002	302 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
3003	303 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
3004	304 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
3005	305 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
3006	306 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
3007	307 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
3008	308 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
3009	309 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
3010	310 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
3011	311 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
4001	401 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
4002	402 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
4003	403 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
4004	404 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
4005	405 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
5001	501 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5002	502 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5003	503 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5004	504 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5005	505 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5006	506 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5007	507 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO

5008	508 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5009	509 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5010	510 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5011	511 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5012	512 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5013	513 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5014	514 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5015	515 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5016	516 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5017	517 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5018	518 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5019	519 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5020	520 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5021	521 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5022	522 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5023	523 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5024	524 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5025	525 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5026	526 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5027	527 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5028	528 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5029	529 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5030	530 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5031	531 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5032	532 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO

5033	533 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5034	534 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
6001	601 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; APR; SBM; DRC; RRAO
6002	602 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; APR; SBM; DRC; RRAO
6003	603 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; APR; SBM; DRC; RRAO
6004	604 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; APR; SBM; DRC; RRAO
6005	605 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; APR; SBM; DRC; RRAO
6006	606 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; APR; SBM; DRC; RRAO
6007	607 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; APR; SBM; DRC; RRAO
6008	608 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; APR; SBM; DRC; RRAO
6009	609 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; APR; SBM; DRC; RRAO
6010	610 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; APR; SBM; DRC; RRAO

Раздел 4: Индивидуални портфейли — няколко инструмента

Институциите представят изискваните показатели за измерване на риска, както и настоящата стойност за следните индивидуални портфейли:

Портфейл	*Колбинация от инструменти:* Първата цифра представлява инструмента (както е посочено в раздел 2 от настоящото приложение). Втората цифра представлява количеството на всеки инструмент или броя на договорите, според случая.	Валутата на портфейла на ЕБО	Изисквани показатели за измерване на риска
1101	103 – 1 инструмент 104 – 1 инструмент 105 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1102	113 – 1 инструмент 110 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1103	115 – 1 инструмент 116 – 1 инструмент	GBP	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1104	109 – 1 инструмент 110 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO

1105	111 – 1 инструмент 112 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1106	102 – 1 инструмент 114 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1107	106 – 1 инструмент 107 – 1 инструмент 108 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1108	101 – 1 инструмент 103 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1109	101 – 1 инструмент 103 – 1 инструмент 104 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1110	102 – 1 инструмент 104 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
2201	206 – 1 инструмент 207 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2202	206 – 1 инструмент 207 – 1 инструмент 208 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2203	206 – 1 инструмент 207 – 1 инструмент 208 – 1 инструмент 209 – 1 инструмент 210 – 1 инструмент 211 – 1 инструмент 212 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2204	201 – 1 инструмент 218 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
2205	201 – 1 инструмент 219 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
2206	218 – 1 инструмент 219 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
2207	201 – 1 инструмент 202 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
2208	215 – 1 инструмент 216 – 1 инструмент 217 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2209	203 – 1 инструмент 215 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO

2210	208 – 1 инструмент 209 – 1 инструмент 210 – 1 инструмент 214 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2211	209 – 1 инструмент 219 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2212	201 – 1 инструмент 223 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
3301	301 – 1 инструмент 302 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
3302	303 – 1 инструмент 304 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
3303	304 – 1 инструмент 305 – 1 инструмент 306 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
3304	307 – 1 инструмент 308 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
4401	401 – 1 инструмент 402 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
4402	403 – 1 инструмент 404 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
4403	401 – 1 инструмент 404 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
5501	501 – 1 инструмент 502 – 1 инструмент 503 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5502	504 – 1 инструмент 505 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5503	507 – 1 инструмент 508 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5504	503 – 1 инструмент 504 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5505	509 – 1 инструмент 510 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5506	511 – 1 инструмент 512 – 1 инструмент 514 – 1 инструмент 515 – 1 инструмент 516 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO

5507	517 – 1 инструмент 518 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5508	519 – 1 инструмент 520 – 1 инструмент 522 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5509	520 – 1 инструмент 521 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5510	519 – 1 инструмент 508 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5511	515 – 1 инструмент 522 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5512	520 – 1 инструмент 521 – 1 инструмент 516 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5513	506 – 1 инструмент 503 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5514	502 – 1 инструмент 209 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5515	504 – 1 инструмент 217 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5516	505 – 1 инструмент 216 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5517	504 – 1 инструмент 217 – 1 инструмент 505 – 1 инструмент 216 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5518	502 – 1 инструмент 209 – 1 инструмент 219 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5519	523 – 1 инструмент 525 – 1 инструмент 527 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5520	524 – 1 инструмент 526 – 1 инструмент 528 – 1 инструмент	USD	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5521	523 – 1 инструмент 524 – 1 инструмент 525 – 1 инструмент 526 – 1 инструмент 527 – 1 инструмент 528 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO

5522	529 – 1 инструмент 530 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
6601	601 – 1 инструмент 602 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; APR; SBM; DRC; RRAO
6602	603 – 1 инструмент 604 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; APR; SBM; DRC; RRAO
6603	605 – 1 инструмент 606 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; APR; SBM; DRC; RRAO
6604	607 – 1 инструмент 608 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; APR; SBM; DRC; RRAO
6605	609 – 1 инструмент 610 – 1 инструмент	EUR	VaR; Stressed VaR; APR; SBM; DRC; RRAO

Раздел 5: Агрегирани портфейли

Институциите представят изискваните показатели за измерване на риска, както и настоящата стойност за следните финансови агрегирани портфейли:

Агрег. Портфейл	Описание	*Комбинация от индивидуални портфейли* (индивидуални портфейли съгласно техните номера, посочени в раздели 3 и 4 към настоящото приложение)	Валутата на портфейла на ЕБО	Изисквани показатели за измерване на риска
10000	Сборен портфейл извън корелационното търгуване	1001, 1101, 1104, 1106, 2001, 2002, 2203, 2206, 3301, 3303, 3304, 4401, 4402, 5503, 5506, 5508, 5521	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
11000	Общо капиталови инструменти	1001, 1101, 1104, 1106	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
12000	Общо лихвен процент	2001, 2002, 2203, 2206	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
13000	Общо валутни сделки	3301, 3303, 3304	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
14000	Общо стоки	4401, 4402	USD	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
15000	Общо кредитен спред	5503, 5506, 5508, 5521	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
16000	Общо портфейл за корелационно търгуване, EUR	6601, 6602	EUR	VaR; Stressed VaR; APR; SBM; DRC; RRAO

Раздел 6: Допълнителни спецификации за инструментите

Институциите прилагат следните допълнителни спецификации по отношение на финансовите инструменти, описани в раздел 2 от настоящото приложение:

j. Инструмент:	k. 220
l. Описание:	m. Петгодишен кръстосан валутен суап EUR/USD по пазарна стойност n. Получават се USD и се плащат EUR. o. Условна стойност: 10 000 000 EUR, USD (10 000 000 EUR * FX USD/EUR)
p. Плащане:	q. Плаващ компонент 2
r. Събиране:	s. Плаващ компонент 1
t. Условна размяна и актуализиране:	u. На началната дата и датата на падеж. Освен това на всяка дата на купонно плащане се извършва допълнително плащане, съответстващо на корекцията на условната стойност в USD към плаващия компонент 2. Условната стойност в USD се коригира на 10 000 000 EUR по спот курс 2 работни дни преди всяка дата на плащане.
v. Парично салдо	w. В т.ч.
x. Плаващ компонент 1	
y. Условна стойност:	z. еквивалент от 10 000 000 EUR, превърнати в USD по цена „спот“ на началната дата; еквивалентът се коригира на тримесечие
aa. Начална дата:	bb. дата на включване + 6 месеца
cc. Дата на падеж:	dd. Дата на включване + 5,5 години
ee. Генериране на дата на плащане:	ff. Форуърд от началната дата
gg. Честота на купонните плащания:	hh. Тримесечна
ii. Ставка на купона:	jj. 3-месечен SOFR + 0 базисни пункта.
kk. Честота на актуализиране на ставката на купона:	ll. Тримесечна
mm. Конвенция за определяне на ставката на купона:	nn. Ежедневно съставяне през 3-месечния период
oo. Честота на съставяне на ставката на купона:	pp. Проста лихва
qq. Отчитане на дните:	rr. ACT/360
ss. Работен ден на плащането:	tt. LON, NYC, TARGET
uu. Конвенция за работните дни на плащането:	vv. Модифициран следващ
ww. Работен ден, в който се актуализира условната стойност:	xx. LON, NYC, TARGET
yy. Конвенция за работния ден, в който се актуализира условната стойност:	zz. Предходен
aaa. Работен ден на актуализиране на ставката на купона:	bbb. LON, NYC, TARGET
ccc. Конвенция за работния ден, в който се актуализира ставката на купона:	ddd. Предходен

eee. Плаващ компонент 2	
fff. Условна стойност:	ggg. 10 000 000 EUR
hhh. Начална дата:	iii. дата на включване + 6 месеца
jjj. Дата на падеж:	kkk. Дата на включване + 5,5 години
lll. Генериране на дата на плащане:	mmm. Форуърд от началната дата
nnn. Честота на купонните плащания:	ooo. Тримесечна
ppp. Ставка на купона:	qqq. 3-месечен ESTER + 0 базисни пункта.
rrr. Честота на актуализиране на ставката на купона:	sss. Тримесечна
ttt. Конвенция за определяне на ставката на купона:	uuu. Ежедневно съставяне през 3-месечния период
vvv. Честота на съставяне на ставката на купона:	www. Проста лихва
xxx. Отчитане на дните:	yyy. ACT/360
zzz. Работен ден на плащането:	aaaa. LON, NYC, TARGET
bbbb. Работен ден на плащането	cccc. Модифициран следващ
dddd. Работен ден, в който се актуализира условната стойност:	eeee. LON, NYC, TARGET
ffff. Конвенция за работния ден, в който се актуализира условната стойност:	gggg. Предходен
hhhh. Работен ден на актуализиране на ставката на купона:	iiii. LON, NYC, TARGET
jjjj. Конвенция за работния ден, в който се актуализира ставката на купона:	kkkk. Предходен

Раздел 7: Портфейли за валидиране по метода за изчисляване на чувствителностите

а) В рамките на подаването на ППО институциите представят показателя за измерване на риска по метода за изчисляване на чувствителностите за портфейлите, определени в приложение X (портфейли за валидиране по SBM), и ги подават в съответствие с датите за докладване на подаването на ППО.

б) За подаването на резултатите относно портфейлите за валидиране по SBM се прилага следното:

i. Институциите докладват само образец C120.02 и ограничават докладването в този образец до резултатите по отчетна валута (т.е. колона 0060 от образец C120.02 не се попълва, а образци C 106.00 и C 106.01 не се докладват за портфейлите за валидиране по SBM);

ii. Институциите приемат, че чувствителностите към риска и позициите, свързани с риска от кривината, определени с посочените в приложение X инструменти, са изразени в отчетната валута на институцията и че информацията е представена във формàта, посочен в указанията за докладване на образци C 106.01/C 120.01, и съответната таблица с насоки за отчитането на тези образци в приложение VI (Указания за образците).““

ПРИЛОЖЕНИЕ III

„ПРИЛОЖЕНИЕ VI

РЕЗУЛТАТИ ОТ СРАВНИТЕЛНИТЕ ПОРТФЕЙЛИ ЗА ЦЕЛИТЕ НА НАДЗОРА

УКАЗАНИЯ ОТНОСНО ОБРАЗЦИТЕ

C 106.00 — Първоначална пазарна оценка и обосновка на изключването 57

C 106.01 – Метод за изчисляване на чувствителностите Чувствителности към риска по инструменти 57

C 107.01 — Стойност под риск (VaR) и стресирана стойност под риск (sVaR) извън портфейла за корелационно търгуване Данни. 61

C 107.02 – Стойност под риск (VaR), стресирана стойност под риск (sVaR) и настояща стойност (PV) извън портфейла за корелационно търгуване. Резултати във валутата на портфейла на ЕБО 63

C 108.00 – Динамични редове за печалбата и загубата 64

C 109.01 — Капиталово изискване за допълнителен риск. Данни за модела 65

C 109.02 — Капиталово изискване за допълнителен риск. Данни по портфейли 65

C 109.03 — Капиталово изискване за допълнителен риск. Размер по портфейл/дата 66

C 110.01 — Корелационно търгуване. Данни за модела 67

C 110.02 — Корелационно търгуване. Данни по портфейли 68

C 110.03 — Корелационно търгуване. Всички ценови рискове по портфейл/дата 69

C 120.01 – Метод за изчисляване на чувствителностите ЧУВСТВИТЕЛНОСТИ КЪМ РИСКА ПО ИНСТРУМЕНТИ/ ПОРТФЕЙЛИ 69

C 120.02 – Метод за изчисляване на чувствителностите СЪСТАВ НА КАПИТАЛОВИТЕ ИЗИСКВАНИЯ ПО ПОРТФЕЙЛИ 72

C 120.04 – КАПИТАЛОВО ИЗИСКВАНЕ ЗА РИСКА ОТ НЕИЗПЪЛНЕНИЕ ПАЗАРНИ СТОЙНОСТИ И БРУТНИ СУМИ, ИЗЛОЖЕНИ НА РИСК ОТ ВНЕЗАПНО НЕИЗПЪЛНЕНИЕ, ПО ИНСТРУМЕНТИ/ПОРТФЕЙЛИ 74

C 120.05 – КАПИТАЛОВО ИЗИСКВАНЕ ЗА РИСКА ОТ НЕИЗПЪЛНЕНИЕ СЪСТАВ НА КАПИТАЛОВИТЕ ИЗИСКВАНИЯ ПО ПОРТФЕЙЛИ 80

C 120.06 — Алтернативен стандартизиран подход КАПИТАЛОВИ ИЗИСКВАНИЯ 82

УКАЗАНИЯ ОТНОСНО ОБРАЗЦИТЕ

С 106.00 — Първоначална пазарна оценка и обосновка на изключването

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0010	Номер на инструмента	Раздел 2 от приложение V	Посочва се номерът на инструмента от приложение V.
0020	Инструмент, моделиран за стойност под риск + стресирана стойност под риск (VaR + sVaR) („ВЯРНО“/„НЕВЯРНО“)		Вписва се „ВЯРНО“ или „НЕВЯРНО“.
0030	Инструмент, моделиран за капиталовото изискване за допълнителен риск („ВЯРНО“/„НЕВЯРНО“)		Вписва се „ВЯРНО“ или „НЕВЯРНО“.
0040	Инструмент, моделиран за корелационно търгуване („ВЯРНО“/„НЕВЯРНО“)		Вписва се „ВЯРНО“ или „НЕВЯРНО“.
0050	Основания за изключване	Член 3, параграф 2	Докладва се някой от следните елементи: а) модел, за който няма разрешение от регулаторния орган; б) инструмент или базов актив, за който няма вътрешно одобрение; в) базов актив или елемент от моделирането, който не е отразен вътрешно; г) други основания за изключване. Моля, обяснете основанията в колона 0060.
0060	Поле за свободен текст		В тази колона институцията може да впише допълнителна информация.
0070	Първоначална пазарна оценка (ППО)		Пазарната стойност на всеки инструмент към референтната дата в 17:30 ч. централноевропейско време (както е посочено в раздел 1, буква б) от приложение V). Полето се оставя празно, когато институцията не желае да предостави първоначална пазарна оценка за даден портфейл (т.е. нулеви стойности се докладват само когато резултатът от изчислението действително е нула).

С 106.01 – Метод за изчисляване на чувствителностите Чувствителности към риска по инструменти

Институциите докладват чувствителността към рисковите фактори, на които е изложен инструментът. Всеки ред обхваща един рисков фактор/чувствителност. Нетната позиция на повишаващия се (CVRk+) или намаляващия (CVRk-) риск от кривината за този рисков фактор, както е посочено в член 325ж от Регламент (ЕС) № 575/2013, се докладват в отделни редове. Всички стойности се отнасят до „референтната дата на ППО“ (и първоначалната референтна дата по метода за изчисляване на чувствителностите), както е посочено в раздел 1, буква б), подточка ii) от приложение V към настоящия регламент. Институциите докладват всяка комбинация от номер на инструмента, идентификатор на риска (колона 0010), група (колона 0020) и допълнителен идентификатор (колона 0030) само веднъж.

Указания относно таблиците (ос z)

Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
Номер на инструмента	Раздел 2 от приложение V	Посочва се номерът на инструмента от приложение V.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0010	Идентификатор на рисковия фактор	Членове 325л, 325м, 325н, 325о, 325п и 325р от Регламент (ЕС) № 575/2013	Докладва се идентификаторът на рисковия фактор, както е посочен в таблицата в края на настоящото приложение.
0020	Група	Член 325г, параграф 3 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Групата се докладва, когато идентификаторът на рисковия фактор, избран в колона 0010, съответства на рисковия клас: — общ лихвен риск, отговорът е наименованието на валутата на съответния рисков фактор, съответстващ на безрисков лихвен процент, на инфлацията или на лихвения спред между различни валути (следвайки обозначението на валутата по ISO 4217, напр. „EUR“); — риск, свързан с кредитния спред, при позиции, които не са част от секюритизация, отговорът е номерът на групата в член 325аз, параграф 1, таблица 4 от Регламент (ЕС) № 575/2013; — риск, свързан с кредитния спред, при позиции, които са част от секюритизация и са извън алтернативния портфейл за корелационно търгуване, отговорът е номерът на групата в член 325ам, параграф 1, таблица 7 от посочения регламент; — риск, свързан с кредитния спред, при позиции, които са част от секюритизация и са включени в алтернативния портфейл за корелационно търгуване, отговорът е номерът на групата в член 325ак, таблица 6 от посочения регламент; — риск, свързан с капиталови инструменти, отговорът е номерът на групата в член 325ап, параграф 1, таблица 8 от посочения регламент; — стоков риск, отговорът е номерът на групата в член 325ат, таблица 9 от посочения регламент. — валутен риск и компоненти делта или кривина, отговорът е наименованието на валутата (напр. „USD“, като посочените кодове са според обозначението на валутата по ISO 4217). — валутен риск и компонент вега, отговорът е наименованието на двойката валути (напр. „EUR_USD“, като посочените кодове са според обозначението на валутата по ISO 4217).
0030	Допълнителен идентификатор1	Членове 325л — 325р и 325аи от Регламент (ЕС) № 575/2013	Докладва се следната информация, която разграничава рисковия фактор на вътрешногрупово равнище. Когато идентификаторът на рисковия фактор, избран в колона 0010, съответства на рисковия клас: — общ лихвен риск и компонент делта, отговорът е наименованието на безрисковата крива или друг съответен собствен идентификатор; — риск, свързан с кредитния спред, при позиции, които не са част от секюритизация, или при позиции, които са част от секюритизация и са включени в алтернативния портфейл за корелационно търгуване, отговорът е наименованието на емитента или друг съответен собствен идентификатор; и е идентичен за всеки две докладвани чувствителности към два

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
			рискови фактора, за които се получава корелационен параметър $\rho_{kl}^{(name)}$, равен на 1 в съответствие с член 325аи, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 575/2013. — риск, свързан с кредитния спред, при позиции, които са част от секюритизация и са извън алтернативния портфейл за корелационно търгуване, отговорът е наименованието на транша или друг съответен собствен идентификатор; — риск, свързан с капиталови инструменти, отговорът е наименованието на емитента на дадения капиталов инструменти или съответен собствен идентификатор; — стоков риск, отговорът е наименованието на стоката или друг съответен собствен идентификатор. Когато никой от тези случаи не се прилага, институциите докладват изрична стойност (NULL), т.е. не се прилага.
0050	Чувствителност към риска (резултати в отчетната валута)	Член 325г, параграф 2 и членове 325ж, 325с, 325т, 325у и 325ач от Регламент (ЕС) № 575/2013	Чувствителностите към риска (чувствителности делта/вега и позиции с риск от кривината) се докладват за всеки инструмент за всички съответни рискови фактори, както е посочено в колони 0010—0030. Стойностите се докладват в отчетната валута на институцията. Когато идентификаторът на рисковия фактор, избран в колона 0010, съответства на: — компонента делта риск на метода за изчисляване на чувствителностите, се докладва нетната чувствителност към рисковия фактор (S_k), както е посочено в член 325с от Регламент (ЕС) № 575/2013; Когато институциите са получили разрешение от своя компетентен орган да използват алтернативни определения на чувствителностите към делта риска в съответствие с член 325у, параграф 5 от посочения регламент, за целите на докладването те се позовават на тези алтернативни определения. — компонента вега риск на метода за изчисляване на чувствителностите, се докладва чувствителността към вега риск на опция при даден рисков фактор (S_k), както е посочено в член 325т от Регламент (ЕС) № 575/2013; Когато институциите са получили разрешение от своя компетентен орган да използват алтернативни изчисления на чувствителностите към вега риска в съответствие с член 325у, параграф 6 от посочения регламент, за целите на докладването те се позовават на тези алтернативни изчисления. Независимо дали институцията използва определението по член 325т или алтернативно изчисление в съответствие с член 325у, параграф 6 от посочения регламент, чувствителността се докладва след претеглянето ѝ по съответната очаквана променливост. — Компонент риск от кривината на метода за изчисляване на чувствителностите, докладва се нетната позиция на нарастващия (CVR_k^+) или намаляващия (CVR_k^-) риск от кривината за този рисков фактор, както е посочено в член 325ж от Регламент (ЕС) № 575/2013. Докладваната стойност се изразява като десетична дроб с точност най-малко два знака след десетичната запетая. Нулеви стойности се докладват само когато резултатът от изчислението е действително нула.
0060	Отчетна валута		Посочва се наименованието на отчетната валута на институцията (докладваната стойност следва обозначението на валутата по ISO 4217, напр. „EUR“).

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0070	Чувствителност към риска (резултати във валутата на инструмента на ЕБО)	Раздел 2 от приложение V към настоящия регламент и член 325г, параграф 2 и членове 325ж, 325с и 325т от Регламент (ЕС) № 575/2013	Стойностите се докладват според указанията за колона 0050, но се преизчисляват по спот курса на ЕЦБ за валутата на инструмента, както е определено в раздел 2 от приложение V към настоящия регламент.
0080	Модел на ценообразуване	Член 325у от Регламент (ЕС) № 575/2013	Институцията посочва кой модел на ценообразуване прилага за определяне на чувствителността. Докладва се някой от следните елементи: а) „модели на ценообразуване на институцията, които служат като основа за отчитане на печалбата и загубата пред висшето ръководство“ (съгласно член 325у, параграф 1, първа алинея от Регламент (ЕС) № 575/2013); б) „подход на вътрешния модел на институцията“ (съгласно член 325у, параграф 1, втора алинея от посочения регламент);
0090	Определения за чувствителностите	Членове 325с, 325т и 325у от Регламент (ЕС) № 575/2013	Институцията посочва кое определение за чувствителности се прилага при изчисляването на капиталовите изисквания. Докладва се някой от следните елементи: а) „определението за чувствителности в членове 325с и 325т от Регламент (ЕС) № 575/2013“; б) „определението на чувствителности в член 325у, параграфи 5 и 6 от Регламент (ЕС) № 575/2013“; Когато идентификаторът на рисковия фактор, избран в колона 0010, съответства на компонента на риска от кривината на метода за изчисляване на чувствителностите, посочената в буква б) стойност се докладва, ако някоя от чувствителностите, използвани при изчисляването на докладваната позиция на риска от кривината, се основава на определение за чувствителност в съответствие с член 325у, параграфи 5 и 6 от Регламент (ЕС) № 575/2013, а в противен случай се докладва стойността, посочена в буква а).
0100	Поле за свободен текст		В тази колона институцията може да предостави допълнителна информация за прилагания модел на ценообразуване и определения за чувствителности.
0110	Допълнителен идентификатор2	Член 325п, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Когато идентификаторът на рисковия фактор, избран в колона 0010, съответства на рисковия клас: стоков риск и компонента делта риск на метода за изчисляване на чувствителностите, отговорът е наборът от правни условия за доставката на стоката или друг съответен собствен идентификатор. Когато никой от тези случаи не се прилага, институциите докладват изрична стойност (NULL), т.е. не се прилага.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0120	Категория кредитно качество	Член 325м, параграф 1 и член 325аз, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Когато идентификаторът на рисковия фактор, избран в колона 0010, съответства на рисковия клас: риск, свързан с кредитния спред, при позиции, които не са част от секюритизация, и компонента делта риск на метода за изчисляване на чувствителностите, отговорът е едно от следните: а) „СКК 1“; б) „СКК 2“; в) „СКК 3“; г) „СКК 4“; д) „СКК 5“; е) „СКК 6“; ж) „Без присъдена СКК (без рейтинг)“. Когато никой от тези случаи не се прилага, институциите докладват изрична стойност (NULL), т.е. не се прилага.

С 107.01 — Стойност под риск (VaR) и стресирана стойност под риск (sVaR) извън портфейла за корелационно търгуване Данни.

Ред	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0010 — 0060	Стойност под риск (VaR)		
0010	Методика		В колона 0010 се докладва едно от следните: а) симулация за минали периоди; б) симулация „Монте Карло“; в) параметрична методика; г) комбинация / друга методика (да се посочи). Институцията използва колона 0020 за поясняване на дадения в колона 0010 отговор. Когато в колона 0010 е избрана подточка г), в колона 0020 институцията представя по-подробни данни.
0020	Изчисляване на 10-дневен период	Член 365, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 575/2013	В колона 0010 се докладва едно от следните: а) 1 ден, преобразуван на 10 дни; б) 10 дни с припокриващи се периоди; в) 10 дни съгласно друга методика. Институцията използва колона 0020 за поясняване на дадения в колона 0010 отговор.
0030	Продължителност на периода на наблюдение	Член 365, параграф 1, буква г) от Регламент (ЕС) № 575/2013	В колона 0010 се докладва едно от следните: а) до 1 година; б) над 1 и най-много до 2 години; в) над 2 и най-много до 3 години; г) Над 3 години. Институцията използва колона 0020 за поясняване на дадения в колона 0010 отговор.

Ред	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0040	Претегляне на данните	Член 365, параграф 1, буква г) от Регламент (ЕС) № 575/2013	В колона 0010 се докладва едно от следните: а) непретеглена (претегляне на данните за VaR); б) претеглена (претегляне на данните за VaR); в) по-високата от претеглената и непретеглената (претегляне на данните за VaR) стойност по букви а) и б). Институцията използва колона 0020 за пояснява на дадения в колона 0010 отговор.
0050	Надбавка в резултат на бек-тестове	Член 366, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Надбавката в резултат на бек-тестове означава надбавка между 0 и 1 в съответствие с член 366, параграф 2, таблица 1 от Регламент (ЕС) № 575/2013. Институцията използва колона 0020 за пояснява на дадения в колона 0010 отговор.
0060	Регулаторна надбавка за VaR	Член 366, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 575/2013 („най-малко 3“)	Регулаторна надбавка за VaR означава допълнителното изискване, наложено от компетентния орган по отношение на мултипликационния коефициент за VaR (най-малко 3) в съответствие с член 366, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 575/2013. Регулаторната надбавка за VaR е сумата от надбавката в резултат на бек-тестове и от качествената надбавка, когато е приложимо, над 3. Институцията използва колона 0020 за пояснява на дадения в колона 0010 отговор.
0070 — 0100	SVaR (т.е. стресирана стойност под риск)		
0070	Методика		В колона 0010 се докладва едно от следните: а) симулация за минали периоди; б) симулация „Монте Карло“; в) параметрична методика; г) комбинация / друга методика (да се посочи). Институцията използва колона 0020 за пояснява на дадения в колона 0010 отговор. В случай че в колона 0010 е избрана подточка г), в колона 0020 институцията представя по-подробни данни.
0080	Изчисляване на 10-дневен период	Член 365, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 575/2013	В колона 0010 се докладва едно от следните: а) 1 ден, преобразуван на 10 дни; б) 10 дни с припокриващи се периоди; в) 10 дни съгласно друга методика. Институцията използва колона 0020 за пояснява на дадения в колона 0010 отговор.
0090	Регулаторна надбавка за sVaR	Член 366, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Регулаторна надбавка означава допълнителното изискване, наложено от компетентния орган по отношение на мултипликационния коефициент за sVaR (най-малко 3) в съответствие с член 366, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 575/2013. Регулаторната надбавка е сумата от 3, надбавката в резултат на бек-тестове и качествената надбавка (когато е приложимо).

Ред	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
			Институцията използва колона 0020 за пояснявӑне на дадения в колона 0010 отговор.
0100	Период на sVaR	Член 365, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 575/2013	В колона 0010 се докладва едно от следните: а) Ежедневно изчисляване на стресираната стойност под риск, калибрирано за един непрекъснат 12-месечен период, започващ от посочената в колона 0020 дата; б) ежеседмично изчисляване на стресираната стойност под риск, калибрирано за един непрекъснат 12-месечен период, започващ от посочената в колона 0020 дата; в) Ежедневно изчисляване на стресираната стойност под риск, калибрирано за различни непрекъснати 12-месечни периоди в рамките на датите за докладване на стресираната стойност под риск, посочени в колона 0010 от образец C107.02, започващи от посочената в колона 0020 дата; а) Ежедневно изчисляване на стресираната стойност под риск, калибрирано за различни непрекъснати 12-месечни периоди в рамките на датите за докладване на стресираната стойност под риск, посочени в колона 0010 от образец C107.02, започващи от посочената в колона 0020 дата; б) максимално ежедневно изчисляване на стресираната стойност под риск, калибрирано за повече от един непрекъснат 12-месечен период; в) максимално ежеседмично изчисляване на стресираната стойност под риск, калибрирано за повече от един непрекъснат 12-месечен период; г) Други възможности за калибриране на стресираната стойност под риск (моля, посочете). Институцията използва колона 0020, за да посочи началната дата във формат „дд/мм/гггг“, когато в колона 0010 е избран вариант а) или б), и началните дати във формат „дд/мм/гггг“, използвани за всяко изчисляване на стресираната стойност под риск, когато в колона 0010 е избран вариант в) или г). Институцията използва също колона 0020 за пояснявӑне на 12-месечния период, използван за всяко изчисляване на стресираната стойност под риск, когато в колона 0010 са избрани варианти д), е) и ж).

C 107.02 – Стойност под риск (VaR), стресирана стойност под риск (sVaR) и настояща стойност (PV) извън портфейла за корелационно търгуване. Резултати във валутата на портфейла на ЕБО

Указания относно таблиците (ос z)

Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
Портфейл	Раздели 3, 4 и 5 от приложение V	Посочва се номерът на портфейла от приложение V.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0010	Дата		Докладват се резултатите за VaR, sVaR и настоящата стойност (PV) за всички 10 работни дни между „първоначалната референтна дата за показателите за измерване на риска“ и „крайната референтна дата за показателите за измерване на риска (и крайната референтна дата по алтернативния стандартизиран подход)“, както е посочено в приложение V, раздел 1, буква б). Датите се докладват във формат „дд/мм/гггг“.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0020	Стойност под риск (VaR)	Член 365 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Докладва се 10-дневната регулаторна VaR, получена за всеки портфейл, без да се прилага регулаторният мултипликационен коефициент „най-малко 3“. Данните се докладват за всяка от датите, посочени в колона 0010. Ако на датата, посочена в колона 0010, институцията не изчислява VaR, полето се оставя празно (т.е. нулеви стойности се докладват само ако резултатът от изчислението е нула).
0030	Стресирана стойност под риск (sVaR)	Член 365 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Докладва се 10-дневната регулаторна sVaR, получена за всеки портфейл, без да се прилага регулаторният мултипликационен коефициент „най-малко 3“. Данните се докладват за всяка от датите, посочени в колона 0010. Ако на датата, посочена в колона 0010, институцията не изчислява sVaR, полето се оставя празно (т.е. нулеви стойности се докладват само ако резултатът от изчислението е нула).
0040	Настояща стойност (PV)		Докладва се PV за всеки портфейл. Данните се докладват за всяка от датите, посочени в колона 0010. Ако на датата, посочена в колона 0010, институцията не изчислява PV, полето се оставя празно (т.е. нулеви стойности се докладват само ако резултатът от изчислението е нула).

С 108.00 – Динамични редове за печалбата и загубата

Образец С 108.00 („Динамични редове за печалбата и загубата“) се попълва само от институциите, които изчисляват стойността под риск посредством симулация за минали периоди.

Указания относно таблиците (ос z)

Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
Портфейл	Раздели 3, 4 и 5 от приложение V	Посочва се номерът на портфейла от приложение V.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0010	Дата	Член 365, параграф 1, буква г) от Регламент (ЕС) № 575/2013	През всеки работен ден, определен съгласно календара в съответната за дадената институция юрисдикция, институциите представят в колона 0010 от образец С 107.02 използваните за изчисляването на стойността под риск (VaR) динамични редове за печалбата и загубата при минимум 250 наблюдения, считано назад от „крайната референтна дата за показателите за измерване на риска (и крайната референтна дата по алтернативния стандартизиран подход)“, съгласно посоченото в раздел 1, буква б), подточка v) от приложение V.
0020	Дневна печалба и загуба		Институциите, които изчисляват стойността под риск чрез симулация за минали периоди, посочват пълния ред използвани от тях данни – като този хронологичен ред трябва да е с минимална дължина една година – за промяната в стойността на портфейла (т.е. дневната печалба и загуба), получена чрез симулация на дневната промяна на факторите на риска за минали периоди (т.е. хронологичния ред данни за дневната печалба и загуба, използван за изчисляването на докладваната за регулаторни цели еднодневна стойност под риск).

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
			Ако в съответната юрисдикция даден ден е почивен, това поле се оставя празно (т.е. за печалбата или загубата се докладва нулева стойност само ако в даден работен ден няма промяна в хипотетичната стойност на портфейла).

C 109.01 — Капиталово изискване за допълнителен риск. Данни за модела

Ред	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0010	Брой фактори, използвани при моделирането		Насоки EBA/GL/2012/3 на ЕБО Докладва се броят на факторите, използвани при моделирането, който се отчита на равнището на целия модел за изискването за допълнителен риск. Посочва се един от следните отговори: а) 1 използван при моделирането фактор; б) 2 използвани при моделирането фактори; в) Повече от 2 използвани при моделирането фактори. Институцията използва колона 0020 за пояснявӑне на дадения в колона 0010 отговор.
0020	Източник на загубите при неизпълнение		Насоки EBA/GL/2012/3 на ЕБО Докладва се източникът на загубите при неизпълнение, който се отчита на равнището на целия модел за изискването за допълнителен риск. Посочва се един от следните отговори: а) пазарна конвенция; б) загуба при неизпълнение, използвана при вътрешнорейтинговия подход; в) друг източник на загуба при неизпълнение (моля, уточнете). Институцията използва колона 0020 за пояснявӑне на дадения в колона 0010 отговор. Ако в колона 0010 е избрана подточка в), институцията представя по-подробни данни в тази колона.

C 109.02 — Капиталово изискване за допълнителен риск. Данни по портфейли

Указания относно таблиците (ос z)

Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
Портфейл	Раздели 3, 4 и 5 от приложение V	Посочва се номерът на портфейла от приложение V — само за портфейлите, при които се изисква модел за допълнителния риск и миграционния риск.

Ред	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0010	Хоризонт на ликвидност	Член 374, параграф 5 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Насоки EBA/GL/2012/3 на ЕБО Докладва се хоризонтът на ликвидност, приложен на равнището на портфейла. Посочва се един от следните отговори: а) до 3 месеца; б) над 3 и най-много до 6 месеца; в) над 6 и най-много до 9 месеца; г) над 9 и най-много до 12 месеца;
0020	Източник на вероятността от неизпълнение		Насоки EBA/GL/2012/3 на ЕБО Докладва се източникът на вероятността от неизпълнение за портфейла. Посочва се един от следните отговори: а) агенции за кредитен рейтинг; б) вътрешнорейтингов подход; в) произтичащи от пазара вероятности от неизпълнение; г) друг източник на вероятности от неизпълнение (моля, уточнете). Институцията използва колона 0020 за поясняване на дадения в колона 0010 отговор. В случай че в колона 0010 е избрана подточка г), в колона 0020 институцията представя по-подробни данни.
0030	Източник на миграционните таблици		Насоки EBA/GL/2012/3 на ЕБО Докладва се източникът на миграционните таблици, приложени на равнището на портфейла. Посочва се един от следните отговори: а) агенции за кредитен рейтинг; б) вътрешнорейтингов подход; в) произтичащи от пазара миграционни таблици; г) други източници на миграционни таблици (моля, уточнете). Институцията използва колона 0020 за поясняване на дадения в колона 0010 отговор. В случай че в колона 0010 е избрана подточка г), в колона 0020 институцията представя по-подробни данни.

C 109.03 — Капиталово изискване за допълнителен риск. Размер по портфейл/дата

Указания относно таблиците (ос z)

Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
Портфейл	Раздели 3, 4 и 5 от приложение V	Посочва се номерът на портфейла от приложение V — само за портфейлите, при които се изисква модел за допълнителния риск и миграционния риск.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0010	Дата		Изискването за допълнителен риск се докладва за всички 10 работни дни между „първоначалната референтна дата за показателите за измерване на риска“ и „крайната референтна дата за показателите за измерване на риска (и крайната референтна дата по алтернативния стандартизиран подход)“, съгласно посоченото в раздел 1, буква б) от приложение V. Датите се докладват във формат „дд/мм/гггг“.
0020	Капиталово изискване за допълнителен риск (IRC)	Членове 372—376 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Насоки EBA/GL/2012/3 на ЕБО Докладва се регулаторното капиталово изискване за допълнителен риск, получено за всеки портфейл. Данните се докладват за всяка от датите, посочени в колона 0010. Ако на датата, посочена в колона 0010, институцията не изчислява капиталово изискване за допълнителен риск, полето се оставя празно (т.е. нулеви стойности се докладват само ако резултатът от изчислението е нула).

С 110.01 — Корелационно търгуване. Данни за модела

Ред	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0010	Брой фактори, използвани при моделирането	Член 377 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Докладва се броят на факторите, използвани при моделирането, за целия модел за отчитане на корелационното търгуване. Посочва се един от следните отговори: а) 1 използван при моделирането фактор; б) 2 използвани при моделирането фактори; в) Повече от 2 използвани при моделирането фактори. Институцията използва колона 0020, когато желае да поясни дадения в колона 0010 отговор.
0020	Източник на загубите при неизпълнение	Член 377 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Докладва се източникът на загубите при неизпълнение за целия модел за отчитане на корелационното търгуване. Посочва се един от следните отговори: а) пазарна конвенция; б) загуба при неизпълнение, използвана при вътрешнорейтинговия подход; в) друг източник на загуба при неизпълнение (моля, уточнете). Институцията използва колона 0020 за пояснява на дадения в колона 0010 отговор. Ако в колона 0010 е избрана подточка в), институцията представя по-подробни данни в тази колона.

C 110.02 — Корелационно търгуване. Данни по портфейли

Указания относно таблиците (ос z)

Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
Портфейл	Раздели 3, 4 и 5 от приложение V	Посочва се номерът на портфейла от приложение V — само за портфейлите, при които се изисква показател за всички ценови рискове.

Ред	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0010	Хоризонт на ликвидност	Член 377, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Докладва се хоризонтът на ликвидност, приложен на равнището на портфейла. Посочва се един от следните отговори: а) до 3 месеца; б) над 3 и най-много до 6 месеца; в) над 6 и най-много до 9 месеца; г) над 9 и най-много до 12 месеца;
0020	Източник на вероятността от неизпълнение	Член 377 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Докладва се източникът на вероятността от неизпълнение за портфейла. Посочва се един от следните отговори: а) агенции за кредитен рейтинг; б) вътрешнорейтингов подход; в) произтичащи от пазара вероятности от неизпълнение; г) друг източник на вероятности от неизпълнение (моля, уточнете). Институцията използва колона 0020 за поясняване на дадения в колона 0010 отговор. В случай че в колона 0010 е избрана подточка г), в колона 0020 институцията представя по-подробни данни.
0030	Източник на миграционните таблици	Член 377 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Докладва се източникът на миграционните таблици, приложени на равнището на портфейла. Посочва се един от следните отговори: а) агенции за кредитен рейтинг; б) вътрешнорейтингов подход; в) произтичащи от пазара миграционни таблици; г) друг източник на миграционни таблици (моля, уточнете). Институцията използва колона 0020 за поясняване на дадения в колона 0010 отговор. В случай че в колона 0010 е избрана подточка г), в колона 0020 институцията представя по-подробни данни.

С 110.03 — Корелационно търгуване. Всички ценови рискове по портфейл/дата

Указания относно таблиците (ос z)

Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
Портфейл	Раздели 3, 4 и 5 от приложение V	Посочва се номерът на портфейла от приложение V — само за портфейлите, при които се изисква показател за всички ценови рискове.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0010	Дата	Член 377 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Докладва се показателят за всички ценови рискове за 10-те работни дни между „първоначалната референтна дата за показателите за измерване на риска“ и „крайната референтна дата за показателите за измерване на риска (и крайната референтна дата по алтернативния стандартизиран подход)“, съгласно посоченото в раздел 1, буква б) от приложение V. Датите се докладват във формат „дд/мм/гггг“.
0060	Всички ценови рискове	Член 377 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Докладват се резултатите, получени при прилагането на регулаторния модел за отчитане на корелационното търгуване към всеки портфейл. Данните се докладват за всяка от датите, посочени в колона 0010. Ако на датата, посочена в колона 0010, институцията не използва модел за отчитане на корелационното търгуване, полето се оставя празно (т.е. нулеви стойности се докладват само ако резултатът от изчислението е нула).

С 120.01 – Метод за изчисляване на чувствителностите ЧУВСТВИТЕЛНОСТИ КЪМ РИСКА ПО ИНСТРУМЕНТИ/ПОРТФЕЙЛИ

Институциите докладват за всеки инструмент чувствителността към рисковите фактори, на които е изложен. Всеки ред обхваща един рисков фактор/чувствителност. Нетната позиция на повишаващия се (CVRk+) или намаляващия (CVRk-) риск от кривината за този рисков фактор, както е посочено в член 325ж от Регламент (ЕС) № 575/2013, се докладват в отделни редове. Всички стойности се отнасят до „крайната референтна дата за показателите за измерване на риска“ (и крайната референтна дата по алтернативния стандартизиран подход), както е определена в раздел 1, буква б), подточка v) от приложение V към настоящия регламент. Институциите докладват всяка комбинация от портфейл, номер на инструмента (колона 0010), идентификатор на риска (колона 0020), група (колона 0030) и допълнителен идентификатор (колона 0040) само веднъж.

Указания относно таблиците (ос z)

Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
Портфейл	Раздели 3, 4 и 5 от приложение V	Посочва се номерът на портфейла от приложение V.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0010	Номер на инструмента	Раздел 2 от приложение V	Посочва се номерът на инструмента от приложение V.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0020	Идентификатор на рисковия фактор	Членове 325л, 325м, 325н, 325о, 325п, 325р от Регламент (ЕС) № 575/2013	Докладва се идентификаторът на рисковия фактор, както е посочен в таблицата в края на настоящото приложение.
0030	Група	Член 325г, параграф 3 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Групата се докладва, когато идентификаторът на рисковия фактор, избран в колона 0020, съответства на рисковия клас: — Общ лихвен риск. Отговорът е наименованието на валутата на съответния рисков фактор, съответстващ на безрисков лихвен процент, на инфлацията или на лихвения спред между различни валути (следвайки обозначението на валутата по ISO 4217, напр. „EUR“); — риск, свързан с кредитния спред, при позиции, които не са част от секюритизация. Отговорът е номерът на групата в таблица 4 в член 325аз, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 575/2013. — риск, свързан с кредитния спред, при позиции, които са част от секюритизация и са извън алтернативния портфейл за корелационно търгуване. Отговорът е номерът на групата в таблица 7 в член 325ам, параграф 1 от посочения регламент. — риск, свързан с кредитния спред, при позиции, които са част от секюритизация и са включени в алтернативния портфейл за корелационно търгуване. Отговорът е номерът на групата в таблица 6 в член 325ак от посочения регламент. — риск, свързан с капиталови инструменти. Отговорът е номерът на групата в таблица 8 в член 325ап, параграф 1 от посочения регламент. — стоков риск. Отговорът е номерът на групата в таблица 9 в член 325ат от посочения регламент. — валутен риск и компоненти делта или кривина. Отговорът е наименованието на валутата (напр. „USD“, като посочените кодове са според обозначението на валутата по ISO 4217); — валутен риск и компонент вега. Отговорът е наименованието на двойката валути (напр. „EUR_USD“, като посочените кодове са според обозначението на валутата по ISO 4217).
0040	Допълнителен идентификатор1	Членове 325л — 325р и 325аи от Регламент (ЕС) № 575/2013	Докладва се следната информация, която разграничава рисковия фактор на вътрешногрупово равнище. Когато идентификаторът на рисковия фактор, избран в колона 0020, съответства на рисковия клас: — общ лихвен риск и компонент делта, отговорът е наименованието на безрисковата крива или друг съответен собствен идентификатор; — риск, свързан с кредитния спред, при позиции, които не са част от секюритизация, или при позиции, които са част от секюритизация и са включени в алтернативния портфейл за корелационно търгуване, отговорът е наименованието на емитента или друг съответен собствен идентификатор; и е идентичен за всеки две докладвани чувствителности към два рискови фактора, за които се получава корелационен параметър $\rho_{kl}^{(name)}$, равен на 1 в съответствие с член 325аи, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 575/2013. — риск, свързан с кредитния спред, при позиции, които са част от секюритизация и са извън алтернативния портфейл за корелационно търгуване, отговорът е наименованието на транша или друг съответен собствен идентификатор; — риск, свързан с капиталови инструменти, отговорът е наименованието на емитента на дадения капиталов инструменти или съответен собствен идентификатор;

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
			— стоков риск, отговорът е наименованието на стоката или друг съответен собствен идентификатор. Когато никой от тези случаи не се прилага, институциите докладват изрична стойност (NULL), т.е. не се прилага.
0060	Чувствителност към риска (резултати в отчетната валута)	Член 325г, параграф 2 и членове 325ж, 325с, 325т, 325у и 325ач от Регламент (ЕС) № 575/2013	Чувствителностите към риска (чувствителности делта/вега и позиции с риск от кривината) се докладват за всеки инструмент за всички съответни рискови фактори, както е посочено в колони 0020—0040. Стойностите се докладват в отчетната валута на институцията. Когато идентификаторът на рисковия фактор, избран в колона 0020, съответства на: — компонента делта риск на метода за изчисляване на чувствителностите, се докладва нетната чувствителност към рисковия фактор (S_k), както е посочено в член 325с от Регламент (ЕС) № 575/2013; Когато институциите са получили разрешение от своя компетентен орган да използват алтернативни изчисления на чувствителностите към делта риска в съответствие с член 325у, параграф 5 от посочения регламент, за целите на докладването те се позовават на тези алтернативни определения. — компонента вега риск на метода за изчисляване на чувствителностите, се докладва чувствителността към вега риск на опция при даден рисков фактор (S_k), както е посочено в член 325т от Регламент (ЕС) № 575/2013; Когато институциите са получили разрешение от своя компетентен орган да използват алтернативни изчисления на чувствителностите към вега риска в съответствие с член 325у, параграф 6 от посочения регламент, за целите на докладването те се позовават на тези алтернативни изчисления. Независимо дали институцията използва изчислението по член 325т или алтернативно изчисление в съответствие с член 325у, параграф 6 от посочения регламент, чувствителността се докладва след претеглянето ѝ по съответната очаквана променливост. — Компонент риск от кривината на метода за изчисляване на чувствителностите, докладва се нетната позиция на нарастващия (CVR_k^+) или намаляващия (CVR_k^-) риск от кривината за този рисков фактор, както е посочено в член 325ж от Регламент (ЕС) № 575/2013. Докладваната стойност се изразява като десетична дроб с точност най-малко два знака след десетичната запетая. Нулеви стойности се докладват само когато резултатът от изчислението е действително нула.
0070	Отчетна валута		Посочва се наименованието на отчетната валута на институцията (докладваната стойност следва обозначението на валутата по ISO 4217, напр. „EUR“).
0080	Чувствителност към риска (Резултати във валутата на портфейла на ЕБО)	Раздели 3 и 4 от приложение V към настоящия регламент и член 325г, параграф 2 и членове 325ж, 325с, 325т, 325у и 325ач от Регламент (ЕС) № 575/2013	Стойностите се докладват според указанията за колона 0060, но се преизчисляват по спот курса на ЕЦБ за валутата на портфейла, както е определено в раздели 3 и 4 от приложение V към настоящия регламент.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0090	Рисково тегло	Трета част, дял IV, глава 1а, раздел 6 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Докладва се рисковото тегло, съответстващо на рисковия фактор, както е посочено в колони 0020—0040. Когато идентификаторът на рисковия фактор, избран в колона 0020, съответства на компонента на риска от кривината, се докладва рисковото тегло, използвано за определяне на приложимата относителна промяна. Докладваната стойност се изразява като десетична дроб с минимална точност от четири знака след десетичната запетая.
0110	Допълнителен идентификатор2	Член 325п, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Когато идентификаторът на рисковия фактор, избран в колона 0010, съответства на рисковия клас: стоков риск и компонента делта риск на метода за изчисляване на чувствителностите, отговорът е наборът от правни условия за доставката на стоката или друг съответен собствен идентификатор. Когато никой от тези случаи не се прилага, институциите докладват изрична стойност (NULL), т.е. не се прилага.
0120	Категория кредитно качество	Член 325м, параграф 1 и член 325аз, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Когато идентификаторът на рисковия фактор, избран в колона 0010, съответства на рисковия клас: риск, свързан с кредитния спред, при позиции, които не са част от секюритизация, и компонента делта риск на метода за изчисляване на чувствителностите, отговорът е едно от следните: а) „СКК 1“; б) „СКК 2“; в) „СКК 3“; г) „СКК 4“; д) „СКК 5“; е) „СКК 6“; ж) „Без присъдена СКК (без рейтинг)“. Когато никой от тези случаи не се прилага, институциите докладват изрична стойност (NULL), т.е. не се прилага.

С 120.02 – Метод за изчисляване на чувствителностите СЪСТАВ НА КАПИТАЛОВИТЕ ИЗИСКВАНИЯ ПО ПОРТФЕЙЛИ

Указания относно таблиците (ос z)

Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
Портфейл	Раздели 3, 4 и 5 от приложение V	Посочва се номерът на портфейла от приложение V.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0010	Рисков клас	Член 325г, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Докладва се рисковият клас. Посочва се един от следните отговори: а) „общ лихвен риск“; б) „риск, свързан с кредитния спред, при позиции, които не са част от секюритизация“; в) „риск, свързан с кредитния спред, при позиции, които са част от секюритизация и са извън алтернативния портфейл за корелационно търгуване“; г) „риск, свързан с кредитния спред, при позиции, които са част от секюритизация и са включени в алтернативния портфейл за корелационно търгуване“; д) „риск, свързан с капиталови инструменти“; е) „стоков риск“; ж) „валутен риск“.
0020	Компонент	Член 325д, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Докладва се компонентът на метода за изчисляване на чувствителностите. Посочва се един от следните отговори: а) „делта риск“; б) „вега риск“; в) „риск от кривината“.
0030	Корелационен сценарий	Член 325з от Регламент (ЕС) № 575/2013	Докладва се корелационният сценарий. Посочва се един от следните отговори: а) „сценарий със средна корелация“; б) „сценарий с висока корелация“; в) „сценарий с ниска корелация“.
0040	Капиталови изисквания (резултати в отчетната валута)	Член 325з от Регламент (ЕС) № 575/2013	Стойностите на капиталовите изисквания се докладват за „крайната референтна дата за показателите за измерване на риска (и крайната референтна дата по алтернативния стандартизиран подход)“ (както е посочена в раздел 1, буква б) от приложение V към настоящия регламент) за всеки портфейл и за всички съответни комбинации от рисков клас, компонент и корелационен сценарий. Стойностите се докладват в отчетната валута на институцията с точност най-малко два знака след десетичната запетая.
0050	Отчетна валута		Посочва се отчетната валута на институцията (докладваната стойност следва обозначението на валутата по ISO 4217).
0060	Капиталови изисквания (Резултати във валутата на портфейла на ЕБО)	Раздели 3 и 4 от приложение V към настоящия регламент и член 325з от Регламент (ЕС) № 575/2013	Стойностите се докладват според указанията за колона 0040, но се преизчисляват по спот курса на ЕЦБ за валутата на портфейла, както е определено в раздели 3 и 4 от приложение V към настоящия регламент.
0070	Позиции без опционални характеристики, за които се прилагат капиталови изисквания за риска от кривината	Член 325д, параграф 3 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Когато компонентът в колона 0020 съответства на риска от кривината: а) Вписва се „ВЯРНО“, ако при изчисляването на резултата, докладван в колони 0040 и 0060, институцията прилага подхода, посочен в член 325д, параграф 3, първа алинея от Регламент (ЕС) № 575/2013. б) В останалите случаи се вписва „НЕВЯРНО“. Когато никой от тези случаи не се прилага, също се вписва „НЕВЯРНО“.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0080	Подход на основната валута, прилаган за делта и риска от кривината на валутния риск	Член 325р, параграф 7 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Когато рисковият клас в колона 0010 съответства на валутния риск, а компонентът в колона 0020 — на делта риска или риска от кривината: а) Вписва се „ВЯРНО“, ако при изчисляването на резултата, докладван в колони 0040 и 0060, институцията прилага подхода, посочен в член 325р, параграф 7 от Регламент (ЕС) № 575/2013. б) В останалите случаи се вписва „НЕВЯРНО“. Когато никой от тези случаи не се прилага, също се вписва „НЕВЯРНО“.
0090	Разделяне на компонентите на риска от кривината за валутния риск по скалар	Член 325р, параграф 6 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Когато рисковият клас в колона 0010 съответства на валутния риск, а компонентът в колона 0020 — на риска от кривината: а) Вписва се „ВЯРНО“, ако при изчисляването на резултата, докладван в колони 0040 и 0060, институцията прилага подхода, посочен в член 325р, параграф 6 от Регламент (ЕС) № 575/2013. б) В останалите случаи се вписва „НЕВЯРНО“. Когато никой от тези случаи не се прилага, също се вписва „НЕВЯРНО“.
0095	Подаване на резултатите за портфейлите за валидиране по SBM	Член 325д, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Когато портфейлът, за който се докладва информация, е портфейл за валидиране по SBM, както е посочено в раздел 7 от приложение V: а) „Подадени“ се посочва, ако институцията подава резултати, съответстващи на този портфейл; б) „Неподадени — няма експозиция към рисков фактор“ се посочва, ако институцията избере да не подава резултати за съответния портфейл за валидиране по SBM, тъй като няма вътрешно одобрение от ръководството на тази институция да се извършва дейност с инструменти, които биха създали експозиция към съответния рисков фактор. „Не е приложимо“ се посочва, когато портфейлът, за който се докладва информация, е портфейл съгласно посоченото в раздели 3, 4 или 5 от приложение V.
0100	Поле за свободен текст		В тази колона институцията може да впише допълнителна информация.

С 120.04 – КАПИТАЛОВО ИЗИСКВАНЕ ЗА РИСКА ОТ НЕИЗПЪЛНЕНИЕ ПАЗАРНИ СТОЙНОСТИ И БРУТНИ СУМИ, ИЗЛОЖЕНИ НА РИСК ОТ ВНЕЗАПНО НЕИЗПЪЛНЕНИЕ, ПО ИНСТРУМЕНТИ/ПОРТФЕЙЛИ

Институциите докладват по инструменти експозициите, съответстващи на инструмента. Всеки ред обхваща една експозиция. Всички стойности се отнасят до „крайната референтна дата за показателите за измерване на риска“ (и крайната референтна дата по алтернативния стандартизиран подход), както е определена в раздел 1, буква б), подточка v) от приложение V към настоящия регламент. Експозициите се докладват преди да е извършено прихващане, но след предприети стъпки за възпроизвеждане или разлагане (както е определено в членове 325щ и 325ав от Регламент (ЕС) № 575/2013), когато е приложимо.

Указания относно таблиците (ос z)

Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
Портфейл	Раздели 3, 4 и 5 от приложение V	Посочва се номерът на портфейла от приложение V.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0010	Номер на инструмента	Раздел 2 от приложение V	Посочва се номерът на инструмента от приложение V.
0020	Рисков клас	Член 325x, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Докладва се рисковият клас, за който в колони 0030 и 0040 се докладва изискването за риск от неизпълнение (DRC). Отговорът е един от следните видове инструменти: а) „Инструменти, различни от секюритизиращи позиции“; б) „Секюритизиращи позиции извън АПКТ“; в) „Секюритизиращи позиции, включени в АПКТ“.
0030	Група1	Член 325ш, параграф 3, член 325аа, параграф 4 и член 325аг, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Докладва се групата. Когато рисковият клас, докладван в колона 0020, съответства на „позиции, които не са част от секюритизация“, отговорът е един от следните: а) „Предприятия“; б) „Държави“; в) „Органи на местната власт/общини“. Когато вместо това рисковият клас, докладван в колона 0020, съответства на „секюритизации извън АПКТ“, отговорът е а) по-горе или едно от следните: а) „Обезпечени с активи търговски ценни книжа — Азия“; б) „Обезпечени с активи търговски ценни книжа — Европа“; в) „Обезпечени с активи търговски ценни книжа — Северна Америка“; г) „Обезпечени с активи търговски ценни книжа — Останал свят“; д) „Заеми за покупка/лизинг на автомобил — Азия“; е) „Заеми за покупка/лизинг на автомобил — Европа“; ж) „Заеми за покупка/лизинг на автомобил — Северна Америка“; з) „Заеми за покупка/лизинг на автомобил — Останал свят“; и) „Обезпечени с дълг структурирани облигации (CDO-squared) — Азия“; й) „Обезпечени с дълг структурирани облигации (CDO-squared) — Европа“; к) „Обезпечени с дълг структурирани облигации (CDO-squared) — Северна Америка“; л) „Обезпечени с дълг структурирани облигации (CDO-squared) — Останал свят“; м) „Обезпечени с кредити облигации — Азия“; н) „Обезпечени с кредити облигации — Европа“; о) „Обезпечени с кредити облигации — Северна Америка“; п) „Обезпечени с кредити облигации — Останал свят“; р) „Обезпечени с ипотека върху търговски имоти ценни книжа (CMBS) — Азия“; с) „Обезпечени с ипотека върху търговски имоти ценни книжа (CMBS) — Европа“; т) „Обезпечени с ипотека върху търговски имоти ценни книжа (CMBS) — Северна Америка“; у) „Обезпечени с ипотека върху търговски имоти ценни книжа (CMBS) — Останал свят“; ф) „Кредитни карти — Азия“; х) „Кредитни карти — Европа“; ц) „Кредитни карти — Северна Америка“; ч) „Кредитни карти — Останал свят“; ш) „Други експозиции на дребно — Азия“; щ) „Други експозиции на дребно — Европа“; ъ) „Други експозиции на дребно — Северна Америка“;

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
			ю) „Други експозиции на дребно — Останал свят“; я) „Други експозиции на едро — Азия“; аа) „Други експозиции на едро — Европа“; бб) „Други експозиции на едро — Северна Америка“; вв) „Други експозиции на едро — Останал свят“; гг) „Обезпечени с ипотека върху жилищни имоти ценни книжа (RMBS) — Азия“; дд) „Обезпечени с ипотека върху жилищни имоти ценни книжа (RMBS) — Европа“; ее) „Обезпечени с ипотека върху жилищни имоти ценни книжа (RMBS) — Северна Америка“; жж) „Обезпечени с ипотека върху жилищни имоти ценни книжа (RMBS) — Останал свят“; зз) „Малки и средни предприятия (МСП) — Азия“; ии) „Малки и средни предприятия (МСП) — Европа“; йй) „Малки и средни предприятия (МСП) — Северна Америка“; кк) „Малки и средни предприятия (МСП) — Останал свят“; лл) „Студентски заеми — Азия“; мм) „Студентски заеми — Европа“; нн) „Студентски заеми — Северна Америка“; оо) „Студентски заеми — Останал свят“. Когато вместо това рисковият клас, докладван в колона 0020, съответства на „секюритизации, включени в АПКТ“, отговорът е „секюритизации, включени в АПКТ“.
0040	Група2	Член 325аг, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Когато рисковият клас, докладван в колона 0020, съответства на „секюритизации, включени в АПКТ“, отговорът е наименованието на индекса, в противен случай се докладва (NUL).
0050	Длъжник	Член 325х, параграф 2, член 325ч, параграф 1 и членове 325щ и 325ав от Регламент (ЕС) № 575/2013	Институциите докладват информация, свързана с длъжника. Когато рисковият клас, докладван в колона 0020, съответства на: — „Инструменти, различни от секюритизиращи позиции“, отговорът е наименованието на длъжника; — „секюритизиращи позиции извън АПКТ“, отговорът е наименованието на длъжника или собствен идентификатор, обозначаващ групата от базови активи и транша; — „секюритизиращи позиции, включени в АПКТ“, отговорът е собствен идентификатор, обозначаващ семейството, серията и транша на индекса.
0060	Категория кредитно качество	Член 325ш, параграфи 1 и 2, член 325аа, параграф 1 и член 325аг, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Институциите докладват кредитното качество. Посочва се един от следните отговори: а) „СКК 1“; б) „СКК 2“; в) „СКК 3“; г) „СКК 4“; д) „СКК 5“; е) „СКК 6“; ж) „Без присъдена СКК (без рейтинг)“;

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
			з) „Без присъдена СКК (в неизпълнение)“; и) „Без присъдена СКК (рисково тегло 0 %“). Когато рисковият клас, докладван в колона 0020, съответства на „секюритизации, включени в АПКТ“ или „секюритизации извън АПКТ“ отговорът е един от посочените по-горе или един от следните: й) „СКК 7“; к) „СКК 8“; л) „СКК 9“; м) „СКК 10“; н) „СКК 11“; о) „СКК 12“; п) „СКК 13“; р) „СКК 14“; с) „СКК 15“; т) „СКК 16“; у) „СКК 17“; ф) „Всички други СКК“;
0070	Тегло на риска от неизпълнение	Член 325x, параграф 1, буква е), член 325ш, параграфи 1 и 2, член 325аа, параграф 1 и член 325аг, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Институциите докладват съответното рисково тегло. Рисковите тегла, прилагани към секюритизиращите експозиции, се докладват след умножаване по 8 % в съответствие с член 325аа, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 575/2013.
0080	Ранг	Член 325ц, параграфи 3 и 6 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Докладва се рангът на експозицията. Когато рисковият клас, докладван в колона 0020, съответства на „Инструменти, различни от секюритизиращи позиции“ или „секюритизиращи позиции извън АПКТ“, отговорът е един от следните: а) „Капиталови инструменти“; б) „Дългови инструменти, които не са първостепенни“; в) „Първостепенни дългови инструменти“; г) „Покрити облигации“. Полето не се попълва, ако никой от тези случаи не се прилага.
0090	Падеж	Членове 325ч, 325щ и 325ав от Регламент (ЕС) № 575/2013	Докладва се датата на падежа на експозицията. Датата се докладва във формат „дд/мм/гггг“.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0100	Процент на събиране на вземанията	Член 325x, параграф 1, буква д) от Регламент (ЕС) № 575/2013	Институциите докладват процента на събиране на вземанията. Процентът на събиране на вземанията се изчислява, като се използва приложимата загуба при неизпълнение (LGD) като процент на събиране на вземанията = 1 - LGD. Докладваният процент на събиране на вземанията се изразява като десетична дроб между 0 и 1 с точност най-малко четири знака след десетичната запетая.
0110	Посока	Член 325x, параграф 1, букви а) и б) от Регламент (ЕС) № 575/2013	Институциите докладват посоката на експозицията в съответствие с определенията в член 325x, параграф 1, букви а) и б) от Регламент (ЕС) № 575/2013. Посочва се един от следните отговори: а) „Къса експозиция“; б) „Дълга експозиция“.
0120	Начална точка на загуба (%)	Членове 325aa и 325ar от Регламент (ЕС) № 575/2013	Когато докладваната експозиция се отнася за транш, институциите докладват началната точка на загуба на транша. Докладваната стойност се изразява като десетична дроб с минимална точност от четири знака след десетичната запетая.
0130	Крайна точка на загуба (%)	Членове 325aa и 325ar от Регламент (ЕС) № 575/2013	Когато докладваната експозиция се отнася за транш, институциите докладват крайната точка на загуба на транша. Докладваната стойност се изразява като десетична дроб с минимална точност от четири знака след десетичната запетая.
0140—0170	Резултати в отчетната валута		Стойностите се докладват спрямо отчетната валута на институцията с точност най-малко два знака след десетичната запетая, когато е приложимо.
0140	Условна стойност	Член 325ц, параграфи 1, 2 и 5 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Когато рисковият клас, докладван в колона 0020, съответства на „Инструменти, различни от секюритизиращи позиции“, институциите докладват условната стойност на инструмента. В зависимост от вида на експозицията стойността съответства на елемента $V_{notional}$ в член 325ц, параграфи 1 и 2 от Регламент (ЕС) № 575/2013 или на елемента V в член 325ц, параграф 5 от същия регламент. Полето не се попълва, когато никой от тези случаи не се прилага или когато институцията не изчислява или не използва сумата, която трябва да се докладва в тази колона, за да оцени брутната сума, изложена на риск от внезапно неизпълнение.
0150	Печалба и загуба + Корекция	Член 325ц, параграфи 1, 2 и 5 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Институциите докладват сбора на печалбата и загубата, както и корекцията за всяка експозиция: — Когато рисковият клас, докладван в колона 0020, съответства на „Инструменти, различни от секюритизиращи позиции“, а докладваната експозиция е дълга експозиция, институциите докладват сбора от $P\&L_{long}$ и $Adjustment_{long}$ в съответствие с член 325ц, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 575/2013. — Когато рисковият клас, докладван в колона 0020, съответства на „Инструменти, различни от секюритизиращи позиции“, а докладваната експозиция е къса експозиция, институциите докладват сбора на $P\&L_{short}$ и $Adjustment_{short}$ в съответствие с член 325ц, параграф 2 от посочения регламент.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
			Полето не се попълва, когато никой от тези случаи не се прилага или когато институцията не изчислява или не използва сумата, която трябва да се докладва в тази колона, за да оцени брутната сума, изложена на риск от внезапно неизпълнение.
0160	Брутна сума, изложена на риск от внезапно неизпълнение	Член 325x, параграф 1, буква в), член 325ц, параграфи 1, 2 и 5, член 325щ, параграф 1 и член 325ав, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Институциите докладват брутната сума, изложена на риска от внезапно неизпълнение, за конкретната експозиция.
0170	Валута		Посочва се отчетната валута на институцията (докладваната стойност следва обозначението на валутата по ISO 4217).
0180—0200	Резултати във валутата на портфейла на ЕБО	Раздели 3 и 4 от приложение V към настоящия регламент и членове 325ш, 325аа и 325аг от Регламент (ЕС) № 575/2013	Стойностите се докладват според указанията за колона 0030, но се преизчисляват по спот курса на ЕЦБ за валутата на портфейла, както е определено в раздели 3 и 4 от приложение V към настоящия регламент.
0180	Условна стойност	Член 325ц, параграфи 1, 2 и 5 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Когато рисковият клас, докладван в колона 0020, съответства на „Инструменти, различни от секюритизиращи позиции“, институциите докладват условната стойност на инструмента. В зависимост от вида на експозицията стойността съответства на елемента $V_{notional}$ в член 325ц, параграфи 1 и 2 от Регламент (ЕС) № 575/2013 или на елемента V в член 325ц, параграф 5 от същия регламент. Полето не се попълва, когато никой от тези случаи не се прилага или когато институцията не изчислява или не използва сумата, която трябва да се докладва в тази колона, за да оцени брутната сума, изложена на риск от внезапно неизпълнение.
0190	Печалба и загуба + Корекция	Член 325ц, параграфи 1, 2 и 5 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Институциите докладват сбора на печалбата и загубата, както и корекцията за всяка експозиция: — Когато рисковият клас, докладван в колона 0020, съответства на „Инструменти, различни от секюритизиращи позиции“, а докладваната експозиция е дълга експозиция, институциите докладват сбора от $P\&L_{long}$ и $Adjustment_{long}$ в съответствие с член 325ц, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 575/2013. — Когато рисковият клас, докладван в колона 0020, съответства на „Инструменти, различни от секюритизиращи позиции“, а докладваната експозиция е къса експозиция, институциите докладват сбора на $P\&L_{short}$ и $Adjustment_{short}$ в съответствие с член 325ц, параграф 2 от посочения регламент.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
			Полето не се попълва, когато никой от тези случаи не се прилага или когато институцията не изчислява или не използва сумата, която трябва да се докладва в тази колона, за да оцени брутната сума, изложена на риск от внезапно неизпълнение.
0200	Брутна сума, изложена на риск от внезапно неизпълнение	Член 325x, параграф 1, буква в), член 325ц, параграфи 1, 2 и 5, член 325щ, параграф 1 и член 325ав, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Институциите докладват брутната сума, изложена на риска от внезапно неизпълнение, за конкретната експозиция.

С 120.05 – КАПИТАЛОВО ИЗИСКВАНЕ ЗА РИСКА ОТ НЕИЗПЪЛНЕНИЕ СЪСТАВ НА КАПИТАЛОВИТЕ ИЗИСКВАНИЯ ПО ПОРТФЕЙЛИ

Указания относно таблиците (ос z)

Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
Портфейл	Раздели 3, 4 и 5 от приложение V	Посочва се номерът на портфейла от приложение V.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0010	Рисков клас	Член 325x, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Посочва се рисковият клас, за който в колони 0030 и 0040 се докладва изискването за риск от неизпълнение. Отговорът е един от следните видове инструменти: а) „инструменти, различни от секюритизиращи позиции“; б) „секюритизиращи позиции извън АПКТ“; в) „секюритизиращи позиции, включени в АПКТ“.
0020	Група1	Член 325ш, параграф 3, член 325аа, параграф 4 и член 325аг, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Докладва се групата. Когато рисковият клас, докладван в колона 0010, съответства на „Инструменти, различни от секюритизиращи позиции“, отговорът е един от следните: а) „Предприятия“; б) „Държави“; в) „Органи на местната власт/общини“.

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
			Когато вместо това рисковият клас, докладван в колона 0010, съответства на „секюритизиращи позиции извън АПКТ“, отговорът е един от следните: а) „Обезпечени с активи търговски ценни книжа — Азия“; б) „Обезпечени с активи търговски ценни книжа — Европа“; в) „Обезпечени с активи търговски ценни книжа — Северна Америка“; г) „Обезпечени с активи търговски ценни книжа — Останал свят“; д) „Заеми за покупка/лизинг на автомобил — Азия“; е) „Заеми за покупка/лизинг на автомобил — Европа“; ж) „Заеми за покупка/лизинг на автомобил — Северна Америка“; з) „Заеми за покупка/лизинг на автомобил — Останал свят“; и) „Обезпечени с дълг структурирани облигации (CDO-squared) — Азия“; й) „Обезпечени с дълг структурирани облигации (CDO-squared) — Европа“; к) „Обезпечени с дълг структурирани облигации (CDO-squared) — Северна Америка“; л) „Обезпечени с дълг структурирани облигации (CDO-squared) — Останал свят“; м) „Обезпечени с кредити облигации — Азия“; н) „Обезпечени с кредити облигации — Европа“; о) „Обезпечени с кредити облигации — Северна Америка“; п) „Обезпечени с кредити облигации — Останал свят“; р) „Обезпечени с ипотека върху търговски имоти ценни книжа (CMBS) — Азия“; с) „Обезпечени с ипотека върху търговски имоти ценни книжа (CMBS) — Европа“; т) „Обезпечени с ипотека върху търговски имоти ценни книжа (CMBS) — Северна Америка“; у) „Обезпечени с ипотека върху търговски имоти ценни книжа (CMBS) — Останал свят“; ф) „Кредитни карти — Азия“; х) „Кредитни карти — Европа“; ц) „Кредитни карти — Северна Америка“; ч) „Кредитни карти — Останал свят“; ш) „Други експозиции на дребно — Азия“; щ) „Други експозиции на дребно — Европа“; ъ) „Други експозиции на дребно — Северна Америка“; ю) „Други експозиции на дребно — Останал свят“; я) „Други експозиции на едро — Азия“; аа) „Други експозиции на едро — Европа“; бб) „Други експозиции на едро — Северна Америка“; вв) „Други експозиции на едро — Останал свят“; гг) „Обезпечени с ипотека върху жилищни имоти ценни книжа (RMBS) — Азия“; дд) „Обезпечени с ипотека върху жилищни имоти ценни книжа (RMBS) — Европа“; ее) „Обезпечени с ипотека върху жилищни имоти ценни книжа (RMBS) — Северна Америка“; жж) „Обезпечени с ипотека върху жилищни имоти ценни книжа (RMBS) — Останал свят“; зз) „Малки и средни предприятия (МСП) — Азия“; ии) „Малки и средни предприятия (МСП) — Европа“; йй) „Малки и средни предприятия (МСП) — Северна Америка“; кк) „Малки и средни предприятия (МСП) — Останал свят“; лл) „Студентски заеми — Азия“;

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
			мм) „Студентски заеми — Европа“; нн) „Студентски заеми — Северна Америка“; оо) „Студентски заеми — Останал свят“. Когато вместо това рисковият клас, докладван в колона 0010, съответства на „секюритизиращи позиции, включени в АПКТ“, отговорът е „секюритизации, включени в АПКТ“.
0030	Група2	Член 325аг, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 575/2013	Когато рисковият клас, докладван в колона 0010, съответства на „секюритизиращи позиции, включени в АПКТ“, отговорът е наименованието на индекса, в противен случай се докладва (NUL).
0040	Капиталови изисквания (резултати в отчетната валута)	Членове 325ш, 325аа и 325аг от Регламент (ЕС) № 575/2013	Капиталовите изисквания за риск от неизпълнение се докладват за „крайната референтна дата за показателите за измерване на риска (и крайната референтна дата по алтернативния стандартизиран подход)“ (както е посочено в раздел 1, буква б) от приложение V към настоящия регламент). Стойностите се докладват в отчетната валута на институцията с точност най-малко два знака след десетичната запетая.
0050	Отчетна валута		Посочва се отчетната валута на институцията (докладваната стойност следва обозначението на валутата по ISO 4217).
0060	Капиталови изисквания (Резултати във валутата на портфейла на ЕБО)	Раздели 3 и 4 от приложение V към настоящия регламент и членове 325ш, 325аа и 325аг от Регламент (ЕС) № 575/2013	Стойностите се докладват според указанията за колона 0030, но се преизчисляват по спот курса на ЕЦБ за валутата на портфейла, както е определено в раздели 3 и 4 от приложение V към настоящия регламент.

С 120.06 — Алтернативен стандартизиран подход КАПИТАЛОВИ ИЗИСКВАНИЯ

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0010	Номер на портфейла	Раздели 3, 4 и 5 от приложение V	Посочва се номерът на портфейла от приложение V.
0020—0040	Резултати в отчетната валута	Раздели 3 и 4 от приложение V	

Колона	Обозначение	Препратка към нормативен акт	Указания
0020	КАПИТАЛОВИ ИЗИСКВАНИЯ — МЕТОД ЗА ИЗЧИСЛЯВАНЕ НА ЧУВСТВИТЕЛНОСТИТЕ	Член 325з от Регламент (ЕС) № 575/2013	Капиталовите изисквания за метода на изчисляване на чувствителностите по алтернативния стандартизиран подход се докладват за „крайната референтна дата за показателите за измерване на риска (и крайната референтна дата по алтернативния стандартизиран подход)“ (както е посочено в раздел 1, буква б) от приложение V към настоящия регламент) за всеки портфейл.
0030	КАПИТАЛОВИ ИЗИСКВАНИЯ — РИСК ОТ НЕИЗПЪЛНЕНИЕ	Член 325х от Регламент (ЕС) № 575/2013	Капиталовите изисквания за риска от неизпълнение по алтернативния стандартизиран подход се докладват за „крайната референтна дата за показателите за измерване на риска (и крайната референтна дата по алтернативния стандартизиран подход)“ (както е посочено в раздел 1, буква б) от приложение V към настоящия регламент) за всеки портфейл.
0040	КАПИТАЛОВИ ИЗИСКВАНИЯ — ДОБАВКА ЗА ОСТАТЪЧЕН РИСК	Член 325ф от Регламент (ЕС) № 575/2013	Капиталовите изисквания за добавката за остатъчен риск по алтернативния стандартизиран подход се докладват за „крайната референтна дата за показателите за измерване на риска (и крайната референтна дата по алтернативния стандартизиран подход)“ (както е посочено в раздел 1, буква б) от приложение V към настоящия регламент) за всеки портфейл.
0050—0070	Резултати във валутата на портфейла на ЕБО	Раздели 3 и 4 от приложение V	Когато отчетната валута на институцията е различна от валутите на портфейла на ЕБО, посочени в приложение V, раздели 3 и 4 към настоящия регламент, институциите преобразуват отчетната валута по приложимия спот курс на ЕЦБ.
0050	КАПИТАЛОВИ ИЗИСКВАНИЯ — МЕТОД ЗА ИЗЧИСЛЯВАНЕ НА ЧУВСТВИТЕЛНОСТИТЕ	Член 325з от Регламент (ЕС) № 575/2013	Капиталовите изисквания за метода на изчисляване на чувствителностите по алтернативния стандартизиран подход се докладват за „крайната референтна дата за показателите за измерване на риска (и крайната референтна дата по алтернативния стандартизиран подход)“ (както е посочено в раздел 1, буква б) от приложение V към настоящия регламент) за всеки портфейл.
0060	КАПИТАЛОВИ ИЗИСКВАНИЯ — РИСК ОТ НЕИЗПЪЛНЕНИЕ	Член 325х от Регламент (ЕС) № 575/2013	Капиталовите изисквания за риска от неизпълнение по алтернативния стандартизиран подход се докладват за „крайната референтна дата за показателите за измерване на риска (и крайната референтна дата по алтернативния стандартизиран подход)“ (както е посочено в раздел 1, буква б) от приложение V към настоящия регламент) за всеки портфейл.
0070	КАПИТАЛОВИ ИЗИСКВАНИЯ — ДОБАВКА ЗА ОСТАТЪЧЕН РИСК	Член 325ф от Регламент (ЕС) № 575/2013	Капиталовите изисквания за добавката за остатъчен риск по алтернативния стандартизиран подход се докладват за „крайната референтна дата за показателите за измерване на риска (и крайната референтна дата по алтернативния стандартизиран подход)“ (както е посочено в раздел 1, буква б) от приложение V към настоящия регламент) за всеки портфейл.

Таблица: насоки за докладването на образци 106.01 (колона 0010) и 120.01 (колона 0020)

— Колоната „рисков клас“ се отнася за член 325г, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 575/2013. За обозначаване на рисковите класове се използват следните съкращения:

а) „GIRR“ (общ лихвен риск);

б) „CSR_NON_SEC“ (риск, свързан с кредитния спред, при позиции, които не са част от секюритизация);

в) „CSR_SEC_NON_ACTP“ (риск, свързан с кредитния спред, при позиции, които са част от секюритизация и са извън алтернативния портфейл за корелационно търгуване);

г) „CSR_SEC_ACTP“ (риск, свързан с кредитния спред, при позиции, които са част от секюритизация и са включени в алтернативния портфейл за корелационно търгуване);

д) „EQ“ (риск, свързан с капиталови инструменти);

е) „CM“ (стоков риск);

ж) „FX“ (валутен риск);

— Колоната „компонент“ се отнася за член 325д, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 575/2013. За обозначаване на компонентите на метода за изчисляване на чувствителностите се използват следните съкращения:

а) „DELTA“ (делта риск);

б) „VEGA“ (вега риск);

в) „CURVATURE“ (риск от кривината).

— Колоната „срок до падежа“ се отнася до падежа на рисковия фактор, когато рисковите фактори са определени според конкретни точки съгласно членове 325л, 325м, 325н, 325о, 325п, 325р от Регламент (ЕС) № 575/2013. За факторите на вега риска при общия лихвен риск, както е посочено в член 325л, параграф 7 от посочения регламент, са дадени два срока до падежа, разделени с тире (напр. „0,5 години — 0,5 години“), като първият се отнася до падежа на опцията, а вторият — до остатъчния срок до падежа на базовия инструмент на опцията към датата на изтичането ѝ.

— В колона „допълнителни характеристики“ се доуточнява съответният рисков фактор предвид разграничението между рисковите фактори на инфлацията и на лихвения спред между различни валути – съгласно член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013; между рисковите фактори на дълговите инструменти и на суаповете за кредитно неизпълнение – съгласно членове 325м и 325н от посочения регламент; между рисковите фактори на спот цената на капиталовите инструменти и на процентите по репо сделки с капиталови инструменти – съгласно член 325о от посочения регламент; както и между нетната позиция на увеличаващия се риск от кривината на този рисков фактор (CVRk+) и нетната позиция на намаляващия риск от кривината на този рисков фактор (CVRk-) – както е посочено в член 325ж от посочения регламент.

Рисков клас	Компонент	Падеж	Допълнителни характеристики	Идентификатор на рисковия фактор	Препратка към нормативен акт
CM	DELTA	0 години		CM_D_00.00	Член 325п от Регламент (ЕС) № 575/2013
CM	DELTA	0,25 години		CM_D_00.25	Член 325п от Регламент (ЕС) № 575/2013
CM	DELTA	0,5 години		CM_D_00.50	Член 325п от Регламент (ЕС) № 575/2013
CM	DELTA	1 година		CM_D_01.00	Член 325п от Регламент (ЕС) № 575/2013
CM	DELTA	2 години		CM_D_02.00	Член 325п от Регламент (ЕС) № 575/2013
CM	DELTA	3 години		CM_D_03.00	Член 325п от Регламент (ЕС) № 575/2013
CM	DELTA	5 години		CM_D_05.00	Член 325п от Регламент (ЕС) № 575/2013
CM	DELTA	10 години		CM_D_10.00	Член 325п от Регламент (ЕС) № 575/2013
CM	DELTA	15 години		CM_D_15.00	Член 325п от Регламент (ЕС) № 575/2013
CM	DELTA	20 години		CM_D_20.00	Член 325п от Регламент (ЕС) № 575/2013
CM	DELTA	30 години		CM_D_30.00	Член 325п от Регламент (ЕС) № 575/2013
CM	VEGA	0,5 години		CM_V_00.50	Член 325п от Регламент (ЕС) № 575/2013
CM	VEGA	1 година		CM_V_01.00	Член 325п от Регламент (ЕС) № 575/2013
CM	VEGA	3 години		CM_V_03.00	Член 325п от Регламент (ЕС) № 575/2013
CM	VEGA	5 години		CM_V_05.00	Член 325п от Регламент (ЕС) № 575/2013
CM	VEGA	10 години		CM_V_10.00	Член 325п от Регламент (ЕС) № 575/2013
CM	CURVATURE		Изместване във възходяща посока	CM_CU	Членове 325п и 325ж от Регламент (ЕС) № 575/2013

Рисков клас	Компонент	Падеж	Допълнителни характеристики	Идентификатор на рисковия фактор	Препратка към нормативен акт
CM	CURVATURE		Изместване в низходяща посока	CM_CD	Членове 325п и 325ж от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	0,5 години	Дългов инструмент	CSR_NON_SEC_D_00.50_DEBT	Член 325м от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	1 година	Дългов инструмент	CSR_NON_SEC_D_01.00_DEBT	Член 325м от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	3 години	Дългов инструмент	CSR_NON_SEC_D_03.00_DEBT	Член 325м от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	5 години	Дългов инструмент	CSR_NON_SEC_D_05.00_DEBT	Член 325м от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	10 години	Дългов инструмент	CSR_NON_SEC_D_10.00_DEBT	Член 325м от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	0,5 години	Суап за кредитно неизпълнение	CSR_NON_SEC_D_00.50_CDS	Член 325м от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	1 година	Суап за кредитно неизпълнение	CSR_NON_SEC_D_01.00_CDS	Член 325м от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	3 години	Суап за кредитно неизпълнение	CSR_NON_SEC_D_03.00_CDS	Член 325м от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	5 години	Суап за кредитно неизпълнение	CSR_NON_SEC_D_05.00_CDS	Член 325м от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	10 години	Суап за кредитно неизпълнение	CSR_NON_SEC_D_10.00_CDS	Член 325м от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	0,5 години		CSR_NON_SEC_V_00.50	Член 325м от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	1 година		CSR_NON_SEC_V_01.00	Член 325м от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	3 години		CSR_NON_SEC_V_03.00	Член 325м от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	5 години		CSR_NON_SEC_V_05.00	Член 325м от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	10 години		CSR_NON_SEC_V_10.00	Член 325м от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_NON_SEC	CURVATURE		Изместване във възходяща посока	CSR_NON_SEC_CU	Членове 325м и 325ж от Регламент (ЕС) № 575/2013

Рисков клас	Компонент	Падеж	Допълнителни характеристики	Идентификатор на рисковия фактор	Препратка към нормативен акт
CSR_NON_SEC	CURVATURE		Изместване в низходяща посока	CSR_NON_SEC_CD	Членове 325м и 325ж от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	0,5 години	Дългов инструмент	CSR_SEC_ACTP_D_00.50_DEBT	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	1 година	Дългов инструмент	CSR_SEC_ACTP_D_01.00_DEBT	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	3 години	Дългов инструмент	CSR_SEC_ACTP_D_03.00_DEBT	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	5 години	Дългов инструмент	CSR_SEC_ACTP_D_05.00_DEBT	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	10 години	Дългов инструмент	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_DEBT	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	0,5 години	Суап за кредитно неизпълнение	CSR_SEC_ACTP_D_00.50_CDS	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	1 година	Суап за кредитно неизпълнение	CSR_SEC_ACTP_D_01.00_CDS	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	3 години	Суап за кредитно неизпълнение	CSR_SEC_ACTP_D_03.00_CDS	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	5 години	Суап за кредитно неизпълнение	CSR_SEC_ACTP_D_05.00_CDS	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	10 години	Суап за кредитно неизпълнение	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_CDS	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	0,5 години		CSR_SEC_ACTP_V_00.50	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	1 година		CSR_SEC_ACTP_V_01.00	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	3 години		CSR_SEC_ACTP_V_03.00	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	5 години		CSR_SEC_ACTP_V_05.00	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	10 години		CSR_SEC_ACTP_V_10.00	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_ACTP	CURVATURE		Изместване във възходяща посока	CSR_SEC_ACTP_CU	Членове 325н и 325ж от Регламент (ЕС) № 575/2013

Рисков клас	Компонент	Падеж	Допълнителни характеристики	Идентификатор на рисковия фактор	Препратка към нормативен акт
CSR_SEC_ACTP	CURVATURE		Изместване в низходяща посока	CSR_SEC_ACTP_CD	Членове 325н и 325ж от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	0,5 години	Дългов инструмент	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_00.50_DEBT	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	1 година	Дългов инструмент	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_01.00_DEBT	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	3 години	Дългов инструмент	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_03.00_DEBT	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	5 години	Дългов инструмент	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_05.00_DEBT	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	10 години	Дългов инструмент	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_10.00_DEBT	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	0,5 години	Суап за кредитно неизпълнение	CSR_SEC_NON_ACTP_D_00.50_CDS	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	1 година	Суап за кредитно неизпълнение	CSR_SEC_NON_ACTP_D_01.00_CDS	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	3 години	Суап за кредитно неизпълнение	CSR_SEC_NON_ACTP_D_03.00_CDS	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	5 години	Суап за кредитно неизпълнение	CSR_SEC_NON_ACTP_D_05.00_CDS	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	10 години	Суап за кредитно неизпълнение	CSR_SEC_NON_ACTP_D_10.00_CDS	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	0,5 години		CSR_SEC_NON_ACTP_V_00.50	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	1 година		CSR_SEC_NON_ACTP_V_01.00	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	3 години		CSR_SEC_NON_ACTP_V_03.00	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	5 години		CSR_SEC_NON_ACTP_V_05.00	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	10 години		CSR_SEC_NON_ACTP_V_10.00	Член 325н от Регламент (ЕС) № 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	CURVATURE		Изместване във възходяща посока	CSR_SEC_NON_ACTP_CU	Членове 325н и 325ж от Регламент (ЕС) № 575/2013

Рисков клас	Компонент	Падеж	Допълнителни характеристики	Идентификатор на рисковия фактор	Препратка към нормативен акт
CSR_SEC_NO-N_ACTP	CURVATURE		Изместване в низходяща посока	CSR_SEC_NON_ACTP_CD	Членове 325н и 325ж от Регламент (ЕС) № 575/2013
EQ	DELTA		Спот цена	EQ_D_SPOT	Член 325о от Регламент (ЕС) № 575/2013
EQ	DELTA		Процент по репо сделка	EQ_D_REPO	Член 325о от Регламент (ЕС) № 575/2013
EQ	VEGA	0,5 години		EQ_V_00.50	Член 325о от Регламент (ЕС) № 575/2013
EQ	VEGA	1 година		EQ_V_01.00	Член 325о от Регламент (ЕС) № 575/2013
EQ	VEGA	3 години		EQ_V_03.00	Член 325о от Регламент (ЕС) № 575/2013
EQ	VEGA	5 години		EQ_V_05.00	Член 325о от Регламент (ЕС) № 575/2013
EQ	VEGA	10 години		EQ_V_10.00	Член 325о от Регламент (ЕС) № 575/2013
EQ	CURVATURE		Изместване във възходяща посока	EQ_CU	Членове 325о и 325ж от Регламент (ЕС) № 575/2013
EQ	CURVATURE		Изместване в низходяща посока	EQ_CD	Членове 325о и 325ж от Регламент (ЕС) № 575/2013
Валутни сделки (FX)	DELTA			FX_D	Член 325р от Регламент (ЕС) № 575/2013
Валутни сделки (FX)	VEGA	0,5 години		FX_V_00.50	Член 325р от Регламент (ЕС) № 575/2013
Валутни сделки (FX)	VEGA	1 година		FX_V_01.00	Член 325р от Регламент (ЕС) № 575/2013
Валутни сделки (FX)	VEGA	3 години		FX_V_03.00	Член 325р от Регламент (ЕС) № 575/2013
Валутни сделки (FX)	VEGA	5 години		FX_V_05.00	Член 325р от Регламент (ЕС) № 575/2013
Валутни сделки (FX)	VEGA	10 години		FX_V_10.00	Член 325р от Регламент (ЕС) № 575/2013
Валутни сделки (FX)	CURVATURE		Изместване във възходяща посока	FX_CU	Членове 325р и 325ж от Регламент (ЕС) № 575/2013

Рисков клас	Компонент	Падеж	Допълнителни характеристики	Идентификатор на рисковия фактор	Препратка към нормативен акт
Валутни сделки (FX)	CURVATURE		Изместване в низходяща посока	FX_CD	Членове 325р и 325ж от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	DELTA	0,25 години		GIRR_D_00.25	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	DELTA	0,5 години		GIRR_D_00.50	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	DELTA	1 година		GIRR_D_01.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	DELTA	2 години		GIRR_D_02.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	DELTA	3 години		GIRR_D_03.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	DELTA	5 години		GIRR_D_05.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	DELTA	10 години		GIRR_D_10.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	DELTA	15 години		GIRR_D_15.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	DELTA	20 години		GIRR_D_20.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	DELTA	30 години		GIRR_D_30.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	DELTA		Инфлация	GIRR_D_INF	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	DELTA		Лихвен спред между валути (спрямо EUR)	GIRR_D_CRO_EUR	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	DELTA		Лихвен спред между валути (спрямо USD)	GIRR_D_CRO_USD	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 години - 0,5 години		GIRR_V_00.50_00.50	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	1 година — 0,5 години		GIRR_V_01.00_00.50	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	3 години - 0,5 години		GIRR_V_03.00_00.50	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013

Рисков клас	Компонент	Падеж	Допълнителни характеристики	Идентификатор на рисковия фактор	Препратка към нормативен акт
GIRR	VEGA	5 години - 0,5 години		GIRR_V_05.00_00.50	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	10 години - 0,5 години		GIRR_V_10.00_00.50	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 години — 1 година		GIRR_V_00.50_01.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	1 година — 1 година		GIRR_V_01.00_01.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	3 години — 1 година		GIRR_V_03.00_01.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	5 години — 1 година		GIRR_V_05.00_01.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	10 години — 1 година		GIRR_V_10.00_01.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 години - 3 години		GIRR_V_00.50_03.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	1 година — 3 години		GIRR_V_01.00_03.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	3 години - 3 години		GIRR_V_03.00_03.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	5 години - 3 години		GIRR_V_05.00_03.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	10 години - 3 години		GIRR_V_10.00_03.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 години - 5 години		GIRR_V_00.50_05.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	1 година — 5 години		GIRR_V_01.00_05.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	3 години - 5 години		GIRR_V_03.00_05.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	5 години - 5 години		GIRR_V_05.00_05.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	10 години - 5 години		GIRR_V_10.00_05.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013

Рисков клас	Компонент	Падеж	Допълнителни характеристики	Идентификатор на рисковия фактор	Препратка към нормативен акт
GIRR	VEGA	0,5 години - 10 години		GIRR_V_00.50_10.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	1 година — 10 години		GIRR_V_01.00_10.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	3 години - 10 години		GIRR_V_03.00_10.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	5 години - 10 години		GIRR_V_05.00_10.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	10 години - 10 години		GIRR_V_10.00_10.00	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 години	Инфлация	GIRR_V_00.50_INF	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	1 година	Инфлация	GIRR_V_01.00_INF	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	3 години	Инфлация	GIRR_V_03.00_INF	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	5 години	Инфлация	GIRR_V_05.00_INF	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	10 години	Инфлация	GIRR_V_10.00_INF	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 години	Лихвен спред между валути (спрямо EUR)	GIRR_V_00.50_CRO_EUR	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	1 година	Лихвен спред между валути (спрямо EUR)	GIRR_V_01.00_CRO_EUR	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	3 години	Лихвен спред между валути (спрямо EUR)	GIRR_V_03.00_CRO_EUR	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	5 години	Лихвен спред между валути (спрямо EUR)	GIRR_V_05.00_CRO_EUR	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	10 години	Лихвен спред между валути (спрямо EUR)	GIRR_V_10.00_CRO_EUR	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 години	Лихвен спред между валути (спрямо USD)	GIRR_V_00.50_CRO_USD	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	1 година	Лихвен спред между валути (спрямо USD)	GIRR_V_01.00_CRO_USD	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013

Рисков клас	Компонент	Падеж	Допълнителни характеристики	Идентификатор на рисковия фактор	Препратка към нормативен акт
GIRR	VEGA	3 години	Лихвен спред между валути (спрямо USD)	GIRR_V_03.00_CRO_USD	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	5 години	Лихвен спред между валути (спрямо USD)	GIRR_V_05.00_CRO_USD	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	VEGA	10 години	Лихвен спред между валути (спрямо USD)	GIRR_V_10.00_CRO_USD	Член 325л от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	CURVATURE		Изместване във възходяща посока	GIRR_CU	Членове 325л и 325ж от Регламент (ЕС) № 575/2013
GIRR	CURVATURE		Изместване в низходяща посока	GIRR_CD	Членове 325л и 325ж от Регламент (ЕС) № 575/2013“

ПРИЛОЖЕНИЕ IV

„ПРИЛОЖЕНИЕ VII

Резултати от сравнителните портфейли за целите на надзора. ПАЗАРЕН РИСК

РЕЗУЛТАТИ ОТ СРАВНИТЕЛНИТЕ ПОРТФЕЙЛИ ПАЗАРЕН РИСК			
Номер на образеца	**Код на образеца**	**Наименование на образеца/групата образци**	**Съкратено наименование**
		ПЪРВОНАЧАЛНА ПАЗАРНА ОЦЕНКА	
106,1	C 106.00	ПЪРВОНАЧАЛНА ПАЗАРНА ОЦЕНКА И ОБОСНОВКА НА ИЗКЛЮЧВАНЕТО	ППО
106,2	C 106.01	ЧУВСТВИТЕЛНОСТИ КЪМ РИСКА, ПО ИНСТРУМЕНТИ	ЧУВСТВИТЕЛНОСТИ
		Стойност под риск (VaR), стресирана стойност под риск (sVaR) и настояща стойност (PV)	
107,1	C 107.01	ДАННИ	VaR&SVaR 1
107,2	C 107.02	**РЕЗУЛТАТИ ЗА ПОРТФЕЙЛА ВЪВ ВАЛУТАТА НА ЕБО**	VaR&SVaR 2
		ДИНАМИЧНИ РЕДОВЕ ЗА ПЕЧАЛБАТА И ЗАГУБАТА	
108	C 108.00	ДИНАМИЧНИ РЕДОВЕ ЗА ПЕЧАЛБАТА И ЗАГУБАТА	Печалба и загуба
		КАПИТАЛОВО ИЗИСКВАНЕ ЗА ДОПЪЛНИТЕЛЕН РИСК	
109,1	C 109.01	Капиталово изискване за допълнителен риск. ДАННИ ЗА МОДЕЛА	IRC 1
109,2	C 109.02	Капиталово изискване за допълнителен риск. ДАННИ ПО ПОРТФЕЙЛИ	IRC 2
109,3	C 109.03	Капиталово изискване за допълнителен риск. РАЗМЕР ПО ПОРТФЕЙЛ/ДАТА	IRC 3
		КОРЕЛАЦИОННО ТЪРГУВАНЕ	
110,1	C 110.01	КТ. ДАННИ ЗА МОДЕЛА	КТ 1
110,2	C 110.02	КТ. ДАННИ ПО ПОРТФЕЙЛИ	КТ 2
110,3	C 110.03	КТ. РАЗМЕР ПО ПОРТФЕЙЛ/ДАТА	КТ 3
		Алтернативен стандартизиран подход (Метод за изчисляване на чувствителностите и Капиталово изискване за риска от неизпълнение)	
120,1	C 120.01	МЕТОД ЗА ИЗЧИСЛЯВАНЕ НА ЧУВСТВИТЕЛНОСТИТЕ. ЧУВСТВИТЕЛНОСТИ КЪМ РИСКА ПО ИНСТРУМЕНТИ/ ПОРТФЕЙЛИ	SBM 1
120,2	C 120.02	МЕТОД ЗА ИЗЧИСЛЯВАНЕ НА ЧУВСТВИТЕЛНОСТИТЕ. СЪСТАВ НА КАПИТАЛОВИТЕ ИЗИСКВАНИЯ ПО ПОРТФЕЙЛИ	SBM 2
120,4	C 120.04	КАПИТАЛОВО ИЗИСКВАНЕ ЗА РИСКА ОТ НЕИЗПЪЛНЕНИЕ. ПАЗАРНИ СТОЙНОСТИ И БРУТНИ СУМИ, ИЗЛОЖЕНИ НА РИСК ОТ ВНЕЗАПНО НЕИЗПЪЛНЕНИЕ, ПО ИНСТРУМЕНТИ/ПОРТФЕЙЛИ	DRC 1
120,5	C 120.05	КАПИТАЛОВО ИЗИСКВАНЕ ЗА РИСКА ОТ НЕИЗПЪЛНЕНИЕ. СЪСТАВ НА КАПИТАЛОВИТЕ ИЗИСКВАНИЯ ПО ПОРТФЕЙЛИ	DRC 2
120,6	C 120.06	АЛТЕРНАТИВЕН СТАНДАРТИЗИРАН ПОДХОД. КАПИТАЛОВИ ИЗИСКВАНИЯ ПО ПОРТФЕЙЛИ	ASA OFR

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

С 106.00 — ПЪРВОНАЧАЛНА ПАЗАРНА ОЦЕНКА И ОБОСНОВКА НА ИЗКЛЮЧВАНЕТО

Номер на инструмента	Инструмент, моделиран за стойност под риск (VaR) + стресирана стойност под риск (sVaR) („ВЯРНО“/ „НЕВЯРНО“)	Инструмент, моделиран за капиталовото изискване за допълнителен риск („ВЯРНО“/„НЕВЯРНО“)	Инструмент, моделиран за корелационно търгуване („ВЯРНО“/ „НЕВЯРНО“)	Основания за изключване	Поле за свободен текст	Първоначална пазарна оценка
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070

С 106.01 — ЧУВСТВИТЕЛНОСТИ КЪМ РИСКА ПО ИНСТРУМЕНТИ

Номер на инструмента

Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Чувствителност към риска (резултати в отчетната валута)	Отчетна валута	Чувствителност към риска (резултати за инструмента във валутата на ЕБО)	Модел на ценообразуване	Определения за чувствителностите	Поле за свободен текст	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество
0010	0020	0030	0050	0060	0070	0080	0090	0100	110	120

С 107.01 — Стойност под риск (VaR), стресирана стойност под риск (sVaR) и настояща стойност (PV). ДАННИ

		Вариант	Поле за свободен текст
		0010	0020
Стойност под риск (VaR)			
0010	**Методика**		
0020	**Изчисляване на 10-дневен период**		

		Вариант	Поле за свободен текст
		0010	0020
0030	**Продължителност на периода на наблюдение**		
0040	**Претегляне на данните**		
0050	**Надбавка в резултат на бек-тестове**		
0060	**Регулаторна надбавка за VaR**		
Стресирана стойност под риск (sVaR)			
0070	**Методика**		
0080	**Изчисляване на 10-дневен период**		
0090	**Регулаторна надбавка за sVaR**		
0100	**Период на sVaR**		

C 107.02 — Стойност под риск (VaR) и стресирана стойност под риск (sVaR) извън портфейла за корелационно търгуване РЕЗУЛТАТИ ЗА ПОРТФЕЙЛА ВЪВ ВАЛУТАТА НА ЕБО

Портфейл

Дата	Стойност под риск (VaR)	Стресирана стойност под риск (sVaR)	Настояща стойност (PV)
0010	0020	0030	0040

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

С 108.00 — ДИНАМИЧНИ РЕДОВЕ ЗА ПЕЧАЛБАТА И ЗАГУБАТА

Портфейл

Дата	**Дневна печалба и загуба**
0010	0020

С 109.01 — Капиталово изискване за допълнителен риск. ДАННИ ЗА МОДЕЛА

		Вариант	**Поле за свободен текст**
Ред	**Позиция**	0010	0020
0010	**Брой фактори, използвани при моделирането**		
0020	**Източник на загубите при неизпълнение**		

С 109.02 — Капиталово изискване за допълнителен риск. ДАННИ ПО ПОРТФЕЙЛИ

Портфейл

		Вариант	Поле за свободен текст
Ред	**Позиция**	0010	0020
0010	**Хоризонт на ликвидност**		
0020	**Източник на вероятността от неизпълнение**		
0030	**Източник на миграционните таблици**		

С 109.03 — Капиталово изискване за допълнителен риск. РАЗМЕР ПО ПОРТФЕЙЛ/ДАТА

Портфейл

Дата	Капиталово изискване за допълнителен риск (IRC)
0010	0020

С 110.01 — КОРЕЛАЦИОННО ТЪРГУВАНЕ. ДАННИ ЗА МОДЕЛА

		Вариант	Поле за свободен текст
Ред	**Позиция**	0010	0020
0010	**Брой фактори, използвани при моделирането**		
0020	**Източник на загубите при неизпълнение**		

С 110.02 — КОРЕЛАЦИОННО ТЪРГУВАНЕ. ДАННИ ПО ПОРТФЕЙЛИ

Портфейл

		Вариант	Поле за свободен текст
Ред	**Позиция**	0010	0020
0010	**Хоризонт на ликвидност**		
0020	**Източник на вероятността от неизпълнение**		
0030	**Източник на миграционните таблици**		

С 110.03 — КОРЕЛАЦИОННО ТЪРГУВАНЕ. ВСИЧКИ ЦЕНОВИ РИСКОВЕ ПО ПОРТФЕЙЛ/ДАТА

Портфейл

Дата	**Всички ценови рискове**
0010	0060

С 120.01 – Метод за изчисляване на чувствителностите. ЧУВСТВИТЕЛНОСТИ КЪМ РИСКА ПО ИНСТРУМЕНТИ/ПОРТФЕЙЛИ

Портфейл

Номер на инструмента	**Идентификатор на рисковия фактор**	**Група**	**Допълнителен идентификатор**	**Чувствителност към риска (Резултати в отчетната валута)**	**Отчетна валута**	**Чувствителност към риска (Резултати за портфейла във валутата на ЕБО)**	**Рисково тегло**	**Допълнителен идентификатор2**	**Категория кредитно качество**
0010	0020	0030	0040	0060	0070	0080	0090	110	120

С 120.02 – Метод за изчисляване на чувствителностите. СЪСТАВ НА КАПИТАЛОВИТЕ ИЗИСКВАНИЯ ПО ПОРТФЕЙЛИ

Портфейл

Риско-в клас	Компонент на риска	Корелационен сценарий	Капиталови изисквания (резултати в отчетната валута)	Отчетна валута	Капиталови изисквания (Резултати за портфейла във валутата на ЕБО)	Позиции без опционални характеристики, за които се прилагат капиталови изисквания за риска от кривината	Подход на основната валута, прилаган за делта и риска от кривината на валутния риск	Разделяне на компонентите на риска от кривината за валутния риск по скалар	Подаване на резултатите за портфейлите за валидиране по SBM	Поле за свободен текст
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0950	0100

С 120.04 – Капиталово изискване за риска от неизпълнение. Пазарни стойности и брутни суми, изложени на риск от внезапно неизпълнение, по инструменти/ портфейли

Портфейл

Цяло число

Номер на инстр-умента	Рисков клас	Група1	Група2	Длъж-ник	Катего-рия кре-дитно качество	Тегло на риска от неизпъ-лнение	Ранг	Падеж	Процент на събиране на вземани-ята	Посока	Начална точка на загуба (%)	Крайна точка на загуба (%)	Резултати в отчетната валута				Резултати за портфейла във валутата на ЕБО		
													Условна стойност	Печалба и загуба + Корекция	Брутна сума, изло-жена на риск от внезапно неизпъл-нение	Валута	Условна стойност	Печалба и загуба + Корекция	Брутна сума, изло-жена на риск от вне-запно неизпъ-лнение
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120	0130	0140	0150	0160	0170	0180	0190	0200

С 120.05 – Капиталово изискване за риска от неизпълнение. СЪСТАВ НА КАПИТАЛОВИТЕ ИЗИСКВАНИЯ ПО ПОРТФЕЙЛИ

Портфейл

Цяло число

Рисков клас	Група1	Група2	Капиталови изисквания (резултати в отчетната валута)	Отчетна валута	Капиталови изисквания (Резултати за портфейла във валутата на ЕБО)
0010	0020	0030	0040	0050	0060

С 120.06 — Алтернативен стандартизиран подход. КАПИТАЛОВИ ИЗИСКВАНИЯ

Номер на портфейла	Резултати в отчетната валута			Резултати за портфейла във валутата на ЕБО		
	КАПИТАЛОВИ ИЗИСКВАНИЯ — МЕТОД ЗА ИЗЧИСЛЯВАНЕ НА ЧУВСТВИТЕЛНОСТИТЕ	КАПИТАЛОВИ ИЗИСКВАНИЯ — РИСК ОТ НЕИЗПЪЛНЕНИЕ	КАПИТАЛОВИ ИЗИСКВАНИЯ — ДОБАВКА ЗА ОСТАТЪЧЕН РИСК	КАПИТАЛОВИ ИЗИСКВАНИЯ — МЕТОД ЗА ИЗЧИСЛЯВАНЕ НА ЧУВСТВИТЕЛНОСТИТЕ	КАПИТАЛОВИ ИЗИСКВАНИЯ — РИСК ОТ НЕИЗПЪЛНЕНИЕ	КАПИТАЛОВИ ИЗИСКВАНИЯ — ДОБАВКА ЗА ОСТАТЪЧЕН РИСК
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070“

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

ПРИЛОЖЕНИЕ V

„ПРИЛОЖЕНИЕ X

ПОРТФЕЙЛИ ЗА ВАЛИДИРАНЕ ПО МЕТОДА ЗА ИЗЧИСЛЯВАНЕ НА ЧУВСТВИТЕЛНОСТИТЕ

Име на таблицата	Описание
Инструменти	Инструменти (чувствителности и позиции с риск от кривината) за целите на валидирането по метода за изчисляването на чувствителностите
Портфейли	Портфейли за валидиране по метода за изчисляване на чувствителностите, определени като комбинации от инструменти по настоящото приложение

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_IRV_b25#	GIRR_V_10.00_10.00	USD				400,00
S_IRV_b24#	GIRR_V_10.00_05.00	USD				200,00
S_IRV_b23#	GIRR_V_10.00_03.00	USD				– 900,00
S_IRV_b22#	GIRR_V_10.00_01.00	USD				950,00
S_IRV_b21#	GIRR_V_10.00_00.50	USD				– 350,00
S_IRV_b20#	GIRR_V_05.00_10.00	USD				1 000,00
S_IRV_b19#	GIRR_V_05.00_05.00	USD				– 300,00
S_IRV_b18#	GIRR_V_05.00_03.00	USD				50,00
S_IRV_b17#	GIRR_V_05.00_01.00	USD				300,00
S_IRV_b16#	GIRR_V_05.00_00.50	USD				– 50,00
S_IRV_e3#	GIRR_V_03.00_CRO_USD	BRL				500,00
S_IRV_b15#	GIRR_V_03.00_10.00	USD				– 400,00

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_IRV_b14#	GIRR_V_03.00_05.00	USD				700,00
S_IRV_b13#	GIRR_V_03.00_03.00	USD				– 800,00
S_IRV_b12#	GIRR_V_03.00_01.00	USD				700,00
S_IRV_b11#	GIRR_V_03.00_00.50	USD				– 100,00
S_IRV_e2#	GIRR_V_01.00_INF	BRL				750,00
S_IRV_b10#	GIRR_V_01.00_10.00	USD				500,00
S_IRV_b9#	GIRR_V_01.00_05.00	USD				50,00
S_IRV_b8#	GIRR_V_01.00_03.00	USD				– 500,00
S_IRV_b7#	GIRR_V_01.00_01.00	USD				200,00
S_IRV_b6#	GIRR_V_01.00_00.50	USD				900,00
S_IRV_b5#	GIRR_V_00.50_10.00	USD				100,00
S_IRV_c5#	GIRR_V_00.50_10.00	CLP				– 100,00
S_IRV_d5#	GIRR_V_00.50_10.00	EUR				– 2 000,00
S_IRV_b4#	GIRR_V_00.50_05.00	USD				100,00
S_IRV_c4#	GIRR_V_00.50_05.00	CLP				100,00
S_IRV_d4#	GIRR_V_00.50_05.00	EUR				1 500,00
S_IRV_b3#	GIRR_V_00.50_03.00	USD				– 500,00
S_IRV_c3#	GIRR_V_00.50_03.00	CLP				– 300,00
S_IRV_d3#	GIRR_V_00.50_03.00	EUR				1 000,00
S_IRV_b2#	GIRR_V_00.50_01.00	USD				400,00
S_IRV_c2#	GIRR_V_00.50_01.00	CLP				150,00
S_IRV_d2#	GIRR_V_00.50_01.00	EUR				3 750,00
S_IRV_a1#	GIRR_V_00.50_00.50	USD				– 100,00
S_IRV_b1#	GIRR_V_00.50_00.50	USD				700,00

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_IRV_c1#	GIRR_V_00.50_00.50	CLP				300,00
S_IRV_d1#	GIRR_V_00.50_00.50	EUR				– 4 750,00
S_IRV_e1#	GIRR_V_00.50_00.50	BRL				– 500,00
S_IRD_b11#	GIRR_D_INF	USD				– 50 000,00
S_IRD_d11#	GIRR_D_INF	CLP				95 000,00
S_IRD_e11#	GIRR_D_INF	EUR	DE			– 65 000,00
S_IRD_e13#	GIRR_D_INF	EUR	FR			– 100 000,00
S_IRD_d12#	GIRR_D_CRO_USD	CLP				10 500,00
S_IRD_e12#	GIRR_D_CRO_USD	EUR				– 85 000,00
S_IRD_b12#	GIRR_D_CRO_EUR	USD				– 65 000,00
S_IRD_b10#	GIRR_D_30.00	USD	OIS			– 50 000,00
S_IRD_c10#	GIRR_D_30.00	USD	Libor3m			10 000,00
S_IRD_d10#	GIRR_D_30.00	CLP	OIS			15 000,00
S_IRD_e10#	GIRR_D_30.00	EUR	OIS			– 120 000,00
S_IRD_b9#	GIRR_D_20.00	USD	OIS			200 000,00
S_IRD_c9#	GIRR_D_20.00	USD	Libor3m			– 30 000,00
S_IRD_d9#	GIRR_D_20.00	CLP	OIS			90 000,00
S_IRD_e9#	GIRR_D_20.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b8#	GIRR_D_15.00	USD	OIS			30 000,00
S_IRD_c8#	GIRR_D_15.00	USD	Libor3m			10 000,00
S_IRD_d8#	GIRR_D_15.00	CLP	OIS			70 000,00

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_IRD_e8#	GIRR_D_15.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b7#	GIRR_D_10.00	USD	OIS			2 000,00
S_IRD_c7#	GIRR_D_10.00	USD	Libor3m			– 100 000,00
S_IRD_d7#	GIRR_D_10.00	CLP	OIS			– 25 000,00
S_IRD_e7#	GIRR_D_10.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b6#	GIRR_D_05.00	USD	OIS			– 90 000,00
S_IRD_c6#	GIRR_D_05.00	USD	Libor3m			– 35 000,00
S_IRD_d6#	GIRR_D_05.00	CLP	OIS			– 5 000,00
S_IRD_e6#	GIRR_D_05.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b5#	GIRR_D_03.00	USD	OIS			85 000,00
S_IRD_c5#	GIRR_D_03.00	USD	Libor3m			55 000,00
S_IRD_d5#	GIRR_D_03.00	CLP	OIS			– 100 000,00
S_IRD_e5#	GIRR_D_03.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b4#	GIRR_D_02.00	USD	OIS			– 10 000,00
S_IRD_c4#	GIRR_D_02.00	USD	Libor3m			10 000,00
S_IRD_d4#	GIRR_D_02.00	CLP	OIS			5 000,00
S_IRD_e4#	GIRR_D_02.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b3#	GIRR_D_01.00	USD	OIS			– 65 000,00
S_IRD_c3#	GIRR_D_01.00	USD	Libor3m			70 000,00
S_IRD_d3#	GIRR_D_01.00	CLP	OIS			10 000,00
S_IRD_e3#	GIRR_D_01.00	EUR	OIS			– 50 000,00
S_IRD_b2#	GIRR_D_00.50	USD	OIS			15 000,00
S_IRD_c2#	GIRR_D_00.50	USD	Libor3m			– 40 000,00
S_IRD_d2#	GIRR_D_00.50	CLP	OIS			45 000,00
S_IRD_e2#	GIRR_D_00.50	EUR	OIS			100,00
S_IRD_a1#	GIRR_D_00.25	USD	OIS			30 000,00
S_IRD_b1#	GIRR_D_00.25	USD	OIS			20 000,00

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_IRD_c1#	GIRR_D_00.25	USD	Libor3m			– 30 000,00
S_IRD_d1#	GIRR_D_00.25	CLP	OIS			– 30 000,00
S_IRD_e1#	GIRR_D_00.25	EUR	OIS			100,00
S_IRD_f1#	GIRR_D_00.25	DKK	OIS			100,00
S_IRC_a1#	GIRR_CU	USD				– 18 466,83
S_IRC_b1#	GIRR_CU	USD				92 233,09
S_IRC_c1#	GIRR_CU	CLP				– 1 270,00
S_IRC_d1#	GIRR_CU	EUR				– 253,12
S_IRC_e1#	GIRR_CU	VND				– 11 950,00
S_IRC_a1#	GIRR_CD	USD				18 647,66
S_IRC_b1#	GIRR_CD	USD				– 93 178,71
S_IRC_c1#	GIRR_CD	CLP				450,00
S_IRC_d1#	GIRR_CD	EUR				– 3 237,08
S_IRC_e1#	GIRR_CD	VND				– 4 030,00
S_FXV_b4#	FX_V_5.00	EUR_CLP				200,00
S_FXV_d4#	FX_V_5.00	CHF_VND				1 500,00
S_FXV_b3#	FX_V_3.00	EUR_CLP				– 400,00
S_FXV_d3#	FX_V_3.00	CHF_VND				1 000,00
S_FXV_b5#	FX_V_10.00	EUR_CLP				150,00
S_FXV_d5#	FX_V_10.00	CHF_VND				– 2 000,00
S_FXV_b2#	FX_V_1.00	EUR_CLP				300,00
S_FXV_d2#	FX_V_1.00	CHF_VND				3 750,00

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_FXV_a1#	FX_V_0.50	EUR_CLP				– 100,00
S_FXV_b1#	FX_V_0.50	EUR_CLP				700,00
S_FXV_c1#	FX_V_0.50	AUD_JPY				450,00
S_FXV_d1#	FX_V_0.50	CHF_VND				– 4 800,00
S_FXD_a1#	FX_D	GBP				5 000,00
S_FXD_b1#	FX_D	GBP				– 8 000,00
S_FXD_c1#	FX_D	CLP				3 000,00
S_FXD_d1#	FX_D	DKK				1 000,00
S_FXD_f1#	FX_D	BGN				1 000,00
S_FXC_a1#	FX_CU	EUR				– 16 037,91
S_FXC_b1#	FX_CU	EUR				80 159,24
S_FXC_c1#	FX_CU	CLP				– 800,00
S_FXC_d1#	FX_CU	JPY				– 1 472,88
S_FXC_e1#	FX_CU	VND				– 3 400,00
S_FXC_f1#	FX_CU	DKK				– 48,61
S_FXC_a1#	FX_CD	EUR				16 162,18
S_FXC_b1#	FX_CD	EUR				– 80 723,02
S_FXC_c1#	FX_CD	CLP				700,00
S_FXC_d1#	FX_CD	JPY				– 1 324,35
S_FXC_e1#	FX_CD	VND				– 2 100,00
S_FXC_f1#	FX_CD	DKK				48,61
S_EQV_a5#	EQ_V_5.00	1	ЕМИТЕНТ А			100,00

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_EQV_aa4#	EQ_V_5.00	5	ЕМИТЕНТ АА			1 200,00
S_EQV_ac1#	EQ_V_5.00	7	ЕМИТЕНТ АВ			– 50,00
S_EQV_ae4#	EQ_V_5.00	9	ЕМИТЕНТ АД			600,00
S_EQV_af4#	EQ_V_5.00	10	ЕМИТЕНТ АЕ			375,00
S_EQV_b4#	EQ_V_5.00	1	ЕМИТЕНТ Б			50,00
S_EQV_f4#	EQ_V_5.00	5	ЕМИТЕНТ Е			450,00
S_EQV_j4#	EQ_V_5.00	9	ЕМИТЕНТ Й			– 200,00
S_EQV_k4#	EQ_V_5.00	10	ЕМИТЕНТ К			– 825,00
S_EQV_m1#	EQ_V_5.00	11	ЕМИТЕНТ М			– 700,00
S_EQV_n4#	EQ_V_5.00	12	ИНДЕКС Н			850,00
S_EQV_o4#	EQ_V_5.00	12	ИНДЕКС О			150,00
S_EQV_y1#	EQ_V_5.00	3	ЕМИТЕНТ Ш			700,00
S_EQV_a4#	EQ_V_3.00	1	ЕМИТЕНТ А			– 500,00
S_EQV_aa3#	EQ_V_3.00	5	ЕМИТЕНТ АА			– 850,00
S_EQV_ad1#	EQ_V_3.00	8	ЕМИТЕНТ АГ			300,00
S_EQV_ae3#	EQ_V_3.00	9	ЕМИТЕНТ АД			– 450,00
S_EQV_af3#	EQ_V_3.00	10	ЕМИТЕНТ АЕ			– 725,00
S_EQV_b3#	EQ_V_3.00	1	ЕМИТЕНТ Б			– 500,00

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_EQV_f3#	EQ_V_3.00	5	ЕМИТЕНТ Е			250,00
S_EQV_j3#	EQ_V_3.00	9	ЕМИТЕНТ Й			– 900,00
S_EQV_k3#	EQ_V_3.00	10	ЕМИТЕНТ К			– 975,00
S_EQV_n3#	EQ_V_3.00	12	ИНДЕКС Н			– 1 250,00
S_EQV_o3#	EQ_V_3.00	12	ИНДЕКС О			100,00
S_EQV_x1#	EQ_V_3.00	2	ЕМИТЕНТ Ч			– 200,00
S_EQV_z1#	EQ_V_3.00	4	ЕМИТЕНТ Щ			– 800,00
S_EQV_a6#	EQ_V_10.00	1	ЕМИТЕНТ А			100,00
S_EQV_aa5#	EQ_V_10.00	5	ЕМИТЕНТ АА			– 300,00
S_EQV_ab1#	EQ_V_10.00	6	ЕМИТЕНТ АБ			– 400,00
S_EQV_ae5#	EQ_V_10.00	9	ЕМИТЕНТ АД			– 850,00
S_EQV_af5#	EQ_V_10.00	10	ЕМИТЕНТ АЕ			525,00
S_EQV_b5#	EQ_V_10.00	1	ЕМИТЕНТ Б			500,00
S_EQV_f5#	EQ_V_10.00	5	ЕМИТЕНТ Е			600,00
S_EQV_j5#	EQ_V_10.00	9	ЕМИТЕНТ Й			150,00
S_EQV_k5#	EQ_V_10.00	10	ЕМИТЕНТ К			300,00
S_EQV_n5#	EQ_V_10.00	12	ИНДЕКС Н			225,00
S_EQV_o5#	EQ_V_10.00	12	ИНДЕКС О			– 200,00

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_EQV_q1#	EQ_V_10.00	13	ИНДЕКС P			– 800,00
S_EQV_a3#	EQ_V_1.00	1	ЕМИТЕНТ A			400,00
S_EQV_aa2#	EQ_V_1.00	5	ЕМИТЕНТ AA			– 400,00
S_EQV_ae2#	EQ_V_1.00	9	ЕМИТЕНТ АД			– 250,00
S_EQV_af2#	EQ_V_1.00	10	ЕМИТЕНТ AE			– 1 150,00
S_EQV_b2#	EQ_V_1.00	1	ЕМИТЕНТ Б			200,00
S_EQV_f2#	EQ_V_1.00	5	ЕМИТЕНТ E			– 750,00
S_EQV_j2#	EQ_V_1.00	9	ЕМИТЕНТ Й			350,00
S_EQV_k2#	EQ_V_1.00	10	ЕМИТЕНТ K			1 050,00
S_EQV_n2#	EQ_V_1.00	12	ИНДЕКС H			– 800,00
S_EQV_o2#	EQ_V_1.00	12	ИНДЕКС O			400,00
S_EQV_a1#	EQ_V_0.50	1	ЕМИТЕНТ A			– 100,00
S_EQV_a2#	EQ_V_0.50	1	ЕМИТЕНТ A			700,00
S_EQV_aa1#	EQ_V_0.50	5	ЕМИТЕНТ AA			950,00
S_EQV_ae1#	EQ_V_0.50	9	ЕМИТЕНТ АД			50,00
S_EQV_af1#	EQ_V_0.50	10	ЕМИТЕНТ AE			– 300,00
S_EQV_b1#	EQ_V_0.50	1	ЕМИТЕНТ Б			900,00
S_EQV_c1#	EQ_V_0.50	2	ЕМИТЕНТ B			– 500,00

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_EQV_d1#	EQ_V_0.50	3	ЕМИТЕНТ Г			600,00
S_EQV_e1#	EQ_V_0.50	4	ЕМИТЕНТ Д			– 800,00
S_EQV_f1#	EQ_V_0.50	5	ЕМИТЕНТ Е			1 000,00
S_EQV_g1#	EQ_V_0.50	6	ЕМИТЕНТ Ж			– 400,00
S_EQV_h1#	EQ_V_0.50	7	ЕМИТЕНТ З			– 50,00
S_EQV_i1#	EQ_V_0.50	8	ЕМИТЕНТ И			300,00
S_EQV_j1#	EQ_V_0.50	9	ЕМИТЕНТ Й			50,00
S_EQV_k1#	EQ_V_0.50	10	ЕМИТЕНТ К			– 300,00
S_EQV_l1#	EQ_V_0.50	11	ЕМИТЕНТ Л			1 000,00
S_EQV_n1#	EQ_V_0.50	12	ИНДЕКС Н			750,00
S_EQV_o1#	EQ_V_0.50	12	ИНДЕКС О			– 500,00
S_EQV_p1#	EQ_V_0.50	13	ИНДЕКС П			40,00
S_EQD_a1#	EQ_D_SPOT	1	ЕМИТЕНТ А			16 500,00
S_EQD_a2#	EQ_D_SPOT	1	ЕМИТЕНТ А			– 35 000,00
S_EQD_b1#	EQ_D_SPOT	1	ЕМИТЕНТ Б			20 000,00
S_EQD_c1#	EQ_D_SPOT	2	ЕМИТЕНТ В			66 000,00
S_EQD_d1#	EQ_D_SPOT	3	ЕМИТЕНТ Г			1 700,00
S_EQD_e1#	EQ_D_SPOT	4	ЕМИТЕНТ Д			1 100,00

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_EQD_f1#	EQ_D_SPOT	5	ЕМИТЕНТ Е			25 000,00
S_EQD_g1#	EQ_D_SPOT	5	ЕМИТЕНТ Ж			8 400,00
S_EQD_h1#	EQ_D_SPOT	6	ЕМИТЕНТ З			22 500,00
S_EQD_i1#	EQ_D_SPOT	7	ЕМИТЕНТ И			– 12 300,00
S_EQD_j1#	EQ_D_SPOT	8	ЕМИТЕНТ Й			– 450,00
S_EQD_k1#	EQ_D_SPOT	9	ЕМИТЕНТ К			– 143,00
S_EQD_l1#	EQ_D_SPOT	9	ЕМИТЕНТ Л			– 143,00
S_EQD_m1#	EQ_D_SPOT	10	ЕМИТЕНТ М			– 100,00
S_EQD_n1#	EQ_D_SPOT	10	ЕМИТЕНТ Н			– 100,00
S_EQD_o1#	EQ_D_SPOT	11	ЕМИТЕНТ О			– 19 600,00
S_EQD_q1#	EQ_D_SPOT	12	ИНДЕКС Р			1 100,00
S_EQD_r1#	EQ_D_SPOT	12	ИНДЕКС С			– 40 000,00
S_EQD_s1#	EQ_D_SPOT	13	ИНДЕКС Т			– 1 950,00
S_EQD_s2#	EQ_D_SPOT	13	ИНДЕКС Т			280,00
S_EQD_t2#	EQ_D_SPOT	13	ИНДЕКС У			3 150,00
S_EQD_u1#	EQ_D_SPOT	9	ЕМИТЕНТ Ф			– 57,00
S_EQD_v1#	EQ_D_SPOT	10	ЕМИТЕНТ Х			– 100,00

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_EQD_a3#	EQ_D_REPO	1	ЕМИТЕНТ А			50 000,00
S_EQD_aa1#	EQ_D_REPO	6	ЕМИТЕНТ АА			79 000,00
S_EQD_ab1#	EQ_D_REPO	7	ЕМИТЕНТ АБ			31 000,00
S_EQD_ac1#	EQ_D_REPO	8	ЕМИТЕНТ АВ			– 10 000,00
S_EQD_b2#	EQ_D_REPO	1	ЕМИТЕНТ Б			– 39 000,00
S_EQD_f2#	EQ_D_REPO	5	ЕМИТЕНТ Е			90 000,00
S_EQD_g2#	EQ_D_REPO	5	ЕМИТЕНТ Ж			60 000,00
S_EQD_k2#	EQ_D_REPO	9	ЕМИТЕНТ К			– 14 250,00
S_EQD_l2#	EQ_D_REPO	9	ЕМИТЕНТ Л			– 150 000,00
S_EQD_m2#	EQ_D_REPO	10	ЕМИТЕНТ М			– 85 000,00
S_EQD_n2#	EQ_D_REPO	10	ЕМИТЕНТ Н			– 72 000,00
S_EQD_p1#	EQ_D_REPO	11	ЕМИТЕНТ П			48 000,00
S_EQD_q2#	EQ_D_REPO	12	ИНДЕКС Р			85 000,00
S_EQD_r2#	EQ_D_REPO	12	ИНДЕКС С			– 40 000,00
S_EQD_t1#	EQ_D_REPO	13	ИНДЕКС У			– 125 000,00
S_EQD_x1#	EQ_D_REPO	2	ЕМИТЕНТ Ч			75 000,00
S_EQD_y1#	EQ_D_REPO	3	ЕМИТЕНТ Ш			4 800,00

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_EQD_z1#	EQ_D_REPO	4	ЕМИТЕНТ Щ			– 15 000,00
S_EQC_a1#	EQ_CU	1	ЕМИТЕНТ А			– 37 820,00
S_EQC_a2#	EQ_CU	1	ЕМИТЕНТ А			77 655,00
S_EQC_aa1#	EQ_CU	2	ЕМИТЕНТ АА			39 300,00
S_EQC_ab1#	EQ_CU	4	ЕМИТЕНТ АБ			17 262,00
S_EQC_ac1#	EQ_CU	5	ЕМИТЕНТ АВ			7 139,60
S_EQC_ad1#	EQ_CU	6	ЕМИТЕНТ АГ			– 3 642,50
S_EQC_ae1#	EQ_CU	7	ЕМИТЕНТ АД			3 900,00
S_EQC_af1#	EQ_CU	8	ЕМИТЕНТ АЕ			41 550,00
S_EQC_ag1#	EQ_CU	9	ЕМИТЕНТ АЖ			36 860,00
S_EQC_ah1#	EQ_CU	10	ЕМИТЕНТ АЗ			22 150,00
S_EQC_b1#	EQ_CU	1	ЕМИТЕНТ Б			20 677,50
S_EQC_c1#	EQ_CU	2	ЕМИТЕНТ В			– 31 440,00
S_EQC_d1#	EQ_CU	3	ЕМИТЕНТ Г			6 238,00
S_EQC_e1#	EQ_CU	4	ЕМИТЕНТ Д			– 21 605,00
S_EQC_f1#	EQ_CU	5	ЕМИТЕНТ Е			– 2 850,00
S_EQC_g1#	EQ_CU	6	ЕМИТЕНТ Ж			– 3 642,50

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_EQC_h1#	EQ_CU	7	ЕМИТЕНТ З			– 7 800,00
S_EQC_i1#	EQ_CU	8	ЕМИТЕНТ И			– 29 550,00
S_EQC_j1#	EQ_CU	9	ЕМИТЕНТ Й			– 216 320,00
S_EQC_k1#	EQ_CU	10	ЕМИТЕНТ К			1 950,00
S_EQC_q1#	EQ_CU	11	ЕМИТЕНТ Р			– 19 142,00
S_EQC_r1#	EQ_CU	11	ЕМИТЕНТ С			28 713,00
S_EQC_s1#	EQ_CU	3	ЕМИТЕНТ Т			– 17 025,00
S_EQC_t1#	EQ_CU	12	ЕМИТЕНТ У			7 466,67
S_EQC_u1#	EQ_CU	13	ЕМИТЕНТ Ф			11 160,00
S_EQC_v1#	EQ_CU	12	ЕМИТЕНТ Х			– 39 200,00
S_EQC_w1#	EQ_CU	13	ЕМИТЕНТ Ц			– 58 590,00
S_EQC_y1#	EQ_CU	1	ЕМИТЕНТ Ш			– 23 930,00
S_EQC_z1#	EQ_CU	1	ЕМИТЕНТ Щ			– 47 860,00
S_EQC_a1#	EQ_CD	1	ЕМИТЕНТ А			39 157,50
S_EQC_a2#	EQ_CD	1	ЕМИТЕНТ А			– 80 349,00
S_EQC_aa1#	EQ_CD	2	ЕМИТЕНТ АА			– 30 600,00
S_EQC_ab1#	EQ_CD	4	ЕМИТЕНТ АБ			– 9 826,00
S_EQC_ac1#	EQ_CD	5	ЕМИТЕНТ АВ			– 5 414,60

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_EQC_ad1#	EQ_CD	6	ЕМИТЕНТ АГ			2 617,50
S_EQC_ae1#	EQ_CD	7	ЕМИТЕНТ АД			– 2 720,00
S_EQC_af1#	EQ_CD	8	ЕМИТЕНТ АЕ			– 28 250,00
S_EQC_ag1#	EQ_CD	9	ЕМИТЕНТ АЖ			– 30 935,00
S_EQC_ah1#	EQ_CD	10	ЕМИТЕНТ АЗ			– 15 025,00
S_EQC_b1#	EQ_CD	1	ЕМИТЕНТ Б			– 238 910,00
S_EQC_c1#	EQ_CD	2	ЕМИТЕНТ В			24 480,00
S_EQC_d1#	EQ_CD	3	ЕМИТЕНТ Г			– 6 068,00
S_EQC_e1#	EQ_CD	4	ЕМИТЕНТ Д			12 310,00
S_EQC_f1#	EQ_CD	5	ЕМИТЕНТ Е			2 160,00
S_EQC_g1#	EQ_CD	6	ЕМИТЕНТ Ж			2 617,50
S_EQC_h1#	EQ_CD	7	ЕМИТЕНТ З			5 440,00
S_EQC_i1#	EQ_CD	8	ЕМИТЕНТ И			20 050,00
S_EQC_j1#	EQ_CD	9	ЕМИТЕНТ Й			181 560,00
S_EQC_k1#	EQ_CD	10	ЕМИТЕНТ К			– 2 900,00
S_EQC_q1#	EQ_CD	11	ЕМИТЕНТ Р			20 052,00
S_EQC_r1#	EQ_CD	11	ЕМИТЕНТ С			– 30 078,00
S_EQC_s1#	EQ_CD	3	ЕМИТЕНТ Т			– 9 435,00

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_EQC_t1#	EQ_CD	12	ЕМИТЕНТ У			– 7 400,00
S_EQC_u1#	EQ_CD	13	ЕМИТЕНТ Ф			– 11 040,00
S_EQC_v1#	EQ_CD	12	ЕМИТЕНТ Х			38 850,00
S_EQC_w1#	EQ_CD	13	ЕМИТЕНТ Ц			57 960,00
S_EQC_y1#	EQ_CD	1	ЕМИТЕНТ Ш			13 590,00
S_EQC_z1#	EQ_CD	1	ЕМИТЕНТ Щ			27 180,00
S_CNV_a5#	CSR_NON_SEC_V_5.00	1	ЕМИТЕНТ А			100,00
S_CNV_b4#	CSR_NON_SEC_V_5.00	1	ЕМИТЕНТ Б			50,00
S_CNV_c4#	CSR_NON_SEC_V_5.00	3	ЕМИТЕНТ В			150,00
S_CNV_hb1#	CSR_NON_SEC_V_5.00	9	ЕМИТЕНТ ЗА			– 750,00
S_CNV_a4#	CSR_NON_SEC_V_3.00	1	ЕМИТЕНТ А			– 500,00
S_CNV_ab1#	CSR_NON_SEC_V_3.00	2	ЕМИТЕНТ АБ			325,00
S_CNV_b3#	CSR_NON_SEC_V_3.00	1	ЕМИТЕНТ Б			– 500,00
S_CNV_c3#	CSR_NON_SEC_V_3.00	3	ЕМИТЕНТ В			100,00
S_CNV_v1#	CSR_NON_SEC_V_3.00	20	ИНДЕКС Х			500,00
S_CNV_a6#	CSR_NON_SEC_V_10.00	1	ЕМИТЕНТ А			100,00
S_CNV_b5#	CSR_NON_SEC_V_10.00	1	ЕМИТЕНТ Б			500,00

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_CNV_c5#	CSR_NON_SEC_V_10.00	3	ЕМИТЕНТ В			– 200,00
S_CNV_a3#	CSR_NON_SEC_V_1.00	1	ЕМИТЕНТ А			400,00
S_CNV_b2#	CSR_NON_SEC_V_1.00	1	ЕМИТЕНТ Б			200,00
S_CNV_c2#	CSR_NON_SEC_V_1.00	3	ЕМИТЕНТ В			400,00
S_CNV_a1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	ЕМИТЕНТ А			– 100,00
S_CNV_a2#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	ЕМИТЕНТ А			700,00
S_CNV_b1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	ЕМИТЕНТ Б			900,00
S_CNV_c1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	3	ЕМИТЕНТ В			– 500,00
S_CNV_d1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	4	ЕМИТЕНТ Г			700,00
S_CNV_e1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	5	ЕМИТЕНТ Д			– 800,00
S_CNV_f1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	6	ЕМИТЕНТ Е			700,00
S_CNV_g1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	7	ЕМИТЕНТ Ж			– 400,00
S_CNV_h1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	8	ЕМИТЕНТ З			– 50,00
S_CNV_i1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	10	ЕМИТЕНТ И			300,00
S_CNV_j1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	11	ЕМИТЕНТ Й			50,00
S_CNV_k1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	12	ЕМИТЕНТ К			– 300,00
S_CNV_l1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	13	ЕМИТЕНТ Л			1 000,00

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_CNV_m1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	14	ЕМИТЕНТ М			– 350,00
S_CNV_n1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	15	ЕМИТЕНТ Н			950,00
S_CNV_o1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	16	ЕМИТЕНТ О			– 900,00
S_CNV_p1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	17	ЕМИТЕНТ П			200,00
S_CNV_q1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	18	ЕМИТЕНТ Р			400,00
S_CNV_r1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	18	ЕМИТЕНТ С			– 300,00
S_CNV_s1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	19	ИНДЕКС Т			850,00
S_CNV_t1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	20	ИНДЕКС У			– 650,00
S_CNV_u1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	19	ИНДЕКС Ф			– 350,00
S_CND_hb2#	CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT	9	ЕМИТЕНТ ЗБ			– 17 000,00
S_CND_t1#	CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT	3	ЕМИТЕНТ У			– 6 000,00
S_CND_y1#	CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT	20	ИНДЕКС Ш			9 000,00
S_CND_ab2#	CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS	2	ЕМИТЕНТ АВ			14 000,00
S_CND_b2#	CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS	1	ЕМИТЕНТ Б			– 17 000,00
S_CND_w1#	CSR_NON_-SEC_D_10.00_DEBT	10	ЕМИТЕНТ Ц		СКК 1	9 000,00
S_CND_a4#	CSR_NON_-SEC_D_1.00_DEBT	1	ЕМИТЕНТ А			– 10 000,00
S_CND_s1#	CSR_NON_-SEC_D_1.00_DEBT	3	ЕМИТЕНТ Т			– 6 000,00

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_CND_x1#	CSR_NON_SEC_D_1.00_CDS	19	ИНДЕКС Ч			– 18 500,00
S_CND_a1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	1	ЕМИТЕНТ А			20 000,00
S_CND_a2#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	1	ЕМИТЕНТ А			– 30 000,00
S_CND_b1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	1	ЕМИТЕНТ Б			12 000,00
S_CND_c1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	3	ЕМИТЕНТ В			– 6 000,00
S_CND_d1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	4	ЕМИТЕНТ Г			25 000,00
S_CND_e1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	5	ЕМИТЕНТ Д			– 4 000,00
S_CND_f1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	6	ЕМИТЕНТ Е			– 8 000,00
S_CND_g1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	7	ЕМИТЕНТ Ж			8 000,00
S_CND_h1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	8	ЕМИТЕНТ З			3 000,00
S_CND_hb1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	9	ЕМИТЕНТ ЗА			– 23 000,00
S_CND_i1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	10	ЕМИТЕНТ И		СКК 2	– 5 000,00
S_CND_j1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	11	ЕМИТЕНТ Й			2 000,00
S_CND_k1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	12	ЕМИТЕНТ К			7 000,00
S_CND_l1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	13	ЕМИТЕНТ Л			– 9 000,00
S_CND_m1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	14	ЕМИТЕНТ М			10 000,00
S_CND_n1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	15	ЕМИТЕНТ Н			– 20 000,00

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_CND_o1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	16	ЕМИТЕНТ О			5 000,00
S_CND_p1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	17	ЕМИТЕНТ П			– 3 000,00
S_CND_q1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	18	ЕМИТЕНТ Р			10 000,00
S_CND_r1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	18	ЕМИТЕНТ С			– 5 000,00
S_CND_a3#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	1	ЕМИТЕНТ А			15 000,00
S_CND_ab1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	2	ЕМИТЕНТ АБ			21 000,00
S_CND_u1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	19	ИНДЕКС Ф			– 32 000,00
S_CND_v1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	20	ИНДЕКС Х			– 13 000,00
S_CND_x2#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	19	ИНДЕКС Ч			52 500,00
S_CNC_a1#	CSR_NON_SEC_CU	1	ЕМИТЕНТ А			– 2 338,64
S_CNC_a2#	CSR_NON_SEC_CU	1	ЕМИТЕНТ А			35 116,67
S_CNC_aa1#	CSR_NON_SEC_CU	10	ЕМИТЕНТ АА		СКК 1	– 1 212,50
S_CNC_ab1#	CSR_NON_SEC_CU	2	ЕМИТЕНТ АБ1			– 247,47
S_CNC_b1#	CSR_NON_SEC_CU	1	ЕМИТЕНТ Б			890,91
S_CNC_c1#	CSR_NON_SEC_CU	3	ЕМИТЕНТ В			– 500,00
S_CNC_d1#	CSR_NON_SEC_CU	4	ЕМИТЕНТ Г			415,00
S_CNC_e1#	CSR_NON_SEC_CU	5	ЕМИТЕНТ Д			– 1 050,00

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_CNC_f1#	CSR_NON_SEC_CU	6	ЕМИТЕНТ Е			– 150,00
S_CNC_g1#	CSR_NON_SEC_CU	7	ЕМИТЕНТ Ж			– 318,75
S_CNC_h1#	CSR_NON_SEC_CU	8	ЕМИТЕНТ З			– 425,00
S_CNC_hb1#	CSR_NON_SEC_CU	9	ЕМИТЕНТ ЗБ1			– 500,00
S_CNC_i1#	CSR_NON_SEC_CU	10	ЕМИТЕНТ И		СКК 2	– 937,50
S_CNC_j1#	CSR_NON_SEC_CU	11	ЕМИТЕНТ Й			– 4 650,00
S_CNC_k1#	CSR_NON_SEC_CU	12	ЕМИТЕНТ К			– 425,00
S_CNC_l1#	CSR_NON_SEC_CU	13	ЕМИТЕНТ Л			– 27 660,00
S_CNC_m1#	CSR_NON_SEC_CU	14	ЕМИТЕНТ М			– 488,00
S_CNC_n1#	CSR_NON_SEC_CU	15	ЕМИТЕНТ Н			13 237,50
S_CNC_o1#	CSR_NON_SEC_CU	16	ЕМИТЕНТ О			– 1 127,50
S_CNC_p1#	CSR_NON_SEC_CU	17	ЕМИТЕНТ П			– 5 775,00
S_CNC_q1#	CSR_NON_SEC_CU	18	ЕМИТЕНТ Р			– 7 842,00
S_CNC_r1#	CSR_NON_SEC_CU	18	ЕМИТЕНТ С			15 684,00
S_CNC_s1#	CSR_NON_SEC_CU	4	ЕМИТЕНТ Т			– 750,00
S_CNC_t1#	CSR_NON_SEC_CU	19	ЕМИТЕНТ У			3 550,00
S_CNC_u1#	CSR_NON_SEC_CU	20	ЕМИТЕНТ Ф			1 660,00
S_CNC_v1#	CSR_NON_SEC_CU	19	ЕМИТЕНТ Х			– 18 637,50

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_CNC_w1#	CSR_NON_SEC_CU	20	ЕМИТЕНТ Ц			– 8 715,00
S_CNC_x1#	CSR_NON_SEC_CU	3	ЕМИТЕНТ Ч			– 500,00
S_CNC_y1#	CSR_NON_SEC_CU	1	ЕМИТЕНТ Ш			– 249,95
S_CNC_z1#	CSR_NON_SEC_CU	1	ЕМИТЕНТ Щ			– 249,95
S_CNC_a1#	CSR_NON_SEC_CD	1	ЕМИТЕНТ А			2 363,38
S_CNC_a2#	CSR_NON_SEC_CD	1	ЕМИТЕНТ А			– 35 314,65
S_CNC_aa1#	CSR_NON_SEC_CD	10	ЕМИТЕНТ АА		СКК 1	1 150,00
S_CNC_ab1#	CSR_NON_SEC_CD	2	ЕМИТЕНТ АБ1			247,47
S_CNC_b1#	CSR_NON_SEC_CD	1	ЕМИТЕНТ Б			– 5 543,43
S_CNC_c1#	CSR_NON_SEC_CD	3	ЕМИТЕНТ В			500,00
S_CNC_d1#	CSR_NON_SEC_CD	4	ЕМИТЕНТ Г			– 385,00
S_CNC_e1#	CSR_NON_SEC_CD	5	ЕМИТЕНТ Д			575,00
S_CNC_f1#	CSR_NON_SEC_CD	6	ЕМИТЕНТ Е			75,00
S_CNC_g1#	CSR_NON_SEC_CD	7	ЕМИТЕНТ Ж			287,50
S_CNC_h1#	CSR_NON_SEC_CD	8	ЕМИТЕНТ З			400,00
S_CNC_hb1#	CSR_NON_SEC_CD	9	ЕМИТЕНТ ЗБ1			500,00
S_CNC_i1#	CSR_NON_SEC_CD	10	ЕМИТЕНТ И		СКК 2	750,00
S_CNC_j1#	CSR_NON_SEC_CD	11	ЕМИТЕНТ Й			4 100,00

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_CNC_k1#	CSR_NON_SEC_CD	12	ЕМИТЕНТ К			387,50
S_CNC_l1#	CSR_NON_SEC_CD	13	ЕМИТЕНТ Л			22 130,00
S_CNC_m1#	CSR_NON_SEC_CD	14	ЕМИТЕНТ М			160,00
S_CNC_n1#	CSR_NON_SEC_CD	15	ЕМИТЕНТ Н			– 23 437,50
S_CNC_o1#	CSR_NON_SEC_CD	16	ЕМИТЕНТ О			1 246,25
S_CNC_p1#	CSR_NON_SEC_CD	17	ЕМИТЕНТ П			6 225,00
S_CNC_q1#	CSR_NON_SEC_CD	18	ЕМИТЕНТ Р			8 752,00
S_CNC_r1#	CSR_NON_SEC_CD	18	ЕМИТЕНТ С			– 17 504,00
S_CNC_s1#	CSR_NON_SEC_CD	4	ЕМИТЕНТ Т			– 250,00
S_CNC_t1#	CSR_NON_SEC_CD	19	ЕМИТЕНТ У			– 3 500,00
S_CNC_u1#	CSR_NON_SEC_CD	20	ЕМИТЕНТ Ф			– 1 540,00
S_CNC_v1#	CSR_NON_SEC_CD	19	ЕМИТЕНТ Х			18 375,00
S_CNC_w1#	CSR_NON_SEC_CD	20	ЕМИТЕНТ Ц			8 085,00
S_CNC_x1#	CSR_NON_SEC_CD	3	ЕМИТЕНТ Ч			500,00
S_CNC_y1#	CSR_NON_SEC_CD	1	ЕМИТЕНТ Ш			– 226,77
S_CNC_z1#	CSR_NON_SEC_CD	1	ЕМИТЕНТ Щ			– 226,77
S_CMV_a5#	CM_V_5.00	1	ВЪГЛИЩА			– 300,00

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_CMV_b4#	CM_V_5.00	1	УРАН			450,00
S_CMV_a4#	CM_V_3.00	1	ВЪГЛИЩА			800,00
S_CMV_b3#	CM_V_3.00	1	УРАН			800,00
S_CMV_a6#	CM_V_10.00	1	ВЪГЛИЩА			100,00
S_CMV_b5#	CM_V_10.00	1	УРАН			– 250,00
S_CMV_a3#	CM_V_1.00	1	ВЪГЛИЩА			– 200,00
S_CMV_b2#	CM_V_1.00	1	УРАН			– 750,00
S_CMV_d1#	CM_V_1.00	2	WTI			– 175,00
S_CMV_f1#	CM_V_1.00	3	FWD ELECTRICITY NE			– 450,00
S_CMV_h1#	CM_V_1.00	4	PANAMAX			– 5 500,00
S_CMV_j1#	CM_V_1.00	5	МЕД			– 200,00
S_CMV_l1#	CM_V_1.00	6	ВТЕЧНЕН ПРИРОДЕН ГАЗ			1 000,00
S_CMV_n1#	CM_V_1.00	7	СРЕБРО			500,00
S_CMV_p1#	CM_V_1.00	8	ЦАРЕВИЦА			– 1 000,00
S_CMV_r1#	CM_V_1.00	9	СУРОВАТКА			– 125,00
S_CMV_t1#	CM_V_1.00	10	КАУЧУК			– 50,00
S_CMV_v1#	CM_V_1.00	11	ПОТАШ			– 1 800,00

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_CMV_a1#	CM_V_0.50	1	ВЪГЛИЩА			1 000,00
S_CMV_a2#	CM_V_0.50	1	ВЪГЛИЩА			– 350,00
S_CMV_b1#	CM_V_0.50	1	УРАН			150,00
S_CMV_c1#	CM_V_0.50	2	BRENT			200,00
S_CMV_e1#	CM_V_0.50	3	SPOT ELECTRICITY SE			– 300,00
S_CMV_g1#	CM_V_0.50	4	SUPRAMAX			– 5 000,00
S_CMV_i1#	CM_V_0.50	5	СТОМАНА			550,00
S_CMV_k1#	CM_V_0.50	6	ПРИРОДЕН ГАЗ			400,00
S_CMV_m1#	CM_V_0.50	7	ЗЛАТО			– 200,00
S_CMV_o1#	CM_V_0.50	8	СОЕВИ ЗЪРНА			– 750,00
S_CMV_q1#	CM_V_0.50	9	РИБА			250,00
S_CMV_s1#	CM_V_0.50	10	КАКАО			350,00
S_CMV_u1#	CM_V_0.50	11	ПЛОСКО СТЪКЛО			3 000,00
S_CMV_w1#	CM_V_0.50	4	SUPRAMAX			– 5 000,00
S_CMV_x1#	CM_V_0.50	4	PANAMAX			15 000,00
S_CMD_p1#	CM_D_30.00	8	ЦАРЕВИЦА	ОКЛАХОМА		– 10 000,00
S_CMD_f1#	CM_D_3.00	3	FWD ELECTRICITY NE	ТЕКСАС		– 4 500,00

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_CMD_h1#	CM_D_3.00	4	PANAMAX	НЮ ОРЛИЪНС		– 68 750,00
S_CMD_n1#	CM_D_20.00	7	СРЕБРО	EU1		5 000,00
S_CMD_r1#	CM_D_20.00	9	СУРОВАТКА	НЮКАСЪЛ		– 1 250,00
S_CMD_d1#	CM_D_2.00	2	WTI	ОКЛАХОМА		– 1 750,00
S_CMD_l1#	CM_D_15.00	6	ВТЕЧНЕН ПРИРОДЕН ГАЗ	ОКЛАХОМА		10 000,00
S_CMD_t1#	CM_D_15.00	10	КАУЧУК	НЮКАСЪЛ		– 500,00
S_CMD_j1#	CM_D_10.00	5	МЕД	ОКЛАХОМА		– 2 000,00
S_CMD_v1#	CM_D_10.00	11	ПОТАШ	НЮКАСЪЛ		– 18 000,00
S_CMD_b1#	CM_D_1.00	1	УРАН	ОКЛАХОМА		1 500,00
S_CMD_g1#	CM_D_1.00	4	SUPRAMAX	САНТОС		– 62 500,00
S_CMD_w1#	CM_D_1.00	4	SUPRAMAX	САНТОС		– 62 500,00
S_CMD_x1#	CM_D_1.00	4	PANAMAX	НЮ ОРЛИЪНС		187 500,00
S_CMD_a4#	CM_D_0.50	1	ВЪГЛИЩА	НЮКАСЪЛ		8 000,00
S_CMD_a1#	CM_D_0.00	1	ВЪГЛИЩА	НЮКАСЪЛ		10 000,00
S_CMD_a2#	CM_D_0.00	1	ВЪГЛИЩА	НЮКАСЪЛ		– 3 500,00
S_CMD_a3#	CM_D_0.00	1	ВЪГЛИЩА	ЛОНДОН		– 2 000,00
S_CMD_c1#	CM_D_0.00	2	BRENT	ХАВЪР		2 000,00

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_CMD_e1#	CM_D_0.00	3	SPOT ELECTRICITY SE	ЛОНДОН		– 3 000,00
S_CMD_i1#	CM_D_0.00	5	СТОМАНА	ХАВЪР		5 500,00
S_CMD_k1#	CM_D_0.00	6	ПРИРОДЕН ГАЗ	ХАВЪР		4 000,00
S_CMD_m1#	CM_D_0.00	7	ЗЛАТО	UK1		– 2 000,00
S_CMD_o1#	CM_D_0.00	8	СОЕВИ ЗЪРНА	ХАВЪР		– 7 500,00
S_CMD_q1#	CM_D_0.00	9	РИБА	ЛОНДОН		2 500,00
S_CMD_s1#	CM_D_0.00	10	КАКАО	ЛОНДОН		3 500,00
S_CMD_u1#	CM_D_0.00	11	ПЛОСКО СТЪКЛО	ЛОНДОН		30 000,00
S_CMC_a1#	CM_CU	1	ВЪГЛИЩА			17 335,00
S_CMC_a2#	CM_CU	1	ВЪГЛИЩА			36 936,00
S_CMC_b1#	CM_CU	1	УРАН			6 635,00
S_CMC_c1#	CM_CU	2	BRENT			– 11 600,00
S_CMC_d1#	CM_CU	2	WTI			– 36 900,00
S_CMC_e1#	CM_CU	3	SPOT ELECTRICITY SE			8 563,00
S_CMC_f1#	CM_CU	3	FWD ELECTRICITY NE			– 27 250,00
S_CMC_g1#	CM_CU	4	SUPRAMAX			– 36 880,00
S_CMC_h1#	CM_CU	4	PANAMAX			29 472,00

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_CMC_i1#	CM_CU	5	СТОМАНА			– 5 850,00
S_CMC_j1#	CM_CU	5	МЕД			14 644,80
S_CMC_k1#	CM_CU	6	ПРИРОДЕН ГАЗ			– 6 147,50
S_CMC_l1#	CM_CU	6	ВТЕЧНЕН ПРИРОДЕН ГАЗ			– 6 147,50
S_CMC_m1#	CM_CU	7	ЗЛАТО			– 1 486,67
S_CMC_n1#	CM_CU	7	СРЕБРО			743,33
S_CMC_o1#	CM_CU	8	СОЕВИ ЗЪРНА			– 14 535,00
S_CMC_p1#	CM_CU	8	ЦАРЕВИЦА			20 475,00
S_CMC_q1#	CM_CU	9	РИБА			– 19 900,00
S_CMC_r1#	CM_CU	9	СУРОВАТКА			3 387,00
S_CMC_s1#	CM_CU	10	КАКАО			1 005,00
S_CMC_t1#	CM_CU	10	КАУЧУК			10 892,20
S_CMC_u1#	CM_CU	11	ПЛОСКО СТЪКЛО			– 13 790,00
S_CMC_v1#	CM_CU	11	ПОТАШ			20 685,00
S_CMC_x1#	CM_CU	9	МЛЯКО			– 6 300,00
S_CMC_y1#	CM_CU	1	УРАН			– 65 864,00
S_CMC_z1#	CM_CU	4	PANAMAX			29 472,00

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_CMC_a1#	CM_CD	1	ВЪГЛИЩА			– 18 260,00
S_CMC_a2#	CM_CD	1	ВЪГЛИЩА			– 37 630,00
S_CMC_b1#	CM_CD	1	УРАН			– 70 460,00
S_CMC_c1#	CM_CD	2	BRENT			8 320,00
S_CMC_d1#	CM_CD	2	WTI			3 550,00
S_CMC_e1#	CM_CD	3	SPOT ELECTRICITY SE			– 8 233,00
S_CMC_f1#	CM_CD	3	FWD ELECTRICITY NE			16 370,00
S_CMC_g1#	CM_CD	4	SUPRAMAX			29 110,00
S_CMC_h1#	CM_CD	4	PANAMAX			– 15 256,00
S_CMC_i1#	CM_CD	5	СТОМАНА			4 080,00
S_CMC_j1#	CM_CD	5	МЕД			– 10 219,80
S_CMC_k1#	CM_CD	6	ПРИРОДЕН ГАЗ			4 222,50
S_CMC_l1#	CM_CD	6	ВТЕЧНЕН ПРИРОДЕН ГАЗ			4 222,50
S_CMC_m1#	CM_CD	7	ЗЛАТО			1 353,33
S_CMC_n1#	CM_CD	7	СРЕБРО			– 676,67
S_CMC_o1#	CM_CD	8	СОЕВИ ЗЪРНА			10 435,00
S_CMC_p1#	CM_CD	8	ЦАРЕВИЦА			– 14 735,00

Инструмент	Идентификатор на рисковия фактор	Група	Допълнителен идентификатор	Допълнителен идентификатор2	Категория кредитно качество	Чувствителност към риска
S_CMC_q1#	CM_CD	9	РИБА			6 700,00
S_CMC_r1#	CM_CD	9	СУРОВАТКА			– 3 012,00
S_CMC_s1#	CM_CD	10	КАКАО			– 1 415,00
S_CMC_t1#	CM_CD	10	КАУЧУК			– 7 817,20
S_CMC_u1#	CM_CD	11	ПЛОСКО СТЪКЛО			14 200,00
S_CMC_v1#	CM_CD	11	ПОТАШ			– 21 300,00
S_CMC_x1#	CM_CD	9	МЛЯКО			– 4 700,00
S_CMC_y1#	CM_CD	1	УРАН			– 66 344,00
S_CMC_z1#	CM_CD	4	PANAMAX			– 22 856,00

Портфейл	Рисков клас	Компонент	Инструменти
G000	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_a1#
G001	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_b1#
G002	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_b2#
G003	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_b3#
G004	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_b4#
G005	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_b5#
G006	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_b6#
G007	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_b7#
G008	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_b8#
G009	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_b9#
G010	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_b10#
G011	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_b11#
G012	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_b12#
G013	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_d1#
G014	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_d2#
G015	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_d3#
G016	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_d4#
G017	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_d5#
G018	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_d6#
G019	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_d7#
G020	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_d8#
G021	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_d9#
G022	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_d10#
G023	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_d11#
G024	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_d12#
G025	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_a1# S_IRD_b1#
G026	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10#
G027	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_b1# S_IRD_c1#
G028	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10#

Портфейл	Рисков клас	Компонент	Инструменти
G029	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11#
G030	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12#
G031	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c6#
G032	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10# S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12#
G033	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12# S_IRD_e1# S_IRD_e2# S_IRD_e3# S_IRD_e4# S_IRD_e5# S_IRD_e6# S_IRD_e7# S_IRD_e8# S_IRD_e9# S_IRD_e10# S_IRD_e11# S_IRD_e12# S_IRD_e13#
G034	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_a1# S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10# S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12# S_IRD_e1# S_IRD_e2# S_IRD_e3# S_IRD_e4# S_IRD_e5# S_IRD_e6# S_IRD_e7# S_IRD_e8# S_IRD_e9# S_IRD_e10# S_IRD_e11# S_IRD_e12# S_IRD_e13# S_IRD_f1#
G035	GIRR	ВЕГА	S_IRV_b1#
G036	GIRR	ВЕГА	S_IRV_a1# S_IRV_b1#
G037	GIRR	ВЕГА	S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5#
G038	GIRR	ВЕГА	S_IRV_b1# S_IRV_b6# S_IRV_b11# S_IRV_b16# S_IRV_b21#

Портфейл	Рисков клас	Компонент	Инструменти
G039	GIRR	ВЕГА	S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25#
G040	GIRR	ВЕГА	S_IRV_e1# S_IRV_e2#
G041	GIRR	ВЕГА	S_IRV_e1# S_IRV_e3#
G042	GIRR	ВЕГА	S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5#
G043	GIRR	ВЕГА	S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25# S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5#
G044	GIRR	ВЕГА	S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5# S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5#
G045	GIRR	ВЕГА	S_IRV_a1# S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25# S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5# S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5# S_IRV_e1# S_IRV_e2# S_IRV_e3#
G046	GIRR	КРИВИНА	S_IRC_b1#
G047	GIRR	КРИВИНА	S_IRC_c1#
G048	GIRR	КРИВИНА	S_IRC_a1# S_IRC_b1#
G049	GIRR	КРИВИНА	S_IRC_d1#
G050	GIRR	КРИВИНА	S_IRC_b1# S_IRC_c1#
G051	GIRR	КРИВИНА	S_IRC_c1# S_IRC_e1#
G052	GIRR	КРИВИНА	S_IRC_d1# S_IRC_e1#
G053	GIRR	КРИВИНА	S_IRC_a1# S_IRC_a1# S_IRC_b1# S_IRC_b1# S_IRC_c1# S_IRC_c1# S_IRC_d1# S_IRC_d1# S_IRC_e1# S_IRC_e1#

Портфейл	Рисков клас	Компонент	Инструменти
G054	GIRR	ВСИЧКИ	S_IRD_a1# S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10# S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12# S_IRD_e1# S_IRD_e2# S_IRD_e3# S_IRD_e4# S_IRD_e5# S_IRD_e6# S_IRD_e7# S_IRD_e8# S_IRD_e9# S_IRD_e10# S_IRD_e11# S_IRD_e12# S_IRD_e13# S_IRD_f1# S_IRV_a1# S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25# S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5# S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5# S_IRV_e1# S_IRV_e2# S_IRV_e3# S_IRC_a1# S_IRC_a1# S_IRC_b1# S_IRC_b1# S_IRC_c1# S_IRC_c1# S_IRC_d1# S_IRC_d1# S_IRC_e1# S_IRC_e1#
G055	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_e11# S_IRD_e13#
G056	GIRR	ДЕЛТА	S_IRD_e1# S_IRD_f1#
E001	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_a2#
E002	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_c1#
E003	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_d1#
E004	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_e1#
E005	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_f1#
E006	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_h1#
E007	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_i1#
E008	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_j1#
E009	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_k1#
E010	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_m1#
E011	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_o1#
E012	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_q1#
E013	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_s1#
E014	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_a3#

Портфейл	Рисков клас	Компонент	Инструменти
E015	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_x1#
E016	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_y1#
E017	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_z1#
E018	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_f2#
E019	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_aa1#
E020	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_ab1#
E021	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_ac1#
E022	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_k2#
E023	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_m2#
E024	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_p1#
E025	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_q2#
E026	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_t1#
E027	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_a1# S_EQD_a2#
E028	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_a2# S_EQD_a3#
E029	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_a2# S_EQD_b1#
E030	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_a2# S_EQD_b2#
E031	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_f1# S_EQD_f2#
E032	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_f1# S_EQD_g1#
E033	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_f1# S_EQD_g2#
E034	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_k1# S_EQD_k2#
E035	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_k1# S_EQD_l1#
E036	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_k1# S_EQD_l2#
E037	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_m1# S_EQD_m2#
E038	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_m1# S_EQD_n1#
E039	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_m1# S_EQD_n2#
E040	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_o1# S_EQD_p1#
E041	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_q1# S_EQD_q2#
E042	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_q1# S_EQD_r1#
E043	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_s1# S_EQD_t1#
E044	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_s1# S_EQD_t1# S_EQD_t2#

Портфейл	Рисков клас	Компонент	Инструменти
E045	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_a2# S_EQD_c1# S_EQD_d1# S_EQD_e1# S_EQD_f1# S_EQD_h1# S_EQD_i1# S_EQD_j1# S_EQD_k1# S_EQD_m1#
E046	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_a2# S_EQD_o1#
E047	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_q1# S_EQD_s1#
E048	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_a2# S_EQD_q1#
E049	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_k1# S_EQD_l1# S_EQD_m1# S_EQD_n1# S_EQD_q1# S_EQD_s2# S_EQD_u1# S_EQD_v1#
E050	EQ	ДЕЛТА	S_EQD_a1# S_EQD_a2# S_EQD_a3# S_EQD_b1# S_EQD_b2# S_EQD_c1# S_EQD_x1# S_EQD_d1# S_EQD_y1# S_EQD_e1# S_EQD_z1# S_EQD_f1# S_EQD_f2# S_EQD_g1# S_EQD_g2# S_EQD_h1# S_EQD_aa1# S_EQD_i1# S_EQD_ab1# S_EQD_j1# S_EQD_ac1# S_EQD_k1# S_EQD_k2# S_EQD_l1# S_EQD_l2# S_EQD_m1# S_EQD_m2# S_EQD_n1# S_EQD_n2# S_EQD_o1# S_EQD_p1# S_EQD_q1# S_EQD_q2# S_EQD_r1# S_EQD_r2# S_EQD_s1# S_EQD_s2# S_EQD_t1# S_EQD_t2# S_EQD_u1# S_EQD_v1#
E051	EQ	ВЕГА	S_EQV_a2#
E052	EQ	ВЕГА	S_EQV_c1#
E053	EQ	ВЕГА	S_EQV_d1#
E054	EQ	ВЕГА	S_EQV_e1#
E055	EQ	ВЕГА	S_EQV_f1#
E056	EQ	ВЕГА	S_EQV_g1#
E057	EQ	ВЕГА	S_EQV_h1#
E058	EQ	ВЕГА	S_EQV_i1#
E059	EQ	ВЕГА	S_EQV_j1#
E060	EQ	ВЕГА	S_EQV_k1#
E061	EQ	ВЕГА	S_EQV_l1#
E062	EQ	ВЕГА	S_EQV_n1#
E063	EQ	ВЕГА	S_EQV_p1#
E064	EQ	ВЕГА	S_EQV_a1# S_EQV_a2#
E065	EQ	ВЕГА	S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6#
E066	EQ	ВЕГА	S_EQV_a2# S_EQV_b1#
E067	EQ	ВЕГА	S_EQV_a1# S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6# S_EQV_b1# S_EQV_b2# S_EQV_b3# S_EQV_b4# S_EQV_b5#

Портфейл	Рисков клас	Компонент	Инструменти
E068	EQ	ВЕГА	S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5#
E069	EQ	ВЕГА	S_EQV_f1# S_EQV_aa1#
E070	EQ	ВЕГА	S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5# S_EQV_aa1# S_EQV_aa2# S_EQV_aa3# S_EQV_aa4# S_EQV_aa5#
E071	EQ	ВЕГА	S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5#
E072	EQ	ВЕГА	S_EQV_j1# S_EQV_ae1#
E073	EQ	ВЕГА	S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5# S_EQV_ae1# S_EQV_ae2# S_EQV_ae3# S_EQV_ae4# S_EQV_ae5#
E074	EQ	ВЕГА	S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5#
E075	EQ	ВЕГА	S_EQV_k1# S_EQV_af1#
E076	EQ	ВЕГА	S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5# S_EQV_af1# S_EQV_af2# S_EQV_af3# S_EQV_af4# S_EQV_af5#
E077	EQ	ВЕГА	S_EQV_l1# S_EQV_m1#
E078	EQ	ВЕГА	S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5#
E079	EQ	ВЕГА	S_EQV_n1# S_EQV_o1#
E080	EQ	ВЕГА	S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5# S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5#
E081	EQ	ВЕГА	S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5#
E082	EQ	ВЕГА	S_EQV_a2# S_EQV_c1# S_EQV_d1# S_EQV_e1# S_EQV_f1# S_EQV_g1# S_EQV_h1# S_EQV_i1# S_EQV_j1# S_EQV_k1#
E083	EQ	ВЕГА	S_EQV_a2# S_EQV_m1#
E084	EQ	ВЕГА	S_EQV_n1# S_EQV_p1#
E085	EQ	ВЕГА	S_EQV_a2# S_EQV_n1#
E086	EQ	ВЕГА	S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5# S_EQV_p1#

Портфейл	Рисков клас	Компонент	Инструменти
E087	EQ	ВЕГА	S_EQV_a1# S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6# S_EQV_b1# S_EQV_b2# S_EQV_b3# S_EQV_b4# S_EQV_b5# S_EQV_c1# S_EQV_x1# S_EQV_d1# S_EQV_y1# S_EQV_e1# S_EQV_z1# S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5# S_EQV_aa1# S_EQV_aa2# S_EQV_aa3# S_EQV_aa4# S_EQV_aa5# S_EQV_g1# S_EQV_ab1# S_EQV_h1# S_EQV_ac1# S_EQV_i1# S_EQV_ad1# S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5# S_EQV_ae1# S_EQV_ae2# S_EQV_ae3# S_EQV_ae4# S_EQV_ae5# S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5# S_EQV_af1# S_EQV_af2# S_EQV_af3# S_EQV_af4# S_EQV_af5# S_EQV_l1# S_EQV_m1# S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5# S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5# S_EQV_p1# S_EQV_q1#
E088	EQ	КРИВИНА	S_EQC_b1#
E089	EQ	КРИВИНА	S_EQC_c1#
E090	EQ	КРИВИНА	S_EQC_d1#
E091	EQ	КРИВИНА	S_EQC_e1#
E092	EQ	КРИВИНА	S_EQC_f1#
E093	EQ	КРИВИНА	S_EQC_g1#
E094	EQ	КРИВИНА	S_EQC_h1#
E095	EQ	КРИВИНА	S_EQC_i1#
E096	EQ	КРИВИНА	S_EQC_j1#
E097	EQ	КРИВИНА	S_EQC_k1#
E098	EQ	КРИВИНА	S_EQC_q1#
E099	EQ	КРИВИНА	S_EQC_t1#
E100	EQ	КРИВИНА	S_EQC_u1#
E101	EQ	КРИВИНА	S_EQC_a1# S_EQC_a2#
E102	EQ	КРИВИНА	S_EQC_a1# S_EQC_b1#
E103	EQ	КРИВИНА	S_EQC_f1# S_EQC_ac1#
E104	EQ	КРИВИНА	S_EQC_j1# S_EQC_ag1#
E105	EQ	КРИВИНА	S_EQC_k1# S_EQC_ah1#
E106	EQ	КРИВИНА	S_EQC_q1# S_EQC_r1#
E107	EQ	КРИВИНА	S_EQC_t1# S_EQC_v1#

Портфейл	Рисков клас	Компонент	Инструменти
E108	EQ	КРИВИНА	S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_y1# S_EQC_z1#
E109	EQ	КРИВИНА	S_EQC_s1#
E110	EQ	КРИВИНА	S_EQC_a2# S_EQC_c1# S_EQC_d1# S_EQC_e1# S_EQC_f1# S_EQC_g1# S_EQC_h1# S_EQC_i1# S_EQC_j1# S_EQC_k1#
E111	EQ	КРИВИНА	S_EQC_a2# S_EQC_q1#
E112	EQ	КРИВИНА	S_EQC_t1# S_EQC_u1#
E113	EQ	КРИВИНА	S_EQC_a2# S_EQC_t1#
E114	EQ	КРИВИНА	S_EQC_a1# S_EQC_b1# S_EQC_d1# S_EQC_s1#
E115	EQ	КРИВИНА	S_EQC_a1# S_EQC_b1# S_EQC_t1# S_EQC_u1#
E116	EQ	КРИВИНА	S_EQC_a1# S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_b1# S_EQC_c1# S_EQC_c1# S_EQC_aa1# S_EQC_aa1# S_EQC_d1# S_EQC_d1# S_EQC_e1# S_EQC_e1# S_EQC_ab1# S_EQC_ab1# S_EQC_f1# S_EQC_f1# S_EQC_ac1# S_EQC_ac1# S_EQC_g1# S_EQC_g1# S_EQC_ad1# S_EQC_ad1# S_EQC_h1# S_EQC_h1# S_EQC_ae1# S_EQC_ae1# S_EQC_i1# S_EQC_i1# S_EQC_af1# S_EQC_af1# S_EQC_j1# S_EQC_j1# S_EQC_ag1# S_EQC_ag1# S_EQC_k1# S_EQC_k1# S_EQC_ah1# S_EQC_ah1# S_EQC_q1# S_EQC_q1# S_EQC_r1# S_EQC_r1# S_EQC_s1# S_EQC_s1# S_EQC_t1# S_EQC_t1# S_EQC_u1# S_EQC_u1# S_EQC_v1# S_EQC_v1# S_EQC_w1# S_EQC_w1# S_EQC_y1# S_EQC_y1# S_EQC_z1# S_EQC_z1#
E117	EQ	ВСИЧКИ	S_EQD_a1# S_EQD_a2# S_EQD_a3# S_EQD_b1# S_EQD_b2# S_EQD_c1# S_EQD_x1# S_EQD_d1# S_EQD_y1# S_EQD_e1# S_EQD_z1# S_EQD_f1# S_EQD_f2# S_EQD_g1# S_EQD_g2# S_EQD_h1# S_EQD_aa1# S_EQD_i1# S_EQD_ab1# S_EQD_j1# S_EQD_ac1# S_EQD_k1# S_EQD_k2# S_EQD_l1# S_EQD_l2# S_EQD_m1# S_EQD_m2# S_EQD_n1# S_EQD_n2# S_EQD_o1# S_EQD_p1# S_EQD_q1# S_EQD_q2# S_EQD_r1# S_EQD_r2# S_EQD_s1# S_EQD_s2# S_EQD_t1# S_EQD_t2# S_EQD_u1# S_EQD_v1# S_EQV_a1# S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6# S_EQV_b1# S_EQV_b2# S_EQV_b3# S_EQV_b4# S_EQV_b5# S_EQV_c1# S_EQV_x1# S_EQV_d1# S_EQV_y1# S_EQV_e1# S_EQV_z1# S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5# S_EQV_aa1# S_EQV_aa2# S_EQV_aa3# S_EQV_aa4# S_EQV_aa5# S_EQV_g1# S_EQV_ab1# S_EQV_h1# S_EQV_ac1# S_EQV_i1# S_EQV_ad1# S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5#

Портфейл	Рисков клас	Компонент	Инструменти
			S_EQV_ae1# S_EQV_ae2# S_EQV_ae3# S_EQV_ae4# S_EQV_ae5# S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5# S_EQV_af1# S_EQV_af2# S_EQV_af3# S_EQV_af4# S_EQV_af5# S_EQV_l1# S_EQV_m1# S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5# S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5# S_EQV_p1# S_EQV_q1# S_EQC_a1# S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_b1# S_EQC_c1# S_EQC_c1# S_EQC_aa1# S_EQC_aa1# S_EQC_d1# S_EQC_d1# S_EQC_e1# S_EQC_e1# S_EQC_ab1# S_EQC_ab1# S_EQC_f1# S_EQC_f1# S_EQC_ac1# S_EQC_ac1# S_EQC_g1# S_EQC_g1# S_EQC_ad1# S_EQC_ad1# S_EQC_h1# S_EQC_h1# S_EQC_ae1# S_EQC_ae1# S_EQC_i1# S_EQC_i1# S_EQC_af1# S_EQC_af1# S_EQC_j1# S_EQC_j1# S_EQC_ag1# S_EQC_ag1# S_EQC_k1# S_EQC_k1# S_EQC_ah1# S_EQC_ah1# S_EQC_q1# S_EQC_q1# S_EQC_r1# S_EQC_r1# S_EQC_s1# S_EQC_s1# S_EQC_t1# S_EQC_t1# S_EQC_u1# S_EQC_u1# S_EQC_v1# S_EQC_v1# S_EQC_w1# S_EQC_w1# S_EQC_y1# S_EQC_y1# S_EQC_z1# S_EQC_z1#
F001	FX	ДЕЛТА	S_FXD_b1#
F002	FX	ДЕЛТА	S_FXD_c1#
F003	FX	ДЕЛТА	S_FXD_a1# S_FXD_b1#
F005	FX	ДЕЛТА	S_FXD_b1# S_FXD_c1#
F007	FX	ДЕЛТА	S_FXD_a1# S_FXD_b1# S_FXD_c1# S_FXD_d1# S_FXD_e1# S_FXD_f1#
F008	FX	ВЕГА	S_FXV_b1#
F009	FX	ВЕГА	S_FXV_a1# S_FXV_b1#
F010	FX	ВЕГА	S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5#
F011	FX	ВЕГА	S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5#
F012	FX	ВЕГА	S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5# S_FXV_c1#
F013	FX	ВЕГА	S_FXV_c1# S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5#
F014	FX	ВЕГА	S_FXV_a1# S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5# S_FXV_c1# S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5#

Портфейл	Рисков клас	Компонент	Инструменти
F015	FX	КРИВИНА	S_FXC_b1#
F016	FX	КРИВИНА	S_FXC_c1#
F017	FX	КРИВИНА	S_FXC_a1# S_FXC_b1#
F018	FX	КРИВИНА	S_FXC_d1#
F019	FX	КРИВИНА	S_FXC_b1# S_FXC_c1#
F020	FX	КРИВИНА	S_FXC_c1# S_FXC_e1#
F021	FX	КРИВИНА	S_FXC_b1# S_FXC_d1# S_FXC_e1#
F022	FX	КРИВИНА	S_FXC_a1# S_FXC_a1# S_FXC_b1# S_FXC_b1# S_FXC_c1# S_FXC_c1# S_FXC_d1# S_FXC_d1# S_FXC_e1# S_FXC_e1# S_FXC_f1# S_FXC_f1#
F023	FX	ВСИЧКИ	S_FXD_a1# S_FXD_b1# S_FXD_c1# S_FXD_d1# S_FXD_e1# S_FXD_f1# S_FXV_a1# S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5# S_FXV_c1# S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5# S_FXC_a1# S_FXC_a1# S_FXC_b1# S_FXC_b1# S_FXC_c1# S_FXC_c1# S_FXC_d1# S_FXC_d1# S_FXC_e1# S_FXC_e1# S_FXC_f1# S_FXC_f1#
F024	FX	ДЕЛТА	S_FXD_d1#
F026	FX	ДЕЛТА	S_FXD_f1#
F028	FX	КРИВИНА	S_FXC_f1#
N001	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_a1#
N002	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_c1#
N003	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_d1#
N004	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_e1#
N005	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_f1#
N006	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_g1#
N007	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_h1#
N008	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_i1#
N009	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_w1#
N010	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_j1#
N011	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_k1#
N012	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_l1#
N013	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_m1#
N014	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_n1#

Портфейл	Рисков клас	Компонент	Инструменти
N015	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_o1#
N016	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_p1#
N017	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_q1#
N018	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_u1#
N019	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_v1#
N020	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_a1# S_CND_a2#
N021	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_a2# S_CND_a3#
N022	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_a2# S_CND_a4#
N023	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_a3# S_CND_a4#
N024	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_a1# S_CND_b1#
N025	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_a3# S_CND_b1#
N026	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_a4# S_CND_b1#
N027	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_a1# S_CND_b2#
N028	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_q1# S_CND_r1#
N029	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_u1# S_CND_x2#
N030	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_v1# S_CND_y1#
N031	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_u1# S_CND_x1# S_CND_x2#
N032	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1#
N033	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1#
N034	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1#
N035	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#
N036	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1#
N037	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1#
N038	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#
N039	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1#
N040	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#

Портфейл	Рисков клас	Компонент	Инструменти
N041	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#
N042	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_a3# S_CND_b1# S_CND_c1# S_CND_s1# S_CND_t1#
N043	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_a1# S_CND_a2# S_CND_a3# S_CND_a4# S_CND_b1# S_CND_b2# S_CND_ab1# S_CND_ab2# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_hb1# S_CND_hb2# S_CND_i1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1# S_CND_q1# S_CND_r1# S_CND_s1# S_CND_t1# S_CND_u1# S_CND_v1# S_CND_w1# S_CND_x1# S_CND_x2# S_CND_y1#
N044	CSR_NON_SEC	ВЕГА	S_CNV_a2#
N045	CSR_NON_SEC	ВЕГА	S_CNV_a1# S_CNV_a2#
N046	CSR_NON_SEC	ВЕГА	S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6#
N047	CSR_NON_SEC	ВЕГА	S_CNV_a2# S_CNV_b1#
N048	CSR_NON_SEC	ВЕГА	S_CNV_a1# S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6# S_CNV_b1# S_CNV_b2# S_CNV_b3# S_CNV_b4# S_CNV_b5#
N049	CSR_NON_SEC	ВЕГА	S_CNV_q1# S_CNV_r1#
N050	CSR_NON_SEC	ВЕГА	S_CNV_s1# S_CNV_u1#
N051	CSR_NON_SEC	ВЕГА	S_CNV_t1# S_CNV_v1#
N052	CSR_NON_SEC	ВЕГА	S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5#
N053	CSR_NON_SEC	ВЕГА	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1#
N054	CSR_NON_SEC	ВЕГА	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1#
N055	CSR_NON_SEC	ВЕГА	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1#
N056	CSR_NON_SEC	ВЕГА	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#
N057	CSR_NON_SEC	ВЕГА	S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1#
N058	CSR_NON_SEC	ВЕГА	S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1#
N059	CSR_NON_SEC	ВЕГА	S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#

Портфейл	Рисков клас	Компонент	Инструменти
N060	CSR_NON_SEC	ВЕГА	S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1#
N061	CSR_NON_SEC	ВЕГА	S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#
N062	CSR_NON_SEC	ВЕГА	S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#
N063	CSR_NON_SEC	ВЕГА	S_CNV_b4# S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5#
N064	CSR_NON_SEC	ВЕГА	S_CNV_a1# S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6# S_CNV_b1# S_CNV_b2# S_CNV_b3# S_CNV_b4# S_CNV_b5# S_CNV_ab1# S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_hb1# S_CNV_i1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1# S_CNV_q1# S_CNV_r1# S_CNV_s1# S_CNV_t1# S_CNV_u1# S_CNV_v1#
N065	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_b1#
N066	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_c1#
N067	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_d1#
N068	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_e1#
N069	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_f1#
N070	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_g1#
N071	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_h1#
N072	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_i1#
N073	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_aa1#
N074	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_j1#
N075	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_k1#
N076	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_l1#
N077	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_m1#
N078	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_n1#
N079	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_o1#
N080	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_p1#

Портфейл	Рисков клас	Компонент	Инструменти
N081	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_q1#
N082	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_t1#
N083	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_u1#
N084	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_a1# S_CNC_a2#
N085	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_a1# S_CNC_b1#
N086	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_q1# S_CNC_r1#
N087	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_t1# S_CNC_v1#
N088	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_u1# S_CNC_w1#
N089	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_y1# S_CNC_z1#
N090	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_s1#
N091	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1#
N092	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1#
N093	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1#
N094	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N095	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1#
N096	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1#
N097	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N098	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1#
N099	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N100	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N101	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_c1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_z1#
N102	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_a1# S_CNC_b1# S_CNC_d1# S_CNC_s1#

Портфейл	Рисков клас	Компонент	Инструменти
N103	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_a1# S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_b1# S_CNC_ab1# S_CNC_ab1# S_CNC_c1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_e1# S_CNC_f1# S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_h1# S_CNC_hb1# S_CNC_hb1# S_CNC_i1# S_CNC_i1# S_CNC_j1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_m1# S_CNC_n1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_q1# S_CNC_r1# S_CNC_r1# S_CNC_s1# S_CNC_s1# S_CNC_t1# S_CNC_t1# S_CNC_u1# S_CNC_u1# S_CNC_v1# S_CNC_v1# S_CNC_w1# S_CNC_w1# S_CNC_x1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_y1# S_CNC_z1# S_CNC_z1# S_CNC_aa1# S_CNC_aa1#
N104	CSR_NON_SEC	ВСИЧКИ	S_CND_a1# S_CND_a2# S_CND_a3# S_CND_a4# S_CND_b1# S_CND_b2# S_CND_ab1# S_CND_ab2# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_hb1# S_CND_hb2# S_CND_i1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1# S_CND_q1# S_CND_r1# S_CND_s1# S_CND_t1# S_CND_u1# S_CND_v1# S_CND_w1# S_CND_x1# S_CND_x2# S_CND_y1# S_CNV_a1# S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6# S_CNV_b1# S_CNV_b2# S_CNV_b3# S_CNV_b4# S_CNV_b5# S_CNV_ab1# S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_hb1# S_CNV_i1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1# S_CNV_q1# S_CNV_r1# S_CNV_s1# S_CNV_t1# S_CNV_u1# S_CNV_v1# S_CNC_a1# S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_b1# S_CNC_ab1# S_CNC_ab1# S_CNC_c1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_e1# S_CNC_f1# S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_h1# S_CNC_hb1# S_CNC_hb1# S_CNC_i1# S_CNC_i1# S_CNC_j1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_m1# S_CNC_n1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_q1# S_CNC_r1# S_CNC_r1# S_CNC_s1# S_CNC_s1# S_CNC_t1# S_CNC_t1# S_CNC_u1# S_CNC_u1# S_CNC_v1# S_CNC_v1# S_CNC_w1# S_CNC_w1# S_CNC_x1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_y1# S_CNC_z1# S_CNC_z1# S_CNC_aa1# S_CNC_aa1#

Портфейл	Рисков клас	Компонент	Инструменти
N104(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_ab1#
N105(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	КРИВИНА	S_CNC_hb1#
N106(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_ab1#
N107(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	ДЕЛТА	S_CND_hb1#
C001	CM	ДЕЛТА	S_CMD_a2#
C002	CM	ДЕЛТА	S_CMD_c1#
C003	CM	ДЕЛТА	S_CMD_e1#
C004	CM	ДЕЛТА	S_CMD_g1#
C005	CM	ДЕЛТА	S_CMD_i1#
C006	CM	ДЕЛТА	S_CMD_k1#
C007	CM	ДЕЛТА	S_CMD_m1#
C008	CM	ДЕЛТА	S_CMD_o1#
C009	CM	ДЕЛТА	S_CMD_q1#
C010	CM	ДЕЛТА	S_CMD_s1#
C011	CM	ДЕЛТА	S_CMD_u1#
C012	CM	ДЕЛТА	S_CMD_a1# S_CMD_a2#
C013	CM	ДЕЛТА	S_CMD_a2# S_CMD_a3#
C014	CM	ДЕЛТА	S_CMD_a2# S_CMD_a4#
C015	CM	ДЕЛТА	S_CMD_a3# S_CMD_a4#
C016	CM	ДЕЛТА	S_CMD_a2# S_CMD_b1#
C017	CM	ДЕЛТА	S_CMD_c1# S_CMD_d1#
C018	CM	ДЕЛТА	S_CMD_e1# S_CMD_f1#
C019	CM	ДЕЛТА	S_CMD_g1# S_CMD_h1#
C020	CM	ДЕЛТА	S_CMD_i1# S_CMD_j1#
C021	CM	ДЕЛТА	S_CMD_k1# S_CMD_l1#
C022	CM	ДЕЛТА	S_CMD_m1# S_CMD_n1#
C023	CM	ДЕЛТА	S_CMD_o1# S_CMD_p1#
C024	CM	ДЕЛТА	S_CMD_q1# S_CMD_r1#
C025	CM	ДЕЛТА	S_CMD_s1# S_CMD_t1#
C026	CM	ДЕЛТА	S_CMD_u1# S_CMD_v1#

Портфейл	Рисков клас	Компонент	Инструменти
C027	CM	ДЕЛТА	S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_w1# S_CMD_x1#
C028	CM	ДЕЛТА	S_CMD_a2# S_CMD_c1# S_CMD_e1# S_CMD_g1# S_CMD_i1# S_CMD_k1# S_CMD_m1# S_CMD_o1# S_CMD_q1# S_CMD_s1#
C029	CM	ДЕЛТА	S_CMD_a2# S_CMD_u1#
C030	CM	ДЕЛТА	S_CMD_c1# S_CMD_d1# S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_w1# S_CMD_x1#
C031	CM	ДЕЛТА	S_CMD_a1# S_CMD_a2# S_CMD_a3# S_CMD_a4# S_CMD_b1# S_CMD_c1# S_CMD_d1# S_CMD_e1# S_CMD_f1# S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_i1# S_CMD_j1# S_CMD_k1# S_CMD_l1# S_CMD_m1# S_CMD_n1# S_CMD_o1# S_CMD_p1# S_CMD_q1# S_CMD_r1# S_CMD_s1# S_CMD_t1# S_CMD_u1# S_CMD_v1# S_CMD_w1# S_CMD_x1#
C032	CM	ВЕГА	S_CMV_a2#
C033	CM	ВЕГА	S_CMV_a1# S_CMV_a2#
C034	CM	ВЕГА	S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6#
C035	CM	ВЕГА	S_CMV_a1# S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6# S_CMV_b1# S_CMV_b2# S_CMV_b3# S_CMV_b4# S_CMV_b5#
C036	CM	ВЕГА	S_CMV_c1# S_CMV_d1#
C037	CM	ВЕГА	S_CMV_e1# S_CMV_f1#
C038	CM	ВЕГА	S_CMV_g1# S_CMV_h1#
C039	CM	ВЕГА	S_CMV_i1# S_CMV_j1#
C040	CM	ВЕГА	S_CMV_k1# S_CMV_l1#
C041	CM	ВЕГА	S_CMV_m1# S_CMV_n1#
C042	CM	ВЕГА	S_CMV_o1# S_CMV_p1#
C043	CM	ВЕГА	S_CMV_q1# S_CMV_r1#
C044	CM	ВЕГА	S_CMV_s1# S_CMV_t1#
C045	CM	ВЕГА	S_CMV_u1# S_CMV_v1#
C046	CM	ВЕГА	S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_w1# S_CMV_x1#
C047	CM	ВЕГА	S_CMV_a2# S_CMV_c1# S_CMV_e1# S_CMV_g1# S_CMV_i1# S_CMV_k1# S_CMV_m1# S_CMV_o1# S_CMV_q1# S_CMV_s1#
C048	CM	ВЕГА	S_CMV_a2# S_CMV_u1#

Портфейл	Рисков клас	Компонент	Инструменти
C049	CM	ВЕГА	S_CMV_c1# S_CMV_d1# S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_w1# S_CMV_x1#
C050	CM	ВЕГА	S_CMV_a1# S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6# S_CMV_b1# S_CMV_b2# S_CMV_b3# S_CMV_b4# S_CMV_b5# S_CMV_c1# S_CMV_d1# S_CMV_e1# S_CMV_f1# S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_i1# S_CMV_j1# S_CMV_k1# S_CMV_l1# S_CMV_m1# S_CMV_n1# S_CMV_o1# S_CMV_p1# S_CMV_q1# S_CMV_r1# S_CMV_s1# S_CMV_t1# S_CMV_u1# S_CMV_v1# S_CMV_w1# S_CMV_x1#
C051	CM	КРИВИНА	S_CMC_b1#
C052	CM	КРИВИНА	S_CMC_c1#
C053	CM	КРИВИНА	S_CMC_e1#
C054	CM	КРИВИНА	S_CMC_g1#
C055	CM	КРИВИНА	S_CMC_i1#
C056	CM	КРИВИНА	S_CMC_k1#
C057	CM	КРИВИНА	S_CMC_m1#
C058	CM	КРИВИНА	S_CMC_o1#
C059	CM	КРИВИНА	S_CMC_q1#
C060	CM	КРИВИНА	S_CMC_s1#
C061	CM	КРИВИНА	S_CMC_u1#
C062	CM	КРИВИНА	S_CMC_a1# S_CMC_a2#
C063	CM	КРИВИНА	S_CMC_a1# S_CMC_b1#
C064	CM	КРИВИНА	S_CMC_c1# S_CMC_d1#
C065	CM	КРИВИНА	S_CMC_e1# S_CMC_f1#
C066	CM	КРИВИНА	S_CMC_g1# S_CMC_h1#
C067	CM	КРИВИНА	S_CMC_i1# S_CMC_j1#
C068	CM	КРИВИНА	S_CMC_k1# S_CMC_l1#
C069	CM	КРИВИНА	S_CMC_m1# S_CMC_n1#
C070	CM	КРИВИНА	S_CMC_o1# S_CMC_p1#
C071	CM	КРИВИНА	S_CMC_q1# S_CMC_r1#
C072	CM	КРИВИНА	S_CMC_s1# S_CMC_t1#
C073	CM	КРИВИНА	S_CMC_u1# S_CMC_v1#
C074	CM	КРИВИНА	S_CMC_a2# S_CMC_b1#
C075	CM	КРИВИНА	S_CMC_g1# S_CMC_z1#

Портфейл	Рисков клас	Компонент	Инструменти
C076	CM	КРИВИНА	S_CMC_b1# S_CMC_c1# S_CMC_e1# S_CMC_g1# S_CMC_i1# S_CMC_k1# S_CMC_m1# S_CMC_o1# S_CMC_q1# S_CMC_s1#
C077	CM	КРИВИНА	S_CMC_a2# S_CMC_u1#
C078	CM	КРИВИНА	S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_y1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_x1#
C079	CM	КРИВИНА	S_CMC_x1# S_CMC_g1# S_CMC_z1#
C080	CM	КРИВИНА	S_CMC_a1# S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_b1# S_CMC_c1# S_CMC_c1# S_CMC_d1# S_CMC_d1# S_CMC_e1# S_CMC_e1# S_CMC_f1# S_CMC_f1# S_CMC_g1# S_CMC_g1# S_CMC_h1# S_CMC_h1# S_CMC_i1# S_CMC_i1# S_CMC_j1# S_CMC_j1# S_CMC_k1# S_CMC_k1# S_CMC_l1# S_CMC_l1# S_CMC_m1# S_CMC_m1# S_CMC_n1# S_CMC_n1# S_CMC_o1# S_CMC_o1# S_CMC_p1# S_CMC_p1# S_CMC_q1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_r1# S_CMC_s1# S_CMC_s1# S_CMC_t1# S_CMC_t1# S_CMC_u1# S_CMC_u1# S_CMC_v1# S_CMC_v1# S_CMC_x1# S_CMC_x1# S_CMC_y1# S_CMC_y1# S_CMC_z1# S_CMC_z1#
C081	CM	ВСИЧКИ	S_CMD_a1# S_CMD_a2# S_CMD_a3# S_CMD_a4# S_CMD_b1# S_CMD_c1# S_CMD_d1# S_CMD_e1# S_CMD_f1# S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_i1# S_CMD_j1# S_CMD_k1# S_CMD_l1# S_CMD_m1# S_CMD_n1# S_CMD_o1# S_CMD_p1# S_CMD_q1# S_CMD_r1# S_CMD_s1# S_CMD_t1# S_CMD_u1# S_CMD_v1# S_CMD_w1# S_CMD_x1# S_CMV_a1# S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6# S_CMV_b1# S_CMV_b2# S_CMV_b3# S_CMV_b4# S_CMV_b5# S_CMV_c1# S_CMV_d1# S_CMV_e1# S_CMV_f1# S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_i1# S_CMV_j1# S_CMV_k1# S_CMV_l1# S_CMV_m1# S_CMV_n1# S_CMV_o1# S_CMV_p1# S_CMV_q1# S_CMV_r1# S_CMV_s1# S_CMV_t1# S_CMV_u1# S_CMV_v1# S_CMV_w1# S_CMV_x1# S_CMC_a1# S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_b1# S_CMC_c1# S_CMC_c1# S_CMC_d1# S_CMC_d1# S_CMC_e1# S_CMC_e1# S_CMC_f1# S_CMC_f1# S_CMC_g1# S_CMC_g1# S_CMC_h1# S_CMC_h1# S_CMC_i1# S_CMC_i1# S_CMC_j1# S_CMC_j1# S_CMC_k1# S_CMC_k1# S_CMC_l1# S_CMC_l1# S_CMC_m1# S_CMC_m1# S_CMC_n1# S_CMC_n1# S_CMC_o1# S_CMC_o1# S_CMC_p1# S_CMC_p1# S_CMC_q1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_r1# S_CMC_s1# S_CMC_s1# S_CMC_t1# S_CMC_t1# S_CMC_u1# S_CMC_u1# S_CMC_v1# S_CMC_v1# S_CMC_x1# S_CMC_x1# S_CMC_y1# S_CMC_y1# S_CMC_z1# S_CMC_z1#“