Euroopa Liidu
Teataja

ET
L-seeria

2025/379

12.3.2025

KOMISJONI RAKENDUSMÄÄRUS (EL) 2025/379,

26. veebruar 2025,

millega muudetakse rakendusmääruses (EL) 2016/2070 sätestatud rakenduslikke tehnilisi standardeid seoses võrdlusportfellide, aruandevormide ja aruandlusjuhistega, mida kohaldatakse liidus Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2013/36/EL artikli 78 lõikes 2 osutatud aruandluse puhul

(EMPs kohaldatav tekst)

EUROOPA KOMISJON,

võttes arvesse Euroopa Liidu toimimise lepingut,

võttes arvesse Euroopa Parlamendi ja nõukogu 26. juuni 2013. aasta direktiivi 2013/36/EL, mis käsitleb krediidiasutuste tegevuse alustamise tingimusi ning krediidiasutuste usaldatavusnõuete täitmise järelevalvet, millega muudetakse direktiivi 2002/87/EÜ ning millega tunnistatakse kehtetuks direktiivid 2006/48/EÜ ja 2006/49/EÜ, ([1]) eriti selle artikli 78 lõike 8 kolmandat lõiku,

ning arvestades järgmist:

(1) Direktiivi 2013/36/EL artikli 78 lõike 1 kohaselt peavad finantsinstitutsioonid, kellel on lubatud kasutada sisemeetodeid, esitama oma pädevale asutusele asjakohase sagedusega ja vähemalt kord aastas võrdlusportfellidesse kuuluvate riskipositsioonide või positsioonide puhul sisemeetodite alusel tehtud riskiga kaalutud varade või omavahendite nõuete arvutuste tulemused, et pädev asutus saaks hinnata nende sisemeetodite kvaliteeti (võrdlusanalüüs). Kõnealuse direktiivi artikli 78 lõike 3 teise lõigu kohaselt peab Euroopa Pangandusjärelevalve (EBA) koostama aruande, et aidata pädevatel asutustel hinnata finantsinstitutsioonide sisemeetodite kvaliteeti, tuginedes võrdlusanalüüsi tulemustele. Võrdlusanalüüsi aruandlusnõuded on sätestatud komisjoni rakendusmääruses (EL) 2016/2070, ([2]) mida on mitu korda muudetud. Selleks et kajastada muutusi pädevate asutuste hinnangute ja EBA aruannete rõhuasetuses ning võttes arvesse seadusandlikke muudatusi tururiski valdkonnas, tuleb taas ajakohastada võrdlusportfelle ja kõnealuses rakendusmääruses sätestatud aruandlusnõudeid.

(2) Krediidiriski võrdlusanalüüsi puhul tuleks muuta juhiseid, et täpsustada makseviivituse tõenäosuse ja makseviivitusest tingitud kahjumäära riskiparameetritest teatamise kohustuslikkust seoses konservatiivsus-marginaali, regulatiivse lisandi ja majanduslanguse komponentidega, mis võib põhjustada mudelite varieeruvust. Lisaks tuleks täpsustada, et finantsinstitutsioonid peavad esitama pädeva asutuse määratud mudelite tunnuse, mis lihtsustab eraldamisandmete aruandluse kasutuselevõttu.

(3) Komisjoni delegeeritud määrusega (EL) 2024/2795 ([3]) lükati edasi uute tururiski omavahendite nõuete kohaldamise kuupäev. Seepärast ei asendata antud juhul praeguse sisemudeli meetodi vorme. Samal ajal tuleks standardmeetodi valideerimise vorme laiendada, et need hõlmaksid rohkem portfelle kui 2024. aastal, mil kohaldamisalasse kuulusid ainult intressimäärainstrumendid. Selle eesmärk on tagada asjakohane järelevalve ja minimaalse väljundmäära arvutamiseks kasutatava uue standardmeetodi sujuv rakendamine.

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

([2]) Komisjoni 14. septembri 2016. aasta rakendusmäärus (EL) 2016/2070, millega sätestatakse rakenduslikud tehnilised standardid seoses vormide, määratluste ja IT-lahendustega, mida krediidiasutused ning investeerimisühingud Euroopa Pangandusjärelevalvele ja pädevatele asutustele aru andes kasutavad kooskõlas Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2013/36/EL artikli 78 lõikega 2 (ELT L 328, 2.12.2016, lk 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2016/2070/oj).

([3]) Komisjoni 24. juuli 2024. aasta delegeeritud määrus (EL) 2024/2795, millega muudetakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 575/2013 seoses tururiski omavahendite nõuete kohaldamise alguskuupäevaga (ELT L, 2024/2795, 31.10.2024, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2024/2795/oj).

(4) Seepärast tuleks rakendusmäärust (EL) 2016/2070 vastavalt muuta.

(5) Käesolev määrus põhineb EBA poolt komisjonile esitatud rakenduslike tehniliste standardite eelnõul.

(6) EBA on korraldanud käesoleva määruse aluseks oleva rakenduslike tehniliste standardite eelnõu kohta avalikud konsultatsioonid, analüüsinud potentsiaalseid seonduvaid kulusid ja kasu ning küsinud nõu Euroopa Parlamendi ja nõukogu määruse (EL) nr 1093/2010 ([4]) artikli 37 kohaselt loodud pangandussektori sidusrühmade kogult,

ON VASTU VÕTNUD KÄESOLEVA MÄÄRUSE:

Artikkel 1

Rakendusmäärust (EL) 2016/2070 muudetakse järgmiselt:

1) IV lisa asendatakse käesoleva määruse I lisas esitatud tekstiga;

2) V lisa asendatakse käesoleva määruse II lisas esitatud tekstiga;

3) VI lisa asendatakse käesoleva määruse III lisas esitatud tekstiga;

4) VII lisa asendatakse käesoleva määruse IV lisas esitatud tekstiga;

5) X lisa asendatakse käesoleva määruse V lisas esitatud tekstiga.

Artikkel 2

Käesolev määrus jõustub kahekümnendal päeval pärast selle avaldamist *Euroopa Liidu Teatajas*.

Käesolev määrus on tervikuna siduv ja vahetult kohaldatav kõikides liikmesriikides.

Brüssel, 26. veebruar 2025

Komisjoni nimel
president
Ursula VON DER LEYEN

([4]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 24. novembri 2010. aasta määrus (EL) nr 1093/2010, millega asutatakse Euroopa Järelevalveasutus (Euroopa Pangandusjärelevalve), muudetakse otsust nr 716/2009/EÜ ning tunnistatakse kehtetuks komisjoni otsus 2009/78/EÜ (ELT L 331, 15.12.2010, lk 12, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2010/1093/oj).

I LISA

„IV LISA

JÄRELEVALVEGA SEOTUD VÕRDLUSPORTFELLIDE TULEMUSED

I OSA. ÜLDISED JUHISED

II OSA. VORMIDE TÄITMISE JUHISED

C 101 – andmed riskipositsioonide kohta madala makseviivituse riskiga portfellides vastaspoolte kaupa

C 102 – andmed riskipositsioonide kohta madala makseviivituse riskiga portfellides

C 103 – andmed riskipositsioonide kohta kõrge makseviivituse riskiga portfellides

C 105.01 – sisemudelite määratlemine

C 105.02 – sisemudelite määramine portfellidele

C 105.03 – sisemudelite määramine riikidele

I OSA. ÜLDISED JUHISED

1. Teave esitatakse ainult selliste vastaspoolte ja portfellide kohta, mille puhul on aruandekuupäeva seisuga olemas tegelik riskipositsioon kas esmase riskipositsiooni või krediidiriski maandamise järgse riskipositsiooni vormis. Vastaspooli ja portfelle, mille puhul aruandekuupäeva seisuga riskipositsiooni ei ole, ei kajastata.

2. Teave esitatakse ainult nende riskipositsioonide kohta, mille puhul on pädev asutus heaks kiitnud sisemudeli riskiga kaalutud vara (RWA) arvutamiseks. Vormis C 101 ei esitata vastaspoole koode, mille lõpus on „STDA“. I lisa vormi C 101 järelejäänud vastaspoole koodide puhul ning vormides C 102 ja C 103 osutatud võrdlusportfellide puhul jäetakse välja standardmeetodi kohased riskipositsioonid ja riskipositsioonid, mille puhul asjaomane pädev asutus on lubanud ajutiselt või alaliselt kasutada osaliselt standardmeetodit.

3. Andmeväljad, millel esitatav teave ei ole asjakohane või on ebamäärane, jäetakse tühjaks või märgitakse sinna „NULL“. Sama kehtib ka makseviivituses oleva riskipositsiooniga kaalutud koguste või parameetrite kohta, mida ei saa arvutada. Ka andmeväljad, mille esitamine ei ole kohustuslik, võib jätta tühjaks või märkida sinna „NULL“. Nullväärtused esitatakse juhul, kui soovitakse teatada, et kogus või parameeter on null. Nullkogustest või -parameetritest teatamiseks ei jäeta lahtrit tühjaks ega kasutata märget „NULL“.

4. Rahalisi summasid kajastatakse samal viisil, nagu neid kajastatakse omavahendite nõuete arvutamisel konkreetsel aruandekuupäeval vastavalt komisjoni rakendusmäärusele (EL) 2021/451 ([1]).

([1]) Komisjoni 17. detsembri 2020. aasta rakendusmäärus (EL) 2021/451, milles sätestatakse rakenduslikud tehnilised standardid Euroopa Parlamendi ja nõukogu määruse (EL) nr 575/2013 kohaldamiseks seoses krediidiasutuste ja investeerimisühingute järelevalvelise aruandlusega ning tunnistatakse kehtetuks rakendusmäärus (EL) nr 680/2014 (ELT L 97, 19.3.2021, lk 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2021/451/oj).

II OSA. VORMIDE TÄITMISE JUHISED

C 101 – andmed riskipositsioonide kohta madala makseviivituse riskiga portfellides vastaspoolte kaupa

Eriotstarbelised nõuded jäetakse välja.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0010	Vastaspoole kood	I lisa vormi C 101 veerg 0010	Esitatakse I lisa vormi C 101 veeru 0010 vastaspoole kood, millega määratletakse madala makseviivituse riskiga portfelli kuuluv vastaspool. See kood on rea tunnus ja see peab vormi iga rea puhul olema kordumatu.
0020	Riskipositsiooni klass	Rakendusmääruse (EL) 2021/451 II lisa punkt 76	Iga vastaspool määratakse ühte järgmistest riskipositsiooni klassidest: a) keskpangad ja keskvalitsused; b) finantsinstitutsioonid; c) äriühingud – VKEd (väikesed ja keskmise suurusega ettevõtjad); d) äriühingud – eriotstarbelised nõuded; e) äriühingud – muud; f) jaenõuded – tagatud VKEde kinnisvaraga; g) jaenõuded – tagatud kinnisvaraga, mis ei ole VKEde kinnisvara; h) jaenõuded – kvalifitseeruvad uuenevad jaenõuded; i) jaenõuded – muud nõuded VKEde vastu; j) jaenõuded – muud nõuded, mis ei ole VKEde vastu; k) ei kohaldata. Märget „ei kohaldata“ kasutatakse siis, kui ükski loetelus esitatud vastustest ei ole asjakohane, see tähendab juhul, kui riskipositsioon vastaspoole suhtes liigitatakse mitmesse riskipositsiooni klassi ilma, et üks oleks selgelt valdav.
0040	Reiting		Esitatakse finantsinstitutsiooni kohaldatava sisereitinguskaala raames vastaspoolele määratud sisereitingu klass. See peab vastama arvulisele järjestusele 1, 2, 3 jne, väiksemaist riskist suurimani, välja arvatud makseviivitused, mille makseviivituse tõenäosus on 100 %. Kui finantsinstitutsioon kasutab pidevat reitinguskaalat vastavalt Euroopa Parlamendi ja nõukogu määruse (EL) nr 575/2013 ([2]) artikli 169 lõikele 3, kasutatakse rakendusmääruse (EL) 2021/451 I lisa vormi C 08.02 veerus 0005 esitatud reitinguklasse. Kui vastaspoole suhtes olevad riskipositsioonid on määratud mitmesse reitinguklassi vastavalt määruse (EL) nr 575/2013 artikli 172 lõike 1 punkti e alapunktile i või iii, märgitakse reitinguklass null (0).

([2]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 26. juuni 2013. aasta määrus (EL) nr 575/2013, mis käsitleb krediidiasutuste suhtes kohaldatavaid usaldatavusnõudeid ja millega muudetakse määrust (EL) nr 648/2012 (ELT L 176, 27.6.2013, lk 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2013/575/oj).

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0050	Vastaspoole kõige viimase reitingu kuupäev		Esitatakse vastaspoole kõige viimase reitingu kuupäev.
0060	Makseviivituse tõenäosus	Rakendusmääruse (EL) 2021/451 I lisa vormi C 08.01 veerg 0010	Esitatakse vastaspoolele määratud makseviivituse tõenäosus. Makseviivituse tõenäosus on see makseviivituse tõenäosus, mida kasutatakse riskiga kaalutud vara arvutamisel, arvestamata määruse (EL) nr 575/2013 artikli 458 kohaselt võetud meetmete mõju. Makseviivituse tõenäosus esitatakse väärtusena vahemikus 0–1.
0070	Makseviivituse seisund		Esitatakse vastaspoole makseviivituse seisund. See on vastavalt määruse (EL) nr 575/2013 artiklile 178 üks järgmistest: a) makseviivituses; b) makseviivituses mitteolev.
0080	Esmane riskipositsioon enne ümberhindlustegurite kohaldamist	Rakendusmääruse (EL) 2021/451 I lisa vormi C 08.01 veerg 0020	Esitatakse esmase riskipositsiooni väärtus enne väärtuse mis tahes korrigeerimiste, eraldiste, krediidiriski maandamise tehnikatest tuleneva mõju või ümberhindlustegurite arvesse võtmist.
0090	Riskipositsioon pärast krediidiriski maandamise tehnikate asendusmõju arvessevõtmist ja enne ümberhindlustegurite kohaldamist	Rakendusmääruse (EL) 2021/451 I lisa vormi C 08.01 veerg 0090	Esitatakse summa, mille suhtes kohaldatakse ümberhindlustegureid, et saada makseviivituses olev riskipositsioon (veerg 0110). Seda tehakse, võttes arvesse krediidiriski maandamise tehnikaid, millel on asendusmõju riskipositsioonile.
0100	Ümberhindlustegur	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 166 lõige 8	Esitatakse kaalutud keskmine ümberhindlustegur. Kasutatavad kaalud on summad, mille suhtes kohaldatakse ümberhindlustegureid, et saada makseviivituses olev riskipositsioon. Vastaspoolte puhul, kelle vahendid vastavad üksnes määruse (EL) nr 575/2013 artikli 166 lõikes 8 osutatud kirjetele, põhineb kajastatav ümberhindlustegurite kaalutud keskmine kõigil vahenditel. Vastaspoolte puhul, kelle vahendid ei kuulu määruse (EL) nr 575/2013 artikli 166 lõikes 8 osutatud kirjete alla, jäetakse ümberhindlusteguri lahter tühjaks või märgitakse „NULL“.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
			Vastaspoolte puhul, kellel on vahendid, mis vastavad määruse (EL) nr 575/2013 artikli 166 lõikes 8 osutatud kirjetele, ja vahendid, mis ei kuulu kõnealuse määruse artikli 166 lõikes 8 osutatud kirjete alla, põhineb kajastatav ümberhindlustegurite kaalutud keskmine üksnes nendel vahenditel, mis vastavad määruse (EL) nr 575/2013 artikli 166 lõikes 8 osutatud kirjetele. Eelkõige ei võeta arvutamisel arvesse vahendeid, mis vastavad kõnealuse määruse artikli 166 lõikes 10 osutatud kirjetele. Kui finantsinstitutsioon kohaldab määruse (EL) nr 575/2013 artikli 166 lõikes 8 osutatud kirjete puhul ümberhindlustegurite sisehinnanguid, kasutatakse neid ümberhindlustegureid ümberhindlustegurite kaalutud keskmise arvutamiseks. Kui finantsinstitutsioon ei kohalda määruse (EL) nr 575/2013 artikli 166 lõikes 8 osutatud kirjete puhul ümberhindlustegurite sisehinnanguid, kasutatakse määruse (EL) nr 575/2013 artikli 166 lõikes 8 osutatud regulatiivseid ümberhindlustegureid. Ümberhindlustegur esitatakse väärtusena vahemikus 0–1.
0110	Makseviivituses olev riskipositsioon	Rakendusmääruse (EL) 2021/451 I lisa vormi C 08.01 veerg 0110	Esitatakse riskipositsiooni väärtus.
0120	Tagatise väärtus	Rakendusmääruse (EL) 2021/451 I lisa vormi C 08.01 veerud 0150–0210	Esitatakse tagatise turuväärtus.
0130	Hüpoteetiline makseviivitusest tingitud kahjumäär, kõrgema nõudeõiguse järguga, tagamata, tagatise andmise piiramise klauslita (*negative pledge*)	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 161	Esitatakse makseviivitusest tingitud kahjumäära hüpoteetilised sisehinnangud, mida finantsinstitutsioon kohaldaks vastaspoole suhtes olevate riskipositsioonide suhtes vastavalt järgmisele: a) riskipositsioonide ulatus on sama, nagu makseviivitusest tingitud kahjumäära puhul, mis on esitatud veerus 0150; b) riskipositsioonid on kõrgema nõudeõiguse järguga ja tagamata; c) puudub tagatise andmise piiramise klausel. Tagatise andmise piiramise klausli kohaselt ei pandi laenusaaja või võlakohustuste emitent ühtegi oma vara teisele isikule.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0140	Hüpoteetiline makseviivitusest tingitud kahjumäär, kõrgema nõudeõiguse järguga, tagamata, tagatise andmise piiramise klausliga	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 161	Esitatakse makseviivitusest tingitud kahjumäära hüpoteetilised sisehinnangud, mida finantsinstitutsioon kohaldaks vastaspoole suhtes olevate riskipositsioonide suhtes vastavalt järgmisele: a) riskipositsioonide ulatus on sama, nagu makseviivitusest tingitud kahjumäära puhul, mis on esitatud veerus 0150; b) riskipositsioonid on kõrgema nõudeõiguse järguga ja tagamata; c) kehtib tagatise andmise piiramise klausel. Tagatise andmise piiramise klausli kohaselt ei pandi laenusaaja või võlakohustuste emitent ühtegi oma vara teisele isikule.
0150	Makseviivitusest tingitud kahjumäär	Rakendusmääruse (EL) 2021/451 I lisa vormi C 08.01 veerud 0230 ja 0240	Esitatakse vastaspoole suhtes olevate riskipositsioonide makseviivituses oleva riskipositsiooniga kaalutud makseviivitusest tingitud kahjumäär. Makseviivitusest tingitud kahjumäärad on need, mida kasutatakse riskiga kaalutud vara arvutamiseks. Kui finantsinstitutsioon on saanud pädevalt asutuselt loa kasutada makseviivitusest tingitud kahjumäärade sisehinnanguid, põhinevad makseviivitusest tingitud kahjumäärad finantsinstitutsiooni sisehinnangutel, vastasel juhul põhinevad makseviivitusest tingitud kahjumäärad regulatiivsetel makseviivitusest tingitud kahjumääradel, võttes arvesse kohaldatavat riskimaandust. Arvesse võetakse makseviivitusest tingitud kahjumäärasid suurte reguleeritud finantssektori ettevõtjate ja reguleerimata finantssektori ettevõtjate puhul. Arvesse ei võeta määruse (EL) nr 575/2013 artikli 458 kohaselt võetud meetmete mõju. Makseviivitusest tingitud kahjumäär esitatakse väärtusena vahemikus 0–1.
0160	Lõpptähtaeg	Rakendusmääruse (EL) 2021/451 I lisa vormi C 08.01 veerg 0250	Esitatakse makseviivituses oleva riskipositsiooniga kaalutud lõpptähtaeg vastaspoole suhtes olevate riskipositsioonide puhul. See esitatakse päevade arvuna.
0170	RWA	Rakendusmääruse (EL) 2021/451 I lisa vormi C 08.01 veerg 0260	Esitatakse riskiga kaalutud vara pärast toetuskoefitsiente (VKEde ja taristu toetuskoefitsiendid). Riskiga kaalutud vara ei hõlma määruse (EL) nr 575/2013 artikli 458 kohaste võimalike meetmete mõju.

C 102 – andmed riskipositsioonide kohta madala makseviivituse riskiga portfellides

Selliste I lisas osutatud portfellide puhul, mille tagatuse seisund on muu kui „ei kohaldata“, on juhul, kui heakskiidetud mudel ei võimalda makseviivitusest tingitud kahjumäära arvutamist riskipositsioonide tagatud ja tagamata osade kohta eraldi, lubatud välja jätta järgmine teave: makseviivitusest tingitud kahjumäär (veerg 0130), makseviivitusest tingitud kahjumäär ilma järelevalvemeetmeteta (veerg 0131), makseviivitusest tingitud kahjumäär ilma konservatiivsusmarginaali ja järelevalvemeetmeteta (veerg 0132), makseviivitusest tingitud kahjumäär ilma konservatiivsusmarginaali, järelevalvemeetmete ja majanduslanguse komponendita (veerg 0133), oodatava kahju summa (veerg 0150) ja riskiga kaalutud vara (veerg 0170).

Portfellide puhul, mille regulatiivne lähenemisviis on määratletud kui „Eriotstarbelistele nõuetele riskikaalu määramise kriteeriumid“, jäetakse välja järgmine teave: makseviivituse tõenäosus (veerg 0060), makseviivituse tõenäosus ilma järelevalvemeetmeteta (veerg 0061), makseviivituse tõenäosus ilma konservatiivsusmarginaali ja järelevalvemeetmeteta (veerg 0062), makseviivitusest tingitud kahjumäär (veerg 0130), makseviivitusest tingitud kahjumäär ilma järelevalvemeetmeteta (veerg 0131), makseviivitusest tingitud kahjumäär ilma konservatiivsusmarginaali ja järelevalvemeetmeteta (veerg 0132), makseviivitusest tingitud kahjumäär ilma konservatiivsusmarginaali, järelevalvemeetmete ja majanduslanguse komponendita (veerg 0133).

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0010	Portfelli tunnus	I lisa vormi C 102 veerg 0010	Esitatakse I lisa vormi C.102 veerus 0010 märgitud portfelli tunnus, millega määratletakse portfell. See tunnus on rea tunnus ja see peab vormi iga rea puhul olema kordumatu. Riskipositsioonide määramine portfellide tunnustele ei ole välistav: riskipositsioonid või riskipositsioonide osad kajastatakse iga kohaldatava portfelli tunnuse all.
0040	Võlgnike arv		Esitatakse võlgnike arv. See põhineb võlgnikel, kelle puhul on kas veerus 0080 või veerus 0090 kajastatud rangelt positiivne väärtus. Kui krediidiriski maandamise tehnika tõttu kohaldatakse täielikku asendamist, lisatakse algne võlgnik algse portfelli andeväljale „võlgnike arv“ ja garantii andja lisatakse garantii andja portfelli andmeväljale „võlgnike arv“.
0060	Makseviivituse tõenäosus	Rakendusmääruse (EL) 2021/451 I lisa vormi C 08.01 veerg 0010	Makseviivituse tõenäosus on see makseviivituse tõenäosus, mida kasutatakse riskiga kaalutud vara arvutamisel, arvestamata võimalike määruse (EL) nr 575/2013 artikli 458 kohaselt võetud meetmete mõju. Üksikule reitinguklassile või kogumile vastavate portfellide puhul esitatakse konkreetsele võlgniku reitinguklassile või kogumile määratud makseviivituse tõenäosus. Eri reitinguklasside või kogumite võlgnike agregeerimisele vastavate portfellide puhul esitatakse agregeeritud riskipositsioonide määratud makseviivituse tõenäosuste keskmine, mis on kaalutud makseviivituses oleva riskipositsiooniga. Makseviivituse tõenäosus esitatakse väärtusena vahemikus 0–1.
0061	Makseviivituse tõenäosus ilma järelevalvemeetmeteta		Makseviivituse tõenäosus ilma järelevalvemeetmeteta on makseviivituse tõenäosus, mis põhineb määruse (EL) nr 575/2013 artiklite 179 ja 180 sätetel ja mis hõlmab finantsinstitutsiooni lisatud konservatiivsusmarginaali, kuid ei hõlma pädevate asutuste kehtestatud meetmeid (kordajad, lisandid, alammäärad või sarnased meetmed, mis otseselt suurendavad makseviivituse tõenäosust). Konkreetsele reitinguklassile või kogumile vastavate portfellide puhul esitatakse selle reitinguklassi makseviivituse tõenäosus, mis hõlmab konservatiivsusmarginaali, kuid millest on maha arvatud järelevalvemeetmed. Eri reitinguklasside või kogumite võlgnike agregeerimisele vastavate portfellide puhul esitatakse vastavate riskipositsioonide makseviivituses oleva riskipositsiooniga kaalutud makseviivituse tõenäosuste keskmine, mis hõlmab konservatiivsusmarginaali, kuid millest on maha arvatud järelevalvemeetmed. Makseviivituse tõenäosus ilma järelevalvemeetmeteta esitatakse väärtusena vahemikus 0–1. Kui finantsinstitutsioonid ei suuda eraldada kahjumäärade asjakohaseid konservatiivseid korrigeerimisi, kohaldatakse I osa punkti 3.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0062	Makseviivituse tõenäosus ilma konservatiivsusmarginaali ja järelevalvemeetmeteta		Makseviivituse tõenäosus ilma konservatiivsusmarginaali ja järelevalvemeetmeteta on makseviivituse tõenäosus, mis ei hõlma konservatiivsusmarginaali, mille finantsinstitutsioon on lisanud vastavalt määruse (EL) nr 575/2013 artikli 179 lõike 1 punktile f ja artikli 180 lõike 1 punktile e, ega pädevate asutuste kehtestatud meetmete (kordajad, lisandid, alammäärad või sarnased meetmed, mis otseselt suurendavad makseviivituse tõenäosust) mõju. Konkreetsele reitinguklassile või kogumile vastavate portfellide puhul esitatakse selle reitinguklassi makseviivituse tõenäosus, millest on maha arvatud konservatiivsusmarginaal ja järelevalvemeetmed. Eri reitinguklasside või kogumi võlgnike agregeerimisele vastavate portfellide puhul esitatakse vastavate riskipositsioonide makseviivituses oleva riskipositsiooniga kaalutud makseviivituse tõenäosuste keskmine, millest on maha arvatud konservatiivsusmarginaalid ja järelevalvemeetmed. Makseviivituse tõenäosus ilma konservatiivsusmarginaali ja järelevalvemeetmeteta esitatakse väärtusena vahemikus 0–1. Kui finantsinstitutsioonid ei suuda eraldada kahjumäärade asjakohaseid konservatiivseid korrigeerimisi, kohaldatakse I osa punkti 3.
0080	Esmane riskipositsioon enne ümberhindlustegurite kohaldamist	Rakendusmääruse (EL) 2021/451 I lisa vormi C 08.01 veerg 0020	Esitatakse esmase riskipositsiooni väärtus enne väärtuse mis tahes korrigeerimiste, eraldiste, krediidiriski maandamise tehnikatest tuleneva mõju või ümberhindlustegurite arvesse võtmist.
0090	Riskipositsioon pärast krediidiriski maandamise tehnikate asendusmõju arvessevõtmist ja enne ümberhindlustegurite kohaldamist	Rakendusmääruse (EL) 2021/451 I lisa vormi C 08.01 veerg 0090	Esitatakse summa, mille suhtes kohaldatakse ümberhindlustegureid, et saada makseviivituses olev riskipositsioon (veerg 0110). Seda tehakse, võttes arvesse krediidiriski maandamise tehnikaid, millel on asendusmõju riskipositsioonile.
0100	Ümberhindlustegur	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 166 lõige 8	Esitatakse kaalutud keskmine ümberhindlustegur. Kasutatavad kaalud on summad, mille suhtes kohaldatakse ümberhindlustegureid, et saada makseviivituses olev riskipositsioon. Portfellide puhul, mis sisaldavad vahendeid, mis vastavad üksnes määruse (EL) nr 575/2013 artikli 166 lõikes 8 osutatud kirjetele, põhineb kajastatav ümberhindlustegurite kaalutud keskmine kõigil vahenditel. Portfellide puhul, milles sisalduvatest vahenditest ükski ei kuulu määruse (EL) nr 575/2013 artiklis 166 osutatud kirjete alla, jäetakse ümberhindlusteguri lahter tühjaks või märgitakse „NULL“. Portfellide puhul, mis sisaldavad vahendeid, mis vastavad määruse (EL) nr 575/2013 artikli 166 lõikes 8 osutatud kirjetele, ja vahendeid, mis ei kuulu kõnealuse määruse artikli 166 lõikes 8 osutatud kirjete alla, põhineb kajastatav ümberhindlustegurite kaalutud keskmine üksnes nendel vahenditel, mis vastavad määruse (EL) nr 575/2013 artikli 166 lõikes 8 osutatud kirjetele.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
			Eelkõige ei võeta arvutamisel arvesse vahendeid, mis vastavad kõnealuse määruse artikli 166 lõikes 10 osutatud kirjetele. Kui finantsinstitutsioon kohaldab määruse (EL) nr 575/2013 artikli 166 lõikes 8 osutatud kirjete puhul ümberhindlustegurite sisehinnanguid, kasutatakse neid ümberhindlustegureid ümberhindlustegurite kaalutud keskmise arvutamiseks. Kui finantsinstitutsioon ei kohalda määruse (EL) nr 575/2013 artikli 166 lõikes 8 osutatud kirjete puhul ümberhindlustegurite sisehinnanguid, kasutatakse määruse (EL) nr 575/2013 artikli 166 lõikes 8 osutatud regulatiivseid ümberhindlustegureid. Ümberhindlustegur esitatakse väärtusena vahemikus 0–1.
0110	Makseviivituses olev riskipositsioon	Rakendusmääruse (EL) 2021/451 I lisa vormi C 08.01 veerg 0110	Esitatakse riskipositsiooni väärtus.
0120	Tagatise väärtus	Rakendusmääruse (EL) 2021/451 I lisa vormi C 08.01 veerud 0150–0210	Esitatakse tagatise turuväärtus.
0130	Makseviivitusest tingitud kahjumäär	Rakendusmääruse (EL) 2021/451 I lisa vormi C 08.01 veerud 0230 ja 0240	Esitatakse vastavas portfellis olevate riskipositsioonide makseviivituses oleva riskipositsiooniga kaalutud makseviivitusest tingitud kahjumäär. Makseviivitusest tingitud kahjumäärad on need, mida kasutatakse riskiga kaalutud vara arvutamiseks. Kui finantsinstitutsioon on saanud pädevalt asutuselt loa kasutada makseviivitusest tingitud kahjumäärade sisehinnanguid, põhinevad makseviivitusest tingitud kahjumäärad finantsinstitutsiooni sisehinnangutel, vastasel juhul põhinevad makseviivitusest tingitud kahjumäärad regulatiivsetel makseviivitusest tingitud kahjumääradel, võttes arvesse kohaldatavat riskimaandust. Arvesse võetakse riskipositsioone ja vastavaid makseviivitusest tingitud kahjumäärasid suurte reguleeritud finantssektori ettevõtjate ja reguleerimata finantssektori ettevõtjate puhul. Arvesse ei võeta määruse (EL) nr 575/2013 artikli 458 kohaselt võetud meetmete mõju. Makseviivitusest tingitud kahjumäär esitatakse väärtusena vahemikus 0–1.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0131	Makseviivitusest tingitud kahjumäär ilma järelevalvemeetmeteta		Makseviivitusest tingitud kahjumäär ilma järelevalvemeetmeteta on makseviivitusest tingitud kahjumäär, mis põhineb määruse (EL) nr 575/2013 artiklite 179 ja 181 sätetel ja mis hõlmab finantsinstitutsiooni lisatud konservatiivsusmarginaali, kuid ei hõlma pädevate asutuste kehtestatud meetmeid (kordajad, lisandid, alammäärad või sarnased meetmed, mis otseselt suurendavad makseviivitusest tingitud kahjumäära). Konkreetsele reitinguklassile või kogumile vastavate portfellide puhul esitatakse selle reitinguklassi makseviivitusest tingitud kahjumäär, mis hõlmab konservatiivsusmarginaali, kuid millest on maha arvatud järelevalvemeetmed. Eri reitinguklasside või kogumite võlgnike agregeerimisele vastavate portfellide puhul esitatakse vastavate riskipositsioonide makseviivituses oleva riskipositsiooniga kaalutud makseviivitusest tingitud kahjumäärade keskmine, mis hõlmab konservatiivsusmarginaali, kuid millest on maha arvatud järelevalvemeetmed. Makseviivitusest tingitud kahjumäär ilma järelevalvemeetmeteta esitatakse väärtusena vahemikus 0–1. Kui finantsinstitutsioonid ei suuda eraldada kahjumäärade asjakohaseid konservatiivseid korrigeerimisi, kohaldatakse I osa punkti 3.
0132	Makseviivitusest tingitud kahjumäär ilma konservatiivsusmarginaali ja järelevalvemeetmeteta		Makseviivitusest tingitud kahjumäär ilma konservatiivsusmarginaali ja järelevalvemeetmeteta on makseviivitusest tingitud kahjumäär, mis ei hõlma konservatiivsusmarginaali, mille finantsinstitutsioon on lisanud kooskõlas määruse (EL) nr 575/2013 artikli 179 lõike 1 punktiga f ja artikliga 181, ega pädevate asutuste kehtestatud meetmete (kordajad, lisandid, alammäärad või sarnased meetmed, mis otseselt suurendavad makseviivitusest tingitud kahjumäära) mõju. Konkreetsele reitinguklassile või kogumile vastavate portfellide puhul esitatakse selle reitinguklassi makseviivitusest tingitud kahjumäär, millest on maha arvatud konservatiivsusmarginaal ja järelevalvemeetmed. Eri reitinguklasside või kogumi võlgnike agregeerimisele vastavate portfellide puhul esitatakse vastavate riskipositsioonide makseviivituses oleva riskipositsiooniga kaalutud makseviivitusest tingitud kahjumäärade keskmine, millest on maha arvatud konservatiivsusmarginaalid ja järelevalvemeetmed. Makseviivitusest tingitud kahjumäär ilma konservatiivsusmarginaali ja järelevalvemeetmeteta esitatakse väärtusena vahemikus 0–1. Kui finantsinstitutsioonid ei suuda eraldada kahjumäärade asjakohaseid konservatiivseid korrigeerimisi, kohaldatakse I osa punkti 3.
0133	Makseviivitusest tingitud kahjumäär ilma konservatiivsusmarginaali, järelevalvemeetmete ja majanduslanguse komponendita		Makseviivitusest tingitud kahjumäär ilma konservatiivsusmarginaali, järelevalvemeetmete ja majanduslanguse komponendita on makseviivitusest tingitud kahjumäär, mis ei hõlma konservatiivsusmarginaali, mille finantsinstitutsioon on lisanud kooskõlas määruse (EL) nr 575/2013 artikli 179 lõike 1 punktiga f ja artikliga 181, ega pädevate asutuste kehtestatud meetmete (kordajad, lisandid, alammäärad või sarnased meetmed, mis otseselt suurendavad makseviivitusest tingitud kahjumäära) mõju ega kõnealuse määruse artikli 181 lõike 1 punktis b nõutud majanduslanguse komponenti. Konkreetsele reitinguklassile või kogumile vastavate portfellide puhul esitatakse selle reitinguklassi makseviivitusest tingitud kahjumäär, millest on maha arvatud konservatiivsusmarginaal, järelevalvemeetmed ja majanduslanguse komponent. Eri reitinguklasside või kogumi võlgnike agregeerimisele vastavate portfellide puhul esitatakse vastavate riskipositsioonide makseviivituses oleva riskipositsiooniga kaalutud makseviivitusest tingitud kahjumäärade keskmine, millest on maha arvatud konservatiivsusmarginaalid, järelevalvemeetmed ja majanduslanguse komponent.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
			Makseviivitusest tingitud kahjumäär ilma konservatiivsusmarginaali, järelevalvemeetmete ja majanduslanguse komponendita esitatakse väärtusena vahemikus 0–1. Kui finantsinstitutsioonid ei suuda eraldada kahjumäärade asjakohaseid konservatiivseid korrigeerimisi, kohaldatakse I osa punkti 3.
0140	Lõpptähtaeg	Rakendusmääruse (EL) 2021/451 I lisa vormi C 08.01 veerg 0250	Esitatakse makseviivituses oleva riskipositsiooniga kaalutud lõpptähtaeg. See esitatakse päevade arvuna. Seda teavet ei esitata nende riskipositsioonide kohta, mille puhul ei võeta riskiga kaalutud vara arvutamisel arvesse lõpptähtaega. Eelkõige ei esitata lõpptähtaega selliste portfellide puhul, mille riskipositsioonid kuuluvad riskipositsiooni klassi „Jaenõuded“.
0150	Oodatava kahju summa	Rakendusmääruse (EL) 2021/451 I lisa vormi C 08.01 veerg 0280	Esitatakse oodatava kahju summa.
0160	Makseviivituses olevate riskipositsioonidega seotud eraldised	Rakendusmääruse (EL) 2021/451 I lisa vormi C 09.02 veerud 0050, 0055 ja 0060	Esitatakse makseviivituses olevate riskipositsioonidega seotud eraldised. Need hõlmavad kõiki makseviivituses olevate riskipositsioonide üldisi ja spetsiifilisi krediidiriskiga korrigeerimisi, nagu on osutatud määruse (EL) nr 575/2013 artiklis 110. (Ühekordsed) krediidiriskiga korrigeerimised, mida finantsinstitutsioon kohaldab seoses makseviivituse määratluse rakendamise muudatustega, esitatakse nii, nagu need on kajastatud finantsinstitutsiooni andmebaasis.
0170	RWA	Rakendusmääruse (EL) 2021/451 I lisa vormi C 08.01 veerg 0260	Esitatakse riskiga kaalutud vara pärast toetuskoefitsiente (VKEde ja taristu toetuskoefitsiendid). Riskiga kaalutud vara ei hõlma määruse (EL) nr 575/2013 artikli 458 kohaste võimalike meetmete mõju.
0180	Standarditud RWA	Määruse (EL) nr 575/2013 III osa II jaotise 2. peatükk	Standarditud RWA on hüpoteetiline riskiga kaalutud vara, mis on saadud riskipositsioonide suhtes sisereitingute meetodi asemel krediidiriski standardmeetodit kohaldades.

C 103 – andmed riskipositsioonide kohta kõrge makseviivituse riskiga portfellides

Selliste I lisas osutatud portfellide puhul, mille tagatuse seisund on muu kui „ei kohaldata“, on juhul, kui heakskiidetud mudel ei võimalda makseviivitusest tingitud kahjumäära arvutamist riskipositsioonide tagatud ja tagamata osade kohta eraldi, lubatud välja jätta järgmine teave: makseviivitusest tingitud kahjumäär (veerg 0130), makseviivitusest tingitud kahjumäär ilma järelevalvemeetmeteta (veerg 0131), makseviivitusest tingitud kahjumäär ilma konservatiivsusmarginaali ja järelevalvemeetmeteta (veerg 0132), makseviivitusest tingitud kahjumäär ilma konservatiivsusmarginaali, järelevalvemeetmete ja majanduslanguse komponendita (veerg 0133), oodatava kahju summa (veerg 0150), riskiga kaalutud vara (veerg 0170), kahjumäär viimasel aastal (veerg 0210) ja kahjumäär viimasel viiel aastal (veerg 0220).

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0010	Portfelli tunnus		Esitatakse I lisa vormi C 103 veerus 0010 märgitud portfelli tunnus, millega määratletakse portfell. See tunnus on rea tunnus ja see peab vormi iga rea puhul olema kordumatu. Riskipositsioonide määramine portfellide tunnustele ei ole välistav: riskipositsioonid või riskipositsioonide osad kajastatakse iga kohaldatava portfelli tunnuse all.
0040	Võlgnike arv		Järgitakse I lisa vormi C 102 veeru 0040 jaoks esitatud juhiseid.
0060	Makseviivituse tõenäosus		Järgitakse I lisa vormi C 102 veeru 0060 jaoks esitatud juhiseid.
0061	Makseviivituse tõenäosus ilma järelevalvemeetmeteta		Järgitakse I lisa vormi C 102 veeru 0061 jaoks esitatud juhiseid.
0062	Makseviivituse tõenäosus ilma konservatiivsusmarginaali ja järelevalvemeetmeteta		Järgitakse I lisa vormi C 102 veeru 0062 jaoks esitatud juhiseid.
0080	Esmane riskipositsioon enne ümberhindlustegurite kohaldamist		Järgitakse I lisa vormi C 102 veeru 0080 jaoks esitatud juhiseid.
0090	Riskipositsioon pärast krediidiriski maandamise tehnikate asendusmõju arvessevõtmist ja enne ümberhindlustegurite kohaldamist		Järgitakse I lisa vormi C 102 veeru 0090 jaoks esitatud juhiseid.
0100	Ümberhindlustegur		Järgitakse I lisa vormi C 102 veeru 0100 jaoks esitatud juhiseid.
0110	Makseviivituses olev riskipositsioon		Järgitakse I lisa vormi C 102 veeru 0110 jaoks esitatud juhiseid.
0120	Tagatise väärtus		Järgitakse I lisa vormi C 102 veeru 0120 jaoks esitatud juhiseid.
0130	Makseviivitusest tingitud kahjumäär		Järgitakse I lisa vormi C 102 veeru 0130 jaoks esitatud juhiseid.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0131	Makseviivitusest tingitud kahjumäär ilma järelevalvemeetmeteta		Järgitakse I lisa vormi C 102 veeru 0131 jaoks esitatud juhiseid.
0132	Makseviivitusest tingitud kahjumäär ilma konservatiivsusmarginaali ja järelevalvemeetmeteta		Järgitakse I lisa vormi C 102 veeru 0132 jaoks esitatud juhiseid.
0133	Makseviivitusest tingitud kahjumäär ilma konservatiivsusmarginaali, järelevalvemeetmete ja majanduslanguse komponendita		Järgitakse I lisa vormi C 102 veeru 0133 jaoks esitatud juhiseid.
0140	Lõpptähtaeg		Järgitakse I lisa vormi C 102 veeru 0140 jaoks esitatud juhiseid.
0150	Oodatava kahju summa		Järgitakse I lisa vormi C 102 veeru 0150 jaoks esitatud juhiseid.
0160	Makseviivituses olevate riskipositsioonidega seotud eraldised		Järgitakse I lisa vormi C 102 veeru 0160 jaoks esitatud juhiseid.
0170	RWA		Järgitakse I lisa vormi C 102 veeru 0170 jaoks esitatud juhiseid.
0180	Standarditud RWA		Järgitakse I lisa vormi C 102 veeru 0180 jaoks esitatud juhiseid.
0190	Makseviivituse määr viimasel aastal		Esitatakse makseviivituse määr viimasel aastal. Selleks määratletakse makseviivituse määr järgmiste väärtuste suhtena: a) selliste riskipositsioonide summa (esmane riskipositsioon (veerg 0080), mõõdetuna seisuga aruandekuupäev miinus üks aasta), mis ei olnud makseviivituses täpselt aasta enne aruandekuupäeva ja mis sattusid makseviivitusse ajavahemikul aruandekuupäev miinus üks aasta kuni aruandekuupäev, b) selliste riskipositsioonide summa (esmane riskipositsioon (veerg 0080), mõõdetuna seisuga aruandekuupäev miinus üks aasta), mis ei olnud makseviivituses seisuga aruandekuupäev miinus üks aasta. Aruandekuupäevale eelnenud aasta jooksul tekkinud riskipositsioone ei võeta arvesse. Riskipositsioonid, mis sattusid makseviivitusse, kuid mis korrigeeriti aruandekuupäevale eelnenud aasta jooksul, võetakse arvesse nii lugejas kui ka nimetajas. Sama võlgniku erinevad makseviivituse juhud esitatakse ainult üks kord.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
			See teave esitatakse üksnes makseviivituses mitteolevate riskipositsioonidega seotud portfelli tunnuste kohta ja seda väljendatakse väärtusena vahemikus 0–1. Makseviivitusi ja makseviivituste kuupäevi kasutatakse nii, nagu need on kajastatud makseviivitusjuhu ajal kohaldatava makseviivituse määratluse rakendamise raames, st finantsinstitutsioon loeb makseviivituse toimunuks makseviivituse määratluse alusel, mida finantsinstitutsioon juhu kajastamise ajal kohaldas. Makseviivituse määratluse muutusi arvestatakse üksnes edasiulatuvalt alates nende rakendamise kuupäevast, samas kui makseviivituse määratluse muutuste tagasiulatuvat kohaldamist pärast asjaomast makseviivitusjuhtu (tagasisimulatsioon) ei kasutata.
0200	Makseviivituse määr viimasel viiel aastal		Esitatakse aruandekuupäevale eelnenud viiel aastal täheldatud makseviivituse määrade kaalutud keskmine. Kohaldatakse veerus 0190 osutatud makseviivituse määra määratlust. Kaaludena tuleb kasutada neid makseviivituses mitteolevaid riskipositsioone, mida kasutatakse makseviivituse määra arvutamiseks vastavalt veerule 0190. Kui finantsinstitutsioon ei pea arvutama aruandekuupäevale eelnenud viie aasta makseviivituse määra vastavalt määruse (EL) nr 575/2013 artikli 180 lõike 1 punktile h või artikli 180 lõike 2 punktile c, töötab ta välja asendaja, kasutades oma pikimat ajalugu (kuni aruandekuupäevale eelnenud viis aastat), ja esitab oma pädevale asutusele arvutuse üksikasju sisaldavad dokumendid. See teave esitatakse üksnes makseviivituses mitteolevate riskipositsioonidega seotud portfelli tunnuste kohta ja seda väljendatakse väärtusena vahemikus 0–1. Makseviivitusi ja makseviivituste kuupäevi kasutatakse nii, nagu need on kajastatud makseviivitusjuhu ajal kohaldatava makseviivituse määratluse rakendamise raames, st finantsinstitutsioon loeb makseviivituse toimunuks makseviivituse määratluse alusel, mida finantsinstitutsioon juhu kajastamise ajal kohaldas. Makseviivituse määratluse muutusi arvestatakse üksnes edasiulatuvalt alates nende rakendamise kuupäevast, samas kui makseviivituse määratluse muutuste tagasiulatuvat kohaldamist pärast asjaomast makseviivitusjuhtu (tagasisimulatsioon) ei kasutata.
0210	Kahjumäär viimasel aastal		Viimasel aastal täheldatud kahjumäär esitatakse üksnes portfelli tunnuste puhul, mis on seotud „makseviivituses mitteolevate“ ja „makseviivituses olevate“ riskipositsioonidega. Makseviivituses mitteolevate portfellide puhul saadakse kahjumäär, liites krediidiriskiga korrigeerimised ja mahakandmised, mida on aruandekuupäevale eelnenud aasta jooksul rakendatud selliste riskipositsioonide suhtes, mis ei olnud makseviivituses täpselt aasta enne aruandekuupäeva, aga mis sattusid makseviivitusse aruandekuupäevale eelnenud aastal, ning saadud summa jagatakse summaga, mille saamiseks liidetakse täpselt aasta enne aruandekuupäeva mõõdetud sellised makseviivituses olevad riskipositsioonid, mis ei olnud makseviivituses täpselt aasta enne aruandekuupäeva, aga mis sattusid makseviivitusse aruandekuupäevale eelnenud aastal.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
			Kahjumäära lugejas võetakse arvesse kõiki krediidiriskiga korrigeerimisi ja mahakandmisi, mis on seotud aruandekuupäevale eelnenud aastal makseviivituses olnud riskipositsioonidega, sealhulgas enne makseviivituse kuupäeva kohaldatud krediidiriskiga korrigeerimisi. Aruandekuupäevale eelnenud aasta jooksul tekkinud riskipositsioone ei võeta arvesse. Riskipositsioonid, mis sattusid makseviivitusse, kuid mis korrigeeriti aruandekuupäevale eelnenud aasta jooksul, võetakse arvesse kahjumäära lugejas ning selliste riskipositsioonide krediidiriskiga korrigeerimised ja mahakandmised võetakse arvesse kahjumäära nimetajas. Ühe ja sama võlgniku erinevad makseviivituse juhud võetakse arvesse ainult üks kord. Makseviivituses olevate portfellide puhul võetakse kahjumäära puhul arvesse riskipositsioone, mis olid makseviivituses täpselt aasta enne aruandekuupäeva. See on järgmiste summa: a) nende riskipositsioonide korrigeerimised krediidiriskiga üks aasta enne aruandekuupäeva ning b) aruandekuupäevale eelneval aastal tehtud krediidiriskiga korrigeerimised ja mahakandmised, jagatuna makseviivituses oleva riskipositsiooni summaga, mis on mõõdetud täpselt üks aasta enne asjaomaste riskipositsioonide aruandekuupäeva. Aruandekuupäevale eelnenud aasta uusi makseviivituses riskipositsioone ei võeta arvesse. Riskipositsioonid, mille makseviivitus korrigeeriti aruandekuupäevale eelnenud aasta jooksul, võetakse arvesse kahjumäära lugejas ning selliste riskipositsioonide krediidiriskiga korrigeerimised ja mahakandmised võetakse arvesse kahjumäära nimetajas. Sama võlgniku erinevad makseviivituse juhud esitatakse ainult üks kord. Kahjumäär esitatakse väärtusena vahemikus 0–1. Makseviivitusi ja makseviivituste kuupäevi kasutatakse nii, nagu need on kajastatud makseviivitusjuhu ajal kohaldatava makseviivituse määratluse rakendamise raames, st finantsinstitutsioon loeb makseviivituse toimunuks makseviivituse määratluse alusel, mida finantsinstitutsioon juhu kajastamise ajal kohaldas. Makseviivituse määratluse muutusi arvestatakse üksnes edasiulatuvalt alates nende rakendamise kuupäevast, samas kui makseviivituse määratluse muutuste tagasiulatuvat kohaldamist pärast asjaomast makseviivitusjuhtu (tagasisimulatsioon) ei kasutata.
0220	Kahjumäär viimasel viiel aastal		Esitatakse aruandekuupäevale eelnenud viiel aastal täheldatud kahjumäärade makseviivituses oleva riskipositsiooniga kaalutud keskmine üksnes portfelli tunnuste puhul, mis on seotud „makseviivituses mitteolevate“ ja „makseviivituses olevate“ riskipositsioonidega. Kohaldatakse veerus 0210 esitatud kahjumäära määratlust. Viimase viie aasta kahjumäär põhineb viimase viie aasta kahjumääradel, kui need aastased kahjumäärad on määratletud analoogselt veerus 0210 esitatud kahjumäära määratlusega. Eelkõige ei hõlma aastased kahjumäärad krediidiriskiga korrigeerimiste ja mahakandmiste täiendavaid muutusi, mis on toimunud pärast iga aastase kahjumäära vaatlusperioodi (kalendriaasta). Kui finantsinstitutsioon ei pea kasutama aruandekuupäevale eelnenud viie aasta andmeid vastavalt määruse (EL) nr 575/2013 artikli 181 lõike 2 viimasele lõigule, töötab ta välja asendaja, kasutades oma pikimat ajalugu (kuni aruandekuupäevale eelnenud viis aastat), ja esitab oma pädevale asutusele arvutuse üksikasju sisaldavad dokumendid. Kahjumäär esitatakse väärtusena vahemikus 0–1. Makseviivitusi ja makseviivituste kuupäevi kasutatakse nii, nagu need on kajastatud makseviivitusjuhu ajal kohaldatava makseviivituse määratluse rakendamise raames, st finantsinstitutsioon loeb makseviivituse toimunuks makseviivituse määratluse alusel, mida finantsinstitutsioon juhu kajastamise ajal kohaldas. Makseviivituse määratluse muutusi arvestatakse üksnes edasiulatuvalt alates nende rakendamise kuupäevast, samas kui makseviivituse määratluse muutuste tagasiulatuvat kohaldamist pärast asjaomast makseviivitusjuhtu (tagasisimulatsioon) ei kasutata.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0250	RWA-		Finantsinstitutsioonid arvutavad ja esitavad RWA- I lisa tabelis C 103 osutatud portfellide puhul, millel on järgmised tunnused: 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 RWA- on hüpoteetiline riskiga kaalutud vara pärast toetuskoefitsiente, mis saadakse, kui iga riskipositsiooni suhtes kohaldatakse makseviivituse tõenäosuse PD- väärtusi, mitte aga finantsinstitutsiooni makseviivituse tõenäosuse PD väärtusi. Ülejäänud arvutamiseks vajalikke parameetreid ei muudeta. PD- aluseks on võlgniku iga reitinguklassi jaoks eraldi tehtav arvutus. Kasutatakse võlgniku reitinguklasse, nagu need on esitatud komisjoni rakendusmääruse (EL) 2021/451 I lisa vormi C 08.02 veerus 0005 (vt juhised kõnealuse määruse II lisa vormi C 08.01 veerg 0010 ja vorm C 08.02). Iga võlgniku reitinguklassi puhul on p^- kõige väiksem positiivne väärtus, mis vastab võrrandile, $$p^- + \Phi^{-1}(q) \bullet \sqrt{\frac{p^- \bullet (1-p^-)}{n}} \geq DR_{1y}$$ kus $DR_{1y} > 0$, ja $p^- = 0$, kus $DR_{1y} = 0$. Siin, Φ^{-1} = standardse normaaljaotuse (kumulatiivse jaotuse) pöördfunktsioon; q = usaldatavustase, mis on fikseeritud 90 %-le; DR_{1y} = aruandekuupäevale eelnenud aasta juhtumipõhine kaalutud makseviivituse määr, st nende võlgnike arv, kes ei olnud makseviivituses täpselt aasta enne aruandekuupäeva ja kellele määrati siis asjaomane võlgniku reitinguklass ning kes sattusid makseviivitusse viimase aasta jooksul, jagatuna nende võlgnike arvuga, kes ei olnud makseviivituses täpselt aasta enne aruandekuupäeva ja kellele määrati siis asjaomane võlgniku reitinguklass; n = nende võlgnike arv, kes ei olnud makseviivituses täpselt aasta enne aruandekuupäeva ja kellele määrati siis asjaomane võlgniku reitinguklass. Iga võlgniku puhul võrdub PD- p^-, kus p^- arvutatakse vastavalt neljandas lõigus esitatud valemile võlgnikule määratud võlgniku reitinguklassi jaoks.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0260	RWA+		Finantsinstitutsioonid arvutavad ja esitavad RWA+ I lisa tabelis C 103 osutatud portfellide puhul, millel on järgmised tunnused: 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 RWA+ on hüpoteetiline riskiga kaalutud vara pärast toetuskoefitsiente, mis saadakse, kui iga riskipositsiooni suhtes kohaldatakse makseviivituse tõenäosuse PD+ väärtusi, mitte aga finantsinstitutsiooni makseviivituse tõenäosuse PD väärtusi. Ülejäänud arvutamiseks vajalikke parameetreid ei muudeta. PD+ aluseks on võlgniku iga reitinguklassi jaoks eraldi tehtav arvutus. Kasutatakse võlgniku reitinguklasse, nagu need on esitatud komisjoni rakendusmääruse (EL) 2021/451 I lisa vormi C 08.02 veerus 0005 (vt juhised kõnealuse määruse II lisa vormi C 08.01 veerg 0010 ja vorm C 08.02). Iga võlgniku reitinguklassi puhul on p^+ kõige suurem positiivne väärtus, mis vastab võrrandile $$p^+ - \Phi^{-1}(q) \bullet \sqrt{\frac{p^+ \bullet (1-p^+)}{n}} \leq DR_{1y}$$ Selles võrrandis Φ^{-1} = standardse normaaljaotuse (kumulatiivse jaotuse) pöördfunktsioon; q = usaldatavustase, mis on fikseeritud 90 %-le; DR_{1y} = aruandekuupäevale eelnenud aasta juhtumipõhine kaalutud makseviivituse määr, st nende võlgnike arv, kes ei olnud makseviivituses täpselt aasta enne aruandekuupäeva ja kellele määrati siis asjaomane võlgniku reitinguklass ning kes sattusid makseviivitusse viimase aasta jooksul, jagatuna nende võlgnike arvuga, kes ei olnud makseviivituses täpselt aasta enne aruandekuupäeva ja kellele määrati siis asjaomane võlgniku reitinguklass; n = nende võlgnike arv, kes ei olnud makseviivituses täpselt aasta enne aruandekuupäeva ja kellele määrati siis asjaomane võlgniku reitinguklass. Iga võlgniku puhul võrdub PD+ p^+, kus p^+ arvutatakse vastavalt neljandas lõigus esitatud valemile võlgnikule määratud võlgniku reitinguklassi jaoks.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0270	RWA–		Finantsinstitutsioonid arvutavad ja esitavad RWA— I lisa tabelis C 103 osutatud portfellide puhul, millel on järgmised tunnused: 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 RWA– on hüpoteetiline riskiga kaalutud vara pärast toetuskoefitsiente, mis saadakse, kui iga riskipositsiooni suhtes kohaldatakse makseviivituse tõenäosuse PD-- väärtusi, mitte aga finantsinstitutsiooni makseviivituse tõenäosuse PD väärtusi. Ülejäänud arvutamiseks vajalikke parameetreid ei muudeta. PD-- aluseks on võlgniku iga reitinguklassi jaoks eraldi tehtav arvutus. Kasutatakse võlgniku reitinguklasse, nagu need on esitatud komisjoni rakendusmääruse (EL) 2021/451 I lisa vormi C 08.02 veerus 0005 (vt juhised kõnealuse määruse II lisa vormi C 08.01 veerg 0010 ja vorm C 08.02). Iga võlgniku reitinguklassi puhul on p^{--} kõige väiksem positiivne väärtus, mis vastab võrrandile, $$p^{--} + \Phi^{-1}(q) \cdot \sqrt{\frac{p^{--} \cdot (1 - p^{--})}{n}} \geq DR_{5y}$$ kus $DR_{5y} > 0$, ja $p^{--} := 0$, kus $DR_{5y} = 0$ Siin, Φ^{-1} = standardse normaaljaotuse (kumulatiivse jaotuse) pöördfunktsioon; q = usaldatavustase, mis on fikseeritud 90 %-le; DR_{5y} = makseviivituse määr viimasel viiel aastal võlgniku reitinguklassi puhul, mis arvutatakse viie üheaastase perioodi juhtumipõhiselt kaalutud makseviivituse määrade aritmeetilise keskmisena; n = nende võlgnike arv, kes ei olnud makseviivituses täpselt aasta enne aruandekuupäeva ja kellele määrati siis asjaomane võlgniku reitinguklass. Iga võlgniku puhul võrdub PD-- p^{--}, kus p^{--} arvutatakse vastavalt neljandas lõigus esitatud valemile võlgnikule määratud võlgniku reitinguklassi jaoks.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0280	RWA++		Finantsinstitutsioonid arvutavad ja esitavad RWA++ I lisa tabelis C 103 osutatud portfellide puhul, millel on järgmised tunnused: 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 RWA++ on hüpoteetiline riskiga kaalutud vara pärast toetuskoefitsiente, mis saadakse, kui iga riskipositsiooni suhtes kohaldatakse makseviivituse tõenäosuse PD++ väärtusi, mitte aga finantsinstitutsiooni makseviivituse tõenäosuse PD väärtusi. Ülejäänud arvutamiseks vajalikke parameetreid ei muudeta. PD++ aluseks on võlgniku iga reitinguklassi jaoks eraldi tehtav arvutus. Kasutatakse võlgniku reitinguklasse, nagu need on esitatud komisjoni rakendusmääruse (EL) 2021/451 I lisa vormi C 08.02 veerus 0005 (vt juhised kõnealuse määruse II lisa vormi C 08.01 veerg 0010 ja vorm C 08.02). Iga võlgniku reitinguklassi puhul on p^{++} kõige suurem positiivne väärtus, mis vastab võrrandile $$p^{++} - \Phi^{-1}(q) \bullet \sqrt{\frac{p^{++} \bullet (1 - p^{++})}{n}} \leq DR_{5y}$$ kus Φ^{-1} = standardse normaaljaotuse (kumulatiivse jaotuse) pöördfunktsioon; q = usaldatavustase, mis on fikseeritud 90 %-le; DR_{5y} = makseviivituse määr viimasel viiel aastal võlgniku reitinguklassi puhul, mis arvutatakse viie üheaastase perioodi juhtumipõhiselt kaalutud makseviivituse määrade aritmeetilise keskmisena; n = nende võlgnike arv, kes ei olnud makseviivituses täpselt aasta enne aruandekuupäeva ja kellele määrati siis asjaomane võlgniku reitinguklass. Iga võlgniku puhul võrdub PD++ p^{++}, kus p^{++} arvutatakse vastavalt neljandas lõigus esitatud valemile võlgnikule määratud võlgniku reitinguklassi jaoks.

C 105.01 – sisemudelite määratlemine

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0010	Sisemudeli tunnus		Finantsinstitutsioon esitab pädeva asutuse määratud sisemudeli tunnuse. Kui see ei ole kättesaadav, esitab finantsinstitutsioon enda määratud sisemudeli tunnuse. Sisemudeli tunnus on kordumatu ja tähistab sisemudelit, mille pädev asutus on heaks kiitnud ja mida kasutatakse riskiga kaalutud vara arvutamiseks. See on rea tunnus ja peab vormi iga rea puhul olema kordumatu.
0020	Mudeli nimetus		Esitatakse aruandva finantsinstitutsiooni poolt sisemudelile määratud mudeli nimetus.
0030	Sisereitingutel põhineva meetodi riskiparameeter		Sisereitingutel põhineva meetodi riskiparameeter on üks järgmistest: a) makseviivituse tõenäosus; b) makseviivitusest tingitud kahjumäär; c) ümberhindlustegur Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 153 lõike 5 kohase äriühingute vastu olevate eriotstarbeliste nõuete sisemudeli („Eriotstarbelistele nõuetele riskikaalu määramise kriteeriumid“) puhul jäetakse andmeväli tühjaks või märgitakse sinna „NULL“.
0040	Makseviivituses olev riskipositsioon	Rakendusmääruse (EL) 2021/451 I lisa vormi C 08.01 veerg 0110	Esitatakse reitingumudeli kohaldamisalasse kuuluvate riskipositsioonide riskipositsiooni koguväärtus.
0050	Makseviivituses oleva riskipositsiooni kaalutud keskmine makseviivituse määr		Esitatakse makseviivituses oleva riskipositsiooni kaalutud keskmine aastane makseviivituse määr, mida kasutatakse makseviivituse tõenäosuse mudelite kalibreerimisel. See teave esitatakse ainult makseviivituse tõenäosuse mudelite puhul. Kasutatakse mudeli parameetrite kalibreerimisel kasutatud andmeid. Kui siseandmed puuduvad ja kalibreerimine põhineb välisandmetel, esitatakse välisandmed.
0060	Juhtumipõhiselt kaalutud keskmine makseviivituse määr		Esitatakse makseviivituse tõenäosuse mudelite kalibreerimisel kasutatud aastase juhtumipõhiselt kaalutud makseviivituse määrade aritmeetiline keskmine. See teave esitatakse ainult makseviivituse tõenäosuse mudelite puhul. Kasutatakse mudeli parameetrite kalibreerimisel kasutatud andmeid. Kui siseandmed puuduvad ja kalibreerimine põhineb välisandmetel, esitatakse välisandmed.
0070	Pikaajaline makseviivituse tõenäosus		Aruandes esitatakse keskne tendents, mida finantsinstitutsioon kasutab selliste mudelite kalibreerimisel, mis hõlmavad konservatiivset korrigeerimist makseviivituse tõenäosuse mudelite kalibreerimisel kasutatud aastaste makseviivituse määrade juhtumipõhiselt kaalutud aritmeetiliste keskmiste puhul. See teave esitatakse ainult makseviivituse tõenäosuse mudelite puhul.
0080	Ebatõenäoliselt laekuvate varade taastamise määr		Ebatõenäoliselt laekuvate varade taastamise määr on protsent makseviivituses nõuetest, mille seisund muutub 12 kuu jooksul makseviivituses mitteolevaks. Finantsinstitutsioon, mis ei arvuta asjaomase mudeli puhul varade taastamise määrasid, arvutab vastavalt esitatud määratlusele taastamise määrade jaoks asendaja. Finantsinstitutsioon teavitab pädevat asutust asendaja kasutamisest. See teave esitatakse ainult makseviivitusest tingitud kahjumäära mudelite puhul.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0090	Sundtäitmisel olevate varade sissenõudmise määr korrigeerimata makseviivituste korral		Esitatakse juhtumipõhiselt kaalutud keskmine makseviivituse määr selliste korrigeerimata makseviivituste korral, mis kuuluvad aegridadesse, mida finantsinstitutsioon kasutab makseviivituses mitteolevate varade makseviivitusest tingitud kahjumäära mudelite kalibreerimisel. Kasutatakse mudeli parameetrite kalibreerimisel kasutatud andmeid. Kui siseandmed puuduvad ja kalibreerimine põhineb välisandmetel, esitatakse välisandmed. Finantsinstitutsioon, millel ei ole korrigeerimata makseviivituste korral varade kindlat sissenõudmise määra, kuna sissenõudmismenetlus on lõpetamata, arvutab asendaja, võttes arvesse täheldatud sissenõudmisi ja sissenõudmise hinnanguid pooleliolevate menetluste puhul. Finantsinstitutsioon teavitab pädevat asutust asendaja kasutamisest. See teave esitatakse ainult makseviivitusest tingitud kahjumäära mudelite puhul.
0100	Sissenõudmise kestus sundtäitmisel olevate varade puhul korrigeerimata makseviivituste korral		Esitatakse sissenõudmise (alates makseviivituse seisundi algusest kuni sissenõudmismenetluse lõpetamise kuupäevani) juhtumipõhiselt kaalutud keskmine kestus selliste korrigeerimata makseviivituste korral, mis kuuluvad aegridadesse, mida finantsinstitutsioon kasutab makseviivituses mitteolevate varade makseviivitusest tingitud kahjumäära mudelite kalibreerimisel. Juhtumipõhiselt kaalutud keskmist kestust väljendatakse päevade arvuna. Kasutatakse mudeli parameetrite kalibreerimisel kasutatud andmeid. Kui siseandmed puuduvad ja kalibreerimine põhineb välisandmetel, esitatakse välisandmed. Finantsinstitutsioon, millel ei ole korrigeerimata makseviivituste korral varade sissenõudmise aeg kindlaks määratud, kuna sissenõudmismenetlus on lõpetamata, arvutab asendaja, võttes arvesse esitatud määratlust. Finantsinstitutsioon teavitab pädevat asutust asendaja kasutamisest. See teave esitatakse ainult makseviivitusest tingitud kahjumäära mudelite puhul.
0110	Ühisotsus	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 20 lõike 2 punkt a	Finantsinstitutsioon teatab, kas konsolideeritud järelevalvet tegev ja vastuvõtva riigi pädev asutus on teinud ühisotsuse usaldatavusnõuete arvutamisel sisereitingute meetodi lubamise kohta riskipositsioonide puhul, mis on finantsinstitutsioonide tütarettevõtjatel aruandes esitatud võrdlusportfellides
0120	Konsolideeritud järelevalve eest vastutav asutus	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 20	Esitatakse sisereitingute meetodit kasutava finantsinstitutsiooni konsolideeritud järelevalve eest vastutava pädeva asutuse päritoluriigi ISO kood
0130	RWA	Rakendusmääruse (EL) 2021/451 I lisa vormi C 08.01 veerg 0260	Esitatakse reitingumudeli kohaldamisalasse kuuluvate riskipositsioonide riskiga kaalutud vara kogusumma pärast toetuskoefitsiente (VKEde ja taristu toetuskoefitsiendid).

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0140	RWA lisandid		Riskiga kaalutud vara lisandid on riskiga kaalutud vara alampositsioon („millest“) (vormi C 105.01 veerg 0130) ja need hõlmavad järgmist: a) riskiga kaalutud vara, mis lisatakse mudeli riskiparameetri(te) kohaldamisest tulenevale riskiga kaalutud varale seoses võimalike täiendavate sisemiste konservatiivsusmeetmetega, mida vahetult kohaldatakse riskiga kaalutud vara suhtes; b) riskiga kaalutud vara, mis lisatakse mudeli riskiparameetri(te) kohaldamisest tulenevale riskiga kaalutud varale seoses võimalike järelevalvemeetmetega, mida vahetult kohaldatakse riskiga kaalutud vara suhtes. Punktides a ja b osutatud summad ei hõlma meetmeid, mis on juba kajastatud makseviivituse tõenäosuses (vormide C 102 ja C 103 veerg 0060), ümberhindlusteguris (vormide C 102 ja C 103 veerg 0100) või makseviivitusest tingitud kahjumääras (vormide C 102 ja C 103 veerg 0130), vaid need piirduvad meetmetega, mida kohaldatakse vahetult riskiga kaalutud vara suhtes, ning asjakohasel juhul lisaks konservatiivsusmarginaalile ja järelevalvemeetmetele (kordajad, lisandid, alammäärad või sarnased meetmed), mis suurendavad riskiparameetreid. Riskiga kaalutud vara lisandid ei hõlma määruse (EL) nr 575/2013 artikli 458 kohaste võimalike meetmete mõju. Kui finantsinstitutsioonid ei suuda eraldada kahjumäärade asjakohaseid konservatiivseid korrigeerimisi, kohaldatakse I osa punkti 3.

C 105.02 – sisemudelite määramine portfellidele

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0010	Portfelli tunnus	Vormi C 102 veerg 0010 ja vormi C 103 veerg 0010	Esitatakse portfelli identifitseeriv kordumatu tunnus vastavalt I lisa vormidele C 102 ja C 103. Veerud 0010 ja 0020 moodustavad koos rea tunnuse ning see tunnus peab selle vormi iga rea puhul olema kordumatu.
0020	Sisemudeli tunnus	Vormi C 105.01 veerg 0010	Esitatakse aruandva finantsinstitutsiooni määratud sisemudeli tunnus. Veerud 0010 ja 0020 moodustavad koos rea tunnuse ning see tunnus peab vormi C 105.02 iga rea puhul olema kordumatu.
0030	Makseviivituses olev riskipositsioon	Rakendusmääruse (EL) 2021/451 I lisa vormi C 08.01 veerg 0110	Esitatakse veerus 0010 määratletud portfelli kuuluvate ja veerus 0020 määratletud reitingumudeli kohaldamisalasse kuuluvate riskipositsioonide riskipositsiooni koguväärtus. Kui kõigi teatavas portfellis sisalduvate riskipositsioonide puhul kasutatakse üht konkreetset mudelit, peab riskipositsiooni väärtus olema sama nagu summa, mis on selle portfelli kohta esitatud vormide C 102 või C 103 (nagu on asjakohane) veerus 0110.
0040	RWA	Rakendusmääruse (EL) 2021/451 I lisa vormi C 08.01 veerg 0260	Esitatakse veerus 0010 määratletud portfelli kuuluvate ja veerus 0020 määratletud reitingumudeli kohaldamisalasse kuuluvate riskipositsioonide riskiga kaalutud vara kogusumma pärast toetuskoefitsiente. Kui kõigi teatavas portfellis sisalduvate riskipositsioonide puhul kasutatakse üht konkreetset mudelit, peab riskiga kaalutud vara olema sama nagu summa, mis on selle portfelli kohta esitatud vormide C 102 või C 103 (nagu on asjakohane) veerus 0170.

C 105.03 – sisemudelite määramine riikidele

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0005	Rea tunnus		See kood on rea tunnus ja see peab vormi iga rea puhul olema kordumatu. See esitatakse numbrilises järjestuses (1, 2, 3 jne).
0010	Sisemudeli tunnus	Vormi C 105.01 veerg 0010	Esitatakse aruandva finantsinstitutsiooni määratud sisemudeli tunnus. Kui üks sisemudeli tunnus on seotud mitme riigiga, esitatakse eraldi read iga sisemudeli tunnuse ja finantsinstitutsiooni asukoha kombinatsiooni kohta. Veerud 0010 ja 0020 moodustavad koos rea tunnuse ning nende kombinatsioon peab tabeli iga rea puhul olema kordumatu.
0020	Finantsinstitut-siooni asukoht	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 20	Esitatakse iga sellise tütarettevõtja seadusjärgse asukoha ISO kood, mille kohta kajastatakse iga võrdlusportfelli puhul esitatavaid sisereitingute meetodi kohaseid riskipositsioone (sõltumata sellest, kas on olemas vastuvõtva riigi järelevalvet teostava asutuse luba kohaldada sisereitingute meetodit).“

II LISA

„V LISA

TURURISKI VÕRDLUSINSTRUMENDID JA -PORTFELLID

1. jagu: juhised
2. jagu: instrumendid
3. jagu: Individuaalsed portfellid – üks instrument
4. jagu: Individuaalsed portfellid – mitu instrumenti
5. jagu: koondportfellid
6. jagu: instrumentide täiendavad spetsifikatsioonid
7. jagu: SBMi valideerimisportfellid

1. jagu: juhised

a) Käesoleva lisa kohaldamisel kasutatakse järgmisi mõisteid:

i) „kajastamiskuupäev“ – kuupäev ja kellaaeg, mil finantsinstitutsioonid kajastavad tehinguid võrdlusanalüüsi eesmärgil;

ii) „esialgne turuväärtus (IMV)“ – käesoleva lisa 2. jaos osutatud instrumentide turuhinnas hinnatud väärtus IMV aruandekuupäeval ja -kellaajal;

iii) „IMV aruandekuupäev“ – kuupäev ja kellaaeg, mille alusel finantsinstitutsioonid määravad võrdlusportfelli tehingute IMV;

iv) „IMV esitamise kuupäev“ – kuupäev, mil finantsinstitutsioonid esitavad võrdlusportfellitehingute IMV tulemused;

v) „Var“ – VaR riskiväärtus;

vi) „sVaR“ – stressiolukorra VaR riskiväärtus;

vii) „IRC“ – täiendavate riskide omavahendite nõue;

viii) „CTP“ – korrelatsioonil põhinev kauplemisportfell;

ix) „APR“ – määruse (EL) nr 575/2013 artikli 377 lõike 2 kohaselt arvutatud kõik hinnariskid;

x) „riskinäitajad“ (RM) – VaR riskiväärtuse, stressiolukorra VaR riskiväärtuse ning vajaduse korral täiendavate riskide omavahendite nõude ja kõigi hinnariskide väärtus portfellide puhul, nagu on esitatud käesoleva lisa 3., 4. ja 5. jaos, RMi esialgse ja RMi lõpliku aruandekuupäeva vahel;

xi) „riskinäitajate esialgne aruandekuupäev“ – kuupäev, mil finantsinstitutsioonid hakkavad riskinäitajate väärtusi arvutama;

xii) „riskinäitajate lõplik aruandekuupäev“ – kuupäev, mil finantsinstitutsioonid lõpetavad riskinäitajate väärtuste arvutamise;

xiii) „riskinäitajate esitamise kuupäev“ – kuupäev, mil finantsinstitutsioonid esitavad võrdlusportfelli tehingute riskinäitajate tulemused;

xiv) „nüüdisväärtus“ – portfellide turuhinnas hinnatud väärtus, nagu on esitatud käesoleva lisa 3. jaos, riskinäitajate lõplikul aruandekuupäeval;

xv) „ATM“ – „raha peal“, võttes aluseks tuletisinstrumendi alusvara praeguse või tulevase hinna suhtelise positsiooni võrreldes kõnealuse tuletisinstrumendi täitmishinnaga;

xvi) „OTM“ – „rahast väljas“, võttes aluseks tuletisinstrumendi alusvara praeguse või tulevase hinna suhtelise positsiooni võrreldes kõnealuse tuletisinstrumendi täitmishinnaga;

xvii) „ITM“ – „rahas“, võttes aluseks tuletisinstrumendi alusvara praeguse või tulevase hinna suhtelise positsiooni võrreldes kõnealuse tuletisinstrumendi täitmishinnaga;

xviii) „pikk positsioon“ – ostetud, lühike positsioon – müüdud;

xix) „CDS“ – krediidiriski vahetustehingud;

xx) krediidiriski vahetustehingute puhul tähendab „pikk positsioon“ kaitse ostmist ja „lühike positsioon“ kaitse müümist.

xxi) „MLN“ – miljonid;

xxii) „OTC“ – börsiväline;

xxiii) „ASA“ – määruse (EL) nr 575/2013 III osa IV jaotise 1a. peatüki 1. jaos osutatud alternatiivse standardmeetod;

xxiv) „SBM“ – määruse (EL) nr 575/2013 III osa IV jaotise 1a. peatüki 2. jaos osutatud tundlikkusel põhinev meetod;

xxv) „DRC“ – määruse (EL) nr 575/2013 III osa IV jaotise 1a. peatüki 5. jaos osutatud makseviivituse riski nõue;

xxvi) „RRAO“ – määruse (EL) nr 575/2013 III osa IV jaotise 1a. peatüki 4. jaos osutatud jääkriski lisand.

b) Võrdlusanalüüsil kohaldatakse järgmisi kuupäevi:

i) kajastamiskuupäev on 30. jaanuar 2025;

ii) IMV (ja algse SBMi) aruandekuupäev on 6. veebruar 2025 (kl 17.30 Kesk-Euroopa aja järgi);

iii) IMV (ja algse SBMi ja SMBi valideerimise) esitamise kuupäev on 28. veebruar 2025;

iv) riskinäitajate esialgne aruandekuupäev on 2. juuni 2025;

v) riskinäitajate (ja lõpliku alternatiivse standardmeetodi) lõplik aruandekuupäev on 13. juuni 2025;

vi) riskinäitajate (ja lõpliku alternatiivse standardmeetodi) esitamise kuupäev on 18. juuli 2025.

c) Kui käesoleva lisa 2. jaos ei ole sõnaselgelt märgitud teisiti, tuleb kõik positsioonid kajastada käesoleva jao punkti b alapunktis i osutatud kajastamiskuupäeval. Kui positsioonid on kajastatud, jääb iga portfell võrdlusanalüüsi ajal puutumatuks ja see arvutatakse eeldusel, et finantsinstitutsioon ei võta kogu võrdlusanalüüsi perioodi jooksul mingeid meetmeid portfelli haldamiseks. Kui asjaomase instrumendi kirjelduses ei ole sõnaselgelt märgitud teisiti, määratakse optsioonipositsioonide täitmishinnad kindlaks alusvara hindade suhtes, mis kehtisid kajastamiskuupäeval turu sulgemisel.

d) Esialgse turuväärtuse hindamisel esitatakse finantsinstitutsiooni pädevale asutusele iga instrumendi väärtus IMV esitamise kuupäevaks. Selleks kuupäevaks esitavad finantsinstitutsioonid kooskõlas punktiga e koos tulemustega selgitava märkuse. IMV esitatakse võimaluse korral kooskõlas finantsinstitutsiooni *front office*'i hinnanguga. Kui IMVsid ei esita finantsinstitutsiooni *front office*, täpsustab finantsinstitutsioon selgitavas märkuses, kes on IMV andmete allikas.

e) Selgitav märkus, mille finantsinstitutsioonid peavad esitama koos IMVga, sisaldab iga instrumendi kohta järgmist:

i) instrumendi IMV arvutamiseks kasutatud riskitegurid;

ii) instrumendi IMV arvutamiseks kasutatud hinnastamismudel ja selle hinnastamismudeli kirjeldus;

iii) VaR mudelis sisalduvad instrumendi riskitegurid;

iv) VaR mudelis sisalduvad riskitegurid, mis on ka instrumendi IMV hindamise sisendid;

v) VaR mudeli spetsiifilisus seoses instrumendiga;

vi) instrumendi kohta finantsinstitutsiooni enda vormingus kättesaadavad võrdlusandmed;

vii) selle jao punktides h, i, k, m, n, o, v, w, y, gg ja kk osutatud aspektid.

f) Punkti e alapunkti v kohaldamisel esitatakse kogu järgmine teave:

i) VaR mudeli lühikirjeldus;

ii) kasutatud ümberhindamismeetodid;

iii) tulususe modelleerimiseks kasutatav funktsionaalne vorm (nt absoluutne, suhteline, muud meetodid;

iv) kvalitatiivne teave aegridade kohta, mida on kasutatud VaR mudeli kalibreerimiseks seoses instrumendiga (nt allikas, normaliseerimise metoodika, kasutatud rühmad, muu teave, mida finantsinstitutsioonid peavad esitatud tulemuste selgitamisel asjakohaseks).

g) Punktis d osutatud selgitavat märkust ajakohastatakse väärtuse uuesti esitamise korral, kajastades vastavaid muutusi. Selgitav märkus sisaldab ühte jagu, milles on loetletud kõik esitamise kuupäevad ja uuestiesitamise põhjused.

h) Positsioonide riskid arvutatakse rahastamiskulusid arvesse võtmata. Vajaduse korral kasutavad finantsinstitutsioonid instrumendi valuuta üleöökurssi diskontomäärana. Loetakse, et tagatisleping on käeoleva lisa 2. jaos osutatud tuletisinstrumentide puhul olemas. Kui see ei ole võimalik, esitatakse põhjendused punktis d osutatud selgitavas märkuses.

i) Vastaspoole krediidiriski ja krediidiväärtuse korrigeerimise riski portfellide riskide hindamisel arvesse ei võeta. Kui see ei ole võimalik, esitatakse põhjendused käesoleva jao punktis d osutatud selgitavas märkuses. Finantsinstitutsioonid teatavad juhtudest, mil IMV hõlmab muid väärtuse korrigeerimise tüpoloogiaid, ning selgitavad iga finantsinstrumendi puhul metoodikat ja mõju käesoleva jao punktis d osutatud selgitavas märkuses.

j) Tehingute puhul, mis hõlmavad pikki positsioone krediidiriski vahetustehingutes, peavad finantsinstitutsioonid eeldama, et tasutakse kohe ettemakstav tasu, et siseneda positsiooni turustandardite ja -tavade kohaselt. Kõikide krediidiriski vahetustehingute lõpptähtaeg vastab tavapärastele kvartaalsetele lõpetamiskuupäevadele.

k) Krediidiriski vahetustehingute positsioonide hinna arvutamiseks vajalikud täiendavad spetsifikatsioonid peavad olema kooskõlas üldkasutatavate turustandardite ja -tavadega ning neid tuleb selgitada käesoleva jao punktis d osutatud selgitavas märkuses.

l) Kooskõlas turustandardite ja -tavadega kasutatakse lõpptähtaega, mis tagab, et tehing on märgitud lõpptähtajani jäävale perioodile lähim.

m) Seoses käesoleva lisa 2. jaos nimetamata instrumentide üksikasjadega esitavad finantsinstitutsioonid kasutatud eeldused, sealhulgas päevaarvestuse meetodi ning kaubeldava ja likviidse instrumendi valiku, kui see on lubatud, koos tulemustega käesoleva jao punktis d osutatud selgitavas märkuses.

n) Kui finantsinstitutsioonid usuvad, et lisaks käesolevas jaos kindlaks määratud eeldustele on võrdlusanalüüsi tulemuste tõlgendamiseks asjakohased ka muud eeldused (nt äritegevuse lõpu ajastus, kupongi üleminek, jaotus indeksite raames jms), esitavad nad nende eelduste kirjelduse käesoleva jao punktis d osutatud selgitavas märkuses.

o) Käesoleva jao punktis d osutatud selgitav märkus peab sisaldama selgitusi riskide kohta, mida mudel käesoleva lisa 2. jaos osutatud instrumentide puhul ei hõlma.

p) Kõiki optsioone käsitletakse nii, nagu nendega kaubeldaks börsiväliselt, välja arvatud juhul, kui on sõnaselgelt märgitud teisiti.

q) Järgitakse börsiväliste optsioonide standardseid tähtaegadega seotud tavasid. N kuu pikkuse optsiooni lõpptähtajani on jäänud n kuud. Kui optsioonid aeguvad muul päeval kui kauplemispäev, peavad finantsinstitutsioonid korrigeerima aegumise kuupäeva tööpäeva järgi kooskõlas turustandardite ja -tavadega.

r) Kõiki börsiväliseid optsioone käsitletakse järgmiselt:

   i) Ameerika-tüüpi optsioonina eraldi aktsiate ja kaupade puhul;

   ii) Euroopa-tüüpi optsioonina aktsiaindeksite, valuuta ja vahetusoptsioonide puhul.

s) Kõiki börsiväliseid optsioone käsitatakse katteta optsioonidena, nii et preemia jäetakse esialgsest turuväärtusest välja.

t) Mis puudutab korrelatsioonil põhinevat kauplemisportfelli, peavad finantsinstitutsioonid, kellel on korrelatsioonil põhineva kauplemisportfelli puhul lubatud kasutada kõigi hinnariskide mudelit, esitama seoses käesoleva lisa 2. jaos osutatud korrelatsioonil põhineva kauplemisportfelli instrumentidega oma kõige tähtsamate eelduste, turustandardite ja -tavade üksikasjad, sealhulgas riskimaandamise suhtarvud, mida nad kasutasid, et muuta korrelatsioonil põhineva kauplemisportfelli instrumendid CS01 neutraalseks kajastamiskuupäeval.

u) Iga instrumendi IMV esitatakse selle instrumendi puhul käesolevas jaos 2. jaos kindlaks määratud EBA instrumendi valuutas.

v) Portfellide puhul, mis koosnevad ühest või mitmest sellises EBA instrumendi valuutas nomineeritud instrumendist, mis erinevad EBA portfelli valuutast, konverteeritakse tulemus EBA portfelli valuutasse, kasutades asjaomasel kuupäeval kehtinud EKP hetkekurssi. Konverteeritud tulemust selgitatakse käesoleva jao punktis d osutatud selgitavas märkuses.

w) Positsioone kajastades järgivad finantsinstitutsioonid asjakohaseid turutavasid, välja arvatud juhul, kui kõnealustes juhistes on instrumentide kirjeldustes (käesoleva lisa 2. jagu) märgitud teisiti.

x) Kui seoses instrumendiga või tuletisinstrumendi alusvaraks oleva instrumendiga toimub korporatiivne sündmus, mis mõjutab võrdlemist (nt ost emitendi poolt, makseviivitus või muu sarnane sündmus), jätavad finantsinstitutsioonid kõnealuse instrumendi koos kõigi sellega seonduvate krediidiriski vahetustehingute või optsioonidega võrdlusanalüüsist välja.

y) Indeksiseeriate puhul tähendab „on-the-run“ indeksi kõige likviidsemat ja kaubeldavamat turul kättesaadavat seeriat. Finantsinstitutsioonid selgitavad oma „on-the-run“ seeriate valikut koos vastavate tulemustega käesoleva jao punktis d osutatud selgitavas märkuses.

z) Kui ei ole kindlaks määratud teisiti, kohaldavad finantsinstitutsioonid intressimäära suhtes ELi võrdlusaluste määrust, et kajastada käesoleva lisa 2. jaos kindlaks määratud instrumendid. Finantsinstitutsioonid määravad kindlaks kohaldatava määra, välja arvatud käesoleva lisa 2. jaos kindlaks määratud määrad, käesolevate juhiste punktis d osutatud selgitavas märkuses.

aa) 3., 4. ja 5. jaos osutatud portfellide riskinäitajad koos nüüdisväärtusega arvutatakse „riskinäitajate esialgsest aruandekuupäevast“ kuni „riskinäitajate lõpliku aruandekuupäevani“. FRTB ASA riskinäitajad (SBM, DRC ja RRAO) arvutatakse „riskinäitajate lõpliku aruandekuupäeva“ jaoks. Finantsinstitutsioonid esitavad kõnealuste arvutuste tulemused oma pädevale asutusele riskinäitajate esitamise kuupäevaks. IMV ja SBM esitatakse iga instrumendi kohta. Riskinäitajad, SBM, DRC, RRAO ja asjakohasel juhul nüüdisväärtus esitatakse iga portfelli kohta eraldi ja agregeeritud kujul. SBM, DRC ja RRAO (kui see on asjakohane) esitatakse vähemalt samade portfellide kohta, mille puhul esitatakse riskinäitajad.

bb) 7. jaos osutatud portfellide puhul esitavad finantsinstitutsioonid SBMi tulemused kooskõlas IMVd käsitleva teabe esitamise aruandekuupäevadega.

cc) Teabe krediidiriski vahetustehingute portfellide kohta peavad esitama üksnes need finantsinstitutsioonid, kellele on antud luba võlainstrumentide spetsiifilise riski modelleerimiseks. Intressiportfellide puhul, mis sisaldavad riski teatavate instrumentide osana, modelleerivad individuaalseid ja agregeeritud portfelle finantsinstitutsioonid, kellele on antud luba modelleerida intressipositsiooni üldist riski, ning finantsinstitutsioonid, kellele on antud luba modelleerida intressipositsiooni üldist ja spetsiifilist riski.

dd) Nii individuaalsete kui ka koondportfellide tulemused esitatakse ainult siis, kui esitatakse ka nendesse kuuluvate instrumentide tulemused.

ee) Käesoleva lisa 2. jaos (Instrumendid) tähendab „aasta T“ 2025. aastat ja aasta „T + X“ tähendab 2025. aastat + X, kus X on kindlaks määratud 2. jaos.

ff) Käesoleva lisa 2. jaos (Instrumendid) määravad finantsinstitutsioonid aegumiskuupäeva/lõpptähtaja kindlaks vastavalt järgmistele juhistele:

i) kui kuupäev on kindlaks määratud, kasutatakse seda konkreetset kuupäeva;

ii) kui kuupäeva ei ole kindlaks määratud, kasutatakse turutava, kui see on olemas. Kui näiteks turutava kohaselt on aegumiskuupäev/lõpptähtaeg kuu kolmas reede, tähendab „juuni aasta T“ aasta T kuu kolmandat reedet;

iii) kuu lõpus, kui on märgitud „lõpp“, tähendab see kuu viimast kalendripäeva;

iv) „Kajastamiskuupäevale“ järgneva kindla perioodi puhul, kui periood on määratletud päevade arvuna, on see perioodi viimane päev. Kui periood on määratletud nädalates, kuudes või aastates, on see sama kuupäev järgmisel nädalal, kuul või aastal nagu kajastamiskuupäev, või kui perioodi viimane kuu või aasta on lühem, siis kõnealuse kuu või aasta viimane päev; kui „kajastamiskuupäev + x periood“ on puhkepäev, valige järgmine tööpäev;

v) Kui ei ole kindlaks määratud teisiti, kasutatakse järgmisi eeldusi: Intressiarvestusmeetod: tegelik/360, puhkepäevad: Target2.

gg) Käesoleva lisa 2. jaos (Instrumendid) kohaldatakse kõigi krediidiriski vahetustehingute suhtes järgmisi nõudeid, välja arvatud juhul, kui on sõnaselgelt märgitud teisiti:

i) Kupongi sagedus: kord kvartalis;

ii) Kupong(baaspunkti): 100;

iii) Päevade arv: tegelik/360;

iv) ISDA määratluste aasta: 2014;

v) Restruktureerimisklausel: muudetud- muudetud restruktureerimine (MMR);

vi) Lõpptähtaeg: detsember aasta T+4;

vii) Võlakohustuse liik: kõrgema nõudeõiguse järguga;

viii) Tähtaeg: 5 aastat;

ix) Jõustumiskuupäev on kajastamiskuupäev.

x) Kasutatud diskontokõver ja sissenõudmismäär esitatakse selle lisa punktis d osutatud selgitavas märkuses.

hh) Võlakirjainstrumentide IMV hõlmab kogunenud intressi.

ii) Finantsinstitutsioonid esitavad nüüdisväärtuse hindamise ajaga seotud teabe, märkides selle käesoleva jao punktis d osutatud selgitavas märkuses. Võimaluse korral arvutatakse nüüdisväärtus tööpäeva lõpu seisuga.

jj) Portfellide riskinäitajad arvutatakse portfelli valuuta samas valuutas, arvestamata valuutariski, sealhulgas seoses finantsinstitutsioonide aruandlusvaluutaga. Valuutariski võetakse arvesse ainult juhul, kui see olemuslikult sisaldub instrumentides. Kui aruandluse raames esitatakse nii aruandlus- kui ka portfellivaluuta tulemused, arvestatakse alternatiivse standardmeetodi näitajate puhul finantsinstitutsiooni aruandlusvaluutas arvutatud tulemused ümber EBA portfelli valuutasse hetkekursiga konverteerimise teel, kasutades arvutamise kuupäeval kehtinud EKP hetkekurssi. Ümberarvestamine EBA portfelli valuutasse ei tähenda valuutariski tegurite muutumist.

kk) Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325q lõike 7 („alusvaluuta meetod“) kohaldamisel võtavad investeerimisühingud SBMi arvutuste tegemisel ja SBMi tundlikkuste esitamisel arvesse alusvaluuta meetodi kohaldamisest tulenevaid valuutariski tegureid. Esitatavaid väärtusi ei väljendata valitud alusvaluutas, vaid finantsinstitutsiooni aruandlus-valuutas hetkekursiga konverteerimise teel, kasutades asjaomasel kuupäeval kehtinud EKP hetkekurssi.

2. jagu: instrumendid

Finantsinstitutsioonid esitavad esialgse turuväärtuse vastavalt käesoleva lisa punktis 1 esitatud juhistele järgmiste finantsinstrumentide kohta, kui finantsinstitutsioonid esitavad 3. ja 4. jaos kindlaks määratud portfellide riskinäitajad ja nüüdisväärtuse.

AKTSIAD

101. Pikk positsioon, EURO STOXX 50 indeksi (tähis: FESX) futuurid.

Tinglik väärtus: võrdub indeks väärtus korda 1 000 eurot.

Börs: Eurex

Aegumistähtaeg: juuni aasta T

EBA instrumendi valuuta: euro

102. Pikk positsioon, 10 000 BAYERi (tähis: BAYN GR) aktsiat,

Börs: Xetra

EBA instrumendi valuuta: euro

103. Lühike positsioon, BAYERi (tähis: BAYN GR) futuurid.

Tinglik väärtus: võrdub alusvara 10 000 aktsia väärtusega.

Börs: Eurex

Aegumistähtaeg: juuni aasta T

EBA instrumendi valuuta: euro

104. Lühike positsioon, STELLANTISi (tähis: STLA FP) futuurid.

Tinglik väärtus: võrdub alusvara 10 000 aktsia väärtusega.

Börs: Euronext

Aegumistähtaeg: juuni aasta T

EBA instrumendi valuuta: euro

105. Lühike positsioon, ALLIANZi (tähis: ALV GR) futuurid.

Tinglik väärtus: võrdub alusvara 10 000 aktsia väärtusega.

Börs: Eurex

Aegumistähtaeg: juuni aasta T

EBA instrumendi valuuta: euro

106. Lühike positsioon, BARCLAYSi (tähis: BARC LN) futuurid.

Tinglik väärtus: võrdub alusvara 10 000 aktsia väärtusega.

Börs: Eurex

Aegumistähtaeg: juuni aasta T

EBA instrumendi valuuta: Inglise nael

107. Lühike positsioon, DEUTSCHE BANKi (tähis: DBK GR) futuurid.

Tinglik väärtus: võrdub alusvara 10 000 aktsia väärtusega.

Börs: Eurex

Aegumistähtaeg: juuni aasta T

EBA instrumendi valuuta: euro

108. Lühike positsioon, CRÉDIT AGRICOLE'i (tähis: ACA FP) futuurid.

Tinglik väärtus: võrdub alusvara 10 000 aktsia väärtusega.

Börs: Euronext

Aegumistähtaeg: juuni aasta T

EBA instrumendi valuuta: euro

109. Pikk positsioon ostuoptsioonides. Alusvara BAYER (tähis: BAYN GR), ATM (1 leping = 100 aktsiat),

Tinglik väärtus: võrdub alusvara 10 000 aktsia väärtusega.

Aegumistähtaeg: juuni aasta T

EBA instrumendi valuuta: euro

110. Lühike positsioon ostuoptsioonides. Alusvara BAYER (tähis: BAYN GR), ATM (1 leping = 100 aktsiat),

Tinglik väärtus: võrdub alusvara 10 000 aktsia väärtusega.

Aegumistähtaeg: detsember aasta T

EBA instrumendi valuuta: euro

111. Pikk positsioon ostuoptsioonides. Alusvara PFIZER (tähis: PFE US) 10 % OTM, (1 leping = 100 aktsiat).

Tinglik väärtus: võrdub alusvara 10 000 aktsia väärtusega.

Aegumistähtaeg: juuni aasta T

EBA instrumendi valuuta: USA dollar

112. Pikk positsioon müügioptsioonides. Alusvara PFIZER (tähis: PFE US) 10 % OTM, (1 leping = 100 aktsiat).

Tinglik väärtus: võrdub alusvara 10 000 aktsia väärtusega.

Aegumistähtaeg: juuni aasta T

EBA instrumendi valuuta: USA dollar

113. Pikk positsioon ostuoptsioonides. Alusvara BAYER (tähis: BAYN GR), 10 % OTM (1 leping = 100 aktsiat),

Tinglik väärtus: võrdub alusvara 10 000 aktsia väärtusega.

Aegumistähtaeg: detsember aasta T

EBA instrumendi valuuta: euro

114. Lühike positsioon ostuoptsioonides. Alusvara BAYER (tähis: BAYN GR), 10 % OTM (1 leping = 100 aktsiat),

Tinglik väärtus: võrdub alusvara 10 000 aktsia väärtusega.

Aegumistähtaeg: juuni aasta T

EBA instrumendi valuuta: euro

115. Pikk positsioon ostuoptsioonides. Alusvara AVIVA (tähis: AV/LN), 10 % OTM (1 leping = 100 aktsiat),

Tinglik väärtus: võrdub alusvara 10 000 aktsia väärtusega.

Aegumistähtaeg: detsember aasta T

EBA instrumendi valuuta: Inglise nael

116. Pikk positsioon müügioptsioonides. Alusvara AVIVA (tähis: AV/LN), 10 % OTM (1 leping = 100 aktsiat),

Tinglik väärtus: võrdub alusvara 10 000 aktsia väärtusega.

Aegumistähtaeg: detsember aasta T

EBA instrumendi valuuta: Inglise nael

117. Lühike positsioon, NIKKEI 225 (tähis: NKY) futuurid.

Tinglik väärtus: võrdub indeks väärtus korda 20 000 Jaapani jeeni.

Börs: CME

Aegumistähtaeg: juuni aasta T

EBA instrumendi valuuta: Jaapani jeen

118. Automaatselt realiseeritav omakapitalitoode.

Pikk positsioon

Kajastamine „kajastamiskuupäeval“

Tinglik väärtus („kapital“): 1 000 000 eurot

Alusvara: Index Euro STOXX 50 (tähis: SX5E)

EBA instrumendi valuuta: euro

Lõpptähtaeg: 5 aastat

Iga-aastane väljamakse ja iga-aastane vaatlus (kajastamiskuupäev + 1 aasta, kajastamiskuupäev + 2 aastat, kajastamiskuupäev + 3 aastat, kajastamiskuupäev + 4 aastat, kajastamiskuupäev + 5 aastat). Väljamakse toimub kümme päeva pärast viitekuupäeva.

Kupongimäär: 6 %.

Automaatse realiseerimise tase („algväärtus“): kajastamiskuupäeva lõpp + 1 kuu

Barjääri kupongimakse 60 % automaatse realiseerimise tasemest

Kaitsebarjäär: 55 % automaatse realiseerimise tasemest

— Kapital ei ole tagatud, kui indeks on allapoole kaitsebarjääri (kui tase on allapoole kaitsebarjääri, makstakse kapital viienda aasta lõpus tagasi proportsionaalselt: näiteks kui SX5E = 40 % algtasemest, makstakse kapitali tagasi 40 %);

— kui SX5E ≥ 60 % (barjääri kupong) algväärtusest mis tahes aasta lõpus, makstakse kupong välja 6 %;

— kui SX5E ≥ 100 % algväärtusest mis tahes aasta lõpus, toode realiseeritakse ja väljamakse võrdub kupong pluss kapital (100 %);

— kui SX5E < 60 % (barjääri kupong) algväärtusest mis tahes aasta lõpus, ei maksta kupongi välja;

— kui SX5E < 55 % (kaitsebarjäär) algväärtusest viienda aasta lõpus, makstakse kapital välja proportsionaalselt; kui SX5E >= 55 % (kaitsebarjäär) algväärtusest viienda aasta lõpus, makstakse kapital välja täielikult.

119. Pikk positsioon ostuoptsioonides. Alusvara EURO STOXX 50 indeks (tähis: SX5E), ATM.

Tinglik väärtus: võrdub indeks väärtus korda 1 000 eurot.

Aegumistähtaeg: juuni aasta T

EBA instrumendi valuuta: euro

120. Pikk positsioon ostuoptsioonides. Alusvara EURO STOXX 600 indeks (tähis: SXXP), ATM.

Tinglik väärtus: võrdub indeks väärtus korda 10 000 eurot.

Aegumistähtaeg: juuni aasta T

EBA instrumendi valuuta: euro

121. Pikk positsioon ostuoptsioonides. Alusvara VIX (CBOE), ATM.

Tinglik väärtus: võrdub indeks väärtus korda 100 000 USA dollarit.

Aegumistähtaeg: juuni aasta T

EBA instrumendi valuuta: USA dollar

INTRESSIMÄÄR

201. Viieaastane IRS EUR – saadakse fikseeritud määra alusel ja makstakse ujuva määra alusel.

Fikseeritud pool: saadakse kord aastas

Ujuv intressimäär: kuue kuu EURIBOR, makstakse kord poolaastas. Päevade arvestus: tegelik/360

Tinglik väärtus: 10 000 000 eurot

Pikendamise tava ja kalender: standardne

Jõustumiskuupäev: kajastamiskuupäev (st kasutatavad määrad on need, mis kehtisid kajastamiskuupäeval turu sulgemisel).

Lõpptähtaeg: september aasta T+4.

EBA instrumendi valuuta: euro

202. Kaheaastane euro vahetusoptsioon viieaastasele euro intressimäära vahetustehingule – makstakse fikseeritud määra alusel ja saadakse ujuva määra alusel.

Tinglik väärtus: 10 000 000 eurot.

Finantsinstitutsioon on vahetustehingu optsiooni müüja. Finantsinstitutsiooni vastaspool ostab õiguse teha vahetustehing finantsinstitutsiooniga. Kui vastaspool seda õigust kasutab, saab ta fikseeritud intressimäära, samal ajal kui finantsinstitutsioon saab ujuva intressimäära.

Kaheaastane vahetusoptsioon (kajastamiskuupäev + 2 aastat) intressimäära vahetustehingule, mis on määratletud järgmiselt: fikseeritud pool – makstakse kord aastas; ujuv intressimäär: kuue kuu EURIBOR, saadakse kord poolaastas. Tinglik väärtus: 10 000 000 eurot. Pikendamise tava ja kalender: standardne. Alusvaraks oleva vahetustehingu jõustumise kuupäev: kajastamiskuupäev + 2 aastat.

Alusvaraks oleva vahetustehingu tähtaeg: kajastamiskuupäev + 7 aastat

Preemia makstud kajastamispäeval (kajastamiskuupäev). Arveldatud rahas

Täitmishind põhineb selle instrumendi all määratletud forvardvahetustehingu ATM kursil.

EBA instrumendi valuuta: euro

203. Viieaastane IRS USD. Saadakse fikseeritud määra alusel ja makstakse ujuva määra alusel.

Fikseeritud intressimäär: saadakse kord aastas

Ujuv intressimäär: kolme kuu USD SOFRi määr, makstakse kord kvartalis.

Tinglik väärtus: 1 000 000 USA dollarit.

Pikendamise tava ja kalender: standardne

Jõustumiskuupäev: kajastamiskuupäev (st kasutatavad määrad on need, mis kehtisid kajastamiskuupäeval turu sulgemisel).

Lõpptähtaeg: september aasta T+4.

EBA instrumendi valuuta: USA dollar

204. Kaheaastane IRS GBP. Saadakse fikseeritud määra alusel ja makstakse ujuva määra alusel.

Fikseeritud intressimäär: saadakse kord aastas

Ujuv intressimäär: SONIA (üleöö)määr, mida liidetakse ja makstakse kord kvartalis. Päevade arvestus: tegelik/365

Tinglik väärtus: 10 000 000 Inglise naela

Pikendamise tava ja kalender: standardne

Jõustumiskuupäev: kajastamiskuupäev (st kasutatavad määrad on need, mis kehtisid kajastamiskuupäeval turu sulgemisel).

Lõpptähtaeg: kajastamiskuupäev + 2 aastat

EBA instrumendi valuuta: Inglise nael

205. UBSi müüdud 10 aastane ülem- ja alammääraga ujuva intressimääraga võlakiri.

Tinglik väärtus (põhisumma): 1 000 000 USA dollarit.

Ujuva intressimääraga võlakirjad on kõrgema nõudeõiguse järguga kui UBS AG tagamata kohustused.

EBA instrumendi valuuta: USA dollar

— Võlakirjade intress on aastamäär, mis võrdub kolmekuuline USA dollari SOFR pluss 1,5 % („ujuv intressimäär“). Kohaldatakse aastast maksimummäära 7,5 % (intressimäära ülempiiri) ja aastast miinimummäära 2,5 % (intressimäära alampiir).

— Võlakirjadega seoses tehtavad mis tahes maksed, sealhulgas intressid ja põhisumma lõpptähtajal, sõltuvad UBS AG krediidivõimelisusest. Finantsinstitutsioonid peavad kasutama asjakohast diskontokõverat, mida nad peavad selgitama selgitavas märkuses.

— Tulu: Võlakirjadelt makstakse kord kvartalis intressi ujuva intressimääraga võrdse määra alusel, tingimusel et, kui mis tahes kupongimäära kindlaksmääramise kuupäeval i) on ujuv intressimäär madalam kui intressi alammäär, siis on asjaomase intressiperioodi kohaldatav intressimäär võrdne intressi alammääraga või ii) on ujuv intressimäär kõrgem kui intressi ülemmäär, siis on asjaomase intressiperioodi kohaldatav intressimäär võrdne intressi ülemmääraga.

Intressimakse summa	Intressiperioodil võlakirjadelt makstav intressisumma võrdub järgmiste korrutisega: a) võlakirjade põhisumma, b) kõnealusel intressiperioodil kohaldatav intressimäär ja c) murdarv, mille lugeja on intressiperioodi päevade arv (arvutatud 360päevase aasta (kaksteist 30päevast kuud) alusel) ja mille nimetaja on 360.
Tehingupäev ja arvelduspäev	kajastamiskuupäev
Intressimakse kuupäevad	Kord kvartalis, kajastamiskuupäev + 3 kuud, kajastamiskuupäev + 6 kuud, kajastamiskuupäev + 9 kuud ja kajastamiskuupäev + 1 aasta, alates kajastamiskuupäevast + 3 kuud, võlakirjade kehtivusaja jooksul (sõltuvalt kohandustest vastavalt kirjeldusele).
Lõpptähtaeg	kajastamiskuupäev + 10 aastat
Valuuta	USA dollar
Päevade arvestuse alus:	30/360
Tööpäevade tava	Kohandamata
Kupongi kindlaksmääramise kuupäev	Iga intressiperioodi puhul teine Londoni pangapäev, mis vahetult eelneb asjaomasele intressikuupäevale. „Londoni pangapäev“ on mis tahes päev, mil kommertspangad on avatud üldiseks äritegevuseks (sealhulgas tehingud välisvaluuta ja välisvaluuta hoiustega) Londonis ja mil Londoni pankadevahelisel turul tehakse tehinguid USA dollarites.

206. Pikk positsioon Saksamaa riigivõlakirjades (inflatsioon) 1 000 000 eurot (ISIN DE0001030583).

Lõpptähtaeg: 15. aprill 2033

EBA instrumendi valuuta: euro

207. Lühike positsioon Saksamaa riigivõlakirjades 1 000 000 eurot (ISIN DE0001030708).

Lõpptähtaeg: 15. august 2030

EBA instrumendi valuuta: euro

208. Pikk positsioon Itaalia riigivõlakirjades (inflatsioon) 1 000 000 eurot (ISIN IT0005138828).

Lõpptähtaeg: 15. september 2032

EBA instrumendi valuuta: euro

209. Pikk positsioon Itaalia riigivõlakirjades 1 000 000 eurot (ISIN IT0005340929).

Lõpptähtaeg: 1. detsember 2028

EBA instrumendi valuuta: euro

210. Pikk positsioon Hispaania riigivõlakirjades 1 000 000 eurot (ISIN ES00000127A2).

Lõpptähtaeg: 30. juuli 2030

EBA instrumendi valuuta: euro

211. Lühike positsioon Prantsusmaa riigivõlakirjades 1 000 000 eurot (ISIN FR0012993103).

Lõpptähtaeg: 25. mai 2031

EBA instrumendi valuuta: euro

212. Lühike positsioon Saksamaa riigivõlakirjades 1 000 000 eurot (ISIN DE0001135176).

Lõpptähtaeg: 4. jaanuar 2031

EBA instrumendi valuuta: euro

213. Pikk positsioon Ühendkuningriigi riigivõlakirjades 1 000 000 Inglise naela (ISIN GB0004893086).

Lõpptähtaeg: 7. juuni 2032

EBA instrumendi valuuta: Inglise nael

214. Pikk positsioon Portugali riigivõlakirjades 1 000 000 eurot (ISIN PTOTEXOE0024).

Lõpptähtaeg: 15. juuni 2029

EBA instrumendi valuuta: euro

215. Lühike positsioon USA riigivõlakirjades 1 000 000 USA dollarit (ISIN US91282CAV37).

Lõpptähtaeg: 15. november 2030

EBA instrumendi valuuta: USA dollar

216. Pikk positsioon Brasiilia riigivõlakirjades (realiseeritavad) 1 000 000 USA dollarit (ISIN US105756BZ27).

Lõpptähtaeg: 13. jaanuar 2028

EBA instrumendi valuuta: USA dollar

217. Pikk positsioon Mehhiko riigivõlakirjades (realiseeritavad) 1 000 000 USA dollarit (ISIN US91087BAT70).

Lõpptähtaeg: 19. mai 2033

EBA instrumendi valuuta: USA dollar

218. Kümneaastane IRS EURO – saadakse ujuva määra alusel ja makstakse fikseeritud määra alusel.

Fikseeritud pool: makstakse kord aastas

Ujuv intressimäär: kolme kuu EURIBOR, saadakse kord kvartalis. Päevade arvestus: tegelik/360

Tinglik väärtus: 10 000 000 eurot

Pikendamise tava ja kalender: standardne

Jõustumiskuupäev: kajastamiskuupäev (st kasutatavad määrad on need, mis kehtisid turu sulgemisel kajastamiskuupäeval)

Lõpptähtaeg: kajastamiskuupäev + 10 aastat

EBA instrumendi valuuta: euro

219. Viieaastane IRS EURO – saadakse ujuva määra alusel ja makstakse fikseeritud määra alusel.

Fikseeritud pool: makstakse kord aastas

Ujuv intressimäär: kuue kuu EURIBOR, saadakse iga kuue kuu tagant. Päevade arvestus: tegelik/360

Tinglik väärtus: 10 000 000 eurot

Pikendamise tava ja kalender: standardne

Jõustumiskuupäev: kajastamiskuupäev (st kasutatavad määrad on need, mis kehtisid turu sulgemisel kajastamiskuupäeval)

Lõpptähtaeg: kajastamiskuupäev + 5 aastat

EBA instrumendi valuuta: euro

220. Viieaastane turuhinnas hinnatud EUR/USD intressimäära vahetustehing. Saadakse USD ja makstakse EUR.

Euro: kolme kuu ESTER, mida makstakse kord kvartalis liidetuna kahepäevase makseviivitusega. Päevade arvestus: tegelik/360

USA dollar: kolme kuu SOFR, mida saadakse kord kvartalis liidetuna kahepäevase makseviivitusega. Päevade arvestus: tegelik/360

Pool 1 – USA dollar: tinglik väärtus 10 000 000 euroga samaväärne summa, kohandatakse kord kvartalis

Pool 2 – euro: tinglik väärtus 10 000 000 eurot

Pikendamise tava ja kalender: standardne

Jõustumiskuupäev on kajastamiskuupäev + 6 kuud

Lõpptähtaeg: kajastamiskuupäev + 5,5 aastat

EBA instrumendi valuuta: euro

Vt ka käesoleva lisa 6. jagu – instrumentide täiendavad spetsifikatsioonid

221. Kümneaastane IRS EURO – saadakse ESTER ja makstakse EURIBOR.

ESTERi pool: saadakse kord aastas. Päevade arvestus: tegelik/360

EURIBORi pool: kolme kuu EURIBOR + baasmäär, makstakse kord kvartalis. Päevade arvestus: tegelik/360

Tinglik väärtus: 10 000 000 eurot

Pikendamise tava ja kalender: standardne

Jõustumiskuupäev: kajastamiskuupäev (st kasutatavad määrad on need, mis kehtisid kajastamiskuupäeval turu sulgemisel).

Lõpptähtaeg: september aasta T + 9 aastat.

EBA instrumendi valuuta: euro

222. Pikk positsioon Itaalia riigivõlakirjades (inflatsioon) 1 000 000 eurot (ISIN IT0005387052).

Lõpptähtaeg: 15. mai 2030

EBA instrumendi valuuta: euro

223. 5 aasta nullkupongiga inflatsiooni vahetusleping eurodes – saadakse inflatsiooniga indekseeritud tulumäära ja makstakse fikseeritud määra alusel (r).

Inflatsiooniindeks: THI (THHIxT)

Fikseeritud pool (makstakse fikseeritud määra): $[(1+r)^5 - 1]$

saadakse inflatsiooniga indekseeritud tulumäära: $\left[\left(\frac{CPI \text{ at the end (maturity) date}}{CPI \text{ at the start date}}\right) - 1\right]$

Tinglik väärtus: 10 000 000 eurot

Baasintressi fikseerimise kuupäev: Juuni, aasta T–1

Lõpliku fikseerimise kuupäev: august aasta T+4

Lõpptähtaeg: september aasta T+4.

EBA instrumendi valuuta: euro

224. Kaheaastane euro vahetusoptsioon viieaastasele euro intressimäära vahetustehingule – saadakse fikseeritud määra alusel ja makstakse ujuva määra alusel.

Tinglik väärtus: 10 000 000 eurot.

Finantsinstitutsioon on vahetustehingu optsiooni müüja. Finantsinstitutsiooni vastaspool ostab õiguse teha vahetustehing finantsinstitutsiooniga. Kui vastaspool seda õigust kasutab, saab ta ujuva intressimäära, samal ajal kui finantsinstitutsioon saab fikseeritud intressimäära.

Kaheaastane vahetusoptsioon (kajastamiskuupäev + 2 aastat) intressimäära vahetustehingule, mis on määratletud järgmiselt: fikseeritud pool – saadakse kord aastas; ujuv intressimäär: kuue kuu EURIBOR, makstakse iga kuue kuu tagant. Tinglik väärtus: 10 000 000 eurot. Pikendamise tava ja kalender: standardne. Alusvaraks oleva vahetustehingu jõustumise kuupäev: kajastamiskuupäev + 2 aastat.

Alusvaraks oleva vahetustehingu tähtaeg: kajastamiskuupäev + 7 aastat

Preemia makstud kajastamispäeval (kajastamiskuupäev). Arveldatud rahas

Täitmishind põhineb selle instrumendi all määratletud forvardvahetustehingu ATM kursil + 100 baaspunkti.

EBA instrumendi valuuta: euro

VALUUTA

301. Kuuekuuline USA dollari / euro forvardleping. Arveldatud rahas. Pikk positsioon USA dollaris – lühike positsioon euros; tinglik väärtus
10 000 000 USA dollarit; Forvardtäitmishind: 100 % EKP asjaomasest kajastamiskuupäeva lõpus kehtinud hetkeviitekursist.

EBA instrumendi valuuta: euro

302. Kuuekuuline USA dollari / Inglise naela forvardleping. Arveldatud rahas. Pikk positsioon euros – lühike Inglise naelas; tinglik väärtus 10 000 000 Inglise naela; Forvardtäitmishind: 100 % EKP asjaomasest kajastamiskuupäeva lõpus kehtinud hetkeviitekursist.

EBA instrumendi valuuta: euro

303. Pikk positsioon 10 000 000 USA dollarit rahas.

Rahapositsioon. Loetakse, et sel on sisemine valuutarisk, nagu on kirjeldatud punktis (kk).

EBA instrumendi valuuta: euro

304. Pikk positsioon EUR/USD ostuoptsioonis (pikk positsioon EUR, lühike positsioon USD). Arveldatud rahas. Tinglik väärtus: 10 000 000 eurot. Samaväärne summa, mis põhineb EKP EUR/USD kajastamiskuupäeva lõpus kehtinud spot-kursil.

Täitmishind: 110 % EKP EUR/USD kajastamiskuupäeva lõpus kehtinud viitekursist.

Aegumistähtaeg: kajastamiskuupäev + 1 aasta

EBA instrumendi valuuta: euro

305. Pikk positsioon EUR/USD ostuoptsioonis (pikk positsioon EUR, lühike positsioon USD). Arveldatud rahas. Tinglik väärtus: 10 000 000 eurot. Samaväärne summa, mis põhineb EKP EUR/USD kajastamiskuupäeva lõpus kehtinud spot-kursil.

Täitmishind: 90 % EKP EUR/USD kajastamiskuupäeva lõpus kehtinud viitekursist.

Aegumistähtaeg: kajastamiskuupäev + 1 aasta

EBA instrumendi valuuta: euro

306. Lühike positsioon EUR/USD ostuoptsioonis (lühike positsioon EUR, pikk positsioon USD). Arveldatud rahas. Tinglik väärtus: 10 000 000 eurot. Samaväärne summa, mis põhineb EKP EUR/USD kajastamiskuupäeva lõpus kehtinud spot-kursil.

Täitmishind: 100 % EKP EUR/USD kajastamiskuupäeva lõpus kehtinud viitekursist.

Aegumistähtaeg: kajastamiskuupäev + 1 aasta

EBA instrumendi valuuta: euro

307. Lühike positsioon EUR/GBP ostuoptsioonis (lühike positsioon EUR, pikk positsioon GBP). Arveldatud rahas. Tinglik väärtus: 10 000 000 eurot. Samaväärne summa, mis põhineb EKP euro/Inglise naela kajastamiskuupäeva lõpus kehtinud spot-kursil.

Täitmishind: 110 % EKP euro/Inglise naela kajastamiskuupäeva lõpus kehtinud viitekursist.

Aegumistähtaeg: kajastamiskuupäev + 1 aasta

EBA instrumendi valuuta: euro

308. Pikk positsioon EUR/JPY müügioptsioonis (lühike positsioon EUR, pikk positsioon JPY). Arveldatud rahas. Tinglik väärtus: 10 000 000 eurot. Samaväärne summa, mis põhineb EKP EUR/JPY kajastamiskuupäeva lõpus kehtinud spot-kursil.

Täitmishind: 110 % EKP EUR/JPY kajastamiskuupäeva lõpus kehtinud viitekursist.

Aegumistähtaeg: kajastamiskuupäev + 1 aasta

EBA instrumendi valuuta: euro

309. Lühike positsioon EUR/AUD müügioptsioonis (pikk positsioon EUR, lühike positsioon AUD). Arveldatud rahas. Tinglik väärtus: 10 000 000 eurot. Samaväärne summa, mis põhineb EKP EUR/AUD kajastamiskuupäeva lõpus kehtinud spot-kursil.

Täitmishind: 110 % EKP EUR/AUD kajastamiskuupäeva lõpus kehtinud viitekursist.

Aegumistähtaeg: kajastamiskuupäev + 1 aasta

EBA instrumendi valuuta: euro

310. Kuuekuuline EUR/DKK forvardleping (pikk positsioon EUR, lühike positsioon DKK). Arveldatud rahas; tinglik väärtus 10 000 000 eurot; kajastamiskuupäeva lõpus kehtinud EKP EUR/DKK hetkekurss forvardkursi kindlaksmääramiseks.

EBA instrumendi valuuta: euro

311. Kuuekuuline EUR/BRL mitteülekantav forvardleping (pikk positsioon EUR, lühike positsioon BRL); tinglik väärtus 10 000 000 eurot; kajastamiskuupäeva lõpus kehtinud EKP EUR/BRL hetkekurss forvardkursi kindlaksmääramiseks.

EBA instrumendi valuuta: euro

KAUBAD

401. Pikk positsioon,
3 500 troiuntsi kuuekuulist Londoni kulla forvardlepingut (pikk positsioon kuld, lühike positsioon USA dollar). Arveldatud rahas. Täitmishind: 6 kuu päeva lõpu forvardhind kajastamiskuupäeval.

EBA instrumendi valuuta: USA dollar

402. Lühike positsioon, 3 500 troiuntsi 12-kuulist Londoni kulla forvardlepingut (lühike positsioon kuld, pikk positsioon USA dollar). Arveldatud rahas. Täitmishind: 12 kuu päeva lõpu forvardhind kajastamiskuupäeval.

EBA instrumendi valuuta: USA dollar

403. Pikk positsioon, 30 000 barreli Brenti toornafta ostuoptsioon (pikk positsioon WTI, lühike positsioon USA dollar). Arveldatud rahas. Täitmishind: 12 kuu päeva lõpu forvardhind kajastamiskuupäeval. Aegumistähtaeg: kajastamiskuupäev + 6 kuud

EBA instrumendi valuuta: USA dollar

404. Lühike positsioon, 30 000 barreli Brenti toornafta müügioptsioon (pikk positsioon WTI, lühike positsioon USA dollar). Arveldatud rahas. Täitmishind: 12 kuu päeva lõpu forvardhind kajastamiskuupäeval. Aegumistähtaeg: kajastamiskuupäev + 6 kuud

EBA instrumendi valuuta: USA dollar

405. Pikk positsioon, 5 000 troiuntsi Londoni kulla ostuoptsioon (pikk positsioon kuld, lühike positsioon USA dollar). Arveldatud rahas. Täitmishind: 18 kuu päeva lõpu forvardhind kajastamiskuupäeval. Aegumistähtaeg: kajastamiskuupäev + 18 kuud

EBA instrumendi valuuta: USA dollar

KREDIIDIRISKI MARGINAAL

501. Pikk positsioon (st kaitse ostmine), 1 000 000 USA dollarit, Portugali krediidiriski vahetustehing.

Restruktureerimisklausel: TÄIELIK

EBA instrumendi valuuta: USA dollar

502. Pikk positsioon (st kaitse ostmine), 1 000 000 USA dollarit, Itaalia krediidiriski vahetustehing.

Restruktureerimisklausel: TÄIELIK
EBA instrumendi valuuta: USA dollar

503. Lühike positsioon (st kaitse müümine), 1 000 000 USA dollarit, Hispaania krediidiriski vahetustehing.

Restruktureerimisklausel: TÄIELIK
EBA instrumendi valuuta: USA dollar

504. Pikk positsioon (st kaitse ostmine), 1 000 000 USA dollarit, Mehhiko krediidiriski vahetustehing.

Restruktureerimisklausel: TÄIELIK
EBA instrumendi valuuta: USA dollar

505. Pikk positsioon (st kaitse ostmine), 1 000 000 USA dollarit, Brasiilia krediidiriski vahetustehing.

Restruktureerimisklausel: TÄIELIK
EBA instrumendi valuuta: USA dollar

506. Pikk positsioon (st kaitse ostmine), 1 000 000 USA dollarit, Ühendkuningriigi krediidiriski vahetustehing.

Restruktureerimisklausel: TÄIELIK
EBA instrumendi valuuta: USA dollar

507. Lühike positsioon (st kaitse müümine), 1 000 000 eurot, Telefonica (tähis TEF SM) krediidiriski vahetustehing.

EBA instrumendi valuuta: euro

508. Pikk positsioon (st kaitse ostmine), 1 000 000 eurot, Telefonica (tähis TEF SM) krediidiriski vahetustehing.

Lõpptähtaeg: detsember aasta T+2
EBA instrumendi valuuta: euro

509. Lühike positsioon (st kaitse müümine), 1 000 000 eurot, Aviva (tähis AV LN) krediidiriski vahetustehing.

ISDA 2003. aasta määratlused
EBA instrumendi valuuta: euro

510. Pikk positsioon (st kaitse ostmine), 1 000 000 eurot, Aviva (tähis AV LN) krediidiriski vahetustehing.

ISDA 2003. aasta määratlused
Lõpptähtaeg: detsember aasta T+2
EBA instrumendi valuuta: euro

511. Lühike positsioon (st kaitse müümine), 1 000 000 eurot, Vodafone (tähis VOD LN) krediidiriski vahetustehing.

EBA instrumendi valuuta: euro

512. Lühike positsioon (st kaitse müümine), 1 000 000 eurot, ENI SpA (tähis ENI IM) krediidiriski vahetustehing.

EBA instrumendi valuuta: euro

513. Lühike positsioon (st kaitse müümine), 1 000 000 USA dollarit, Eli Lilly (tähis LLY US) krediidiriski vahetustehing.

Restruktureerimisklausel: ei saa restruktureerida (XR14)
EBA instrumendi valuuta: USA dollar

514. Lühike positsioon (st kaitse müümine), 1 000 000 eurot, Unileveri (tähis UNA NA) krediidiriski vahetustehing.

EBA instrumendi valuuta: euro

515. Pikk positsioon (st kaitse ostmine), 1 000 000 eurot, Total SA (tähis FP FP) krediidiriski vahetustehing.

EBA instrumendi valuuta: euro

516. Pikk positsioon (st kaitse ostmine), 1 000 000 eurot, Volkswagen Groupi (tähis VOW GR) krediidiriski vahetustehing.

EBA instrumendi valuuta: euro

517. Pikk positsioon Türgi riigivõlakirjades 1 000 000 USA dollarit (ISIN US900123CT57).

Lõpptähtaeg: 26. aprill 2029

EBA instrumendi valuuta: USA dollar

518. Pikk positsioon (st kaitse ostmine), 1 000 000 USA dollarit, Türgi krediidiriski vahetustehing. Jõustumiskuupäev on kajastamiskuupäev.

Restruktureerimisklausel: TÄIELIK

EBA instrumendi valuuta: USA dollar

519. Pikk positsioon Telefonica võlakirjades 1 000 000 eurot (ISIN XS1681521081).

Lõpptähtaeg: 12. jaanuar 2028

EBA instrumendi valuuta: euro

520. Pikk positsioon Volkswagen Groupi võlakirjades, 1 000 000 eurot, (ISIN XS2234567233).

Lõpptähtaeg: 22. september 2028

EBA instrumendi valuuta: euro

521. Lühike positsioon Volkswagen Groupi võlakirjades, 1 000 000 eurot, (ISIN XS1167667283).

Lõpptähtaeg: 16. jaanuar 2030

EBA instrumendi valuuta: euro

522. Pikk positsioon Total SA võlakirjades 1 000 000 eurot (ISIN XS1856281834).

Lõpptähtaeg: 11. juuli 2033

EBA instrumendi valuuta: euro

523. Pikk positsioon Austria riigivõlakirjades 1 000 000 eurot (ISIN AT0000A04967).

Lõpptähtaeg: 15. märts 2037

EBA instrumendi valuuta: euro

524. Pikk positsioon (st kaitse ostmine), 1 000 000 USA dollarit, Austria krediidiriski vahetustehing.

Lõpptähtaeg: juuni aasta T+15.

EBA instrumendi valuuta: USA dollar

525. Pikk positsioon Madalmaade riigivõlakirjades 1 000 000 eurot (ISIN NL0013552060).

Lõpptähtaeg: 15. jaanuar 2040

EBA instrumendi valuuta: euro

526. Pikk positsioon (st kaitse ostmine), 1 000 000 USA dollarit, Madalmaade krediidiriski vahetustehing.

Lõpptähtaeg: juuni aasta T+20.

EBA instrumendi valuuta: USA dollar

527. Pikk positsioon Belgia riigivõlakirjades 1 000 000 eurot (ISIN BE0000348574).

Lõpptähtaeg: 22. juuni 2050

EBA instrumendi valuuta: euro

528. Pikk positsioon (st kaitse ostmine), 1 000 000 USA dollarit, Belgia krediidiriski vahetustehing.

Lõpptähtaeg: juuni aasta T+30.

EBA instrumendi valuuta: USA dollar

529. Pikk positsioon (kaitse ostmine), 10 000 000 eurot, iTraxx Europe indeksi on-the-run seeria krediidiriski vahetustehingus.

Lõpptähtaeg: juuni aasta T+4.

EBA instrumendi valuuta: euro

530. Lühike positsioon müügioptsioonis. 10 000 000 eurot. Alusvara iTraxx Europe indeksi on-the-run seeria (sama instrument nagu 529).

Täitmishind: ATM

Aegumistähtaeg: kajastamiskuupäev + 6 kuud

EBA instrumendi valuuta: euro

531. Pikk positsioon, AXA SA (realiseeritav), 1 000 000 eurot (ISIN XS1799611642).

Lõpptähtaeg: 28. mai 2049

EBA instrumendi valuuta: euro

532. Pikk positsioon, AT&T võlakiri (realiseeritav), 1 000 000 USA dollarit (ISIN US00206RFW79).

Lõpptähtaeg: 15. august 2037

EBA instrumendi valuuta: USA dollar

533. Pikk positsioon, BAYER AG (realiseeritav), 1 000 000 eurot (ISIN XS2199266268).

Lõpptähtaeg: 6. jaanuar 2030

EBA instrumendi valuuta: euro

534. Pikk positsioon, ORANGE SA võlakiri (realiseeritav), 1 000 000 eurot (ISIN FR0013323870).

Lõpptähtaeg: 20. märts 2028

EBA instrumendi valuuta: euro

KORRELATSIOONIL PÕHINEVAD KAUPLEMISPORTFELLID

601. Lühike positsioon (st kaitse müümine) iTraxx Europe indeksi on-the-run seerias.

Alumine eraldamispunkt: 3 %.

Ülemine eraldamispunkt: 6 %.

Tinglik väärtus: 5 000 000 eurot

Lõpptähtaeg: 5 aastat

EBA instrumendi valuuta: euro

602. Pikk positsioon (st kaitse ostmine), 5 000 000 eurot, iTraxx Europe indeksi kõige hiljutisema on-the-run seeria krediidiriski vahetustehing.

Lõpptähtaeg: juuni aasta T+4.

EBA instrumendi valuuta: euro

Kohandatud tinglik väärtus, et täielikult maandada CS01 601, ilma et oleks vaja uuesti maandada.

603. Pikk positsioon (st kaitse ostmine) iTraxx Europe indeksi on-the-run seerias.

Alumine eraldamispunkt: 3 %.

Ülemine eraldamispunkt: 6 %.

Tinglik väärtus: 5 000 000 eurot

Lõpptähtaeg: 5 aastat

EBA instrumendi valuuta: euro

604. Lühike positsioon (st kaitse müümine), 5 000 000 eurot, iTraxx Europe indeksi kõige hiljutisema on-the-run seeria krediidiriski vahetustehing.

Lõpptähtaeg: juuni aasta T+4.

EBA instrumendi valuuta: euro

Kohandatud tinglik väärtus, et täielikult maandada CS01 603, ilma et oleks vaja uuesti maandada.

605. Lühike positsioon (st kaitse müümine) iTraxx Europe indeksi on-the-run seerias.

Alumine eraldamispunkt: 12 %.

Ülemine eraldamispunkt: 100 %.

Tinglik väärtus: 5 000 000 eurot

Lõpptähtaeg: 5 aastat

EBA instrumendi valuuta: euro

606. Pikk positsioon (st kaitse ostmine), 5 000 000 eurot, iTraxx Europe indeksi kõige hiljutisema on-the-run seeria krediidiriski vahetustehing.

Lõpptähtaeg: juuni aasta T+4.

EBA instrumendi valuuta: euro

Kohandatud tinglik väärtus, et täielikult maandada CS01 605, ilma et oleks vaja uuesti maandada.

607. Pikk positsioon (st kaitse ostmine) iTraxx Europe indeksi on-the-run seerias.

Alumine eraldamispunkt: 12 %.

Ülemine eraldamispunkt: 100 %.

Tinglik väärtus: 5 000 000 eurot

Lõpptähtaeg: 5 aastat

EBA instrumendi valuuta: euro

608. Lühike positsioon (st kaitse müümine), 5 000 000 eurot, iTraxx Europe indeksi kõige hiljutisema on-the-run seeria krediidiriski vahetustehing.

Lõpptähtaeg: juuni aasta T+4.

EBA instrumendi valuuta: euro

Kohandatud tinglik väärtus, et täielikult maandada CS01 607, ilma et oleks vaja uuesti maandada.

609. Lühike positsioon (st kaitse müümine) iTraxx Europe indeksi on-the-run seerias.

Alumine eraldamispunkt: 3 %.

Ülemine eraldamispunkt: 6 %.

Tinglik väärtus: 5 000 000 eurot

Lõpptähtaeg: 5 aastat

EBA instrumendi valuuta: euro

Sissenõudmismäär: 40 % fikseeritud.

610. Pikk positsioon (st kaitse ostmine), 5 000 000 eurot, iTraxx Europe indeksi kõige hiljutisema on-the-run seeria krediidiriski vahetustehing.

Lõpptähtaeg: juuni aasta T+4.

EBA instrumendi valuuta: euro

Kohandatud tinglik väärtus, et täielikult maandada CS01 609, ilma et oleks vaja uuesti maandada.

3. jagu: Individuaalsed portfellid – üks instrument

Finantsinstitutsioonid esitavad järgmiste individuaalsete portfellide nõutavad riskinäitajad koos nüüdisväärtusega.

Portfell	*Instrumentide kombinatsioon.* Esimene arv tähistab instrumenti (nagu on osutatud käesoleva lisa 2. jaos). Teine arv näitab iga instrumendi kogust või lepingute arvu.	EBA portfelli valuuta	Nõutavad riskinäitajad
1001	101 – 1 instrument	euro	VaR; Stressiolukorra VaR; SBM; DRC; RRAO
1002	102 – 1 instrument	euro	VaR; Stressiolukorra VaR; SBM; DRC; RRAO
1003	103 – 1 instrument	euro	VaR; Stressiolukorra VaR; SBM; DRC; RRAO
1004	104 – 1 instrument	euro	VaR; Stressiolukorra VaR; SBM; DRC; RRAO
1005	105 – 1 instrument	euro	VaR; Stressiolukorra VaR; SBM; DRC; RRAO
1006	106 – 1 instrument	Inglise nael	VaR; Stressiolukorra VaR; SBM; DRC; RRAO
1007	107 – 1 instrument	euro	VaR; Stressiolukorra VaR; SBM; DRC; RRAO
1008	108 – 1 instrument	euro	VaR; Stressiolukorra VaR; SBM; DRC; RRAO
1009	109 – 1 instrument	euro	VaR; Stressiolukorra VaR; SBM; DRC; RRAO
1010	110 – 1 instrument	euro	VaR; Stressiolukorra VaR; SBM; DRC; RRAO
1011	111 – 1 instrument	USA dollar	VaR; Stressiolukorra VaR; SBM; DRC; RRAO
1012	112 – 1 instrument	USA dollar	VaR; Stressiolukorra VaR; SBM; DRC; RRAO
1013	113 – 1 instrument	euro	VaR; Stressiolukorra VaR; SBM; DRC; RRAO
1014	114 – 1 instrument	euro	VaR; Stressiolukorra VaR; SBM; DRC; RRAO
1015	115 – 1 instrument	Inglise nael	VaR; Stressiolukorra VaR; SBM; DRC; RRAO
1016	116 – 1 instrument	Inglise nael	VaR; Stressiolukorra VaR; SBM; DRC; RRAO
1017	117 – 1 instrument	Jaapani jeen	VaR; Stressiolukorra VaR; SBM; DRC; RRAO
1018	118 – 1 instrument	euro	VaR; Stressiolukorra VaR; SBM; DRC; RRAO

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

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

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

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

4. jagu: Individuaalsed portfellid – mitu instrumenti

Finantsinstitutsioonid esitavad järgmiste individuaalsete portfellide nõutavad riskinäitajad koos nüüdisväärtusega.

Portfell	*Instrumentide kombinatsioon.* Esimene arv tähistab instrumenti (nagu on osutatud käesoleva lisa 2. jaos). Teine arv näitab iga instrumendi kogust või lepingute arvu.	EBA portfelli valuuta	Nõutavad riskinäitajad
1101	103 – 1 instrument 104 – 1 instrument 105 – 1 instrument	euro	VaR; Stressiolukorra VaR; SBM; DRC; RRAO
1102	113 – 1 instrument 110 – 1 instrument	euro	VaR; Stressiolukorra VaR; SBM; DRC; RRAO
1103	115 – 1 instrument 116 – 1 instrument	Inglise nael	VaR; Stressiolukorra VaR; SBM; DRC; RRAO
1104	109 – 1 instrument 110 – 1 instrument	euro	VaR; Stressiolukorra VaR; SBM; DRC; RRAO

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

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

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

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

5. jagu: koondportfellid

Finantsinstitutsioonid esitavad järgmiste finantskoondportfellide nõutavad riskinäitajad koos nüüdisväärtusega.

Koond- portfell	Kirjeldus	*Individuaalsete portfellide kombinatsioon* (individuaalsed portfellid, nagu on märgitud numbritega käesoleva lisa 3. ja 4. jaos)	EBA portfelli valuuta	Nõutavad riskinäitajad
10000	Koguportfell, muu kui korrelatsioonil põhinev kauplemisportfell	1001, 1101, 1104, 1106, 2001, 2002, 2203, 2206, 3301, 3303, 3304, 4401, 4402, 5503, 5506, 5508, 5521	euro	VaR; Stressiolukorra VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
11000	AKTSIAD, kumulatiivne	1001, 1101, 1104, 1106	euro	VaR; Stressiolukorra VaR; SBM; DRC; RRAO
12000	INTRESSIMÄÄR, kumulatiivne	2001, 2002, 2203, 2206	euro	VaR; Stressiolukorra VaR; SBM; DRC; RRAO
13000	VALUUTA, kumulatiivne	3301, 3303, 3304	euro	VaR; Stressiolukorra VaR; SBM; DRC; RRAO
14000	KAUBAD, kumulatiivne	4401, 4402	USA dollar	VaR; Stressiolukorra VaR; SBM; DRC; RRAO
15000	Krediidiriski marginaal, kumulatiivne	5503, 5506, 5508, 5521	euro	VaR; Stressiolukorra VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
16000	Korrelatsioonil põhinev kauplemisportfell, euro	6601, 6602	euro	VaR; Stressiolukorra VaR; APR; SBM; DRC; RRAO

6. jagu: instrumentide täiendavad spetsifikatsioonid

Finantsinstitutsioonid kohaldavad käesoleva lisa 2. jaos kirjeldatud finantsinstrumentide puhul järgmisi täiendavaid spetsifikatsioone:

Instrument:	220
Kirjeldus:	Viieaastane turuhinnas hinnatud EUR/USD intressimäära vahetustehing. Saadakse USD ja makstakse EUR. Tinglik väärtus: 10 000 000 eurot, (10 000 000 eurot * USD/EUR kurss) dollarit
Makstakse:	ujuv pool 2
Saadakse:	ujuv pool 1
Tinglik vahetus ja korrigeerimine:	Jõustumiskuupäeval ja lõpptähtajal. Lisaks tehakse igal kupongimakse kuupäeval lisamakse, mis vastab ujuva poole 2 USA dollarites tingliku väärtuse korrigeerimisele. Tinglikku väärtust USA dollarites korrigeeritakse nii, et see võrduks 10 000 000 euroga hetkekursi alusel kaks tööpäeva enne iga maksekuupäeva.
Rahasaldo	lisatud
Ujuv pool 1	
Tinglik väärtus:	10 000 000 euroga samaväärne väärtus konverteerituna USA dollariteks hetkekursiga jõustumiskuupäeval, samaväärsust kohandatakse kord kvartalis.
Jõustumiskuupäev:	kajastamiskuupäev + 6 kuud
Lõpptähtaeg:	kajastamiskuupäev + 5,5 aastat
Maksekuupäeva genereerimine:	jõustumiskuupäevast edasi
Kupongimaksete sagedus:	kord kvartalis
Kupongimäär:	kolme kuu SOFR + 0 baaspunkti.
Kupongimäära korrigeerimise sagedus:	kord kvartalis
Kupongimäärade kindlaksmääramise tava:	liidetud kord päevas kolme kuu jooksul
Kupongimäära liitmise sagedus:	lihtintress
Päevade arv:	tegelik/360
Makse tegemise tööpäev:	LON, NYC, TARGET
Makse tegemise tööpäevade tava:	muudetakse järgnevalt
Tingliku väärtuse korrigeerimise tööpäev:	LON, NYC, TARGET
Tingliku väärtuse korrigeerimise tööpäeva tava:	eelmine
Kupongimäära korrigeerimise tööpäev:	LON, NYC, TARGET
Kupongimäära korrigeerimise tööpäeva tava:	eelmine

Ujuv pool 2	
Tinglik väärtus:	10 000 000 eurot
Jõustumiskuupäev:	kajastamiskuupäev + 6 kuud
Lõpptähtaeg:	kajastamiskuupäev + 5,5 aastat
Maksekuupäeva genereerimine:	jõustumiskuupäevast edasi
Kupongimaksete sagedus:	kord kvartalis
Kupongimäär:	kolme kuu ESTER + 0 baaspunkti.
Kupongimäära korrigeerimise sagedus:	kord kvartalis
Kupongimäärade kindlaksmääramise tava:	liidetud kord päevas kolme kuu jooksul
Kupongimäära liitmise sagedus:	lihtintress
Päevade arv:	tegelik/360
Makse tegemise tööpäev:	LON, NYC, TARGET
Makse tegemise tööpäev:	muudetakse järgnevalt
Tingliku väärtuse korrigeerimise tööpäev:	LON, NYC, TARGET
Tingliku väärtuse korrigeerimise tööpäeva tava:	eelmine
Kupongimäära korrigeerimise tööpäev:	LON, NYC, TARGET
Kupongimäära korrigeerimise tööpäeva tava:	eelmine“

7. jagu: SBMi valideerimisportfellid

a) Finantsinstitutsioonid esitavad X lisas määratletud portfellide (SBMi valideerimisportfellid) SBMi riskinäitaja IMVd käsitleva teabe osana ja kooskõlas IMVd käsitleva teabe esitamise aruandekuupäevadega.

b) SBMi valideerimisportfellidele vastavate tulemuste esitamisel kohaldatakse järgmist:

i. Finantsinstitutsioonid esitavad ainult vormi C120.02 ja piirduvad selles vormis valuutatulemuste aruandlusega (st SBMi valideerimisportfellide puhul vormi C120.02 veergu 0060 ei täideta ning vorme C 106.00 ja C 106.01 ei esitata).

ii. Finantsinstitutsioonid eeldavad, et X lisas kindlaks määratud instrumentidega määratletud riskitundlikkused ja kumerusriski positsioonid on väljendatud finantsinstitutsiooni aruandlusvaluutas ning et teave esitatakse vormingus, mis on kindlaks määratud vormide C 106.01 / C 120.01 aruandlusjuhistes ja VI lisa (vormide täitmise juhised) vastavas tabelis esitatud juhistes nende vormide täitmise kohta.“

III LISA

„VI LISA

JÄRELEVALVEGA SEOTUD VÕRDLUSPORTFELLIDE TULEMUSED

VORMIDE TÄITMISE JUHISED

C 106.00 – Esialgne turuväärtus ja väljajätmise põhjendus 57
C 106.01 – SBM. Riskitundlikkused instrumentide kaupa 57
C 107.01 – VaR riskiväärtuse ja stressiolukorra VaR riskiväärtuse mittekorrelatsioonil põhinev kauplemisportfell. Üksikasjad 61
C 107.02 – VaR riskiväärtus, stressiolukorra VaR riskiväärtus ja nüüdisväärtus – mittekorrelatsioonil põhinev kauplemisportfell. Tulemused EBA portfelli valuutas 63
C 108.00 – Kasumi/kahjumi aegread 64
C 109.01 – Täiendavate riskide omavahendite nõue. Mudeli üksikasjad 65
C 109.02 – Täiendavate riskide omavahendite nõue. Üksikasjad portfellide kaupa 65
C 109.03 – Täiendavate riskide omavahendite nõue. Summa portfellide/kuupäevade kaupa 66
C 110.01 – Korrelatsioonikauplemine. Mudeli üksikasjad. 67
C 110.02 – Korrelatsioonikauplemine. Üksikasjad portfellide kaupa. 68
C 110.03 – Korrelatsioonikauplemine. Kõik hinnariskid portfellide/kuupäevade kaupa 69
C 120.01 – SBM. RISKITUNDLIKKUSED INSTRUMENTIDE/PORTFELLIDE KAUPA 69
C 120.02 – SBM. OFR KOOSSEIS PORTFELLIDE KAUPA 72
C 120.04 – DRC. TURUVÄÄRTUSED JA OOTAMATULT MAKSEVIIVITUSSE SATTUMISE (JTD) BRUTOSUMMAD INSTRUMENTIDE/PORTFELLIDE KAUPA 74
C 120.05 – DRC. OFR KOOSSEIS PORTFELLIDE KAUPA 80
C 120.06 – Alternatiivne standardmeetod. OFR 82

VORMIDE TÄITMISE JUHISED

C 106.00 – Esialgne turuväärtus ja väljajätmise põhjendus

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0010	Instrumendi number	V lisa 2. jagu	Esitatakse V lisast võetud instrumendi number.
0020	Instrument modelleeritud VaR riskiväärtuse ja stressiolukorra VaR riskiväärtuse jaoks (ÕIGE/VALE)		Märgitakse kas ÕIGE või VALE.
0030	Instrument modelleeritud täiendavate riskide omavahendite nõude jaoks (ÕIGE/VALE)		Märgitakse kas ÕIGE või VALE.
0040	Instrument modelleeritud korrelatsioonikauplemise jaoks (ÕIGE/VALE)		Märgitakse kas ÕIGE või VALE.
0050	Väljajätmise põhjendus	Artikli 3 lõige 2	Märgitakse üks järgmistest: a) reguleeriv asutus ei ole mudelit lubanud; b) instrument või alusvara ei ole asutusesiseselt lubatud; c) alusvara või modelleerimise tunnust ei ole asutusesiseselt kokku lepitud; d) väljajätmise muu põhjendus. Palun selgitada seda põhjendust veerus 0060.
0060	Vabateksti lahter		Selles veerus saab finantsinstitutsioon esitada lisateavet.
0070	Esialgne turuväärtus		Iga instrumendi turuväärtus aruandekuupäeval kell 17.30 Kesk-Euroopa aja järgi (nagu on osutatud V lisa 1. jao punktis b). Lahter jäetakse tühjaks, kui finantsinstitutsioon ei soovi esitada teatava portfelli esialgset turuväärtust (st nullväärtus esitatakse üksnes juhul, kui arvutuse tulemus on null).

C 106.01 – SBM. Riskitundlikkused instrumentide kaupa

Finantsinstitutsioonid esitavad tundlikkused riskitegurite suhtes, millele instrument on avatud. Iga riskiteguri/tundlikkuse kohta esitatakse üks rida. Selle riskiteguri ülespoole liikumisest tingitud netokumerusriskipositsioon (CVRk+) või selle riskiteguri allapoole liikumisest tingitud netokumerusriskipositsioon (CVRk–), nagu on sätestatud määruse (EL) nr 575/2013 artiklis 325g, esitatakse eraldi ridadel. Kõik väärtused osutavad „Esialgse turuväärtuse (ja algse tundlikkusel põhineva meetodi) aruandekuupäevale“ (nagu on kindlaks määratud käesoleva määruse V lisa 1. jao punkti b alapunktis ii). Finantsinstitutsioonid esitavad instrumendi numbri, riskitunnuse (veerg 0010), rühma (veerg 0020) ja täiendava tunnuse (veerg 0030) iga kombinatsiooni ainult üks kord.

Töölehti käsitlevad juhised (z-telg)

Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
Instrumendi number	V lisa 2. jagu	Esitatakse V lisast võetud instrumendi number.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0010	Riskiteguri tunnus	Määruse (EL) nr 575/2013 artiklid 325l, 325m, 325n, 325o, 325p ja 325q	Esitatakse käesoleva lisa lõpus olevas tabelis esitatud riskiteguri tunnus.
0020	Rühm	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325d lõige 3	Rühm märgitakse juhul, kui veerus 0010 valitud riskiteguri tunnus vastab riskiklassile: — intressimäära üldrisk, on vastus asjaomase riskivaba intressimäära, inflatsiooni või eri valuutade alusriski riskiteguri valuuta nimetus (kasutades ISO 4217 kohast valuuta tähist, nt „EUR“); — muu kui väärtpaberistamise krediidimarginaali risk, on vastus määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325ah lõike 1 tabelis 4 esitatud rühma number; — alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli mittekuuluva väärtpaberistamise krediidimarginaali risk (non-ACTP CSR), on vastus kõnealuse määruse artikli 325am lõike 1 tabelis 7 esitatud rühma number; — alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli kuuluva väärtpaberistamise krediidimarginaali risk (ACTP CSR), on vastus kõnealuse määruse artikli 325ak tabelis 6 esitatud rühma number; — aktsiarisk, on vastus kõnealuse määruse artikli 325ap lõike 1 tabelis 8 esitatud rühma number; — kaubarisk, on vastus kõnealuse määruse artikli 325as tabelis 9 esitatud rühma number; — valuutarisk ja Delta või kumeruse komponendid, on vastus valuuta nimetus (nt „USD“, valuutakoodide puhul kasutatakse ISO 4217 kohast valuuta tähist); — valuutarisk ja Vega komponent, on vastus valuutapaari nimetus (nt EUR_USD, valuutakoodide puhul kasutatakse ISO 4217 kohast valuuta tähist).
0030	Täiendav tunnus1	Määruse (EL) nr 575/2013 artiklid 325l–325q ja artikkel 325ai	Esitatakse järgmine teave riskiteguri eristamise kohta rühmasisesel tasandil. Kui veerus 0010 valitud riskiteguri tunnus vastab riskiklassile: — intressimäära üldrisk ning Delta komponent ja riskitegur, on vastus riskivaba kõvera nimetus või muu vastav kordumatu tunnus; — muu kui väärtpaberistamise krediidimarginaali risk või riskliklassile alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli kuuluva väärtpaberistamise krediidimarginaali risk (ACTP CSR), on vastus on emitendi nimi või muu vastav kordumatu tunnus ning see on identne mis tahes kahe sellise kajastatud tundlikkuse puhul kahe riskiteguri suhtes,

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
			mille korrelatsiooniparameeter $\rho_{kl}^{(name)}$ võrdub 1 vastavalt määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325ai lõikele 1; — alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli mittekuuluva väärtpaberistamise krediidimarginaali risk (non-ACTP CSR), on vastus seeria nimi või muu vastav kordumatu tunnus; — aktsiarisk, on vastus aktsiaemitendi nimi või vastav kordumatu tunnus; — kaubarisk, on vastus kauba nimi või muu vastav kordumatu tunnus. Kui ükski nendest juhtudest ei ole kohaldatav, esitavad finantsinstitutsioonid kindla väärtuse (NULL) kui mitte kohaldatava.
0050	Riskitundlikkus (tulemused aruandlusvaluutas)	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325d lõige 2 ning artiklid 325g, 325r, 325s, 325t ja 325ax	Riskitundlikkused (delta/vega tundlikkused ja kumerusriski positsioonid) kajastatakse iga instrumendi tasandil kõigi asjakohaste riskitegurite puhul, nagu on märgitud veergudes 0010–0030. Väärtused esitatakse finantsinstitutsiooni aruandlusvaluutas. Kui veerus 0010 valitud riskiteguri tunnus vastab: — tundlikkusel põhineva meetodi deltariski komponendile, kajastatakse netotundlikkus riskiteguri suhtes (S_k), nagu on sätestatud määruse (EL) nr 575/2013 artiklis 325r. Kui finantsinstitutsioonid on saanud oma pädevalt asutuselt loa kasutada deltariski tundlikkuse alternatiivseid määratlusi vastavalt kõnealuse määruse artikli 325t lõikele 5, osutavad nad aruandluses nendele alternatiivsetele määratlustele; — tundlikkusel põhineva meetodi vegariski komponendile, kajastatakse optsiooni vegariski tundlikkus teatava riskiteguri suhtes(S_k), nagu on sätestatud määruse (EL) nr 575/2013 artiklis 325s. Kui finantsinstitutsioonid on saanud oma pädevalt asutuselt loa kasutada vegariski tundlikkuse alternatiivseid arvutusi vastavalt kõnealuse määruse artikli 325t lõikele 6, osutavad nad aruandluses nendele alternatiivsetele arvutustele. Olenemata sellest, kas finantsinstitutsioon kasutab kõnealuse määruse artikli 325s kohast määratlust või alternatiivset arvutust vastavalt artikli 325t lõikele 6, esitatakse tundlikkus pärast selle kaalumist vastava eeldatava volatiilsusega; — tundlikkusel põhineva meetodi kumerusriski komponendile, kajastatakse selle riskiteguri ülespoole liikumisest tingitud netokumerusriskipositsioon (CVR_k^+) või selle riskiteguri allapoole liikumisest tingitud netokumerusriskipositsioon (CVR_k^-), nagu on sätestatud määruse (EL) nr 575/2013 artiklis 325g. Esitatud arvu väljendatakse täpsusega vähemalt kaks kohta pärast koma. Nullväärtused esitatakse ainult juhul, kui arvutuse tulemus on tegelikult null.
0060	Aruandlusvaluuta		Esitatakse finantsinstitutsiooni aruandlusvaluuta nimetus (kasutatakse ISO 4217 kohast valuuta tähist, nt „EUR“).

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0070	Riskitundlikkus (tulemused EBA instrumendi valuutas)	Käesoleva määruse V lisa 2. jagu ja määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325d lõige 2 ning artiklid 325g, 325r ja 325s	Väärtused esitatakse vastavalt veeru 0050 juhistele, kuid ümberarvestatuna instrumendi valuuta EKP hetkekursiga, nagu on määratletud käesoleva määruse V lisa 2. jaos.
0080	Hinnastamismudel	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325t	Finantsinstitutsioon märgib, millist hinnastamismudelit kasutatakse tundlikkuste tuletamiseks. Märgitakse üks järgmistest: a) „finantsinstitutsiooni hinnastamismudelid, mis on aluseks kõrgema juhtkonna teavitamisel kasumi ja kahjumi kohta“ (nagu on sätestatud määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325t lõike 1 esimeses lõigus); b) „finantsinstitutsiooni sisemudeli meetod“ (nagu on sätestatud kõnealuse määruse artikli 325t lõike 1 teises lõigus).
0090	Tundlikkuse määratlus	Määruse (EL) nr 575/2013 artiklid 325r, 325s ja 325t	Finantsinstitutsioon märgib, millist tundlikkuse määratlust omavahendite nõuete arvutamisel kohaldatakse. Märgitakse üks järgmistest: a) „määruse (EL) nr 575/2013 artiklite 325r ja 325s kohane tundlikkuse määratlus“; b) „määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325t lõigete 5 ja 6 kohane tundlikkuse määratlus“. Kui veerus 0010 valitud riskiteguri tunnus vastab tundlikkusel põhineva meetodi kumerusriski komponendile, esitatakse punktis b osutatud väärtus, kui mõni kajastatud kumerusriski positsiooni arvutamisel kasutatud tundlikkus põhineb määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325t lõigete 5 ja 6 kohasel tundlikkuse määratlusel, ning muul juhul esitatakse punktis a osutatud väärtus.
0100	Vabateksti lahter		Finantsinstitutsioon võib selles veerus esitada lisateavet kohaldatava hinnastamismudeli ja tundlikkuse määratluse kohta.
0110	Täiendav tunnus2	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325p lõige 2	Kui veerus 0010 valitud riskiteguri tunnus vastab kaubariski klassile ja tundlikkusel põhineva meetodi deltariski komponendile, on vastus juriidilised tingimused seoses üleandmise asukohaga või muu vastav kordumatu tunnus. Kui ükski nendest juhtudest ei ole kohaldatav, esitavad finantsinstitutsioonid kindla väärtuse (NULL) kui mitte kohaldatava.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0120	Krediidikvaliteedi kategooria	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325m lõige 1 ja artikli 325ah lõige 1	Kui veerus 0010 valitud riskiteguri tunnus vastab muu kui väärtpaberistamise krediidimarginaali riski klassile ja tundlikkusel põhineva meetodi deltariski komponendile, on vastus üks järgmistest: a) „krediidikvaliteedi aste 1“; b) „krediidikvaliteedi aste 2“; c) „krediidikvaliteedi aste 3“; d) „krediidikvaliteedi aste 4“; e) „krediidikvaliteedi aste 5“; f) „krediidikvaliteedi aste 6“; g) „krediidikvaliteedi astet ei ole määratud (reitinguta)“. Kui ükski nendest juhtudest ei ole kohaldatav, esitavad finantsinstitutsioonid kindla väärtuse (NULL) kui mitte kohaldatava.

C 107.01 – VaR riskiväärtuse ja stressiolukorra VaR riskiväärtuse mittekorrelatsioonil põhinev kauplemisportfell. Üksikasjad.

Rida	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0010 - 0060	VaR riskiväärtus		
0010	Metoodika		Veerus 0010 märgitakse üks järgmistest: a) varasemate perioodide andmetel põhinev simulatsioon; b) Monte Carlo simulatsioon; c) parameetriline metoodika; d) kombinatsioon / muu metoodika (palun täpsustage). Veerus 0010 antud vastuse selgitamiseks kasutab finantsinstitutsioon veergu 0020. Kui veerus 0010 märgiti variant d, peab finantsinstitutsioon esitama veerus 0020 üksikasjad.
0020	Kümnepäevase perioodi arvutamine	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 365 lõige 1	Veerus 0010 märgitakse üks järgmistest: a) üks päev, mis on ümber arvutatud kümneks päevaks; b) kümme päeva kattuvate perioodidega; c) kümme päeva muu metoodika kohaselt. Veerus 0010 antud vastuse selgitamiseks kasutab finantsinstitutsioon veergu 0020.
0030	Vaatlusperioodi pikkus	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 365 lõike 1 punkt d	Veerus 0010 märgitakse üks järgmistest: a) kuni üks aasta; b) üle ühe aasta ja kuni kaks aastat; c) üle kahe aasta ja kuni kolm aastat; d) üle kolme aasta. Veerus 0010 antud vastuse selgitamiseks kasutab finantsinstitutsioon veergu 0020.

Rida	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0040	Andmete kaalumine	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 365 lõike 1 punkt d	Veerus 0010 märgitakse üks järgmistest: a) kaalumata (VaR andmete kaalumine); b) kaalutud (VaR andmete kaalumine); c) suurim punktides a ja b kaalutud ja kaalumata andmetest (VaR andmete kaalumine). Veerus 0010 antud vastuse selgitamiseks kasutab finantsinstitutsioon veergu 0020.
0050	Järeltestimise lisand	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 366 lõige 2	Järeltestimise lisand tähendab määruse (EL) nr 575/2013 artikli 366 lõike 2 tabeli 1 kohast liidetavat, mille vahemik on 0–1. Veerus 0010 antud vastuse selgitamiseks kasutab finantsinstitutsioon veergu 0020.
0060	VaR regulatiivne lisand	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 366 lõige 2 (vähemalt arv 3)	VaR regulatiivne lisand tähendab lisandit, mille pädev asutus on kehtestanud vastavalt määruse (EL) nr 575/2013 artikli 366 lõikele 2 VaR riskiväärtuse korrigeerimise korrutusteguri suhtes (vähemalt 3). VaR regulatiivne lisand on järeltestimise lisandi ja asjakohasel juhul kvalitatiivse lisandi summa, mis ületab 3. Veerus 0010 antud vastuse selgitamiseks kasutab finantsinstitutsioon veergu 0020.
0070 - 0100	SVaR (st stressiolukorra VaR riskiväärtus)		
0070	Metoodika		Veerus 0010 märgitakse üks järgmistest: a) varasemate perioodide andmetel põhinev simulatsioon; b) Monte Carlo simulatsioon; c) parameetriline metoodika; d) kombinatsioon / muu metoodika (palun täpsustage). Veerus 0010 antud vastuse selgitamiseks kasutab finantsinstitutsioon veergu 0020. Kui veerus 0010 märgiti variant d, peab finantsinstitutsioon esitama veerus 0020 üksikasjad.
0080	Kümnepäevase perioodi arvutamine	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 365 lõige 1	Veerus 0010 märgitakse üks järgmistest: a) üks päev, mis on ümber arvutatud kümneks päevaks; b) kümme päeva kattuvate perioodidega; c) kümme päeva muu metoodika kohaselt. Veerus 0010 antud vastuse selgitamiseks kasutab finantsinstitutsioon veergu 0020.
0090	Stressiolukorra VaR regulatiivne lisand	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 366 lõige 2	Regulatiivne lisand tähendab lisandit, mille pädev asutus on kehtestanud vastavalt määruse (EL) nr 575/2013 artikli 366 lõikele 2 stressiolukorra VaR riskiväärtuse korrigeerimise korrutusteguri suhtes (vähemalt 3). Regulatiivne lisand on kolme, järeltestimise lisandi ja kvalitatiivse lisandi (asjakohasel juhul) summa.

Rida	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
			Veerus 0010 antud vastuse selgitamiseks kasutab finantsinstitutsioon veergu 0020.
0100	Stressiolukorra VaR riskiväärtuse periood	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 365 lõige 2	Veerus 0010 märgitakse üks järgmistest: a) stressiolukorra VaR riskiväärtuse päevapõhine arvutus kalibreerituna üheks pidevaks 12-kuuliseks perioodiks alates veerus 0020 kindaks määratud kuupäevast; b) stressiolukorra VaR riskiväärtuse nädalapõhine arvutus kalibreerituna üheks pidevaks 12-kuuliseks perioodiks alates veerus 0020 kindaks määratud kuupäevast; c) stressiolukorra VaR riskiväärtuse päevapõhine arvutus kalibreerituna mitmeks pidevaks 12-kuuliseks perioodiks vormi C107.02 veerus 0010 esitatud stressiolukorra VaR riskiväärtuse esitamise kuupäevade ajal, alates veerus 0020 kindaks määratud kuupäevadest; d) stressiolukorra VaR riskiväärtuse nädalapõhine arvutus kalibreerituna mitmeks pidevaks 12-kuuliseks perioodiks vormi C107.02 veerus 0010 esitatud stressiolukorra VaR riskiväärtuse esitamise kuupäevade ajal, alates veerus 0020 kindaks määratud kuupäevadest; e) mitmeks pidevaks 12-kuuliseks perioodiks kalibreeritud stressiolukorra VaR riskiväärtuse päevapõhiste arvutuste maksimum; f) mitmeks pidevaks 12-kuuliseks perioodiks kalibreeritud stressiolukorra VaR riskiväärtuse nädalapõhiste arvutuste maksimum; g) stressiolukorra VaR riskiväärtuse kalibreerimise muud võimalused (täpsustada). Finantsinstitutsioon kasutab veergu 0020, et esitada alguskuupäev vormingus „pp/kk/aaaa“ veerus 0010 esitatud variantide a või b puhul ning iga stressiolukorra VaR riskiväärtuse arvutamiseks kasutatud alguskuupäevad vormingus „pp/kk/aaaa“ veerus 0010 esitatud variantide c või d puhul. Finantsinstitutsioon kasutab veergu 0020 ka selleks, et selgitada 12-kuulist perioodi, mida on kasutatud iga stressiolukorra VaR riskiväärtuse arvutuse puhul, kui veerus 0010 on märgitud variandid e, f ja g.

C 107.02 – VaR riskiväärtus, stressiolukorra VaR riskiväärtus ja nüüdisväärtus – mittekorrelatsioonil põhinev kauplemisportfell. Tulemused EBA portfelli valuutas

Töölehti käsitlevad juhised (z-telg)

Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
Portfell	V lisa 3., 4. ja 5. jagu	Esitatakse V lisast võetud portfelli number.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0010	Kuupäev		VaR riskiväärtuse, stressiolukorra VaR riskiväärtuse ja nüüdisväärtuse tulemused esitatakse kõigi 10 tööpäeva kohta, mis jäävad „Riskinäitajate esialgse aruandekuupäeva“ ja „Riskinäitajate (ja lõpliku alternatiivse standardmeetodi) lõpliku aruandekuupäeva“ vahele (nagu on sätestatud V lisa 1. jao punktis b). Kuupäevade esitamiseks kasutatakse „pp/kk/aaaa“ vormingut.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0020	VaR riskiväärtus	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 365	Esitatakse iga portfelli kohta leitud kümne päeva regulatiivne VaR riskiväärtus, kohaldamata „vähemalt 3“ regulatiivset korrutustegurit. Näitajad esitatakse kõikide veerus 0010 esitatud kuupäevade kohta. Lahter jäetakse tühjaks, kui finantsinstitutsioon ei arvuta VaR riskiväärtust veerus 0010 esitatud kuupäeval (st nullväärtus esitatakse üksnes juhul, kui arvutuse tulemus on null).
0030	Stressiolukorra VaR riskiväärtus	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 365	Esitatakse iga portfelli kohta leitud kümne päeva regulatiivne stressiolukorra VaR riskiväärtus, kohaldamata „vähemalt 3“ regulatiivset korrutustegurit. Näitajad esitatakse kõikide veerus 0010 esitatud kuupäevade kohta. Lahter jäetakse tühjaks, kui finantsinstitutsioon ei arvuta stressiolukorra VaR riskiväärtust veerus 0010 esitatud kuupäeval (st nullväärtus esitatakse üksnes juhul, kui arvutuse tulemus on null).
0040	Nüüdisväärtus		Esitatakse iga portfelli nüüdisväärtus. Näitajad esitatakse kõikide veerus 0010 esitatud kuupäevade kohta. Lahter jäetakse tühjaks, kui finantsinstitutsioon ei arvuta nüüdisväärtust veerus 0010 esitatud kuupäeval (st nullväärtus esitatakse üksnes juhul, kui arvutuse tulemus on null).

C 108.00 – Kasumi/kahjumi aegread

Vormi C 108.00 („Kasumi/kahjumi aegread“) täidavad ainult need finantsinstitutsioonid, kes arvutavad VaR riskiväärtust varasemate perioodide andmetel põhineva simulatsiooni abil.

Töölehti käsitlevad juhised (z-telg)

Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
Portfell	V lisa 3., 4. ja 5. jagu	Esitatakse V lisast võetud portfelli number.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0010	Kuupäev	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 365 lõike 1 punkt d	Igal tööpäeval, mis on kindalaks määratud finantsinstitutsiooni jurisdiktsioonis kehtiva kalendri alusel, esitavad finantsinstitutsioonid kasumi/kahjumi aegread, mida on kasutatud Var riskiväärtuse arvutamiseks vormi C 107.02 veerus 0010 ja mis hõlmavad vähemalt 250 vaatlust alates riskinäitajate (ja lõpliku alternatiivse standardmeetodi) lõplikust aruandekuupäevast (nagu on kindlaks määratud V lisa 1. jao punkti b alapunktis v) ja minnes ajas tagasi.
0020	Igapäevane kasum/kahjum		Finantsinstitutsioonid, kes kasutavad VaR riskiväärtuse arvutamiseks varasemate perioodide andmetel põhinevat simulatsiooni, täidavad finantsinstitutsiooni kasutatud varasemate perioodide kogupikkuses andmeread (vähemalt üheaastased andmeread) portfelli väärtuse muutusega (st päevane kasum/kahjum), mis saadakse, kasutades varasemate perioodide simuleeritud päevaseid riskitegurite muutusi (st päevase kasumi/kahjumi aegread, mida kasutatakse regulatiivse ühe päeva VaR riskiväärtus tuletamiseks).

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
			Kui üks päevadest on asjaomases jurisdiktsioonis puhkepäev, siis jäetakse see lahter tühjaks (st nullväärtusega kasum/kahjum esitatakse üksnes juhul, kui portfelli hüpoteetiline väärtus ei ole asjaomasel tööpäeval muutunud).

C 109.01 – Täiendavate riskide omavahendite nõue. Mudeli üksikasjad

Rida	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0010	Modelleerimisel kasutatavate tegurite arv		EBA/GL/2012/3 Esitatakse modelleerimisel kasutatavate tegurite arv kogu täiendavate riskide omavahendite nõude mudeli tasandil. Vastus on üks järgmistest: a) 1 modelleerimisel kasutatav tegur; b) 2 modelleerimisel kasutatavat tegurit; c) rohkem kui 2 modelleerimisel kasutatavat tegurit. Veerus 0010 antud vastuse selgitamiseks kasutab finantsinstitutsioon veergu 0020.
0020	Makseviivitusest tingitud kahjude allikas		EBA/GL/2012/3 Esitatakse makseviivitusest tingitud kahjude allikas kogu täiendavate riskide omavahendite nõude mudeli tasandil. Vastus on üks järgmistest: a) turutava; b) sisereitingute meetodi puhul kasutatav makseviivitusest tingitud kahjumäär; c) makseviivitusest tingitud kahjumäära muu allikas (palun täpsustage). Veerus 0010 antud vastuse selgitamiseks kasutab finantsinstitutsioon veergu 0020. Kui veerus 0010 märgiti variant c, peab finantsinstitutsioon esitama selles veerus üksikasjad.

C 109.02 – Täiendavate riskide omavahendite nõue. Üksikasjad portfellide kaupa

Töölehti käsitlevad juhised (z-telg)

Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
Portfell	V lisa 3., 4. ja 5. jagu	Esitatakse V lisast võetud portfelli number üksnes nende portfellide kohta, mille puhul on nõutav täiendavate riskide omavahendite nõue.

Rida	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0010	Likviidsusperiood	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 374 lõige 5	EBA/GL/2012/3 Esitatakse portfelli tasandil kohaldatud likviidsusperiood. Vastus on üks järgmistest: a) kuni kolm kuud; b) üle kolme kuu ja kuni kuus kuud; c) üle kuue kuu ja kuni üheksa kuud; d) üle üheksa kuu ja kuni kaksteist kuud.
0020	Makseviivituste tõenäosuste allikas		EBA/GL/2012/3 Esitatakse portfelli tasandil kohaldatud makseviivituste tõenäosuste allikas. Vastus on üks järgmistest: a) reitinguagentuurid; b) sisereitingute meetod; c) turupõhised makseviivituse tõenäosused; d) muu makseviivituse tõenäosuste allikas (palun täpsustage). Veerus 0010 antud vastuse selgitamiseks kasutab finantsinstitutsioon veergu 0020. Kui veerus 0010 märgiti variant d, peab finantsinstitutsioon esitama veerus 0020 üksikasjad.
0030	Krediidikvaliteedi hinnangute muutmise maatriksite allikas		EBA/GL/2012/3 Esitatakse portfelli tasandil kohaldatud krediidikvaliteedi hinnangute muutmise maatriksite allikas. Vastus on üks järgmistest: a) reitinguagentuurid; b) sisereitingute meetod; c) turupõhised krediidikvaliteedi hinnangute muutmise maatriksid; d) muud krediidikvaliteedi hinnangute muutmise maatriksite allikad (palun täpsustage). Veerus 0010 antud vastuse selgitamiseks kasutab finantsinstitutsioon veergu 0020. Kui veerus 0010 märgiti variant d, peab finantsinstitutsioon esitama veerus 0020 üksikasjad.

C 109.03 – Täiendavate riskide omavahendite nõue. Summa portfellide/kuupäevade kaupa.

Töölehti käsitlevad juhised (z-telg)

Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
Portfell	V. lisa 3., 4. ja 5. jagu	Esitatakse V lisast võetud portfelli number üksnes nende portfellide kohta, mille puhul on nõutav täiendavate riskide omavahendite nõue.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0010	Kuupäev		Täiendavate riskide omavahendite nõue esitatakse kõigi 10 tööpäeva kohta, mis jäävad „Riskinäitajate esialgse aruandekuupäeva“ ja „Riskinäitajate (ja lõpliku alternatiivse standardmeetodi) lõpliku aruandekuupäeva“ vahele (nagu on sätestatud V lisa 1. jao punktis b). Kuupäevade esitamiseks kasutatakse „pp/kk/aaaa“ vormingut.
0020	TÄIENDAVATE RISKIDE OMAVAHENDITE NÕUE	Määruse (EL) nr 575/2013 artiklid 372–376	EBA/GL/2012/3 Esitatakse iga portfelli kohta saadud regulatiivne täiendavate riskide omavahendite nõue. Näitajad esitatakse kõikide veerus 0010 esitatud kuupäevade kohta. Lahter jäetakse tühjaks, kui finantsinstitutsioon ei arvuta täiendavate riskide omavahendite nõuet veerus 0010 esitatud kuupäeval (st nullväärtus esitatakse üksnes juhul, kui arvutuse tulemus on null).

C 110.01 – Korrelatsioonikauplemine. Mudeli üksikasjad.

Rida	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0010	Modelleerimisel kasutatavate tegurite arv	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 377	Esitatakse modelleerimisel kasutatavate tegurite arv kogu korrelatsioonikauplemise mudeli tasandil. Vastus on üks järgmistest: a) 1 modelleerimisel kasutatav tegur; b) 2 modelleerimisel kasutatavat tegurit; c) rohkem kui 2 modelleerimisel kasutatavat tegurit. Kui finantsinstitutsioon soovib veerus 0010 antud vastust selgitada, kasutab ta selleks veergu 0020.
0020	Makseviivitusest tingitud kahjude allikas	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 377	Esitatakse makseviivitusest tingitud kahjude allikas kogu korrelatsioonikauplemise mudeli tasandil. Vastus on üks järgmistest: a) turutava; b) sisereitingute meetodi puhul kasutatav makseviivitusest tingitud kahjumäär; c) makseviivitusest tingitud kahjumäära muud allikad (palun täpsustage). Veerus 0010 antud vastuse selgitamiseks kasutab finantsinstitutsioon veergu 0020. Kui veerus 0010 märgiti variant c, peab finantsinstitutsioon esitama selles veerus üksikasjad.

C 110.02 – Korrelatsioonikauplemine. Üksikasjad portfellide kaupa.

Töölehti käsitlevad juhised (z-telg)

Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
Portfell	V lisa 3., 4. ja 5. jagu	Esitatakse V lisast võetud portfelli number üksnes nende portfellide kohta, mille puhul on nõutavad kõik hinnariskid..

Rida	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0010	Likviidsusperiood	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 377 lõige 2	Esitatakse portfelli tasandil kohaldatud likviidsusperiood. Vastus on üks järgmistest: a) kuni kolm kuud; b) üle kolme kuu ja kuni kuus kuud; c) üle kuue kuu ja kuni üheksa kuud; d) üle üheksa kuu ja kuni kaksteist kuud.
0020	Makseviivituste tõenäosuste allikas	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 377	Esitatakse portfelli tasandil kohaldatud makseviivituste tõenäosuste allikas. Vastus on üks järgmistest: a) reitinguagentuurid; b) sisereitingute meetod; c) turupõhised makseviivituse tõenäosused; d) muu makseviivituse tõenäosuste allikas (palun täpsustage). Veerus 0010 antud vastuse selgitamiseks kasutab finantsinstitutsioon veergu 0020. Kui veerus 0010 märgiti variant d, peab finantsinstitutsioon esitama veerus 0020 üksikasjad.
0030	Krediidikvaliteedi hinnangute muutmise maatriksite allikas	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 377	Esitatakse portfelli tasandil kohaldatud krediidikvaliteedi hinnangute muutmise maatriksite allikas. Vastus on üks järgmistest: a) reitinguagentuurid; b) sisereitingute meetod; c) turupõhised krediidikvaliteedi hinnangute muutmise maatriksid; d) muu krediidikvaliteedi hinnangute muutmise maatriksite allikas (palun täpsustage). Veerus 0010 antud vastuse selgitamiseks kasutab finantsinstitutsioon veergu 0020. Kui veerus 0010 märgiti variant d, peab finantsinstitutsioon esitama veerus 0020 üksikasjad.

C 110.03 – Korrelatsioonikauplemine. Kõik hinnariskid portfellide/kuupäevade kaupa

Töölehti käsitlevad juhised (z-telg)

Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
Portfell	V. lisa 3., 4. ja 5. jagu	Esitatakse V lisast võetud portfelli number üksnes nende portfellide kohta, mille puhul on nõutavad kõik hinnariskid.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0010	Kuupäev	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 377	Kõik hinnariskid esitatakse kõigi kümne tööpäeva kohta, mis jäävad „Riskinäitajate esialgse aruandekuupäeva“ ja „Riskinäitajate (ja lõpliku alternatiivse standardmeetodi) lõpliku aruandekuupäeva“ vahele, nagu on osutatud V lisa 1. jao punktis b. Kuupäevade esitamiseks kasutatakse „pp/kk/aaaa“ vormingut.
0060	KÕIK HINNARISKID	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 377	Tulemused, mille saamiseks on kohaldatud regulatiivset korrelatsioonikauplemise mudelit iga portfelli suhtes. Näitajad esitatakse kõikide veerus 0010 esitatud kuupäevade kohta. Lahter jäetakse tühjaks, kui finantsinstitutsioon ei kasuta korrelatsioonikauplemise mudelit veerus 0010 esitatud kuupäeval (st nullväärtus esitatakse üksnes juhul, kui arvutuse tulemus on null).

C 120.01 – SBM. RISKITUNDLIKKUSED INSTRUMENTIDE/PORTFELLIDE KAUPA

Finantsinstitutsioonid esitavad instrumentide kaupa tundlikkused riskitegurite suhtes, millele instrument on avatud. Iga riskiteguri/tundlikkuse kohta esitatakse üks rida. Selle riskiteguri ülespoole liikumisest tingitud netokumerusriskipositsioon (CVRk+) või selle riskiteguri allapoole liikumisest tingitud netokumerusriskipositsioon (CVRk–), nagu on sätestatud määruse (EL) nr 575/2013 artiklis 325g, esitatakse eraldi ridadel. Kõik väärtused osutavad „Riskinäitajate (ja lõpliku alternatiivse standardmeetodi) lõplikule aruandekuupäevale“ (nagu on määratletud käesoleva määruse V lisa 1. jao punkti b alapunktis v). Finantsinstitutsioonid esitavad portfelli, instrumendi numbri (veerg 0010), riskitunnuse (veerg 0020), rühma (veerg 0030) ja täiendava tunnuse (veerg 0040) iga kombinatsiooni ainult üks kord.

Töölehti käsitlevad juhised (z-telg)

Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
Portfell	V. lisa 3., 4. ja 5. jagu	Esitatakse V lisast võetud portfelli number.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0010	Instrumendi number	V lisa 2. jagu	Esitatakse V lisast võetud instrumendi number.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0020	Riskiteguri tunnus	Määruse (EL) nr 575/2013 artiklid 325l, 325m, 325n, 325o, 325p ja 325q	Esitatakse käesoleva lisa lõpus olevas tabelis esitatud riskiteguri tunnus.
0030	Rühm	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325d lõige 3	Rühm märgitakse juhul, kui veerus 0020 valitud riskiteguri tunnus vastab riskiklassile: — Intressimäära üldrisk. Vastus on asjaomase riskivaba intressimäära, inflatsiooni või eri valuutade alusriski riskiteguri valuuta nimetus (kasutades ISO 4217 kohast valuuta tähist, nt „EUR“). — Muu kui väärtpaberistamise krediidimarginaali risk. Vastus on määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325ah lõike 1 tabelis 4 esitatud rühma number. — Alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli mittekuuluva väärtpaberistamise krediidimarginaali risk (non-ACTP CSR). Vastus kõnealuse määruse artikli 325am lõike 1 tabelis 7 esitatud rühma number. — Alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli kuuluva väärtpaberistamise krediidimarginaali risk (ACTP CSR). Vastus kõnealuse määruse artikli 325ak tabelis 6 esitatud rühma number. — Aktsiarisk. Vastus kõnealuse määruse artikli 325ap lõike 1 tabelis 8 esitatud rühma number. — Kaubarisk. Vastus kõnealuse määruse artikli 325as tabelis 9 esitatud rühma number. — Valuutarisk ja Delta või kumeruse komponendid. Vastus valuuta nimetus (nt „USD“, valuutakoodide puhul kasutatakse ISO 4217 kohast valuuta tähist). — Valuutarisk ja Vega komponent. Vastus on valuutapaari nimetus (nt „EUR_USD“, valuutakoodide puhul kasutatakse ISO 4217 kohast valuuta tähist).
0040	Täiendav tunnus1	Määruse (EL) nr 575/2013 artiklid 325l–325q ja artikkel 325ai	Esitatakse järgmine teave riskiteguri eristamise kohta rühmasisesel tasandil. Kui veerus 0020 valitud riskiteguri tunnus vastab riskiklassile: — intressimäära üldrisk ning Delta komponent ja riskitegur, on vastus riskivaba kõvera nimetus või muu vastav kordumatu tunnus; — muu kui väärtpaberistamise krediidimarginaali risk või riskliklassile alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli kuuluva väärtpaberistamise krediidimarginaali risk (ACTP CSR), on vastus on emitendi nimi või muu vastav kordumatu tunnus ning see on identne mis tahes kahe sellise kajastatud tundlikkuse puhul kahe riskiteguri suhtes, mille korrelatsiooniparameeter $\rho_{kl}^{(name)}$ võrdub 1 vastavalt määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325ai lõikele 1; — alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli mittekuuluva väärtpaberistamise krediidimarginaali risk (non-ACTP CSR), on vastus seeria nimi või muu vastav kordumatu tunnus; — aktsiarisk, on vastus aktsiaemitendi nimi või vastav kordumatu tunnus;

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
			— kaubarisk, on vastus kauba nimi või muu vastav kordumatu tunnus. Kui ükski nendest juhtudest ei ole kohaldatav, esitavad finantsinstitutsioonid kindla väärtuse (NULL) kui mitte kohaldatava.
0060	Riskitundlikkus (tulemused aruandlusvaluutas)	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325d lõige 2 ning artiklid 325g, 325r, 325s, 325t ja 325ax	Riskitundlikkused (delta/vega tundlikkused ja kumerusriski positsioonid) kajastatakse iga instrumendi tasandil kõigi asjakohaste riskitegurite puhul, nagu on märgitud veergudes 0020–0040. Väärtused esitatakse finantsinstitutsiooni aruandlusvaluutas. Kui veerus 0020 valitud riskiteguri tunnus vastab: — tundlikkusel põhineva meetodi deltariski komponendile, kajastatakse netotundlikkus riskiteguri suhtes (S_k), nagu on sätestatud määruse (EL) nr 575/2013 artiklis 325r. Kui finantsinstitutsioonid on saanud oma pädevalt asutuselt loa kasutada deltariski tundlikkuse alternatiivseid arvutusi vastavalt kõnealuse määruse artikli 325t lõikele 5, osutavad nad aruandluses nendele alternatiivsetele määratlustele; — tundlikkusel põhineva meetodi vegariski komponendile, kajastatakse optsiooni vegariski tundlikkus teatava riskiteguri suhtes(S_k), nagu on sätestatud määruse (EL) nr 575/2013 artiklis 325s. Kui finantsinstitutsioonid on saanud oma pädevalt asutuselt loa kasutada vegariski tundlikkuse alternatiivseid arvutusi vastavalt kõnealuse määruse artikli 325t lõikele 6, osutavad nad aruandluses nendele alternatiivsetele arvutustele. Olenemata sellest, kas finantsinstitutsioon kasutab kõnealuse määruse artikli 325s kohast arvutust või alternatiivset arvutust vastavalt artikli 325t lõikele 6, esitatakse tundlikkus pärast selle kaalumist vastava eeldatava volatiilsusega; — tundlikkusel põhineva meetodi kumerusriski komponendile, kajastatakse selle riskiteguri ülespoole liikumisest tingitud netokumerusriskipositsioon (CVR_k^+) või selle riskiteguri allapoole liikumisest tingitud netokumerusriskipositsioon (CVR_k^-), nagu on sätestatud määruse (EL) nr 575/2013 artiklis 325g. Esitatud arvu väljendatakse täpsusega vähemalt kaks kohta pärast koma. Nullväärtused esitatakse ainult juhul, kui arvutuse tulemus on tegelikult null.
0070	Aruandlusvaluuta		Esitatakse finantsinstitutsiooni aruandlusvaluuta nimetus (kasutatakse ISO 4217 kohast valuuta tähist, nt „EUR“).
0080	Riskitundlikkus (tulemused EBA portfelli valuutas)	Käesoleva määruse V lisa 3. ja 4. jagu ning Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325d lõige 2 ning artiklid 325g, 325r, 325s, 325t ja 325ax	Väärtused esitatakse vastavalt veeru 0060 juhistele, kuid ümberarvestatuna portfelli valuuta EKP hetkekursiga, nagu on määratletud käesoleva määruse V lisa 3. ja 4. jaos.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0090	Riskikaal	Määruse (EL) nr 575/2013 III osa IV jaotise 1a. peatüki 6. jagu	Esitatakse riskikaal, mis vastab riskitegurile, nagu on kindlaks määratud veergudes 0020–0040. Kui veerus 0020 valitud riskiteguri tunnus vastab kumerusriski komponendile, esitatakse kohaldatava suhtelise nihke kindlaksmääramiseks kasutatud riskikaal. Esitatud arvu väljendatakse täpsusega vähemalt nelja kohta pärast koma.
0110	Täiendav tunnus2	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325p lõige 2	Kui veerus 0010 valitud riskiteguri tunnus vastab kaubariski klassile ja tundlikkusel põhineva meetodi deltariski komponendile, on vastus juriidilised tingimused seoses üleandmise asukohaga või muu vastav kordumatu tunnus. Kui ükski nendest juhtudest ei ole kohaldatav, esitavad finantsinstitutsioonid kindla väärtuse (NULL) kui mitte kohaldatava.
0120	Krediidikvaliteedi kategooria	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325m lõige 1 ja artikli 325ah lõige 1	Kui veerus 0010 valitud riskiteguri tunnus vastab muu kui väärtpaberistamise krediidimarginaali riski klassile ja tundlikkusel põhineva meetodi deltariski komponendile, on vastus üks järgmistest: a) „krediidikvaliteedi aste 1“; b) „krediidikvaliteedi aste 2“; c) „krediidikvaliteedi aste 3“; d) „krediidikvaliteedi aste 4“; e) „krediidikvaliteedi aste 5“; f) „krediidikvaliteedi aste 6“; g) „krediidikvaliteedi astet ei ole määratud (reitinguta)“. Kui ükski nendest juhtudest ei ole kohaldatav, esitavad finantsinstitutsioonid kindla väärtuse (NULL) kui mitte kohaldatava.

C 120.02 – SBM. OFR KOOSSEIS PORTFELLIDE KAUPA

Töölehti käsitlevad juhised (z-telg)

Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
Portfell	V. lisa 3., 4. ja 5. jagu	Esitatakse V lisast võetud portfelli number.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0010	Riskiklass	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325d lõige 1	Märgitakse riskiklass. Vastus on üks järgmistest: a) „Intressimäära üldrisk (GIRR)“; b) „Krediidimarginaali risk. Muu kui väärtpaberistamise krediidimarginaali risk“ (muu kui väärtpaberistamise krediidimarginaali risk); c) „Krediidimarginaali risk. Alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli mittekuuluv väärtpaberistamine“ (alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli mittekuuluva väärtpaberistamise krediidimarginaali risk); d) „Krediidimarginaali risk. Alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli kuuluva väärtpaberistamise krediidimarginaali risk“ (alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli kuuluva väärtpaberistamise krediidimarginaali risk); e) „Aktsiarisk“; f) „Kaubarisk“; g) „Valuutarisk“.
0020	Komponent	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325e lõige 1	Esitatakse tundlikkusel põhineva meetodi komponent. Vastus on üks järgmistest: a) „deltarisk“; b) „vegarisk“; c) „kumerusrisk“.
0030	Korrelatsioonistsenaarium	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325h	Esitatakse korrelatsioonistsenaarium. Vastus on üks järgmistest: a) „Keskmise korrelatsiooni stsenaarium“; b) „Kõrge korrelatsiooni stsenaarium“; c) „Madala korrelatsiooni stsenaarium“.
0040	Omavahendite nõuded (tulemused aruandlusvaluutas)	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325h	Omavahendite nõuete väärtused esitatakse iga portfelli puhul kõigi riskiklassi, komponendi ja korrelatsioonistsenaariumi asjakohaste kombinatsioonide puhul „Riskinäitajate (ja lõpliku alternatiivse standardmeetodi) lõpliku aruandekuupäeva“ puhul (nagu on kindlaks määratud käesoleva määruse V lisa 1. jao punktis b). Väärtused esitatakse finantsinstitutsiooni aruandlusvaluutas ja neid väljendatakse täpsusega vähemalt kaks kohta pärast koma.
0050	Aruandlusvaluuta		Esitatakse finantsinstitutsiooni aruandlusvaluuta (kasutatakse ISO 4217 kohast valuuta tähist).
0060	Omavahendite nõuded (tulemused EBA portfelli valuutas)	Käesoleva määruse V lisa 3. ja 4. jagu ning määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325h	Väärtused esitatakse vastavalt veeru 0040 juhistele, kuid ümberarvestatuna portfelli valuuta EKP hetkekursiga, nagu on määratletud käesoleva määruse V lisa 3. ja 4. jaos.
0070	Valikulisuseta positsioonid, mille suhtes kohaldatakse kumerusriski omavahendite nõudeid	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325e lõige 3	Kui veerus 0020 esitatud komponent vastab kumerusriskile: a) kui finantsinstitutsioon kohaldab veergudes 0040 ja 0060 kajastatava tulemuse arvutamisel määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325e lõike 3 esimeses lõigus sätestatud meetodit, märgitakse „ÕIGE“; b) muul juhul märgitakse „VALE“. „VALE“ märgitakse ka juhul, kui ükski nendest juhtudest ei ole asjakohane.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0080	Valuutariski delta ja kumeruse puhul kohaldatav alusvaluuta meetod	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325q lõige 7	Kui veerus 0010 esitatud riskiklass vastab valuutariskile ja veerus 0020 esitatud komponent vastab deltariskile või kumerusriskile: a) kui finantsinstitutsioon kohaldab veergudes 0040 ja 0060 kajastatava tulemuse arvutamisel määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325q lõikes 7 sätestatud meetodit, märgitakse „ÕIGE“; b) muul juhul märgitakse „VALE“. „VALE“ märgitakse ka juhul, kui ükski nendest juhtudest ei ole asjakohane.
0090	Valuutariski puhul kumerusriski komponentide jaotus skalaaride kaupa	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325q lõige 6	Kui veerus 0010 esitatud riskiklass vastab valuutariskile ja veerus 0020 esitatud komponent vastab kumerusriskile: a) kui finantsinstitutsioon kohaldab veergudes 0040 ja 0060 kajastatava tulemuse arvutamisel määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325q lõikes 6 sätestatud meetodit, märgitakse „ÕIGE“; b) muul juhul märgitakse „VALE“. „VALE“ märgitakse ka juhul, kui ükski nendest juhtudest ei ole asjakohane.
0095	SBMi valideerimisportfelli tulemuste esitamine	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325e lõige 1	Kui portfell, mille kohta teavet esitatakse, on V lisa 7. jaos osutatud SBMi valideerimisportfell: a) märgitakse „esitatud“, kui finantsinstitutsioon esitab sellele portfellile vastavad tulemused; b) märgitakse „ei ole esitatud – ei ole avatud riskiteguri suhtes“, kui finantsinstitutsioon otsustab asjaomase SBMi valideerimisportfelli kohta tulemusi mitte esitada, kuna selle finantsinstitutsiooni juhtkond ei ole andnud heakskiitu selliste instrumentide kasutamiseks, mis tekitaksid avatuse asjaomase riskiteguri suhtes. „Ei kohaldata“ märgitakse juhul, kui portfell, mille kohta teavet esitatakse, on V lisa 3., 4. või 5. jaos osutatud portfell.
0100	Vabateksti lahter		Selles veerus saab finantsinstitutsioon esitada lisateavet.

C 120.04 – DRC. TURUVÄÄRTUSED JA OOTAMATULT MAKSEVIIVITUSSE SATTUMISE (JTD) BRUTOSUMMAD INSTRUMENTIDE/PORTFELLIDE KAUPA

Finantsinstitutsioonid esitavad instrumentide kaupa instrumendile vastavad riskipositsioonid. Iga riskipositsiooni kohta esitatakse üks rida. Kõik väärtused osutavad „Riskinäitajate (ja lõpliku alternatiivse standardmeetodi) lõplikule aruandekuupäevale“ (nagu on määratletud käesoleva määruse V lisa 1. jao punkti b alapunktis v). Riskipositsioonid kajastatakse enne tasaarvestusi, kuid asjakohasel juhul pärast kordamise või jaotamise etappe (nagu on määratletud määruse (EL) nr 575/2013 artiklites 325z ja 325ac).

Töölehti käsitlevad juhised (z-telg)

Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
Portfell	V. lisa 3., 4. ja 5. jagu	Esitatakse V lisast võetud portfelli number.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0010	Instrumendi number	V lisa 2. jagu	Esitatakse V lisast võetud instrumendi number.
0020	Riskiklass	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325v lõige 2	Esitatakse riskiklass, mille puhul on veergudes 0030 ja 0040 esitatud makseviivituse riski nõue. Vastus on üks järgmistest instrumendi liikidest: a) „muud instrumendid kui väärtpaberistamise positsioonid“; b) „alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli mittekuuluvad väärtpaberistamise positsioonid“; c) „alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli kuuluvad väärtpaberistamise positsioonid“.
0030	Rühm1	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325y lõige 3, artikli 325aa lõige 4 ja artikli 325ad lõige 2	Märgitakse rühm. Kui veerus 0020 kajastatud riskiklass vastab kirjele „muud kui väärtpaberistamised“, on vastus üks järgmistest: a) „Äriühingud“; b) „Riigid“; c) „Kohalikud omavalitsused“. Seevastu, kui veerus 0020 kajastatud riskiklass vastab kirjele „alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli mittekuuluvad väärtpaberistamised“, on vastus eespool esitatud punkt a või üks järgmistest: d) „Varaga tagatud kommertsväärtpaberid – Aasia“; e) „Varaga tagatud kommertsväärtpaberid – Euroopa“; f) „Varaga tagatud kommertsväärtpaberid – Põhja-Ameerika“; g) „Varaga tagatud kommertsväärtpaberid – muu maailm“; h) „Autolaenud/liisingud – Aasia“; i) „Autolaenud/liisingud – Euroopa“; j) „Autolaenud/liisingud – Põhja-Ameerika“; k) „Autolaenud/liisingud – muu maailm“; l) „Tagatud võlakohustused (CDO-squared) – Aasia“; m) „Tagatud võlakohustused (CDO-squared) – Euroopa“; n) „Tagatud võlakohustused (CDO-squared) – Põhja-Ameerika“; o) „Tagatud võlakohustused (CDO-squared) – muu maailm“; p) „Tagatud laenukohustused – Aasia“; q) „Tagatud laenukohustused – Euroopa“; r) „Tagatud laenukohustused – Põhja-Ameerika“; s) „Tagatud laenukohustused – muu maailm“; t) „Ärikinnisvara hüpoteekväärtpaberid (CMBS) – Aasia“; u) „Ärikinnisvara hüpoteekväärtpaberid (CMBS) – Euroopa“; v) „Ärikinnisvara hüpoteekväärtpaberid (CMBS) – Põhja-Ameerika“; w) „Ärikinnisvara hüpoteekväärtpaberid (CMBS) – muu maailm“; x) „Krediitkaardid – Aasia“; y) „Krediitkaardid – Euroopa“; z) „Krediitkaardid – Põhja-Ameerika“; aa) „Krediitkaardid – muu maailm“; bb) „Muud jaenõuded – Aasia“; cc) „Muud jaenõuded – Euroopa“; dd) „Muud jaenõuded – Põhja-Ameerika“;

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
			ee) „Muud jaenõuded – muu maailm“; ff) „Muud hulginõuded – Aasia“; gg) „Muud hulginõuded – Euroopa“; hh) „Muud hulginõuded – Põhja-Ameerika“; ii) „Muud hulginõuded – muu maailm“; jj) „Eluasemehüpoteekväärtpaberid (RMBS) – Aasia“; kk) „Eluasemehüpoteekväärtpaberid (RMBS) – Euroopa“; ll) „Eluasemehüpoteekväärtpaberid (RMBS) – Põhja-Ameerika“; mm) „Eluasemehüpoteekväärtpaberid (RMBS) – muu maailm“; nn) „Väikesed ja keskmise suurusega ettevõtjad (VKEd) – Aasia“; oo) „Väikesed ja keskmise suurusega ettevõtjad (VKEd) – Euroopa“; pp) „Väikesed ja keskmise suurusega ettevõtjad (VKEd) – Põhja-Ameerika“; qq) „Väikesed ja keskmise suurusega ettevõtjad (VKEd) – muu maailm“; rr) „Õppelaenud – Aasia“; ss) „Õppelaenud – Euroopa“; tt) „Õppelaenud – Põhja-Ameerika“; uu) „Õppelaenud – muu maailm“. Seevastu, kui veerus 0020 kajastatud riskiklass vastab kirjele „alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli kuuluvad väärtpaberistamised“, on vastus „alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli kuuluvad väärtpaberistamised“.
0040	Rühm2	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325ad lõige 2	Kui veerus 0020 kajastatud riskiklass vastab kirjele „alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli kuuluvad väärtpaberistamised“, on vastus indeksi nimi; muul juhul märgitakse (NUL).
0050	Võlgnik	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325v lõige 2, artikli 325x lõige 1 ning artiklid 325z ja 325ac	Finantsinstitutsioonid esitavad võlgnikuga seotud teabe. Kui veerus 0020 kajastatud riskiklass vastab kirjele: — „muud instrumendid kui väärtpaberistamise positsioonid“, on vastus võlgniku nimi; — „alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli mittekuuluvad väärtpaberistamise positsioonid“, on vastus on võlgniku nimi või kordumatu tunnus, mis tähistab alusvara kogumit ja seeriat; — „alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli kuuluvad väärtpaberistamise positsioonid“, on vastus kordumatu tunnus, mis tähistab indeksirühma, -seeriat ja osa.
0060	Krediidikvaliteedi kategooria	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325y lõiked 1 ja 2, artikli 325aa lõige 1 ja artikli 325ad lõige 1	Finantsinstitutsioonid märgivad krediidikvaliteedi. Vastus on üks järgmistest: a) „krediidikvaliteedi aste 1“; b) „krediidikvaliteedi aste 2“; c) „krediidikvaliteedi aste 3“; d) „krediidikvaliteedi aste 4“; e) „krediidikvaliteedi aste 5“; f) „krediidikvaliteedi aste 6“; g) „krediidikvaliteedi astet ei ole määratud (reitinguta)“;

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
			h) „krediidikvaliteedi astet ei ole määratud (makseviivituses)“; i) „krediidikvaliteedi astet ei ole määratud (riskikaal 0 %). Kui veerus 0020 kajastatud riskiklass vastab kirjele „alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli kuuluvad väärtpaberistamised või „alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli mittekuuluvad väärtpaberistamised on vastus üks eespool esitatutest või järgmistest: j) „krediidikvaliteedi aste 7“; k) „krediidikvaliteedi aste 8“; l) „krediidikvaliteedi aste 9“; m) „krediidikvaliteedi aste 10“; n) „krediidikvaliteedi aste 11“; o) „krediidikvaliteedi aste 12“; p) „krediidikvaliteedi aste 13“; q) „krediidikvaliteedi aste 14“; r) „krediidikvaliteedi aste 15“; s) „krediidikvaliteedi aste 16“; t) „krediidikvaliteedi aste 17“; u) „krediidikvaliteedi aste – kõik muud“.
0070	Makseviivituse riskikaal	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325v lõike 1 punkt f, artikli 325y lõiked 1 ja 2, artikli 325aa lõige 1 ja artikli 325ad lõige 1	Finantsinstitutsioonid esitavad asjakohase riskikaalu. Väärtpaberistamise positsioonide suhtes kohaldatavaid riskikaalusid kajastatakse pärast nende 8 %ga korrutamist vastavalt määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325aa lõikele 1.
0080	Nõudeõiguse järk	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325w lõiked 3 ja 6	Esitatakse riskipositsiooni nõudejärk. Kui veerus 0020 kajastatud riskiklass vastab kirjele „muud instrumendid kui väärtpaberistamise positsioonid“ või „alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli mittekuuluvad väärtpaberistamise positsioonid“ on vastus üks järgmistest: a) „omakapitaliinstrumendid“; b) „muud kui kõrgema nõudeõiguse järguga võlainstrumendid“; c) „kõrgema nõudeõiguse järguga võlainstrumendid“; d) „pandikirjad“. Kui ükski nendest juhtudest ei ole asjakohane, jäetakse see lahter tühjaks.
0090	Lõpptähtaeg	Määruse (EL) nr 575/2013 artiklid 325x, 325z ja 325ac	Esitatakse riskipositsiooni lõpptähtaeg. Kuupäeva esitamiseks kasutatakse „pp/kk/aaaa“ vormingut.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0100	Sissenõudmismäär	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325v lõike 1 punkt e	Finantsinstitutsioonid esitavad sissenõudmismäära. Sissenõudmismäära arvutamisel kasutatakse kohaldatavat makseviivitusest tingitud kahjumäära (LGD), st sissenõudmismäär = 1 – LGD. Sissenõudmismäära väljendatakse kümnendväärtusena vahemikus 0–1 täpsusega vähemalt nelja kohta pärast koma.
0110	Suund	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325v lõike 1 punktid a ja b	Finantsinstitutsioonid esitavad riskipositsiooni suuna vastavalt määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325v lõike 1 punktides a ja b sätestatud määratlustele. Vastus on üks järgmistest: a) „lühike riskipositsioon“; b) „pikk riskipositsioon“.
0120	Alumine eraldamispunkt (%)	Määruse (EL) nr 575/2013 artiklid 325aa ja 325ad	Kui kajastatav riskipositsioon on seotud väärtpaberistamise seeriaga, esitavad finantsinstitutsioonid väärtpaberistamise seeria alumise eraldamispunkti. Esitatud arvu väljendatakse täpsusega vähemalt nelja kohta pärast koma.
0130	Ülemine eraldamispunkt (%)	Määruse (EL) nr 575/2013 artiklid 325aa ja 325ad	Kui kajastatav riskipositsioon on seotud väärtpaberistamise seeriaga, esitavad finantsinstitutsioonid väärtpaberistamise seeria ülemise eraldamispunkti. Esitatud arvu väljendatakse täpsusega vähemalt nelja kohta pärast koma.
0140-0170	Tulemused aruandlusvaluutas		Väärtused esitatakse finantsinstitutsiooni aruandlusvaluutas ja neid väljendatakse täpsusega vähemalt kaks kohta pärast koma (kui see on asjakohane).
0140	Tinglik väärtus	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325w lõiked 1, 2 ja 5	Kui veerus 0020 kajastatud riskiklass vastab kirjele „muud instrumendid kui väärtpaberistamise positsioonid“, esitavad finantsinstitutsioonid instrumendi tinglikku väärtuse. Väärtus vastab määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325w lõigetes 1 ja 2 sätestatud mõistele $V_{notional}$ või kõnealuse määruse artikli 325w lõikes 5 sätestatud mõistele V, olenevalt riskipositsiooni liigist. Lahter jäetakse tühjaks, kui ükski nendest juhtudest ei ole kohaldatav või kui finantsinstitutsioon otseselt ei arvuta ega kasuta selles veerus kajastatavat summat, et hinnata ootamatult makseviivitusse sattumise brutosummat.
0150	Kasu ja kahju + kohandus (P&L + Adjustment)	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325w lõiked 1, 2 ja 5	Finantsinstitutsioonid esitavad kasu ja kahju ning kohanduse summa iga riskipositsiooni kohta. — Kui veerus 0020 kajastatud riskiklass vastab kirjele „muud instrumendid kui väärtpaberistamise positsioonid“ ja kajastatav riskipositsioon on pikk riskipositsioon, esitavad finantsinstitutsioonid $P\&L_{long}$ ja $Adjustment_{long}$ summa vastavalt määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325w lõikele 1. — Kui veerus 0020 kajastatud riskiklass vastab kirjele „muud instrumendid kui väärtpaberistamise positsioonid“ ja kajastatav riskipositsioon on lühike riskipositsioon, esitavad finantsinstitutsioonid $P\&L_{short}$ ja $Adjustment_{short}$ summa vastavalt kõnealuse määruse artikli 325w lõikele 2.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
			Lahter jäetakse tühjaks, kui ükski nendest juhtudest ei ole kohaldatav või kui finantsinstitutsioon otseselt ei arvuta ega kasuta selles veerus kajastatavat summat, et hinnata ootamatult makseviivitusse sattumise brutosummat.
0160	Ootamatult makseviivitusse sattumise brutosumma (Gross JTD amount)	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325v lõike 1 punkt c, artikli 325w lõiked 1, 2 ja 5, artikli 325z lõige 1 ja artikli 325ac lõige 2	Finantsinstitutsioonid esitavad konkreetse riskipositsiooni ootamatult makseviivitusse sattumise brutosumma.
0170	Valuuta		Esitatakse finantsinstitutsiooni aruandlusvaluuta (kasutatakse ISO 4217 kohast valuuta tähist).
0180-0200	Tulemused EBA portfelli valuutas	Käesoleva määruse V lisa 3. ja 4. jagu ning määruse (EL) nr 575/2013 artiklid 325y, 325aa ja 325ad	Väärtused esitatakse vastavalt veeru 0030 juhistele, kuid ümberarvestatuna portfelli valuuta EKP hetkekursiga, nagu on määratletud käesoleva määruse V lisa 3. ja 4. jaos.
0180	Tinglik väärtus	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325w lõiked 1, 2 ja 5	Kui veerus 0020 kajastatud riskiklass vastab kirjele „muud instrumendid kui väärtpaberistamise positsioonid“, esitavad finantsinstitutsioonid instrumendi tinglikku väärtuse. Väärtus vastab määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325w lõigetes 1 ja 2 sätestatud mõistele $V_{notional}$ või kõnealuse määruse artikli 325w lõikes 5 sätestatud mõistele V, olenevalt riskipositsiooni liigist. Lahter jäetakse tühjaks, kui ükski nendest juhtudest ei ole kohaldatav või kui finantsinstitutsioon otseselt ei arvuta ega kasuta selles veerus kajastatavat summat, et hinnata ootamatult makseviivitusse sattumise brutosummat.
0190	Kasu ja kahju + kohandus (P&L + Adjustment)	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325w lõiked 1, 2 ja 5	Finantsinstitutsioonid esitavad kasu ja kahju ning kohanduse summa iga riskipositsiooni kohta. — Kui veerus 0020 kajastatud riskiklass vastab kirjele „muud instrumendid kui väärtpaberistamise positsioonid“ ja kajastatav riskipositsioon on pikk riskipositsioon, esitavad finantsinstitutsioonid $P\&L_{long}$ ja $Adjustment_{long}$ summa vastavalt määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325w lõikele 1. — Kui veerus 0020 kajastatud riskiklass vastab kirjele „muud instrumendid kui väärtpaberistamise positsioonid“ ja kajastatav riskipositsioon on lühike riskipositsioon, esitavad finantsinstitutsioonid $P\&L_{short}$ ja $Adjustment_{short}$ summa vastavalt kõnealuse määruse artikli 325w lõikele 2.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
			Lahter jäetakse tühjaks, kui ükski nendest juhtudest ei ole kohaldatav või kui finantsinstitutsioon otseselt ei arvuta ega kasuta selles veerus kajastatavat summat, et hinnata ootamatult makseviivituse sattumise brutosummat.
0200	Ootamatult makseviivituse sattumise brutosumma (Gross JTD amount)	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325v lõike 1 punkt c, artikli 325w lõiked 1, 2 ja 5, artikli 325z lõige 1 ja artikli 325ac lõige 2	Finantsinstitutsioonid esitavad konkreetse riskipositsiooni ootamatult makseviivituse sattumise brutosumma.

C 120.05 – DRC. OFR KOOSSEIS PORTFELLIDE KAUPA

Töölehti käsitlevad juhised (z-telg)

Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
Portfell	V. lisa 3., 4. ja 5. jagu	Esitatakse V lisast võetud portfelli number.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0010	Riskiklass	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325v lõige 2	Esitatakse riskiklass, mille puhul on veergudes 0030 ja 0040 esitatud makseviivituse riski nõue. Vastus on üks järgmistest instrumendi liikidest: a) „muud instrumendid kui väärtpaberistamise positsioonid“; b) „alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli mittekuuluvad väärtpaberistamise positsioonid“; c) „alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli kuuluvad väärtpaberistamise positsioonid“.
0020	Rühm1	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325y lõige 3, artikli 325aa lõige 4 ja artikli 325ad lõige 2	Märgitakse rühm. Kui veerus 0010 kajastatud riskiklass vastab kirjele „muud instrumendid kui väärtpaberistamise positsioonid“, on vastus üks järgmistest: a) „äriühingud“; b) „riigid“; c) „kohalikud omavalitsused“.

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
			Seevastu, kui veerus 0010 kajastatud riskiklass vastab kirjele „alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli mittekuuluvad väärtpaberistamise positsioonid“, on vastus üks järgmistest: d) „Varaga tagatud kommertsväärtpaberid – Aasia“; e) „Varaga tagatud kommertsväärtpaberid – Euroopa“; f) „Varaga tagatud kommertsväärtpaberid – Põhja-Ameerika“; g) „Varaga tagatud kommertsväärtpaberid – muu maailm“; h) „Autolaenud/liisingud – Aasia“; i) „Autolaenud/liisingud – Euroopa“; j) „Autolaenud/liisingud – Põhja-Ameerika“; k) „Autolaenud/liisingud – muu maailm“; l) „Tagatud võlakohustused (CDO-squared) – Aasia“; m) „Tagatud võlakohustused (CDO-squared) – Euroopa“; n) „Tagatud võlakohustused (CDO-squared) – Põhja-Ameerika“; o) „Tagatud võlakohustused (CDO-squared) – muu maailm“; p) „Tagatud laenukohustused – Aasia“; q) „Tagatud laenukohustused – Euroopa“; r) „Tagatud laenukohustused – Põhja-Ameerika“; s) „Tagatud laenukohustused – muu maailm“; t) „Ärikinnisvara hüpoteekväärtpaberid (CMBS) – Aasia“; u) „Ärikinnisvara hüpoteekväärtpaberid (CMBS) – Euroopa“; v) „Ärikinnisvara hüpoteekväärtpaberid (CMBS) – Põhja-Ameerika“; w) „Ärikinnisvara hüpoteekväärtpaberid (CMBS) – muu maailm“; x) „Krediitkaardid – Aasia“; y) „Krediitkaardid – Euroopa“; z) „Krediitkaardid – Põhja-Ameerika“; aa) „Krediitkaardid – muu maailm“; bb) „Muud jaenõuded – Aasia“; cc) „Muud jaenõuded – Euroopa“; dd) „Muud jaenõuded – Põhja-Ameerika“; ee) „Muud jaenõuded – muu maailm“; ff) „Muud hulginõuded – Aasia“; gg) „Muud hulginõuded – Euroopa“; hh) „Muud hulginõuded – Põhja-Ameerika“; ii) „Muud hulginõuded – muu maailm“; jj) „Eluasemehüpoteekväärtpaberid (RMBS) – Aasia“; kk) „Eluasemehüpoteekväärtpaberid (RMBS) – Euroopa“; ll) „Eluasemehüpoteekväärtpaberid (RMBS) – Põhja-Ameerika“; mm) „Eluasemehüpoteekväärtpaberid (RMBS) – muu maailm“; nn) „Väikesed ja keskmise suurusega ettevõtjad (VKEd) – Aasia“; oo) „Väikesed ja keskmise suurusega ettevõtjad (VKEd) – Euroopa“; pp) „Väikesed ja keskmise suurusega ettevõtjad (VKEd) – Põhja-Ameerika“; qq) „Väikesed ja keskmise suurusega ettevõtjad (VKEd) – muu maailm“; rr) „Õppelaenud – Aasia“;

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
			ss) „Õppelaenud – Euroopa“; tt) „Õppelaenud – Põhja-Ameerika“; uu) „Õppelaenud – muu maailm“. Seevastu, kui veerus 0010 kajastatud riskiklass vastab kirjele „alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli kuuluvad väärtpaberistamise positsioonid“, on vastus „alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli kuuluvad väärtpaberistamised“.
0030	Rühm2	Määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325ad lõige 2	Kui veerus 0010 kajastatud riskiklass vastab kirjele „alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli kuuluvad väärtpaberistamise positsioonid“, on vastus indeksi nimi; muul juhul märgitakse (NUL).
0040	Omavahendite nõuded (tulemused aruandlusvaluutas)	Määruse (EL) nr 575/2013 artiklid 325y, 325aa ja 325ad	Makseviivituse riski omavahendite nõuded esitatakse „Riskinäitajate (ja lõpliku alternatiivse standardmeetodi) lõpliku aruandekuupäeva“ puhul (nagu on kindlaks määratud käesoleva määruse V lisa 1. jao punktis b). Väärtused esitatakse finantsinstitutsiooni aruandlusvaluutas ja neid väljendatakse täpsusega vähemalt kaks kohta pärast koma.
0050	Aruandlusvaluuta		Esitatakse finantsinstitutsiooni aruandlusvaluuta (kasutatakse ISO 4217 kohast valuuta tähist).
0060	Omavahendite nõuded (tulemused EBA portfelli valuutas)	Käesoleva määruse V lisa 3. ja 4. jagu ning määruse (EL) nr 575/2013 artiklid 325y, 325aa ja 325ad	Väärtused esitatakse vastavalt veeru 0030 juhistele, kuid ümberarvestatuna portfelli valuuta EKP hetkekursiga, nagu on määratletud käesoleva määruse V lisa 3. ja 4. jaos.

C 120.06 – Alternatiivne standardmeetod. OFR

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0010	Portfelli number	V. lisa 3., 4. ja 5. jagu	Esitatakse V lisast võetud portfelli number.
0020-0040	Tulemused aruandlusvaluutas	V. lisa 3. ja 4. jagu	

Veerg	Nimetus	Viide õigussättele	Juhised
0020	SBM OFR	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325h	Alternatiivse standardmeetodi tundlikkusel põhineva meetodi omavahendite nõuded esitatakse iga portfelli puhul „Riskinäitajate (ja lõpliku alternatiivse standardmeetodi) lõpliku aruandekuupäeva“ puhul (nagu on kindlaks määratud käesoleva määruse V lisa 1. jao punktis b).
0030	DRC OFR	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325v	Alternatiivse standardmeetodi makseviivituse riski omavahendite nõuded esitatakse iga portfelli puhul „Riskinäitajate (ja lõpliku alternatiivse standardmeetodi) lõpliku aruandekuupäeva“ puhul (nagu on kindlaks määratud käesoleva määruse V lisa 1. jao punktis b).
0040	RRAO OFR	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325u	Alternatiivse standardmeetodi jääkriski lisandi omavahendite nõuded esitatakse iga portfelli puhul „Riskinäitajate (ja lõpliku alternatiivse standardmeetodi) lõpliku aruandekuupäeva“ puhul (nagu on kindlaks määratud käesoleva määruse V lisa 1. jao punktis b).
0050-0070	Tulemused EBA portfelli valuutas	V. lisa 3. ja 4. jagu	Kui finantsinstitutsiooni aruandlusvaluuta erineb V lisa 3. ja 4. jaos kindlaks määratud EBA portfelli valuutadest, konverteerivad finantsinstitutsioonid aruandlusvaluuta kohaldatava EKP hetkekursi alusel.
0050	SBM OFR	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325h	Alternatiivse standardmeetodi tundlikkusel põhineva meetodi omavahendite nõuded esitatakse iga portfelli puhul „Riskinäitajate (ja lõpliku alternatiivse standardmeetodi) lõpliku aruandekuupäeva“ puhul (nagu on kindlaks määratud käesoleva määruse V lisa 1. jao punktis b).
0060	DRC OFR	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325v	Alternatiivse standardmeetodi makseviivituse riski omavahendite nõuded esitatakse iga portfelli puhul „Riskinäitajate (ja lõpliku alternatiivse standardmeetodi) lõpliku aruandekuupäeva“ puhul (nagu on kindlaks määratud käesoleva määruse V lisa 1. jao punktis b).
0070	RRAO OFR	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325u	Alternatiivse standardmeetodi jääkriski lisandi omavahendite nõuded esitatakse iga portfelli puhul „Riskinäitajate (ja lõpliku alternatiivse standardmeetodi) lõpliku aruandekuupäeva“ puhul (nagu on kindlaks määratud käesoleva määruse V lisa 1. jao punktis b).

Tabel: vormide 106.01 (veerg 0010) ja 120.01 (veerg 0020) täitmise juhised

— Veerg „riskiklass“ osutab määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325d lõikele 1. Riskiklasside tähistamiseks kasutatakse järgmisi lühendeid:

a) „GIRR“ (intressimäära üldrisk);

b) „CSR_NON_SEC“ (muu kui väärtpaberistamise krediidimarginaali risk);

c) „CSR_SEC_NON_ACTP“ (alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli mittekuuluva väärtpaberistamise krediidimarginaali risk (non-ACTP CSR));

d) „CSR_SEC_ACTP“ (alternatiivsesse korrelatsioonil põhinevasse kauplemisportfelli kuuluva väärtpaberistamise krediidimarginaali risk (ACTP CSR));

e) „EQ“ (aktsiarisk);

f) „CM“ (kaubarisk);

g) „FX“ (valuutarisk).

— Veerg „komponent“ osutab määruse (EL) nr 575/2013 artikli 325e lõikele 1. Tundlikkusel põhineva meetodi komponentide tähistamiseks kasutatakse järgmisi lühendeid:

a) „DELTA“ (deltarisk);

b) „VEGA“ (vegarisk);

c) „CURVATURE“ (kumerusrisk).

— Veerg „lõpptähtaeg“ osutab riskiteguri lõpptähtajale, kus riskitegurid on määratud täpsustatud punktidele vastavalt määruse (EL) nr 575/2013 artiklitele 325l, 325m, 325n, 325o, 325p ja 325q. Kõnealuse määruse artikli 325l lõikes 7 sätestatud intressimäära vega-üldriski tegurite puhul on kaks tähtaega, mis on eraldatud sidekriipsuga (nt „0,5 aastat - 0,5 aastat“), millest esimene osutab optsiooni lõpptähtajale ja teine optsiooni alusvara järelejäänud tähtajale optsiooni lõppkuupäeval.

— Veerus „Täiendavad spetsifikatsioonid“ täpsustatakse asjaomast riskitegurit seoses inflatsiooniriski ja eri valuutade alusriski tegurite eristamisega vastavalt määruse (EL) nr 575/2013 artiklile 325l, võlainstrumentidega seotud riskitegurite ja krediidiriski vahetustehingutega seotud riskitegurite eristamisega vastavalt kõnealuse määruse artiklitele 325m ja 325n, aktsia hetkehinna ja aktsia repomäära riskitegurite eristamisega vastavalt kõnealuse määruse artiklile 325o ning selle riskiteguri ülespoole liikumisest tingitud netokumerusriskipositsiooni (CVRk+) või selle riskiteguri allapoole liikumisest tingitud netokumerusriskipositsiooni (CVRk-) eristamisega vastavalt kõnealuse määruse artiklile 325g.

Riskiklass	Komponent	Lõpptähtaeg	Täiendavad spetsifikatsioonid	Riskiteguri tunnus	Viide õigussättele
CM	DELTA	0 aastat		CM_D_00.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325p
CM	DELTA	0,25 aastat		CM_D_00.25	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325p
CM	DELTA	0,5 aastat		CM_D_00.50	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325p
CM	DELTA	1 aasta		CM_D_01.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325p
CM	DELTA	2 aastat		CM_D_02.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325p
CM	DELTA	3 aastat		CM_D_03.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325p
CM	DELTA	5 aastat		CM_D_05.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325p
CM	DELTA	10 aastat		CM_D_10.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325p
CM	DELTA	15 aastat		CM_D_15.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325p
CM	DELTA	20 aastat		CM_D_20.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325p
CM	DELTA	30 aastat		CM_D_30.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325p
CM	VEGA	0,5 aastat		CM_V_00.50	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325p
CM	VEGA	1 aasta		CM_V_01.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325p
CM	VEGA	3 aastat		CM_V_03.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325p
CM	VEGA	5 aastat		CM_V_05.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325p
CM	VEGA	10 aastat		CM_V_10.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325p
CM	CURVATURE		Ülespoole liikumine	CM_CU	Määruse (EL) nr 575/2013 artiklid 325p ja 325g

Riskiklass	Komponent	Lõpptähtaeg	Täiendavad spetsifikatsioonid	Riskiteguri tunnus	Viide õigussättele
CM	CURVATURE		Allapoole liikumine	CM_CD	Määruse (EL) nr 575/2013 artiklid 325p ja 325g
CSR_NON_SEC	DELTA	0,5 aastat	Võlainstrument	CSR_NON_SEC_D_00.50_DEBT	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325m
CSR_NON_SEC	DELTA	1 aasta	Võlainstrument	CSR_NON_SEC_D_01.00_DEBT	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325m
CSR_NON_SEC	DELTA	3 aastat	Võlainstrument	CSR_NON_SEC_D_03.00_DEBT	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325m
CSR_NON_SEC	DELTA	5 aastat	Võlainstrument	CSR_NON_SEC_D_05.00_DEBT	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325m
CSR_NON_SEC	DELTA	10 aastat	Võlainstrument	CSR_NON_SEC_D_10.00_DEBT	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325m
CSR_NON_SEC	DELTA	0,5 aastat	Krediidiriski vahetustehing	CSR_NON_SEC_D_00.50_CDS	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325m
CSR_NON_SEC	DELTA	1 aasta	Krediidiriski vahetustehing	CSR_NON_SEC_D_01.00_CDS	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325m
CSR_NON_SEC	DELTA	3 aastat	Krediidiriski vahetustehing	CSR_NON_SEC_D_03.00_CDS	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325m
CSR_NON_SEC	DELTA	5 aastat	Krediidiriski vahetustehing	CSR_NON_SEC_D_05.00_CDS	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325m
CSR_NON_SEC	DELTA	10 aastat	Krediidiriski vahetustehing	CSR_NON_SEC_D_10.00_CDS	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325m
CSR_NON_SEC	VEGA	0,5 aastat		CSR_NON_SEC_V_00.50	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325m
CSR_NON_SEC	VEGA	1 aasta		CSR_NON_SEC_V_01.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325m
CSR_NON_SEC	VEGA	3 aastat		CSR_NON_SEC_V_03.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325m
CSR_NON_SEC	VEGA	5 aastat		CSR_NON_SEC_V_05.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325m
CSR_NON_SEC	VEGA	10 aastat		CSR_NON_SEC_V_10.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325m
CSR_NON_SEC	CURVATURE		Ülespoole liikumine	CSR_NON_SEC_CU	Määruse (EL) nr 575/2013 artiklid 325m ja 325g

Riskiklass	Komponent	Lõpptähtaeg	Täiendavad spetsifikatsioonid	Riskiteguri tunnus	Viide õigussättele
CSR_NON_SEC	CURVATURE		Allapoole liikumine	CSR_NON_SEC_CD	Määruse (EL) nr 575/2013 artiklid 325m ja 325g
CSR_SEC_ACTP	DELTA	0,5 aastat	Võlainstrument	CSR_SEC_ACTP_D_00.50_DEBT	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_ACTP	DELTA	1 aasta	Võlainstrument	CSR_SEC_ACTP_D_01.00_DEBT	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_ACTP	DELTA	3 aastat	Võlainstrument	CSR_SEC_ACTP_D_03.00_DEBT	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_ACTP	DELTA	5 aastat	Võlainstrument	CSR_SEC_ACTP_D_05.00_DEBT	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_ACTP	DELTA	10 aastat	Võlainstrument	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_DEBT	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_ACTP	DELTA	0,5 aastat	Krediidiriski vahetustehing	CSR_SEC_ACTP_D_00.50_CDS	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_ACTP	DELTA	1 aasta	Krediidiriski vahetustehing	CSR_SEC_ACTP_D_01.00_CDS	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_ACTP	DELTA	3 aastat	Krediidiriski vahetustehing	CSR_SEC_ACTP_D_03.00_CDS	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_ACTP	DELTA	5 aastat	Krediidiriski vahetustehing	CSR_SEC_ACTP_D_05.00_CDS	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_ACTP	DELTA	10 aastat	Krediidiriski vahetustehing	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_CDS	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_ACTP	VEGA	0,5 aastat		CSR_SEC_ACTP_V_00.50	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_ACTP	VEGA	1 aasta		CSR_SEC_ACTP_V_01.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_ACTP	VEGA	3 aastat		CSR_SEC_ACTP_V_03.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_ACTP	VEGA	5 aastat		CSR_SEC_ACTP_V_05.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_ACTP	VEGA	10 aastat		CSR_SEC_ACTP_V_10.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_ACTP	CURVATURE		Ülespoole liikumine	CSR_SEC_ACTP_CU	Määruse (EL) nr 575/2013 artiklid 325n ja 325g

Riskiklass	Komponent	Lõpptähtaeg	Täiendavad spetsifikatsioonid	Riskiteguri tunnus	Viide õigussättele
CSR_SEC_ACTP	CURVATURE		Allapoole liikumine	CSR_SEC_ACTP_CD	Määruse (EL) nr 575/2013 artiklid 325n ja 325g
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	0,5 aastat	Võlainstrument	CSR_SEC_NON_ACTP_D_00.50_DEBT	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	1 aasta	Võlainstrument	CSR_SEC_NON_ACTP_D_01.00_DEBT	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	3 aastat	Võlainstrument	CSR_SEC_NON_ACTP_D_03.00_DEBT	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	5 aastat	Võlainstrument	CSR_SEC_NON_ACTP_D_05.00_DEBT	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	10 aastat	Võlainstrument	CSR_SEC_NON_ACTP_D_10.00_DEBT	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	0,5 aastat	Krediidiriski vahetustehing	CSR_SEC_NON_ACTP_D_00.50_CDS	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	1 aasta	Krediidiriski vahetustehing	CSR_SEC_NON_ACTP_D_01.00_CDS	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	3 aastat	Krediidiriski vahetustehing	CSR_SEC_NON_ACTP_D_03.00_CDS	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	5 aastat	Krediidiriski vahetustehing	CSR_SEC_NON_ACTP_D_05.00_CDS	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	10 aastat	Krediidiriski vahetustehing	CSR_SEC_NON_ACTP_D_10.00_CDS	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_NON_ACTP	VEGA	0,5 aastat		CSR_SEC_NON_ACTP_V_00.50	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_NON_ACTP	VEGA	1 aasta		CSR_SEC_NON_ACTP_V_01.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_NON_ACTP	VEGA	3 aastat		CSR_SEC_NON_ACTP_V_03.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_NON_ACTP	VEGA	5 aastat		CSR_SEC_NON_ACTP_V_05.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_NON_ACTP	VEGA	10 aastat		CSR_SEC_NON_ACTP_V_10.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325n
CSR_SEC_NON_ACTP	CURVATURE		Ülespoole liikumine	CSR_SEC_NON_ACTP_CU	Määruse (EL) nr 575/2013 artiklid 325n ja 325g

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

Riskiklass	Komponent	Lõpptähtaeg	Täiendavad spetsifikatsioonid	Riskiteguri tunnus	Viide õigussättele
CSR_SEC_NON_ACTP	CURVATURE		Allapoole liikumine	CSR_SEC_NON_ACTP_CD	Määruse (EL) nr 575/2013 artiklid 325n ja 325g
EQ	DELTA		Hetkehind	EQ_D_SPOT	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325o
EQ	DELTA		Repomäär	EQ_D_REPO	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325o
EQ	VEGA	0,5 aastat		EQ_V_00.50	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325o
EQ	VEGA	1 aasta		EQ_V_01.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325o
EQ	VEGA	3 aastat		EQ_V_03.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325o
EQ	VEGA	5 aastat		EQ_V_05.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325o
EQ	VEGA	10 aastat		EQ_V_10.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325o
EQ	CURVATURE		Ülespoole liikumine	EQ_CU	Määruse (EL) nr 575/2013 artiklid 325o ja 325g
EQ	CURVATURE		Allapoole liikumine	EQ_CD	Määruse (EL) nr 575/2013 artiklid 325o ja 325g
FX	DELTA			FX_D	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325q
FX	VEGA	0,5 aastat		FX_V_00.50	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325q
FX	VEGA	1 aasta		FX_V_01.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325q
FX	VEGA	3 aastat		FX_V_03.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325q
FX	VEGA	5 aastat		FX_V_05.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325q
FX	VEGA	10 aastat		FX_V_10.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325q
FX	CURVATURE		Ülespoole liikumine	FX_CU	Määruse (EL) nr 575/2013 artiklid 325q ja 325g

Riskiklass	Komponent	Lõpptähtaeg	Täiendavad spetsifikatsioonid	Riskiteguri tunnus	Viide õigussättele
FX	CURVATURE		Allapoole liikumine	FX_CD	Määruse (EL) nr 575/2013 artiklid 325q ja 325g
GIRR	DELTA	0,25 aastat		GIRR_D_00.25	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	DELTA	0,5 aastat		GIRR_D_00.50	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	DELTA	1 aasta		GIRR_D_01.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	DELTA	2 aastat		GIRR_D_02.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	DELTA	3 aastat		GIRR_D_03.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	DELTA	5 aastat		GIRR_D_05.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	DELTA	10 aastat		GIRR_D_10.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	DELTA	15 aastat		GIRR_D_15.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	DELTA	20 aastat		GIRR_D_20.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	DELTA	30 aastat		GIRR_D_30.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	DELTA		Inflatsioon	GIRR_D_INF	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	DELTA		Eri valuutade alus (euro suhtes)	GIRR_D_CRO_EUR	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	DELTA		Eri valuutade alus (USA dollari suhtes)	GIRR_D_CRO_USD	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	0,5 aastat - 0,5 aastat		GIRR_V_00.50_00.50	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	1 aasta - 0,5 aastat		GIRR_V_01.00_00.50	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	3 aastat - 0,5 aastat		GIRR_V_03.00_00.50	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l

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

Riskiklass	Komponent	Lõpptähtaeg	Täiendavad spetsifikatsioonid	Riskiteguri tunnus	Viide õigussättele
GIRR	VEGA	5 aastat - 0,5 aastat		GIRR_V_05.00_00.50	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	10 aastat - 0,5 aastat		GIRR_V_10.00_00.50	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	0,5 aastat - 1 aasta		GIRR_V_00.50_01.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	1 aasta - 1 aasta		GIRR_V_01.00_01.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	3 aastat - 1 aasta		GIRR_V_03.00_01.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	5 aastat - 1 aasta		GIRR_V_05.00_01.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	10 aastat - 1 aasta		GIRR_V_10.00_01.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	0,5 aastat - 3 aastat		GIRR_V_00.50_03.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	1 aasta - 3 aastat		GIRR_V_01.00_03.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	3 aastat - 3 aastat		GIRR_V_03.00_03.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	5 aastat - 3 aastat		GIRR_V_05.00_03.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	10 aastat - 3 aastat		GIRR_V_10.00_03.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	0,5 aastat - 5 aastat		GIRR_V_00.50_05.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	1 aasta - 5 aastat		GIRR_V_01.00_05.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	3 aastat - 5 aastat		GIRR_V_03.00_05.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	5 aastat - 5 aastat		GIRR_V_05.00_05.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	10 aastat - 5 aastat		GIRR_V_10.00_05.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l

Riskiklass	Komponent	Lõpptähtaeg	Täiendavad spetsifikatsioonid	Riskiteguri tunnus	Viide õigussättele
GIRR	VEGA	0,5 aastat - 10 aastat		GIRR_V_00.50_10.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	1 aasta - 10 aastat		GIRR_V_01.00_10.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	3 aastat - 10 aastat		GIRR_V_03.00_10.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	5 aastat - 10 aastat		GIRR_V_05.00_10.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	10 aastat - 10 aastat		GIRR_V_10.00_10.00	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	0,5 aastat	Inflatsioon	GIRR_V_00.50_INF	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	1 aasta	Inflatsioon	GIRR_V_01.00_INF	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	3 aastat	Inflatsioon	GIRR_V_03.00_INF	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	5 aastat	Inflatsioon	GIRR_V_05.00_INF	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	10 aastat	Inflatsioon	GIRR_V_10.00_INF	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	0,5 aastat	Eri valuutade alus (euro suhtes)	GIRR_V_00.50_CRO_EUR	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	1 aasta	Eri valuutade alus (euro suhtes)	GIRR_V_01.00_CRO_EUR	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	3 aastat	Eri valuutade alus (euro suhtes)	GIRR_V_03.00_CRO_EUR	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	5 aastat	Eri valuutade alus (euro suhtes)	GIRR_V_05.00_CRO_EUR	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	10 aastat	Eri valuutade alus (euro suhtes)	GIRR_V_10.00_CRO_EUR	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	0,5 aastat	Eri valuutade alus (USA dollari suhtes)	GIRR_V_00.50_CRO_USD	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	1 aasta	Eri valuutade alus (USA dollari suhtes)	GIRR_V_01.00_CRO_USD	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l

Riskiklass	Komponent	Lõpptähtaeg	Täiendavad spetsifikatsioonid	Riskiteguri tunnus	Viide õigussättele
GIRR	VEGA	3 aastat	Eri valuutade alus (USA dollari suhtes)	GIRR_V_03.00_CRO_USD	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	5 aastat	Eri valuutade alus (USA dollari suhtes)	GIRR_V_05.00_CRO_USD	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	VEGA	10 aastat	Eri valuutade alus (USA dollari suhtes)	GIRR_V_10.00_CRO_USD	Määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 325l
GIRR	CURVATURE		Ülespoole liikumine	GIRR_CU	Määruse (EL) nr 575/2013 artiklid 325l ja 325g
GIRR	CURVATURE		Allapoole liikumine	GIRR_CD	Määruse (EL) nr 575/2013 artiklid 325l ja 325g“

IV LISA

„VII LISA –

JÄRELEVALVEGA SEOTUD VÕRDLUSPORTFELLIDE TULEMUSED. TURURISK

VÕRDLUSPORTFELLIDE TULEMUSED. TURURISK			
Vormi number	**Vormi kood**	**Vormi / vormide rühma nimi**	**Lühinimi**
		ESIALGNE TURUVÄÄRTUS	
106,1	C 106.00	ESIALGNE TURUVÄÄRTUS JA VÄLJAJÄTMISE PÕHJENDUS	IMV
106,2	C 106.01	RISKITUNDLIKKUSED INSTRUMENTIDE KAUPA	TUNDLIKKUSED
		VaR riskiväärtus, stressiolukorra VaR riskiväärtus ja nüüdisväärtus	
107,1	C 107.01	ÜKSIKASJAD	VaR&SVaR 1
107,2	C 107.02	TULEMUSED **EBA PORTFELLI** VALUUTAS	VaR&SVaR 2
		KASUMI/KAHJUMI AEGREAD	
108	C 108.00	KASUMI/KAHJUMI AEGREAD	P&L
		TÄIENDAVATE RISKIDE OMAVAHENDITE NÕUE	
109,1	C 109.01	TÄIENDAVATE RISKIDE OMAVAHENDITE NÕUE. MUDELI ÜKSIKASJAD	IRC 1
109,2	C 109.02	TÄIENDAVATE RISKIDE OMAVAHENDITE NÕUE. ÜKSIKASJAD PORTFELLIDE KAUPA	IRC 2
109,3	C 109.03	TÄIENDAVATE RISKIDE OMAVAHENDITE NÕUE. SUMMA PORTFELLIDE/KUUPÄEVADE KAUPA	IRC 3
		KORRELATSIOONIKAUPLEMINE	
110,1	C 110.01	KORRELATSIOONIKAUPLEMINE. MUDELI ÜKSIKASJAD	CT 1
110,2	C 110.02	KORRELATSIOONIKAUPLEMINE. ÜKSIKASJAD PORTFELLIDE KAUPA	CT 2
110,3	C 110.03	KORRELATSIOONIKAUPLEMINE. SUMMA PORTFELLIDE/KUUPÄEVADE KAUPA	CT 3
		ASA (SBM & DRC)	
120,1	C 120.01	SBM. RISKITUNDLIKKUSED INSTRUMENTIDE/PORTFELLIDE KAUPA	SBM 1
120,2	C 120.02	SBM. OFR KOOSSEIS PORTFELLIDE KAUPA	SBM 2
120,4	C 120.04	DRC. TURUVÄÄRTUSED JA OOTAMATULT MAKSEVIIVITUSSE SATTUMISE BRUTOSUMMAD INSTRUMENTIDE/PORTFELLIDE KAUPA	DRC 1
120,5	C 120.05	DRC. OFR KOOSSEIS PORTFELLIDE KAUPA	DRC 2
120,6	C 120.06	ASA. OFR PORTFELLIDE KAUPA	ASA OFR

C 106.00 – ESIALGNE TURUVÄÄRTUS JA VÄLJAJÄTMISE PÕHJENDUS

Instrumendi number	Instrument modelleeritud VaR riskiväärtuse + stressiolukorra VaR riskiväärtuse jaoks (Õige/Vale)	Instrument modelleeritud täiendavate riskide omavahendite nõude jaoks (Õige/Vale)	Instrument modelleeritud korrelatsiooni-kauplemise jaoks (Õige/Vale)	Väljajätmise põhjendus	Vabateksti lahter	Esialgne turuväärtus
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070

C 106.01 - RISKITUNDLIKKUSED INSTRUMENTIDE KAUPA

Instrumendi number

Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Riskitundlikkus (tulemused aruandlusvaluutas)	Aruandlusvaluuta	Riskitundlikkus (tulemused EBA instrumendi valuutas)	Hinnastamismudel	Tundlikkuse määratlus	Vabateksti lahter	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria
0010	0020	0030	0050	0060	0070	0080	0090	0100	110	120

C 107.01 – VaR RISKIVÄÄRTUS, STRESSIOLUKORRA VaR RISKIVÄÄRTUS JA NÜÜDISVÄÄRTUS. ÜKSIKASJAD

		Valikuvõimalus	Vabateksti lahter
		0010	0020
VaR riskiväärtus			
0010	**Metoodika**		
0020	**Kümnepäevase perioodi arvutamine**		

		Valikuvõimalus	Vabateksti lahter
		0010	0020
0030	**Vaatlusperioodi pikkus**		
0040	**Andmete kaalumine**		
0050	**Järeltestimise lisand**		
0060	**VaR regulatiivne lisand**		
Stressiolukorra VaR riskiväärtus			
0070	**Metoodika**		
0080	**Kümnepäevase perioodi arvutamine**		
0090	**Stressiolukorra VaR regulatiivne lisand**		
0100	**Stressiolukorra VaR riskiväärtuse periood**		

C 107.02 – VaR RISKIVÄÄRTUSE JA STRESSIOLUKORRA VaR RISKIVÄÄRTUSE MITTEKORRELATSIOONIL PÕHINEV KAUPLEMISPORTFELL. TULEMUSED EBA PORTFELLI VALUUTAS

Portfell

Kuupäev	VaR riskiväärtus	Stressiolukorra VaR riskiväärtus	Nüüdisväärtus
0010	0020	0030	0040

C 108.00 – KASUMI/KAHJUMI AEGREAD

Portfell

Kuupäev	**Igapäevane kasum/kahjum**
0010	0020

C 109.01 – TÄIENDAVATE RISKIDE OMAVAHENDITE NÕUE. MUDELI ÜKSIKASJAD

		Valikuvõimalus	**Vabateksti lahter**
Rida	**Kirje**	0010	0020
0010	**Modelleerimisel kasutatavate tegurite arv**		
0020	**Makseviivitusest tingitud kahjude allikas**		

C 109.02 – TÄIENDAVATE RISKIDE OMAVAHENDITE NÕUE. ÜKSIKASJAD PORTFELLIDE KAUPA

Portfell

		Valikuvõimalus	Vabateksti lahter
Rida	**Kirje**	0010	0020
0010	**Likviidsusperiood**		
0020	**Makseviivituste tõenäosuste allikas**		
0030	**Krediidikvaliteedi hinnangute muutmise maatriksite allikas**		

C 109.03 – TÄIENDAVATE RISKIDE OMAVAHENDITE NÕUE. SUMMA PORTFELLIDE/KUUPÄEVADE KAUPA

Portfell

Kuupäev	TÄIENDAVATE RISKIDE OMAVAHENDITE NÕUE
0010	0020

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

C 110.01 – KORRELATSIOONIKAUPLEMINE. MUDELI ÜKSIKASJAD

		Valikuvõimalus	Vabateksti lahter
Rida	**Kirje**	0010	0020
0010	**Modelleerimisel kasutatavate tegurite arv**		
0020	**Makseviivitusest tingitud kahjude allikas**		

C 110.02 – KORRELATSIOONIKAUPLEMINE. ÜKSIKASJAD PORTFELLIDE KAUPA.

Portfell

		Valikuvõimalus	Vabateksti lahter
Rida	**Kirje**	0010	0020
0010	**Likviidsusperiood**		
0020	**Makseviivituste tõenäosuste allikas**		
0030	**Krediidikvaliteedi hinnangute muutmise maatriksite allikas**		

C 110.03 – KORRELATSIOONIKAUPLEMINE. KÕIK HINNARISKID PORTFELLIDE/KUUPÄEVADE KAUPA

Portfell

Kuupäev	**KÕIK HINNARISKID**
0010	0060

C 120.01 – SBM. RISKITUNDLIKKUSED INSTRUMENTIDE/PORTFELLIDE KAUPA

Portfell

Instrumendi number	**Riskiteguri tunnus**	**Rühm**	**Täiendav tunnus**	**Riskitundlikkus (tulemused aruandlusvaluutas)**	**Aruandlusvaluuta**	**Riskitundlikkus (tulemused EBA portfelli valuutas)**	**Riskikaal**	**Täiendav tunnus2**	**Krediidikvaliteedi kategooria**
0010	0020	0030	0040	0060	0070	0080	0090	110	120

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

C 120.02 – SBM. OFR KOOSSEIS PORTFELLIDE KAUPA

Portfell

Riskiklass	Riskikomponent	Korrelatsioonistsenaarium	Omavahendite nõuded (tulemused aruandlusvaluutas)	Aruandlusvaluuta	Omavahendite nõuded (tulemused EBA portfelli valuutas)	Valikulisuseta positsioonid, mille suhtes kohaldatakse kumerusriski omavahendite nõudeid	Valuutariski delta ja kumeruse puhul kohaldatav alusvaluuta meetod	Valuutariski puhul kumerusriski komponentide jaotus skalaaride kaupa	SBMi valideerimisportfelli tulemuste esitamine	Vabateksti lahter
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0950	0100

C 120.04 – DRC. Turuväärtused ja ootamatult makseviivitusse sattumise brutosummad instrumentide/portfellide kaupa

Portfell

täisarv

Instrumendi number	Riskiklass	Rühm1	Rühm2	Võlgnik	Krediidikvaliteedi kategooria	Makseviivituse riskikaal	Nõudeõiguse järk	Lõpptähtaeg	Sissenõudmismäär	Suund	Alumine eraldamispunkt (%)	Ülemine eraldamispunkt (%)	Tulemused aruandlusvaluutas				Tulemused EBA portfelli valuutas		
													Tinglik väärtus	Kasu ja kahju + kohandus (P&L + Adjustment)	Ootamatult makseviivitusse sattumise brutosumma (Gross JTD amount)	Valuuta	Tinglik väärtus	Kasu ja kahju + kohandus (P&L + Adjustment)	Ootamatult makseviivitusse sattumise brutosumma (Gross JTD amount)
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120	0130	0140	0150	0160	0170	0180	0190	0200

C 120.05 – DRC. OFR KOOSSEIS PORTFELLIDE KAUPA

Portfell

täisarv

Riskiklass	Rühm1	Rühm2	Omavahendite nõuded (tulemused aruandlusvaluutas)	Aruandlusvaluuta	Omavahendite nõuded (tulemused EBA portfelli valuutas)
0010	0020	0030	0040	0050	0060

C 120.06 - ASA. OFR

Portfelli number	Tulemused aruandlusvaluutas			Tulemused EBA portfelli valuutas		
	SBM OFR	DRC OFR	RRAO OFR	SBM OFR	DRC OFR	RRAO OFR
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070“

V LISA

„X LISA –

SBMi valideerimisportfellid

Lehe nimi	Kirjeldus
Instrumendid	Instrumendid (tundlikkused ja kumerusriski positsioonid) SBMi valideerimiseks
Portfellid	SBMi valideerimisportfellid, mis on määratletud selles lisas määratletud instrumentide kombinatsioonidena

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
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

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
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

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
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

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
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

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
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

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
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	EMITENT A			100,00

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
S_EQV_aa4#	EQ_V_5.00	5	EMITENT AA			1 200,00
S_EQV_ac1#	EQ_V_5.00	7	EMITENT AC			– 50,00
S_EQV_ae4#	EQ_V_5.00	9	EMITENT AE			600,00
S_EQV_af4#	EQ_V_5.00	10	EMITENT AF			375,00
S_EQV_b4#	EQ_V_5.00	1	EMITENT B			50,00
S_EQV_f4#	EQ_V_5.00	5	EMITENT F			450,00
S_EQV_j4#	EQ_V_5.00	9	EMITENT J			– 200,00
S_EQV_k4#	EQ_V_5.00	10	EMITENT K			– 825,00
S_EQV_m1#	EQ_V_5.00	11	EMITENT M			– 700,00
S_EQV_n4#	EQ_V_5.00	12	INDEKS N			850,00
S_EQV_o4#	EQ_V_5.00	12	INDEKS O			150,00
S_EQV_y1#	EQ_V_5.00	3	EMITENT Y			700,00
S_EQV_a4#	EQ_V_3.00	1	EMITENT A			– 500,00
S_EQV_aa3#	EQ_V_3.00	5	EMITENT AA			– 850,00
S_EQV_ad1#	EQ_V_3.00	8	EMITENT AD			300,00
S_EQV_ae3#	EQ_V_3.00	9	EMITENT AE			– 450,00
S_EQV_af3#	EQ_V_3.00	10	EMITENT AF			– 725,00
S_EQV_b3#	EQ_V_3.00	1	EMITENT B			– 500,00

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
S_EQV_f3#	EQ_V_3.00	5	EMITENT F			250,00
S_EQV_j3#	EQ_V_3.00	9	EMITENT J			– 900,00
S_EQV_k3#	EQ_V_3.00	10	EMITENT K			– 975,00
S_EQV_n3#	EQ_V_3.00	12	INDEKS N			– 1 250,00
S_EQV_o3#	EQ_V_3.00	12	INDEKS O			100,00
S_EQV_x1#	EQ_V_3.00	2	EMITENT X			– 200,00
S_EQV_z1#	EQ_V_3.00	4	EMITENT Z			– 800,00
S_EQV_a6#	EQ_V_10.00	1	EMITENT A			100,00
S_EQV_aa5#	EQ_V_10.00	5	EMITENT AA			– 300,00
S_EQV_ab1#	EQ_V_10.00	6	EMITENT AB			– 400,00
S_EQV_ae5#	EQ_V_10.00	9	EMITENT AE			– 850,00
S_EQV_af5#	EQ_V_10.00	10	EMITENT AF			525,00
S_EQV_b5#	EQ_V_10.00	1	EMITENT B			500,00
S_EQV_f5#	EQ_V_10.00	5	EMITENT F			600,00
S_EQV_j5#	EQ_V_10.00	9	EMITENT J			150,00
S_EQV_k5#	EQ_V_10.00	10	EMITENT K			300,00
S_EQV_n5#	EQ_V_10.00	12	INDEKS N			225,00
S_EQV_o5#	EQ_V_10.00	12	INDEKS O			– 200,00

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

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
S_EQV_q1#	EQ_V_10.00	13	INDEKS Q			– 800,00
S_EQV_a3#	EQ_V_1.00	1	EMITENT A			400,00
S_EQV_aa2#	EQ_V_1.00	5	EMITENT AA			– 400,00
S_EQV_ae2#	EQ_V_1.00	9	EMITENT AE			– 250,00
S_EQV_af2#	EQ_V_1.00	10	EMITENT AF			– 1 150,00
S_EQV_b2#	EQ_V_1.00	1	EMITENT B			200,00
S_EQV_f2#	EQ_V_1.00	5	EMITENT F			– 750,00
S_EQV_j2#	EQ_V_1.00	9	EMITENT J			350,00
S_EQV_k2#	EQ_V_1.00	10	EMITENT K			1 050,00
S_EQV_n2#	EQ_V_1.00	12	INDEKS N			– 800,00
S_EQV_o2#	EQ_V_1.00	12	INDEKS O			400,00
S_EQV_a1#	EQ_V_0.50	1	EMITENT A			– 100,00
S_EQV_a2#	EQ_V_0.50	1	EMITENT A			700,00
S_EQV_aa1#	EQ_V_0.50	5	EMITENT AA			950,00
S_EQV_ae1#	EQ_V_0.50	9	EMITENT AE			50,00
S_EQV_af1#	EQ_V_0.50	10	EMITENT AF			– 300,00
S_EQV_b1#	EQ_V_0.50	1	EMITENT B			900,00
S_EQV_c1#	EQ_V_0.50	2	EMITENT C			– 500,00

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
S_EQV_d1#	EQ_V_0.50	3	EMITENT D			600,00
S_EQV_e1#	EQ_V_0.50	4	EMITENT E			– 800,00
S_EQV_f1#	EQ_V_0.50	5	EMITENT F			1 000,00
S_EQV_g1#	EQ_V_0.50	6	EMITENT G			– 400,00
S_EQV_h1#	EQ_V_0.50	7	EMITENT H			– 50,00
S_EQV_i1#	EQ_V_0.50	8	EMITENT I			300,00
S_EQV_j1#	EQ_V_0.50	9	EMITENT J			50,00
S_EQV_k1#	EQ_V_0.50	10	EMITENT K			– 300,00
S_EQV_l1#	EQ_V_0.50	11	EMITENT L			1 000,00
S_EQV_n1#	EQ_V_0.50	12	INDEKS N			750,00
S_EQV_o1#	EQ_V_0.50	12	INDEKS O			– 500,00
S_EQV_p1#	EQ_V_0.50	13	INDEKS P			40,00
S_EQD_a1#	EQ_D_SPOT	1	EMITENT A			16 500,00
S_EQD_a2#	EQ_D_SPOT	1	EMITENT A			– 35 000,00
S_EQD_b1#	EQ_D_SPOT	1	EMITENT B			20 000,00
S_EQD_c1#	EQ_D_SPOT	2	EMITENT C			66 000,00
S_EQD_d1#	EQ_D_SPOT	3	EMITENT D			1 700,00
S_EQD_e1#	EQ_D_SPOT	4	EMITENT E			1 100,00

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
S_EQD_f1#	EQ_D_SPOT	5	EMITENT F			25 000,00
S_EQD_g1#	EQ_D_SPOT	5	EMITENT G			8 400,00
S_EQD_h1#	EQ_D_SPOT	6	EMITENT H			22 500,00
S_EQD_i1#	EQ_D_SPOT	7	EMITENT I			– 12 300,00
S_EQD_j1#	EQ_D_SPOT	8	EMITENT J			– 450,00
S_EQD_k1#	EQ_D_SPOT	9	EMITENT K			– 143,00
S_EQD_l1#	EQ_D_SPOT	9	EMITENT L			– 143,00
S_EQD_m1#	EQ_D_SPOT	10	EMITENT M			– 100,00
S_EQD_n1#	EQ_D_SPOT	10	EMITENT N			– 100,00
S_EQD_o1#	EQ_D_SPOT	11	EMITENT O			– 19 600,00
S_EQD_q1#	EQ_D_SPOT	12	INDEKS Q			1 100,00
S_EQD_r1#	EQ_D_SPOT	12	INDEKS R			– 40 000,00
S_EQD_s1#	EQ_D_SPOT	13	INDEKS S			– 1 950,00
S_EQD_s2#	EQ_D_SPOT	13	INDEKS S			280,00
S_EQD_t2#	EQ_D_SPOT	13	INDEKS T			3 150,00
S_EQD_u1#	EQ_D_SPOT	9	EMITENT U			– 57,00
S_EQD_v1#	EQ_D_SPOT	10	EMITENT V			– 100,00

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
S_EQD_a3#	EQ_D_REPO	1	EMITENT A			50 000,00
S_EQD_aa1#	EQ_D_REPO	6	EMITENT AA			79 000,00
S_EQD_ab1#	EQ_D_REPO	7	EMITENT AB			31 000,00
S_EQD_ac1#	EQ_D_REPO	8	EMITENT AC			– 10 000,00
S_EQD_b2#	EQ_D_REPO	1	EMITENT B			– 39 000,00
S_EQD_f2#	EQ_D_REPO	5	EMITENT F			90 000,00
S_EQD_g2#	EQ_D_REPO	5	EMITENT G			60 000,00
S_EQD_k2#	EQ_D_REPO	9	EMITENT K			– 14 250,00
S_EQD_l2#	EQ_D_REPO	9	EMITENT L			– 150 000,00
S_EQD_m2#	EQ_D_REPO	10	EMITENT M			– 85 000,00
S_EQD_n2#	EQ_D_REPO	10	EMITENT N			– 72 000,00
S_EQD_p1#	EQ_D_REPO	11	EMITENT P			48 000,00
S_EQD_q2#	EQ_D_REPO	12	INDEKS Q			85 000,00
S_EQD_r2#	EQ_D_REPO	12	INDEKS R			– 40 000,00
S_EQD_t1#	EQ_D_REPO	13	INDEKS T			– 125 000,00
S_EQD_x1#	EQ_D_REPO	2	EMITENT X			75 000,00
S_EQD_y1#	EQ_D_REPO	3	EMITENT Y			4 800,00

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
S_EQD_z1#	EQ_D_REPO	4	EMITENT Z			– 15 000,00
S_EQC_a1#	EQ_CU	1	EMITENT A			– 37 820,00
S_EQC_a2#	EQ_CU	1	EMITENT A			77 655,00
S_EQC_aa1#	EQ_CU	2	EMITENT AA			39 300,00
S_EQC_ab1#	EQ_CU	4	EMITENT AB			17 262,00
S_EQC_ac1#	EQ_CU	5	EMITENT AC			7 139,60
S_EQC_ad1#	EQ_CU	6	EMITENT AD			– 3 642,50
S_EQC_ae1#	EQ_CU	7	EMITENT AE			3 900,00
S_EQC_af1#	EQ_CU	8	EMITENT AF			41 550,00
S_EQC_ag1#	EQ_CU	9	EMITENT AG			36 860,00
S_EQC_ah1#	EQ_CU	10	EMITENT AH			22 150,00
S_EQC_b1#	EQ_CU	1	EMITENT B			20 677,50
S_EQC_c1#	EQ_CU	2	EMITENT C			– 31 440,00
S_EQC_d1#	EQ_CU	3	EMITENT D			6 238,00
S_EQC_e1#	EQ_CU	4	EMITENT E			– 21 605,00
S_EQC_f1#	EQ_CU	5	EMITENT F			– 2 850,00
S_EQC_g1#	EQ_CU	6	EMITENT G			– 3 642,50

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
S_EQC_h1#	EQ_CU	7	EMITENT H			– 7 800,00
S_EQC_i1#	EQ_CU	8	EMITENT I			– 29 550,00
S_EQC_j1#	EQ_CU	9	EMITENT J			– 216 320,00
S_EQC_k1#	EQ_CU	10	EMITENT K			1 950,00
S_EQC_q1#	EQ_CU	11	EMITENT Q			– 19 142,00
S_EQC_r1#	EQ_CU	11	EMITENT R			28 713,00
S_EQC_s1#	EQ_CU	3	EMITENT S			– 17 025,00
S_EQC_t1#	EQ_CU	12	EMITENT T			7 466,67
S_EQC_u1#	EQ_CU	13	EMITENT U			11 160,00
S_EQC_v1#	EQ_CU	12	EMITENT V			– 39 200,00
S_EQC_w1#	EQ_CU	13	EMITENT W			– 58 590,00
S_EQC_y1#	EQ_CU	1	EMITENT Y			– 23 930,00
S_EQC_z1#	EQ_CU	1	EMITENT Z			– 47 860,00
S_EQC_a1#	EQ_CD	1	EMITENT A			39 157,50
S_EQC_a2#	EQ_CD	1	EMITENT A			– 80 349,00
S_EQC_aa1#	EQ_CD	2	EMITENT AA			– 30 600,00
S_EQC_ab1#	EQ_CD	4	EMITENT AB			– 9 826,00
S_EQC_ac1#	EQ_CD	5	EMITENT AC			– 5 414,60

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

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
S_EQC_ad1#	EQ_CD	6	EMITENT AD			2 617,50
S_EQC_ae1#	EQ_CD	7	EMITENT AE			– 2 720,00
S_EQC_af1#	EQ_CD	8	EMITENT AF			– 28 250,00
S_EQC_ag1#	EQ_CD	9	EMITENT AG			– 30 935,00
S_EQC_ah1#	EQ_CD	10	EMITENT AH			– 15 025,00
S_EQC_b1#	EQ_CD	1	EMITENT B			– 238 910,00
S_EQC_c1#	EQ_CD	2	EMITENT C			24 480,00
S_EQC_d1#	EQ_CD	3	EMITENT D			– 6 068,00
S_EQC_e1#	EQ_CD	4	EMITENT E			12 310,00
S_EQC_f1#	EQ_CD	5	EMITENT F			2 160,00
S_EQC_g1#	EQ_CD	6	EMITENT G			2 617,50
S_EQC_h1#	EQ_CD	7	EMITENT H			5 440,00
S_EQC_i1#	EQ_CD	8	EMITENT I			20 050,00
S_EQC_j1#	EQ_CD	9	EMITENT J			181 560,00
S_EQC_k1#	EQ_CD	10	EMITENT K			– 2 900,00
S_EQC_q1#	EQ_CD	11	EMITENT Q			20 052,00
S_EQC_r1#	EQ_CD	11	EMITENT R			– 30 078,00
S_EQC_s1#	EQ_CD	3	EMITENT S			– 9 435,00

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
S_EQC_t1#	EQ_CD	12	EMITENT T			– 7 400,00
S_EQC_u1#	EQ_CD	13	EMITENT U			– 11 040,00
S_EQC_v1#	EQ_CD	12	EMITENT V			38 850,00
S_EQC_w1#	EQ_CD	13	EMITENT W			57 960,00
S_EQC_y1#	EQ_CD	1	EMITENT Y			13 590,00
S_EQC_z1#	EQ_CD	1	EMITENT Z			27 180,00
S_CNV_a5#	CSR_NON_SEC_V_5.00	1	EMITENT A			100,00
S_CNV_b4#	CSR_NON_SEC_V_5.00	1	EMITENT B			50,00
S_CNV_c4#	CSR_NON_SEC_V_5.00	3	EMITENT C			150,00
S_CNV_hb1#	CSR_NON_SEC_V_5.00	9	EMITENT HA			– 750,00
S_CNV_a4#	CSR_NON_SEC_V_3.00	1	EMITENT A			– 500,00
S_CNV_ab1#	CSR_NON_SEC_V_3.00	2	EMITENT AB			325,00
S_CNV_b3#	CSR_NON_SEC_V_3.00	1	EMITENT B			– 500,00
S_CNV_c3#	CSR_NON_SEC_V_3.00	3	EMITENT C			100,00
S_CNV_v1#	CSR_NON_SEC_V_3.00	20	INDEKS V			500,00
S_CNV_a6#	CSR_NON_SEC_V_10.00	1	EMITENT A			100,00
S_CNV_b5#	CSR_NON_SEC_V_10.00	1	EMITENT B			500,00

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
S_CNV_c5#	CSR_NON_SEC_V_10.00	3	EMITENT C			– 200,00
S_CNV_a3#	CSR_NON_SEC_V_1.00	1	EMITENT A			400,00
S_CNV_b2#	CSR_NON_SEC_V_1.00	1	EMITENT B			200,00
S_CNV_c2#	CSR_NON_SEC_V_1.00	3	EMITENT C			400,00
S_CNV_a1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	EMITENT A			– 100,00
S_CNV_a2#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	EMITENT A			700,00
S_CNV_b1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	EMITENT B			900,00
S_CNV_c1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	3	EMITENT C			– 500,00
S_CNV_d1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	4	EMITENT D			700,00
S_CNV_e1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	5	EMITENT E			– 800,00
S_CNV_f1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	6	EMITENT F			700,00
S_CNV_g1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	7	EMITENT G			– 400,00
S_CNV_h1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	8	EMITENT H			– 50,00
S_CNV_i1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	10	EMITENT I			300,00
S_CNV_j1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	11	EMITENT J			50,00
S_CNV_k1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	12	EMITENT K			– 300,00
S_CNV_l1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	13	EMITENT L			1 000,00

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
S_CNV_m1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	14	EMITENT M			– 350,00
S_CNV_n1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	15	EMITENT N			950,00
S_CNV_o1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	16	EMITENT O			– 900,00
S_CNV_p1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	17	EMITENT P			200,00
S_CNV_q1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	18	EMITENT Q			400,00
S_CNV_r1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	18	EMITENT R			– 300,00
S_CNV_s1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	19	INDEKS S			850,00
S_CNV_t1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	20	INDEKS T			– 650,00
S_CNV_u1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	19	INDEKS U			– 350,00
S_CND_hb2#	CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT	9	EMITENT HB			– 17 000,00
S_CND_t1#	CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT	3	EMITENT T			– 6 000,00
S_CND_y1#	CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT	20	INDEKS Y			9 000,00
S_CND_ab2#	CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS	2	EMITENT AC			14 000,00
S_CND_b2#	CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS	1	EMITENT B			– 17 000,00
S_CND_w1#	CSR_NON_-SEC_D_10.00_DEBT	10	EMITENT W		CQS 1	9 000,00
S_CND_a4#	CSR_NON_-SEC_D_1.00_DEBT	1	EMITENT A			– 10 000,00
S_CND_s1#	CSR_NON_-SEC_D_1.00_DEBT	3	EMITENT S			– 6 000,00

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
S_CND_x1#	CSR_NON_SEC_D_1.00_CDS	19	INDEKS X			– 18 500,00
S_CND_a1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	1	EMITENT A			20 000,00
S_CND_a2#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	1	EMITENT A			– 30 000,00
S_CND_b1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	1	EMITENT B			12 000,00
S_CND_c1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	3	EMITENT C			– 6 000,00
S_CND_d1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	4	EMITENT D			25 000,00
S_CND_e1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	5	EMITENT E			– 4 000,00
S_CND_f1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	6	EMITENT F			– 8 000,00
S_CND_g1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	7	EMITENT G			8 000,00
S_CND_h1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	8	EMITENT H			3 000,00
S_CND_hb1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	9	EMITENT HA			– 23 000,00
S_CND_i1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	10	EMITENT I		CQS 2	– 5 000,00
S_CND_j1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	11	EMITENT J			2 000,00
S_CND_k1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	12	EMITENT K			7 000,00
S_CND_l1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	13	EMITENT L			– 9 000,00
S_CND_m1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	14	EMITENT M			10 000,00
S_CND_n1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	15	EMITENT N			– 20 000,00

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
S_CND_o1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	16	EMITENT O			5 000,00
S_CND_p1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	17	EMITENT P			– 3 000,00
S_CND_q1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	18	EMITENT Q			10 000,00
S_CND_r1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	18	EMITENT R			– 5 000,00
S_CND_a3#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	1	EMITENT A			15 000,00
S_CND_ab1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	2	EMITENT AB			21 000,00
S_CND_u1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	19	INDEKS U			– 32 000,00
S_CND_v1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	20	INDEKS V			– 13 000,00
S_CND_x2#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	19	INDEKS X			52 500,00
S_CNC_a1#	CSR_NON_SEC_CU	1	EMITENT A			– 2 338,64
S_CNC_a2#	CSR_NON_SEC_CU	1	EMITENT A			35 116,67
S_CNC_aa1#	CSR_NON_SEC_CU	10	EMITENT AA		CQS 1	– 1 212,50
S_CNC_ab1#	CSR_NON_SEC_CU	2	EMITENT AB1			– 247,47
S_CNC_b1#	CSR_NON_SEC_CU	1	EMITENT B			890,91
S_CNC_c1#	CSR_NON_SEC_CU	3	EMITENT C			– 500,00
S_CNC_d1#	CSR_NON_SEC_CU	4	EMITENT D			415,00
S_CNC_e1#	CSR_NON_SEC_CU	5	EMITENT E			– 1 050,00

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

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
S_CNC_f1#	CSR_NON_SEC_CU	6	EMITENT F			– 150,00
S_CNC_g1#	CSR_NON_SEC_CU	7	EMITENT G			– 318,75
S_CNC_h1#	CSR_NON_SEC_CU	8	EMITENT H			– 425,00
S_CNC_hb1#	CSR_NON_SEC_CU	9	EMITENT HB1			– 500,00
S_CNC_i1#	CSR_NON_SEC_CU	10	EMITENT I		CQS 2	– 937,50
S_CNC_j1#	CSR_NON_SEC_CU	11	EMITENT J			– 4 650,00
S_CNC_k1#	CSR_NON_SEC_CU	12	EMITENT K			– 425,00
S_CNC_l1#	CSR_NON_SEC_CU	13	EMITENT L			– 27 660,00
S_CNC_m1#	CSR_NON_SEC_CU	14	EMITENT M			– 488,00
S_CNC_n1#	CSR_NON_SEC_CU	15	EMITENT N			13 237,50
S_CNC_o1#	CSR_NON_SEC_CU	16	EMITENT O			– 1 127,50
S_CNC_p1#	CSR_NON_SEC_CU	17	EMITENT P			– 5 775,00
S_CNC_q1#	CSR_NON_SEC_CU	18	EMITENT Q			– 7 842,00
S_CNC_r1#	CSR_NON_SEC_CU	18	EMITENT R			15 684,00
S_CNC_s1#	CSR_NON_SEC_CU	4	EMITENT S			– 750,00
S_CNC_t1#	CSR_NON_SEC_CU	19	EMITENT T			3 550,00
S_CNC_u1#	CSR_NON_SEC_CU	20	EMITENT U			1 660,00
S_CNC_v1#	CSR_NON_SEC_CU	19	EMITENT V			– 18 637,50

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
S_CNC_w1#	CSR_NON_SEC_CU	20	EMITENT W			– 8 715,00
S_CNC_x1#	CSR_NON_SEC_CU	3	EMITENT X			– 500,00
S_CNC_y1#	CSR_NON_SEC_CU	1	EMITENT Y			– 249,95
S_CNC_z1#	CSR_NON_SEC_CU	1	EMITENT Z			– 249,95
S_CNC_a1#	CSR_NON_SEC_CD	1	EMITENT A			2 363,38
S_CNC_a2#	CSR_NON_SEC_CD	1	EMITENT A			– 35 314,65
S_CNC_aa1#	CSR_NON_SEC_CD	10	EMITENT AA		CQS 1	1 150,00
S_CNC_ab1#	CSR_NON_SEC_CD	2	EMITENT AB1			247,47
S_CNC_b1#	CSR_NON_SEC_CD	1	EMITENT B			– 5 543,43
S_CNC_c1#	CSR_NON_SEC_CD	3	EMITENT C			500,00
S_CNC_d1#	CSR_NON_SEC_CD	4	EMITENT D			– 385,00
S_CNC_e1#	CSR_NON_SEC_CD	5	EMITENT E			575,00
S_CNC_f1#	CSR_NON_SEC_CD	6	EMITENT F			75,00
S_CNC_g1#	CSR_NON_SEC_CD	7	EMITENT G			287,50
S_CNC_h1#	CSR_NON_SEC_CD	8	EMITENT H			400,00
S_CNC_hb1#	CSR_NON_SEC_CD	9	EMITENT HB1			500,00
S_CNC_i1#	CSR_NON_SEC_CD	10	EMITENT I		CQS 2	750,00
S_CNC_j1#	CSR_NON_SEC_CD	11	EMITENT J			4 100,00

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
S_CNC_k1#	CSR_NON_SEC_CD	12	EMITENT K			387,50
S_CNC_l1#	CSR_NON_SEC_CD	13	EMITENT L			22 130,00
S_CNC_m1#	CSR_NON_SEC_CD	14	EMITENT M			160,00
S_CNC_n1#	CSR_NON_SEC_CD	15	EMITENT N			– 23 437,50
S_CNC_o1#	CSR_NON_SEC_CD	16	EMITENT O			1 246,25
S_CNC_p1#	CSR_NON_SEC_CD	17	EMITENT P			6 225,00
S_CNC_q1#	CSR_NON_SEC_CD	18	EMITENT Q			8 752,00
S_CNC_r1#	CSR_NON_SEC_CD	18	EMITENT R			– 17 504,00
S_CNC_s1#	CSR_NON_SEC_CD	4	EMITENT S			– 250,00
S_CNC_t1#	CSR_NON_SEC_CD	19	EMITENT T			– 3 500,00
S_CNC_u1#	CSR_NON_SEC_CD	20	EMITENT U			– 1 540,00
S_CNC_v1#	CSR_NON_SEC_CD	19	EMITENT V			18 375,00
S_CNC_w1#	CSR_NON_SEC_CD	20	EMITENT W			8 085,00
S_CNC_x1#	CSR_NON_SEC_CD	3	EMITENT X			500,00
S_CNC_y1#	CSR_NON_SEC_CD	1	EMITENT Y			– 226,77
S_CNC_z1#	CSR_NON_SEC_CD	1	EMITENT Z			– 226,77
S_CMV_a5#	CM_V_5.00	1	KIVISÜSI			– 300,00

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
S_CMV_b4#	CM_V_5.00	1	URAAN			450,00
S_CMV_a4#	CM_V_3.00	1	KIVISÜSI			800,00
S_CMV_b3#	CM_V_3.00	1	URAAN			800,00
S_CMV_a6#	CM_V_10.00	1	KIVISÜSI			100,00
S_CMV_b5#	CM_V_10.00	1	URAAN			– 250,00
S_CMV_a3#	CM_V_1.00	1	KIVISÜSI			– 200,00
S_CMV_b2#	CM_V_1.00	1	URAAN			– 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	VASK			– 200,00
S_CMV_l1#	CM_V_1.00	6	VEELDATUD MAAGAAS			1 000,00
S_CMV_n1#	CM_V_1.00	7	HÕBE			500,00
S_CMV_p1#	CM_V_1.00	8	MAIS			– 1 000,00
S_CMV_r1#	CM_V_1.00	9	VADAK			– 125,00
S_CMV_t1#	CM_V_1.00	10	KUMMI			– 50,00
S_CMV_v1#	CM_V_1.00	11	KAALIUMKARBO-NAAT			– 1 800,00

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
S_CMV_a1#	CM_V_0.50	1	KIVISÜSI			1 000,00
S_CMV_a2#	CM_V_0.50	1	KIVISÜSI			– 350,00
S_CMV_b1#	CM_V_0.50	1	URAAN			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	TERAS			550,00
S_CMV_k1#	CM_V_0.50	6	MAAGAAS			400,00
S_CMV_m1#	CM_V_0.50	7	KULD			– 200,00
S_CMV_o1#	CM_V_0.50	8	SOJAOAD			– 750,00
S_CMV_q1#	CM_V_0.50	9	KALA			250,00
S_CMV_s1#	CM_V_0.50	10	KAKAO			350,00
S_CMV_u1#	CM_V_0.50	11	LEHTKLAAS			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	MAIS	OKLAHOMA		– 10 000,00
S_CMD_f1#	CM_D_3.00	3	FWD ELECTRICITY NE	TEXAS		– 4 500,00

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
S_CMD_h1#	CM_D_3.00	4	PANAMAX	NEW ORLEANS		– 68 750,00
S_CMD_n1#	CM_D_20.00	7	HÕBE	EU1		5 000,00
S_CMD_r1#	CM_D_20.00	9	VADAK	NEWCASTLE		– 1 250,00
S_CMD_d1#	CM_D_2.00	2	WTI	OKLAHOMA		– 1 750,00
S_CMD_l1#	CM_D_15.00	6	VEELDATUD MAAGAAS	OKLAHOMA		10 000,00
S_CMD_t1#	CM_D_15.00	10	KUMMI	NEWCASTLE		– 500,00
S_CMD_j1#	CM_D_10.00	5	VASK	OKLAHOMA		– 2 000,00
S_CMD_v1#	CM_D_10.00	11	KAALIUMKARBO-NAAT	NEWCASTLE		– 18 000,00
S_CMD_b1#	CM_D_1.00	1	URAAN	OKLAHOMA		1 500,00
S_CMD_g1#	CM_D_1.00	4	SUPRAMAX	SANTOS		– 62 500,00
S_CMD_w1#	CM_D_1.00	4	SUPRAMAX	SANTOS		– 62 500,00
S_CMD_x1#	CM_D_1.00	4	PANAMAX	NEW ORLEANS		187 500,00
S_CMD_a4#	CM_D_0.50	1	KIVISÜSI	NEWCASTLE		8 000,00
S_CMD_a1#	CM_D_0.00	1	KIVISÜSI	NEWCASTLE		10 000,00
S_CMD_a2#	CM_D_0.00	1	KIVISÜSI	NEWCASTLE		– 3 500,00
S_CMD_a3#	CM_D_0.00	1	KIVISÜSI	LONDON		– 2 000,00
S_CMD_c1#	CM_D_0.00	2	BRENT	LE HAVRE		2 000,00

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
S_CMD_e1#	CM_D_0.00	3	SPOT ELECTRICITY SE	LONDON		– 3 000,00
S_CMD_i1#	CM_D_0.00	5	TERAS	LE HAVRE		5 500,00
S_CMD_k1#	CM_D_0.00	6	MAAGAAS	LE HAVRE		4 000,00
S_CMD_m1#	CM_D_0.00	7	KULD	UK1		– 2 000,00
S_CMD_o1#	CM_D_0.00	8	SOJAOAD	LE HAVRE		– 7 500,00
S_CMD_q1#	CM_D_0.00	9	KALA	LONDON		2 500,00
S_CMD_s1#	CM_D_0.00	10	KAKAO	LONDON		3 500,00
S_CMD_u1#	CM_D_0.00	11	LEHTKLAAS	LONDON		30 000,00
S_CMC_a1#	CM_CU	1	KIVISÜSI			17 335,00
S_CMC_a2#	CM_CU	1	KIVISÜSI			36 936,00
S_CMC_b1#	CM_CU	1	URAAN			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

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
S_CMC_i1#	CM_CU	5	TERAS			– 5 850,00
S_CMC_j1#	CM_CU	5	VASK			14 644,80
S_CMC_k1#	CM_CU	6	MAAGAAS			– 6 147,50
S_CMC_l1#	CM_CU	6	VEELDATUD MAAGAAS			– 6 147,50
S_CMC_m1#	CM_CU	7	KULD			– 1 486,67
S_CMC_n1#	CM_CU	7	HÕBE			743,33
S_CMC_o1#	CM_CU	8	SOJAOAD			– 14 535,00
S_CMC_p1#	CM_CU	8	MAIS			20 475,00
S_CMC_q1#	CM_CU	9	KALA			– 19 900,00
S_CMC_r1#	CM_CU	9	VADAK			3 387,00
S_CMC_s1#	CM_CU	10	KAKAO			1 005,00
S_CMC_t1#	CM_CU	10	KUMMI			10 892,20
S_CMC_u1#	CM_CU	11	LEHTKLAAS			– 13 790,00
S_CMC_v1#	CM_CU	11	KAALIUMKARBO-NAAT			20 685,00
S_CMC_x1#	CM_CU	9	PIIM			– 6 300,00
S_CMC_y1#	CM_CU	1	URAAN			– 65 864,00
S_CMC_z1#	CM_CU	4	PANAMAX			29 472,00

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
S_CMC_a1#	CM_CD	1	KIVISÜSI			– 18 260,00
S_CMC_a2#	CM_CD	1	KIVISÜSI			– 37 630,00
S_CMC_b1#	CM_CD	1	URAAN			– 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	TERAS			4 080,00
S_CMC_j1#	CM_CD	5	VASK			– 10 219,80
S_CMC_k1#	CM_CD	6	MAAGAAS			4 222,50
S_CMC_l1#	CM_CD	6	VEELDATUD MAAGAAS			4 222,50
S_CMC_m1#	CM_CD	7	KULD			1 353,33
S_CMC_n1#	CM_CD	7	HÕBE			– 676,67
S_CMC_o1#	CM_CD	8	SOJAOAD			10 435,00
S_CMC_p1#	CM_CD	8	MAIS			– 14 735,00

Instrument	Riskiteguri tunnus	Rühm	Täiendav tunnus	Täiendav tunnus2	Krediidikvaliteedi kategooria	Riskitundlikkus
S_CMC_q1#	CM_CD	9	KALA			6 700,00
S_CMC_r1#	CM_CD	9	VADAK			– 3 012,00
S_CMC_s1#	CM_CD	10	KAKAO			– 1 415,00
S_CMC_t1#	CM_CD	10	KUMMI			– 7 817,20
S_CMC_u1#	CM_CD	11	LEHTKLAAS			14 200,00
S_CMC_v1#	CM_CD	11	KAALIUMKARBO-NAAT			– 21 300,00
S_CMC_x1#	CM_CD	9	PIIM			– 4 700,00
S_CMC_y1#	CM_CD	1	URAAN			– 66 344,00
S_CMC_z1#	CM_CD	4	PANAMAX			– 22 856,00

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

Portfell	Riskiklass	Komponent	Instrumendid
G000	GIRR	DELTA	S_IRD_a1#
G001	GIRR	DELTA	S_IRD_b1#
G002	GIRR	DELTA	S_IRD_b2#
G003	GIRR	DELTA	S_IRD_b3#
G004	GIRR	DELTA	S_IRD_b4#
G005	GIRR	DELTA	S_IRD_b5#
G006	GIRR	DELTA	S_IRD_b6#
G007	GIRR	DELTA	S_IRD_b7#
G008	GIRR	DELTA	S_IRD_b8#
G009	GIRR	DELTA	S_IRD_b9#
G010	GIRR	DELTA	S_IRD_b10#
G011	GIRR	DELTA	S_IRD_b11#
G012	GIRR	DELTA	S_IRD_b12#
G013	GIRR	DELTA	S_IRD_d1#
G014	GIRR	DELTA	S_IRD_d2#
G015	GIRR	DELTA	S_IRD_d3#
G016	GIRR	DELTA	S_IRD_d4#
G017	GIRR	DELTA	S_IRD_d5#
G018	GIRR	DELTA	S_IRD_d6#
G019	GIRR	DELTA	S_IRD_d7#
G020	GIRR	DELTA	S_IRD_d8#
G021	GIRR	DELTA	S_IRD_d9#
G022	GIRR	DELTA	S_IRD_d10#
G023	GIRR	DELTA	S_IRD_d11#
G024	GIRR	DELTA	S_IRD_d12#
G025	GIRR	DELTA	S_IRD_a1# S_IRD_b1#
G026	GIRR	DELTA	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	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_c1#
G028	GIRR	DELTA	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#

Portfell	Riskiklass	Komponent	Instrumendid
G029	GIRR	DELTA	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	DELTA	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	DELTA	S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c6#
G032	GIRR	DELTA	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	DELTA	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	DELTA	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	VEGA	S_IRV_b1#
G036	GIRR	VEGA	S_IRV_a1# S_IRV_b1#
G037	GIRR	VEGA	S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5#
G038	GIRR	VEGA	S_IRV_b1# S_IRV_b6# S_IRV_b11# S_IRV_b16# S_IRV_b21#

Portfell	Riskiklass	Komponent	Instrumendid
G039	GIRR	VEGA	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	VEGA	S_IRV_e1# S_IRV_e2#
G041	GIRR	VEGA	S_IRV_e1# S_IRV_e3#
G042	GIRR	VEGA	S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5#
G043	GIRR	VEGA	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	VEGA	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	VEGA	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	CURVATURE	S_IRC_b1#
G047	GIRR	CURVATURE	S_IRC_c1#
G048	GIRR	CURVATURE	S_IRC_a1# S_IRC_b1#
G049	GIRR	CURVATURE	S_IRC_d1#
G050	GIRR	CURVATURE	S_IRC_b1# S_IRC_c1#
G051	GIRR	CURVATURE	S_IRC_c1# S_IRC_e1#
G052	GIRR	CURVATURE	S_IRC_d1# S_IRC_e1#
G053	GIRR	CURVATURE	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#

Portfell	Riskiklass	Komponent	Instrumendid
G054	GIRR	ALL	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	DELTA	S_IRD_e11# S_IRD_e13#
G056	GIRR	DELTA	S_IRD_e1# S_IRD_f1#
E001	EQ	DELTA	S_EQD_a2#
E002	EQ	DELTA	S_EQD_c1#
E003	EQ	DELTA	S_EQD_d1#
E004	EQ	DELTA	S_EQD_e1#
E005	EQ	DELTA	S_EQD_f1#
E006	EQ	DELTA	S_EQD_h1#
E007	EQ	DELTA	S_EQD_i1#
E008	EQ	DELTA	S_EQD_j1#
E009	EQ	DELTA	S_EQD_k1#
E010	EQ	DELTA	S_EQD_m1#
E011	EQ	DELTA	S_EQD_o1#
E012	EQ	DELTA	S_EQD_q1#
E013	EQ	DELTA	S_EQD_s1#
E014	EQ	DELTA	S_EQD_a3#

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

Portfell	Riskiklass	Komponent	Instrumendid
E045	EQ	DELTA	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	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_o1#
E047	EQ	DELTA	S_EQD_q1# S_EQD_s1#
E048	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_q1#
E049	EQ	DELTA	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	DELTA	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	VEGA	S_EQV_a2#
E052	EQ	VEGA	S_EQV_c1#
E053	EQ	VEGA	S_EQV_d1#
E054	EQ	VEGA	S_EQV_e1#
E055	EQ	VEGA	S_EQV_f1#
E056	EQ	VEGA	S_EQV_g1#
E057	EQ	VEGA	S_EQV_h1#
E058	EQ	VEGA	S_EQV_i1#
E059	EQ	VEGA	S_EQV_j1#
E060	EQ	VEGA	S_EQV_k1#
E061	EQ	VEGA	S_EQV_l1#
E062	EQ	VEGA	S_EQV_n1#
E063	EQ	VEGA	S_EQV_p1#
E064	EQ	VEGA	S_EQV_a1# S_EQV_a2#
E065	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6#
E066	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_b1#
E067	EQ	VEGA	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#

Portfell	Riskiklass	Komponent	Instrumendid
E068	EQ	VEGA	S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5#
E069	EQ	VEGA	S_EQV_f1# S_EQV_aa1#
E070	EQ	VEGA	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	VEGA	S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5#
E072	EQ	VEGA	S_EQV_j1# S_EQV_ae1#
E073	EQ	VEGA	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	VEGA	S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5#
E075	EQ	VEGA	S_EQV_k1# S_EQV_af1#
E076	EQ	VEGA	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	VEGA	S_EQV_l1# S_EQV_m1#
E078	EQ	VEGA	S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5#
E079	EQ	VEGA	S_EQV_n1# S_EQV_o1#
E080	EQ	VEGA	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	VEGA	S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5#
E082	EQ	VEGA	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	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_m1#
E084	EQ	VEGA	S_EQV_n1# S_EQV_p1#
E085	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_n1#
E086	EQ	VEGA	S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5# S_EQV_p1#

Portfell	Riskiklass	Komponent	Instrumendid
E087	EQ	VEGA	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	CURVATURE	S_EQC_b1#
E089	EQ	CURVATURE	S_EQC_c1#
E090	EQ	CURVATURE	S_EQC_d1#
E091	EQ	CURVATURE	S_EQC_e1#
E092	EQ	CURVATURE	S_EQC_f1#
E093	EQ	CURVATURE	S_EQC_g1#
E094	EQ	CURVATURE	S_EQC_h1#
E095	EQ	CURVATURE	S_EQC_i1#
E096	EQ	CURVATURE	S_EQC_j1#
E097	EQ	CURVATURE	S_EQC_k1#
E098	EQ	CURVATURE	S_EQC_q1#
E099	EQ	CURVATURE	S_EQC_t1#
E100	EQ	CURVATURE	S_EQC_u1#
E101	EQ	CURVATURE	S_EQC_a1# S_EQC_a2#
E102	EQ	CURVATURE	S_EQC_a1# S_EQC_b1#
E103	EQ	CURVATURE	S_EQC_f1# S_EQC_ac1#
E104	EQ	CURVATURE	S_EQC_j1# S_EQC_ag1#
E105	EQ	CURVATURE	S_EQC_k1# S_EQC_ah1#
E106	EQ	CURVATURE	S_EQC_q1# S_EQC_r1#
E107	EQ	CURVATURE	S_EQC_t1# S_EQC_v1#

Portfell	Riskiklass	Komponent	Instrumendid
E108	EQ	CURVATURE	S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_y1# S_EQC_z1#
E109	EQ	CURVATURE	S_EQC_s1#
E110	EQ	CURVATURE	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	CURVATURE	S_EQC_a2# S_EQC_q1#
E112	EQ	CURVATURE	S_EQC_t1# S_EQC_u1#
E113	EQ	CURVATURE	S_EQC_a2# S_EQC_t1#
E114	EQ	CURVATURE	S_EQC_a1# S_EQC_b1# S_EQC_d1# S_EQC_s1#
E115	EQ	CURVATURE	S_EQC_a1# S_EQC_b1# S_EQC_t1# S_EQC_u1#
E116	EQ	CURVATURE	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	ALL	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#

Portfell	Riskiklass	Komponent	Instrumendid
			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	DELTA	S_FXD_b1#
F002	FX	DELTA	S_FXD_c1#
F003	FX	DELTA	S_FXD_a1# S_FXD_b1#
F005	FX	DELTA	S_FXD_b1# S_FXD_c1#
F007	FX	DELTA	S_FXD_a1# S_FXD_b1# S_FXD_c1# S_FXD_d1# S_FXD_e1# S_FXD_f1#
F008	FX	VEGA	S_FXV_b1#
F009	FX	VEGA	S_FXV_a1# S_FXV_b1#
F010	FX	VEGA	S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5#
F011	FX	VEGA	S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5#
F012	FX	VEGA	S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5# S_FXV_c1#
F013	FX	VEGA	S_FXV_c1# S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5#
F014	FX	VEGA	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#

Portfell	Riskiklass	Komponent	Instrumendid
F015	FX	CURVATURE	S_FXC_b1#
F016	FX	CURVATURE	S_FXC_c1#
F017	FX	CURVATURE	S_FXC_a1# S_FXC_b1#
F018	FX	CURVATURE	S_FXC_d1#
F019	FX	CURVATURE	S_FXC_b1# S_FXC_c1#
F020	FX	CURVATURE	S_FXC_c1# S_FXC_e1#
F021	FX	CURVATURE	S_FXC_b1# S_FXC_d1# S_FXC_e1#
F022	FX	CURVATURE	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	ALL	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	DELTA	S_FXD_d1#
F026	FX	DELTA	S_FXD_f1#
F028	FX	CURVATURE	S_FXC_f1#
N001	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1#
N002	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_c1#
N003	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_d1#
N004	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_e1#
N005	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_f1#
N006	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_g1#
N007	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_h1#
N008	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_i1#
N009	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_w1#
N010	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_j1#
N011	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_k1#
N012	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_l1#
N013	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_m1#
N014	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_n1#

Portfell	Riskiklass	Komponent	Instrumendid
N015	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_o1#
N016	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_p1#
N017	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_q1#
N018	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_u1#
N019	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_v1#
N020	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_a2#
N021	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a2# S_CND_a3#
N022	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a2# S_CND_a4#
N023	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a3# S_CND_a4#
N024	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_b1#
N025	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a3# S_CND_b1#
N026	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a4# S_CND_b1#
N027	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_b2#
N028	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_q1# S_CND_r1#
N029	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_u1# S_CND_x2#
N030	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_v1# S_CND_y1#
N031	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_u1# S_CND_x1# S_CND_x2#
N032	CSR_NON_SEC	DELTA	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	DELTA	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	DELTA	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	DELTA	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	DELTA	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	DELTA	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	DELTA	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	DELTA	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	DELTA	S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#

Portfell	Riskiklass	Komponent	Instrumendid
N041	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#
N042	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a3# S_CND_b1# S_CND_c1# S_CND_s1# S_CND_t1#
N043	CSR_NON_SEC	DELTA	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	VEGA	S_CNV_a2#
N045	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_a2#
N046	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6#
N047	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a2# S_CNV_b1#
N048	CSR_NON_SEC	VEGA	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	VEGA	S_CNV_q1# S_CNV_r1#
N050	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_s1# S_CNV_u1#
N051	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_t1# S_CNV_v1#
N052	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5#
N053	CSR_NON_SEC	VEGA	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	VEGA	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	VEGA	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	VEGA	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	VEGA	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	VEGA	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	VEGA	S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#

Portfell	Riskiklass	Komponent	Instrumendid
N060	CSR_NON_SEC	VEGA	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	VEGA	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	VEGA	S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#
N063	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_b4# S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5#
N064	CSR_NON_SEC	VEGA	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	CURVATURE	S_CNC_b1#
N066	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_c1#
N067	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_d1#
N068	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_e1#
N069	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_f1#
N070	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_g1#
N071	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_h1#
N072	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_i1#
N073	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_aa1#
N074	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_j1#
N075	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_k1#
N076	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_l1#
N077	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_m1#
N078	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_n1#
N079	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_o1#
N080	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_p1#

Portfell	Riskiklass	Komponent	Instrumendid
N081	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_q1#
N082	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_t1#
N083	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_u1#
N084	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_a2#
N085	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_b1#
N086	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_q1# S_CNC_r1#
N087	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_t1# S_CNC_v1#
N088	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_u1# S_CNC_w1#
N089	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_y1# S_CNC_z1#
N090	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_s1#
N091	CSR_NON_SEC	CURVATURE	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	CURVATURE	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	CURVATURE	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	CURVATURE	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	CURVATURE	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	CURVATURE	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	CURVATURE	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	CURVATURE	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	CURVATURE	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	CURVATURE	S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N101	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_c1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_z1#
N102	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_b1# S_CNC_d1# S_CNC_s1#

Portfell	Riskiklass	Komponent	Instrumendid
N103	CSR_NON_SEC	CURVATURE	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	ALL	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#

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

Portfell	Riskiklass	Komponent	Instrumendid
C027	CM	DELTA	S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_w1# S_CMD_x1#
C028	CM	DELTA	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	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_u1#
C030	CM	DELTA	S_CMD_c1# S_CMD_d1# S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_w1# S_CMD_x1#
C031	CM	DELTA	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	VEGA	S_CMV_a2#
C033	CM	VEGA	S_CMV_a1# S_CMV_a2#
C034	CM	VEGA	S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6#
C035	CM	VEGA	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	VEGA	S_CMV_c1# S_CMV_d1#
C037	CM	VEGA	S_CMV_e1# S_CMV_f1#
C038	CM	VEGA	S_CMV_g1# S_CMV_h1#
C039	CM	VEGA	S_CMV_i1# S_CMV_j1#
C040	CM	VEGA	S_CMV_k1# S_CMV_l1#
C041	CM	VEGA	S_CMV_m1# S_CMV_n1#
C042	CM	VEGA	S_CMV_o1# S_CMV_p1#
C043	CM	VEGA	S_CMV_q1# S_CMV_r1#
C044	CM	VEGA	S_CMV_s1# S_CMV_t1#
C045	CM	VEGA	S_CMV_u1# S_CMV_v1#
C046	CM	VEGA	S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_w1# S_CMV_x1#
C047	CM	VEGA	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	VEGA	S_CMV_a2# S_CMV_u1#

Portfell	Riskiklass	Komponent	Instrumendid
C049	CM	VEGA	S_CMV_c1# S_CMV_d1# S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_w1# S_CMV_x1#
C050	CM	VEGA	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	CURVATURE	S_CMC_b1#
C052	CM	CURVATURE	S_CMC_c1#
C053	CM	CURVATURE	S_CMC_e1#
C054	CM	CURVATURE	S_CMC_g1#
C055	CM	CURVATURE	S_CMC_i1#
C056	CM	CURVATURE	S_CMC_k1#
C057	CM	CURVATURE	S_CMC_m1#
C058	CM	CURVATURE	S_CMC_o1#
C059	CM	CURVATURE	S_CMC_q1#
C060	CM	CURVATURE	S_CMC_s1#
C061	CM	CURVATURE	S_CMC_u1#
C062	CM	CURVATURE	S_CMC_a1# S_CMC_a2#
C063	CM	CURVATURE	S_CMC_a1# S_CMC_b1#
C064	CM	CURVATURE	S_CMC_c1# S_CMC_d1#
C065	CM	CURVATURE	S_CMC_e1# S_CMC_f1#
C066	CM	CURVATURE	S_CMC_g1# S_CMC_h1#
C067	CM	CURVATURE	S_CMC_i1# S_CMC_j1#
C068	CM	CURVATURE	S_CMC_k1# S_CMC_l1#
C069	CM	CURVATURE	S_CMC_m1# S_CMC_n1#
C070	CM	CURVATURE	S_CMC_o1# S_CMC_p1#
C071	CM	CURVATURE	S_CMC_q1# S_CMC_r1#
C072	CM	CURVATURE	S_CMC_s1# S_CMC_t1#
C073	CM	CURVATURE	S_CMC_u1# S_CMC_v1#
C074	CM	CURVATURE	S_CMC_a2# S_CMC_b1#
C075	CM	CURVATURE	S_CMC_g1# S_CMC_z1#

Portfell	Riskiklass	Komponent	Instrumendid
C076	CM	CURVATURE	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	CURVATURE	S_CMC_a2# S_CMC_u1#
C078	CM	CURVATURE	S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_y1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_x1#
C079	CM	CURVATURE	S_CMC_x1# S_CMC_g1# S_CMC_z1#
C080	CM	CURVATURE	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	ALL	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#“