Europos Sąjungos
oficialusis leidinys

LT
L serija

2025/379

2025 3 12

KOMISIJOS ĮGYVENDINIMO REGLAMENTAS (ES) 2025/379

2025 m. vasario 26 d.

kuriuo dėl lyginamųjų portfelių ir informacijos teikimo formų bei nurodymų, naudotinų Sąjungoje teikiant informaciją pagal Europos Parlamento ir Tarybos direktyvos 2013/36/ES 78 straipsnio 2 dalį, iš dalies keičiami Įgyvendinimo reglamente (ES) 2016/2070 nustatyti techniniai įgyvendinimo standartai

(Tekstas svarbus EEE)

EUROPOS KOMISIJA,

atsižvelgdama į Sutartį dėl Europos Sąjungos veikimo,

atsižvelgdama į 2013 m. birželio 26 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyvą 2013/36/ES dėl galimybės verstis kredito įstaigų veikla ir dėl riziką ribojančios kredito įstaigų priežiūros, kuria iš dalies keičiama Direktyva 2002/87/EB ir panaikinamos direktyvos 2006/48/EB bei 2006/49/EB ([1]), ypač į jos 78 straipsnio 8 dalies trečią pastraipą,

kadangi:

(1) pagal Direktyvos 2013/36/ES 78 straipsnio 1 dalį įstaigos, turinčios leidimą naudoti vidaus metodus, įpareigojamos savo kompetentingai institucijai tinkamu periodiškumu, bet bent kartą per metus pateikti savo pozicijų rizikos arba pozicijų, įtrauktų į lyginamuosius portfelius, pagal riziką įvertintų pozicijų sumų arba nuosavų lėšų reikalavimų apskaičiavimo pagal savo vidaus metodus rezultatus, kad ta kompetentinga institucija galėtų įvertinti tų vidaus metodų kokybę (t. y. atlikti lyginamąją analizę). Pagal tos direktyvos 78 straipsnio 3 dalies antrą pastraipą Europos bankininkystės institucija (EBI) turi parengti ataskaitą, kad padėtų kompetentingoms institucijoms įvertinti įstaigų vidaus metodų kokybę, remiantis lyginamosios analizės rezultatais. Dėl lyginamosios analizės taikytini atskaitomybės reikalavimai yra nurodyti kelis kartus iš dalies pakeistame Komisijos įgyvendinimo reglamente (ES) 2016/2070 ([2]). Atsižvelgiant į pasikeitusius kompetentingų institucijų vertinimų ir EBI ataskaitų pagrindinius prioritetus ir į rinkos rizikos srities teisės aktų pakeitimus, lyginamuosius portfelius ir kartu tame įgyvendinimo reglamente išdėstytus atskaitomybės reikalavimus būtina vėl atnaujinti;

(2) kredito rizikos lyginamosios analizės tikslu reikėtų pakeisti nurodymus siekiant nustatyti prievolę pateikti įsipareigojimų neįvykdymo tikimybės (PD) ir nuostolio dėl įsipareigojimų neįvykdymo (LGD) rizikos parametrus, susijusius su konservatyvumo atsargos (MoC), reguliavimo padidėjimo koeficiento ir nuosmukio komponentais, kurie modeliuose gali varijuoti. Be to, siekiant paprasčiau sklandžiai priskirti pateiktus duomenis, reikėtų nurodyti, kad įstaigos yra įpareigojamos nurodyti kompetentingos institucijos priskirtą modelio identifikatorių;

(3) Komisijos deleguotuoju reglamentu (ES) 2024/2795 ([3]) naujų nuosavų lėšų reikalavimų rinkos rizikai padengti taikymo pradžios data buvo atidėta. Todėl dabartinio vidaus modelio metodo formos šios lyginamosios analizės tikslu nėra keičiamos. Kartu reikėtų papildyti standartizuoto metodo patvirtinimo formas, į jas įtraukiant papildomus portfelius, kurių 2024 m. lyginamosios analizės metu nebuvo, nes tuo metu buvo analizuojamos tik palūkanų normų priemonės. Taip siekiama užtikrinti naujo standartizuoto metodo, naudojamo rezultatų apatinei ribai apskaičiuoti, tinkamą priežiūrą ir sklandų įgyvendinimą;

([1]) OL L 176, 2013 6 27, p. 338, ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2013/36/oj.

([2]) 2016 m. rugsėjo 14 d. Komisijos įgyvendinimo reglamentas (ES) 2016/2070, kuriuo nustatomi formų, apibrėžčių ir IT sprendimų, kuriais įstaigos turi naudotis pagal Europos Parlamento ir Tarybos direktyvos 2013/36/ES 78 straipsnio 2 dalį teikdamos duomenis Europos bankininkystės institucijai ir kompetentingoms institucijoms, techniniai įgyvendinimo standartai (OL L 328, 2016 12 2, p. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2016/2070/oj).

([3]) 2024 m. liepos 24 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2024/2795, kuriuo dėl nuosavų lėšų reikalavimų rinkos rizikai padengti taikymo datos iš dalies keičiamas Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 575/2013 (OL L, 2024/2795, 2024 10 31, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2024/2795/oj).

(4) todėl Įgyvendinimo reglamentas (ES) 2016/2070 turėtų būti atitinkamai iš dalies pakeistas;

(5) šis reglamentas grindžiamas techninių įgyvendinimo standartų projektais, kuriuos EBI pateikė Komisijai;

(6) EBI dėl techninių įgyvendinimo standartų projektų, kuriais pagrįstas šis reglamentas, surengė atviras viešas konsultacijas, išnagrinėjo galimas susijusias sąnaudas ir naudą ir paprašė Bankininkystės suinteresuotųjų subjektų grupės, įsteigtos pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 1093/2010 ([4]) 37 straipsnį, pateikti savo nuomonę,

PRIĖMĖ ŠĮ REGLAMENTĄ:

1 straipsnis

Įgyvendinimo reglamentas (ES) 2016/2070 iš dalies keičiamas taip:

1) IV priedas pakeičiamas šio reglamento I priedo tekstu;

2) V priedas pakeičiamas šio reglamento II priedo tekstu;

3) VI priedas pakeičiamas šio reglamento III priedo tekstu;

4) VII priedas pakeičiamas šio reglamento IV priedo tekstu;

5) X priedas pakeičiamas šio reglamento V priedo tekstu.

2 straipsnis

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

Šis reglamentas privalomas visas ir tiesiogiai taikomas visose valstybėse narėse.

Priimta Briuselyje 2025m. vasario 26 d.

Komisijos vardu
Pirmininkė
Ursula VON DER LEYEN

([4]) 2010 m. lapkričio 24 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 1093/2010, kuriuo įsteigiama Europos priežiūros institucija (Europos bankininkystės institucija), iš dalies keičiamas Sprendimas Nr. 716/2009/EB ir panaikinamas Komisijos sprendimas 2009/78/EB (OL L 331, 2010 12 15, p. 12, ELI; http://data.europa.eu/eli/reg/2010/1093/oj).

I PRIEDAS

„IV PRIEDAS

LYGINAMŲJŲ PORTFELIŲ PRIEŽIŪROS REZULTATAI

I DALIS. BENDRIEJI NURODYMAI

II DALIS. SU FORMA SUSIJĘ NURODYMAI

C 101 – Mažos įsipareigojimų neįvykdymo rizikos portfelių pozicijų duomenys pagal sandorio šalis

C 102 – Mažos įsipareigojimų neįvykdymo rizikos portfelių pozicijų duomenys

C 103 – Didelės įsipareigojimų neįvykdymo rizikos portfelio pozicijų duomenys

C 105.01 – Vidaus modelių apibrėžtis

C 105.02 – Vidaus modelių susiejimas su portfeliais

C 105.03 – Vidaus modelių susiejimas su šalimis

I DALIS. BENDRIEJI NURODYMAI

1. Pateikiama informacija tik apie tas sandorio šalis ir portfelius, kurių atžvilgiu ataskaitinę datą egzistuoja pradinės pozicijos arba pozicijos pritaikius KRM formos faktinė pozicija. Sandorio šalys ir portfeliai, kurių atžvilgiu pozicijų ataskaitinę datą nėra, nenurodomi.

2. Pateikiama informacija tik apie tas pozicijas, kurių vidaus modelį pagal riziką įvertintų pozicijų sumoms (RWA) apskaičiuoti kompetentinga institucija yra patvirtinusi. C 101 formoje sandorio šalies kodų, kurie baigiasi „STDA“, nurodyti nereikia. Likusių I priedo C 101 formoje pateiktų sandorio šalies kodų ir C 102 bei C 103 formose nurodytų lyginamųjų portfelių atveju pozicijos, kurioms taikomas standartizuotas metodas, ir pozicijos, kurioms atitinkama kompetentinga institucija leido laikinai arba nuolat iš dalies naudoti standartizuotą metodą, neįtraukiamos.

3. Laukeliai, kuriuose renkama netaikoma arba netinkamai apibrėžta informacija, arba paliekami tušti, arba užpildomi įrašant nuorodą „NEAKTUALU“; tai taikytina ir pagal pozicijas esant įsipareigojimų neįvykdymui įvertintiems kiekiams arba parametrams, kurių neįmanoma apskaičiuoti. Duomenų laukeliai, kurių pildyti neprivaloma, taip pat gali būti palikti tušti, arba užpildyti įrašant nuorodą „NEAKTUALU“. Nulis įrašomas tik tais atvejais, kai siekiama parodyti, kad kiekis arba parametras lygus nuliui. Nuliniam kiekiui ar parametrui nurodyti nei tuščias laukelis, nei nuoroda „NEAKTUALU“ nenaudojami.

4. Pinigų sumos nurodomos taip, kaip jos nurodytos apskaičiuojant nuosavų lėšų reikalavimus konkrečią ataskaitinę datą pagal Komisijos įgyvendinimo reglamentą (ES) 2021/451 ([1]).

([1]) 2020 m. gruodžio 17 d. Komisijos įgyvendinimo reglamentas (ES) 2021/451, kuriuo nustatomi Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 575/2013 taikymo įstaigų priežiūros ataskaitų teikimo srityje techniniai įgyvendinimo standartai ir panaikinamas Įgyvendinimo reglamentas (ES) Nr. 680/2014, (OL L 97, 2021 3 19, p. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2021/451/oj).

C 101 – Mažos įsipareigojimų neįvykdymo rizikos portfelių pozicijų duomenys pagal sandorio šalis

Specializuoto skolinimo pozicijos neįtraukiamos.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0010	Sandorio šalies kodas	I priedo C 101 formos 0010 skiltis	Nurodomas I priedo C 101 formos 0010 skiltyje nurodytas sandorio šalies kodas, atitinkantis sandorio šalį, įtrauktą į mažos įsipareigojimų neįvykdymo rizikos portfelio (toliau – LDP) imties portfelius. Šiuo unikaliu kodu identifikuojama kiekviena formos eilutė.
0020	Pozicijų klasė	Įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 II priedo 76 dalis	Kiekviena sandorio šalis priskiriama prie vienos iš šių pozicijų klasių: a) centrinių bankų ir centrinės valdžios pozicijos; b) įstaigų pozicijos; c) įmonių pozicijos: MVĮ pozicijos (mažosios ir vidutinės įmonės); d) įmonių pozicijos: specializuoto skolinimo pozicijos; e) įmonių pozicijos: kitos pozicijos; f) mažmeninės pozicijos: užtikrintos nekilnojamuoju turtu MVĮ pozicijos; g) mažmeninės pozicijos: užtikrintos nekilnojamuoju turtu ne MVĮ pozicijos; h) mažmeninės pozicijos: reikalavimus atitinkančios atnaujinamosios pozicijos; i) mažmeninės pozicijos: kitos MVĮ pozicijos; j) mažmeninės pozicijos: kitos ne MVĮ pozicijos; k) netaikoma. Įrašoma „netaikoma“ tuo atveju, kai netinka nė vienas iš sąrašo atsakymų, pavyzdžiui, kai sandorio šalies pozicijos yra priskiriamos prie kelių pozicijų klasių, iš kurių nė viena nėra akivaizdžiai pagrindinė.
0040	Reitingas		Nurodomas sandorio šaliai priskirtas vidaus reitingo kategorijos rangas pagal įstaigos taikytiną vidaus reitingų skalę. Jis atitinka skaičių seką 1, 2, 3 ir t. t. nuo mažiausios iki didžiausios rizikos, išskyrus įsipareigojimų neįvykdymą, kai yra 100 % įsipareigojimų neįvykdymo tikimybė. Kai įstaiga naudoja tolydžias reitingų skales pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 575/2013 ([2]) 169 straipsnio 3 dalį, taikomi reitingo rangai, kaip nurodyta Įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 I priedo C 08.02 formos 0005 skiltyje. Kai sandorio šalies pozicijoms priskirta keletas reitingo rangų pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 172 straipsnio 1 dalies e punkto i ar iii papunktį, nurodomas nulinis (0) reitingo rangas.

([2]) 2013 m. birželio 26 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 575/2013 dėl prudencinių reikalavimų kredito įstaigoms ir investicinėms įmonėms ir kuriuo iš dalies keičiamas Reglamentas (ES) Nr. 648/2012 (OL L 176, 2013 6 27, p. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2013/575/oj).

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0050	Sandorio šalies paskutinio reitingo data		Nurodoma sandorio šalies paskutinio reitingo data.
0060	PD	Įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 I priedo C 08.01 formos 0010 skiltis	Nurodoma sandorio šaliai priskirta PD vertė. Nurodoma ta PD, kuri naudota apskaičiuojant pagal riziką įvertintą turtą, atėmus priemonių, taikomų pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 458 straipsnį, poveikį. PD išreiškiama verte nuo 0 iki 1.
0070	Įsipareigojimų neįvykdymo statusas		Nurodomas sandorio šalies įsipareigojimų neįvykdymo statusas. Tai vienas iš šių statusų, nurodytų Reglamento (ES) Nr. 575/2013 178 straipsnyje: a) pozicijos esant įsipareigojimų neįvykdymui; b) pozicijos nesant įsipareigojimų neįvykdymo.
0080	Pradinė pozicija iki perskaičiavimo koeficientų taikymo	Įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 I priedo C 08.01 formos 0020 skiltis	Nurodoma pradinės pozicijos vertė iki visų vertės koregavimų, atidėjinių, kredito rizikos mažinimo priemonių poveikio arba kredito perskaičiavimo koeficientų taikymo.
0090	Pozicijos vertė pritaikius KRM, turintį pakeitimo poveikį, iki perskaičiavimo koeficientų taikymo	Įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 I priedo C 08.01 formos 0090 skiltis	Nurodoma suma, kuriai taikomi perskaičiavimo koeficientai (toliau – CCF) siekiant gauti EAD vertę (0110 skiltis). Tai atliekama atsižvelgiant į kredito rizikos mažinimo priemones, turinčias pozicijos pakeitimo poveikį.
0100	CCF	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 166 straipsnio 8 dalis	Nurodomas CCF svertinis vidurkis. Naudotini svoriniai daugikliai yra sumos, kurioms taikomi CCF siekiant gauti EAD. Kai sandorio šalių priemonės atitinka tik Reglamento (ES) Nr. 575/2013 166 straipsnio 8 dalyje nurodytus straipsnius, nurodomas CCF svertinis vidurkis grindžiamas visomis priemonėmis. Sandorio šalių, kurių priemonės neatitinka Reglamento (ES) Nr. 575/2013 166 straipsnio 8 dalyje nurodytų straipsnių, atveju CCF laukelis arba paliekamas tuščias, arba užpildomas nuoroda „NEAKTUALU“.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
			Kai sandorio šalys turi priemonių, atitinkančių Reglamento (ES) Nr. 575/2013 166 straipsnio 8 dalyje nurodytus straipsnius, ir priemonių, neatitinkančių jokių to reglamento 166 straipsnio 8 dalyje nurodytų straipsnių, nurodomas CCF svertinis vidurkis yra grindžiamas tik priemonėmis, atitinkančiomis Reglamento (ES) Nr. 575/2013 166 straipsnio 8 dalyje nurodytus straipsnius. Visų pirma atliekant skaičiavimus neatsižvelgiama į priemones, atitinkančias straipsnius, nurodytus to reglamento 166 straipsnio 10 dalyje. Kai įstaiga Reglamento (ES) Nr. 575/2013 166 straipsnio 8 dalyje nurodytiems straipsniams taiko savus CCF įverčius, tie CCF naudojami apskaičiuojant CCF svertinį vidurkį. Kai įstaiga Reglamento (ES) Nr. 575/2013 166 straipsnio 8 dalyje nurodytiems straipsniams savų CCF įverčių netaiko, naudojami Reglamento (ES) Nr. 575/2013 166 straipsnio 8 dalyje pateikti reguliavimo CCF. CCF išreiškiamas verte nuo 0 iki 1.
0110	EAD	Įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 I priedo C 08.01 formos 0110 skiltis	Nurodoma pozicijos vertė.
0120	Užtikrinimo priemonių vertė	Įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 I priedo C 08.01 formos 0150–0210 skiltys	Nurodoma užtikrinimo priemonių rinkos vertė.
0130	Hipotetinis nuostolio dėl įsipareigojimų neįvykdymo (LGD) įvertis didesnio prioriteto neužtikrintų pozicijų atžvilgiu nesant įsipareigojimo neįkeisti	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 161 straipsnis	Hipotetiniai savi nuostolių dėl įsipareigojimų neįvykdymo (toliau – LGD) įverčiai, kuriuos įstaiga taikytų sandorio šalies pozicijoms, pateikiami laikantis šių sąlygų: (a) pozicijų mastas yra toks pats kaip ir LGD vertės, nurodytos 0150 skiltyje, atveju; (b) pozicijos yra didesnio prioriteto ir neužtikrintos; (c) nesama jokio įsipareigojimo neįkeisti. Įsipareigojimas neįkeisti yra sąlyga, pagal kurią paskolos gavėjas arba skolos vertybinių popierių emitentas įsipareigoja neįkeisti jokio savo turto kitai šaliai.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0140	Hipotetinis LGD įvertis didesnio prioriteto neužtikrintų pozicijų atžvilgiu esant įsipareigojimui neįkeisti	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 161 straipsnis	Hipotetiniai savi LGD įverčiai, kuriuos įstaiga taikytų sandorio šalies pozicijoms, pateikiami laikantis šių sąlygų: (a) pozicijų mastas yra toks pats kaip ir LGD vertės, nurodytos 0150 skiltyje, atveju; (b) pozicijos yra didesnio prioriteto ir neužtikrintos; (c) yra įsipareigojimas neįkeisti. Įsipareigojimas neįkeisti yra sąlyga, pagal kurią paskolos gavėjas arba skolos vertybinių popierių emitentas įsipareigoja neįkeisti jokio savo turto kitai šaliai.
0150	LGD	Įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 I priedo C 08.01 formos 0230 ir 0240 skiltys	Nurodomas sandorio šalių pozicijų pagal EAD įvertintas LGD verčių svertinis vidurkis. LGD vertės atitinka RWA apskaičiuoti naudotas vertes. Konkrečiau, jeigu įstaiga yra gavusi savo kompetentingos institucijos leidimą taikyti savo pačios apskaičiuotus LGD įverčius, LGD yra grindžiami pačios įstaigos įverčiais, o kitu atveju LGD įverčiai grindžiami reguliavimo LGD vertėmis, atsižvelgiant į taikytiną rizikos mažinimą. Į vertę įtraukiamos stambių reguliuojamų finansų sektoriaus subjektų ir nereguliuojamųjų finansų subjektų LGD vertės. Į priemonių, pradėtų taikyti pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 458 straipsnį, poveikį neatsižvelgiama. LGD išreiškiamas verte nuo 0 iki 1.
0160	Terminas	Įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 I priedo C 08.01 formos 0250 skiltis	Nurodomas sandorio šalies pozicijų terminas, įvertintas pagal EAD. Jis išreiškiamas dienų skaičiumi.
0170	RWA	Įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 I priedo C 08.01 formos 0260 skiltis	Nurodoma RWA pritaikius (MVĮ ir infrastruktūros) rėmimo koeficientus. Į RWA vertę pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 458 straipsnį galimų taikyti priemonių poveikis neįtraukiamas.

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

C 102 – Mažos įsipareigojimų neįvykdymo rizikos portfelių pozicijų duomenys

Portfelių, kurie I priede yra nurodyti pagal kitą užtikrinimo statusą nei „netaikoma“, atveju, kai pagal patvirtintą modelį atskiri LGD skaičiavimai užtikrintoms ir neužtikrintoms pozicijos dalims neatliekami, galima neteikti šios informacijos: LGD (0130 skiltis), LGD netaikant priežiūros priemonių (0131 skiltis), LGD netaikant konservatyvumo atsargos (MoC) ir priežiūros priemonių (0132 skiltis), LGD netaikant MoC, priežiūros priemonių ir nuosmukio komponento (0133 skiltis), tikėtino nuostolio suma (0150 skiltis) ir RWA (0170 skiltis).

Apie portfelius, kurių reguliavimo metodas yra „specializuoto skolinimo skirstymo kriterijai“, neteikiama ši informacija: PD (0060 skiltis), PD netaikant priežiūros priemonių (0061skiltis), PD netaikant MoC ir priežiūros priemonių (0062 skiltis), LGD (0130 skiltis), LGD netaikant priežiūros priemonių (0131 skiltis), LGD netaikant MoC ir priežiūros priemonių (0132 skiltis), LGD netaikant MoC, priežiūros priemonių ir nuosmukio komponento (0133 skiltis).

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0010	Portfelio identifikavimo kodas	I priedo C 102 formos 0010 skiltis	Nurodomas portfelį apibrėžiantis identifikavimo kodas, pateiktas I priedo C 102 formos 0010 skiltyje. Šiuo unikaliu identifikavimo kodu identifikuojama kiekviena formos eilutė. Pozicijos gali būti priskiriamos ne vienam portfelio identifikavimo kodui: pozicijos arba jų dalys nurodomos prie kiekvieno taikytino portfelio identifikavimo kodo.
0040	Įsipareigojančiųjų asmenų skaičius		Nurodomas įsipareigojančiųjų asmenų skaičius. Į jį įtraukiami tik įsipareigojantieji asmenys, kurių vertė, nurodyta 0080 arba 0090 skiltyje, yra teigiama. Kai dėl kredito rizikos mažinimo priemonės yra taikomas visapusiškas pakeitimas, pradinis įsipareigojantysis asmuo pridedamas prie pradinio portfelio įsipareigojančiųjų asmenų skaičiaus, o garantas pridedamas prie garanto portfelio įsipareigojančiųjų asmenų skaičiaus.
0060	PD	Įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 I priedo C 08.01 formos 0010 skiltis	Nurodoma ta PD, kuri naudota apskaičiuojant pagal riziką įvertintą turtą, atėmus galimų priemonių, pradėtų taikyti pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 458 straipsnį, poveikį. Atskirą rangą arba grupę atitinkančių portfelių atveju nurodoma konkretaus įsipareigojančiojo asmens rangui arba grupei priskirta PD. Kai portfelius sudaro įvairių rangų arba grupių įsipareigojančiųjų asmenų sankaupa, nurodomas pagal EAD įvertintas PD, priskirtų į tą sankaupą įtrauktoms pozicijoms, svertinis vidurkis. PD išreiškiama verte nuo 0 iki 1.
0061	PD netaikant priežiūros priemonių		PD netaikant priežiūros priemonių yra PD, grindžiama Reglamento (ES) Nr. 575/2013 179 ir 180 straipsnių nuostatomis, taikant įstaigos pridėtą MoC, tačiau netaikant kompetentingų institucijų nustatytų priemonių (koeficientų, padidėjimo koeficientų, žemiausių ribų ar panašių priemonių, kuriomis tiesiogiai didinama PD). Atskirą rangą arba grupę atitinkančių portfelių atveju nurodoma to rango PD, taikant MoC, bet netaikant priežiūros priemonių. Kai portfelius sudaro įvairių rangų arba grupių įsipareigojančiųjų asmenų sankaupa, nurodomas pagal EAD įvertintas atitinkamų pozicijų, taikant MoC, bet netaikant priežiūros priemonių, PD svertinis vidurkis. PD netaikant priežiūros priemonių išreiškiama verte nuo 0 iki 1. Kai įstaiga atitinkamų konservatyvių koregavimų atskirti negali, taikomas I dalies 3 punktas.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0062	PD netaikant MoC (konservatyvumo atsargų) ir priežiūros priemonių		PD netaikant MoC ir priežiūros priemonių yra PD, netaikant nei MoC, kurią įstaiga pridėjo pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 179 straipsnio 1 dalies f punktą ir 180 straipsnio 1 dalies e punktą, nei kompetentingų institucijų nustatytų priemonių (koeficientų, padidėjimo koeficientų, žemiausių ribų ar panašių priemonių, kuriomis tiesiogiai didinama PD) poveikio. Atskirą rangą arba grupę atitinkančių portfelių atveju nurodoma to rango PD, netaikant MoC ir netaikant priežiūros priemonių. Kai portfelius sudaro įvairių rangų arba grupių įsipareigojančiųjų asmenų sankaupa, nurodomas pagal EAD įvertintas atitinkamų pozicijų, netaikant MoC ir priežiūros priemonių, PD svertinis vidurkis. PD netaikant MoC ir priežiūros priemonių išreiškiama verte nuo 0 iki 1. Kai įstaiga atitinkamų konservatyvių koregavimų atskirti negali, taikomas I dalies 3 punktas.
0080	Pradinė pozicija iki perskaičiavimo koeficientų taikymo	Įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 I priedo C 08.01 formos 0020 skiltis	Nurodoma pradinės pozicijos vertė iki visų vertės koregavimų, atidėjinių, kredito rizikos mažinimo priemonių poveikio arba kredito perskaičiavimo koeficientų taikymo.
0090	Pozicijos vertė pritaikius KRM, turintį pakeitimo poveikį, iki perskaičiavimo koeficientų taikymo	Įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 I priedo C 08.01 formos 0090 skiltis	Nurodoma suma, kuriai taikomi perskaičiavimo koeficientai (toliau – CCF) siekiant gauti EAD vertę (0110 skiltis). Tai atliekama atsižvelgiant į kredito rizikos mažinimo priemones, turinčias pozicijos pakeitimo poveikį.
0100	CCF	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 166 straipsnio 8 dalis	Nurodomas CCF svertinis vidurkis. Naudotini svoriniai daugikliai yra sumos, kurioms taikomi CCF siekiant gauti EAD. Kai portfelį sudaro priemonės, atitinkančios tik Reglamento (ES) Nr. 575/2013 166 straipsnio 8 dalyje nurodytus straipsnius, nurodomas CCF svertinis vidurkis yra grindžiamas visomis priemonėmis. Portfelių, kurių nė viena priemonė neatitinka Reglamento (ES) Nr. 575/2013 166 straipsnyje nurodytų straipsnių, atveju CCF laukelis arba paliekamas tuščias, arba užpildomas nuoroda „NEAKTUALU“. Kai portfeliai apima priemones, atitinkančias Reglamento (ES) Nr. 575/2013 166 straipsnio 8 dalyje nurodytus straipsnius, ir priemones, neatitinkančias jokių to reglamento 166 straipsnio 8 dalyje nurodytų straipsnių, nurodomas CCF svertinis vidurkis yra grindžiamas tik priemonėmis, atitinkančiomis Reglamento (ES) Nr. 575/2013 166 straipsnio 8 dalyje nurodytus straipsnius. Visų pirma atliekant skaičiavimus neatsižvelgiama į priemones, atitinkančias straipsnius, nurodytus to reglamento

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
			166 straipsnio 10 dalyje. Kai įstaiga Reglamento (ES) Nr. 575/2013 166 straipsnio 8 dalyje nurodytiems straipsniams taiko savus CCF įverčius, tie CCF naudojami apskaičiuojant CCF svertinį vidurkį. Kai įstaiga Reglamento (ES) Nr. 575/2013 166 straipsnio 8 dalyje nurodytiems straipsniams savų CCF įverčių netaiko, naudojami Reglamento (ES) Nr. 575/2013 166 straipsnio 8 dalyje pateikti reguliavimo CCF. CCF išreiškiamas verte nuo 0 iki 1.
0110	EAD	Įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 I priedo C 08.01 formos 0110 skiltis	Nurodoma pozicijos vertė.
0120	Užtikrinimo priemonių vertė	Įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 I priedo C 08.01 formos 0150–0210 skiltys	Nurodoma užtikrinimo priemonių rinkos vertė.
0130	LGD	Įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 I priedo C 08.01 formos 0230 ir 0240 skiltys	Nurodomas atitinkamo portfelio pozicijų pagal EAD įvertintas LGD verčių svertinis vidurkis. LGD vertės atitinka RWA apskaičiuoti naudotas vertes. Konkrečiau, jeigu įstaiga yra gavusi savo kompetentingos institucijos leidimą taikyti savo pačios apskaičiuotus LGD įverčius, LGD yra grindžiami pačios įstaigos įverčiais, o kitu atveju LGD įverčiai grindžiami reguliavimo LGD vertėmis, atsižvelgiant į taikytiną rizikos mažinimą. Į vertę įtraukiamos stambių reguliuojamų finansų sektoriaus subjektų ir nereguliuojamųjų finansų subjektų pozicijos ir atitinkami jų LGD. Į priemonių, pradėtų taikyti pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 458 straipsnį, poveikį neatsižvelgiama. LGD išreiškiamas verte nuo 0 iki 1.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0131	LGD netaikant priežiūros priemonių		LGD netaikant priežiūros priemonių yra LGD, grindžiamas Reglamento (ES) Nr. 575/2013 179 ir 181 straipsnių nuostatomis, taikant įstaigos pridėtą MoC, tačiau netaikant kompetentingų institucijų nustatytų priemonių (koeficientų, padidėjimo koeficientų, žemiausių ribų ar panašių priemonių, kuriomis tiesiogiai didinama LGD). Atskirą rangą arba grupę atitinkančių portfelių atveju nurodoma to rango LGD, taikant MoC, bet netaikant priežiūros priemonių. Kai portfelius sudaro įvairių rangų arba grupių įsipareigojančiųjų asmenų sankaupa, nurodomas pagal EAD įvertintas atitinkamų pozicijų, taikant MoC, bet netaikant priežiūros priemonių, LGD svertinis vidurkis. LGD netaikant priežiūros priemonių išreiškiama verte nuo 0 iki 1. Kai įstaiga atitinkamų konservatyvių koregavimų atskirti negali, taikomas I dalies 3 punktas.
0132	LGD netaikant MoC ir priežiūros priemonių		LGD netaikant MoC ir priežiūros priemonių yra LGD, netaikant nei MoC, kurią įstaiga pridėjo pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 179 straipsnio 1 dalies f punktą ir 181 straipsnį, nei kompetentingų institucijų nustatytų priemonių (koeficientų, padidėjimo koeficientų, žemiausių ribų ar panašių priemonių, kuriomis tiesiogiai didinama LGD) poveikio. Atskirą rangą arba grupę atitinkančių portfelių atveju nurodoma to rango LGD, netaikant MoC ir netaikant priežiūros priemonių. Kai portfelius sudaro įvairių rangų arba grupių įsipareigojančiųjų asmenų sankaupa, nurodomas pagal EAD įvertintas atitinkamų pozicijų, netaikant MoC ir priežiūros priemonių, LGD svertinis vidurkis. LGD netaikant MoC ir priežiūros priemonių išreiškiama verte nuo 0 iki 1. Kai įstaiga atitinkamų konservatyvių koregavimų atskirti negali, taikomas I dalies 3 punktas.
0133	LGD netaikant MoC, priežiūros priemonių ir nuosmukio komponento		LGD netaikant MoC, priežiūros priemonių ir nuosmukio komponento yra LGD, netaikant nei MoC, kurią įstaiga pridėjo pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 179 straipsnio 1 dalies f punktą ir 181 straipsnį, nei kompetentingų institucijų nustatytų priemonių (koeficientų, padidėjimo koeficientų, žemiausių ribų ar panašių priemonių, kuriomis tiesiogiai didinama LGD) poveikio, nei nuosmukio komponento, kaip reikalaujama to reglamento 181 straipsnio 1 dalies b punkte. Atskirą rangą arba grupę atitinkančių portfelių atveju nurodoma to rango LGD, netaikant MoC, netaikant priežiūros priemonių ir netaikant nuosmukio komponento. Kai portfelius sudaro įvairių rangų arba grupių įsipareigojančiųjų asmenų sankaupa, nurodomas pagal EAD įvertintas atitinkamų pozicijų, netaikant MoC, priežiūros priemonių ir nuosmukio komponento, LGD svertinis vidurkis.

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

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
			LGD netaikant MoC, priežiūros priemonių ir nuosmukio komponento išreiškiama verte nuo 0 iki 1. Kai įstaiga atitinkamų konservatyvių koregavimų atskirti negali, taikomas I dalies 3 punktas.
0140	Terminas	Įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 I priedo C 08.01 formos 0250 skiltis	Nurodomas pagal EAD įvertintas terminas. Jis išreiškiamas dienų skaičiumi. Nenurodoma informacija, susijusi su tomis pozicijomis, kurių atveju terminas nėra vienas iš dydžių, naudojamų apskaičiuojant RWA. Visų pirma termino nereikia nurodyti portfelių, apimančių pozicijų klasės „mažmeninės pozicijos“ pozicijas, atveju.
0150	Tikėtino nuostolio suma	Įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 I priedo C 08.01 formos 0280 skiltis	Nurodoma tikėtino nuostolio suma.
0160	Pozicijų esant įsipareigojimų neįvykdymui atidėjiniai	Įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 I priedo C 09.02 formos 0050, 0055 ir 0060 skiltys	Nurodomi pozicijų esant įsipareigojimų neįvykdymui atidėjiniai. Jie apima visus pozicijų esant įsipareigojimų neįvykdymui bendrosios ir specifinės kredito rizikos koregavimus, kaip nurodyta Reglamento (ES) Nr. 575/2013 110 straipsnyje. (Vienkartinė priemonė) Kredito rizikos koregavimai, kuriuos įstaiga taiko dėl įsipareigojimų neįvykdymo apibrėžties taikymo pokyčių, nurodomi taip, kaip įrašyti įstaigos duomenų bazėje.
0170	RWA	Įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 I priedo C 08.01 formos 0260 skiltis	Nurodoma RWA pritaikius (MVĮ ir infrastruktūros) rėmimo koeficientus. Į RWA vertę pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 458 straipsnį galimų taikyti priemonių poveikis neįtraukiamas.
0180	RWA taikant standartizuotą metodą	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 trečios dalies II antraštinės dalies 2 skyrius	Pagal riziką įvertintas turtas taikant standartizuotą metodą – hipotetinė RWA suma, apskaičiuota pozicijoms pritaikius standartizuotą kredito rizikos vertinimo metodą vietoj IRB metodo.

C 103 – Didelės įsipareigojimų neįvykdymo rizikos portfelio pozicijų duomenys

Portfelių, kurie I priede yra nurodyti pagal kitą užtikrinimo statusą nei „netaikoma“, atveju, kai pagal patvirtintą modelį atskiri LGD skaičiavimai užtikrintoms ir neužtikrintoms pozicijos dalims neatliekami, galima neteikti šios informacijos: LGD (0130 skiltis), LGD netaikant priežiūros priemonių (0131 skiltis), LGD netaikant MoC ir priežiūros priemonių (0132 skiltis), LGD netaikant MoC, priežiūros priemonių ir nuosmukio komponento (0133 skiltis), tikėtino nuostolio suma (0150 skiltis), RWA (0170 skiltis), praėjusių metų nuostolio lygis (0210 skiltis) ir paskutinių 5 metų nuostolio lygis (0220 skiltis).

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0010	Portfelio identifikavimo kodas		Nurodomas portfelį apibrėžiantis identifikavimo kodas, pateiktas I priedo C 103 formos 0010 skiltyje. Šiuo unikaliu identifikavimo kodu identifikuojama kiekviena formos eilutė. Pozicijos gali būti priskiriamos ne vienam portfelio identifikavimo kodui: pozicijos arba jų dalys nurodomos prie kiekvieno taikytino portfelio identifikavimo kodo.
0040	Įsipareigojančiųjų asmenų skaičius		Taikomi nurodymai, skirti I priedo C 102 formos 0040 skilčiai.
0060	PD		Taikomi nurodymai, skirti I priedo C 102 formos 0060 skilčiai.
0061	PD netaikant priežiūros priemonių		Taikomi nurodymai, skirti I priedo C 102 formos 0061 skilčiai.
0062	PD netaikant MoC (konservatyvumo atsargų) ir priežiūros priemonių		Taikomi nurodymai, skirti I priedo C 102 formos 0062 skilčiai.
0080	Pradinė pozicija iki perskaičiavimo koeficientų taikymo		Taikomi nurodymai, skirti I priedo C 102 formos 0080 skilčiai.
0090	Pozicijos vertė pritaikius KRM, turintį pakeitimo poveikį, iki perskaičiavimo koeficientų taikymo		Taikomi nurodymai, skirti I priedo C 102 formos 0090 skilčiai.
0100	CCF		Taikomi nurodymai, skirti I priedo C 102 formos 0100 skilčiai.
0110	EAD		Taikomi nurodymai, skirti I priedo C 102 formos 0110 skilčiai.
0120	Užtikrinimo priemonių vertė		Taikomi nurodymai, skirti I priedo C 102 formos 0120 skilčiai.
0130	LGD		Taikomi nurodymai, skirti I priedo C 102 formos 0130 skilčiai.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0131	LGD netaikant priežiūros priemonių		Taikomi nurodymai, skirti I priedo C 102 formos 0131 skilčiai.
0132	LGD netaikant MoC ir priežiūros priemonių		Taikomi nurodymai, skirti I priedo C 102 formos 0132 skilčiai.
0133	LGD netaikant MoC, priežiūros priemonių ir nuosmukio komponento		Taikomi nurodymai, skirti I priedo C 102 formos 0133 skilčiai.
0140	Terminas		Taikomi nurodymai, skirti I priedo C 102 formos 0140 skilčiai.
0150	Tikėtino nuostolio suma		Taikomi nurodymai, skirti I priedo C 102 formos 0150 skilčiai.
0160	Pozicijų esant įsipareigojimų neįvykdymui atidėjiniai		Taikomi nurodymai, skirti I priedo C 102 formos 0160 skilčiai.
0170	RWA		Taikomi nurodymai, skirti I priedo C 102 formos 0170 skilčiai.
0180	RWA taikant standartizuotą metodą		Taikomi nurodymai, skirti I priedo C 102 formos 0180 skilčiai.
0190	Praėjusių metų įsipareigojimų neįvykdymo rodiklis		Nurodomas paskutinių metų įsipareigojimų neįvykdymo rodiklis. Tuo tikslu įsipareigojimų neįvykdymo rodiklis nustatomas kaip santykis tarp toliau nurodytų verčių: a) pozicijų, kurių atžvilgiu lygiai prieš vienus metus iki ataskaitinės datos įsipareigojimų neįvykdymo atvejų nebuvo, bet per vienų metų laikotarpį iki ataskaitinės datos įsipareigojimų neįvykdymo atvejų atsirado, sumos (pradinė pozicija (0080 skiltis), įvertinta prieš vienus metus iki ataskaitinės datos) ir b) pozicijų, kurių atžvilgiu prieš vienus metus iki ataskaitinės datos nebuvo įsipareigojimų neįvykdymo atvejų, sumos (pradinė pozicija (0080 skiltis), įvertinta prieš vienus metus iki ataskaitinės datos). Apskaičiuojant neatsižvelgiama į naujas pozicijas, atsiradusias per metus iki ataskaitinės datos. Pozicijos, kurių atžvilgiu per metus iki ataskaitinės datos įsipareigojimų neįvykdymo atvejų buvo, tačiau jų statusas pasikeitė, įtraukiamos tiek į skaitiklį, tiek į vardiklį. To paties įsipareigojančiojo asmens kelių įsipareigojimų neįvykdymas įtraukiamas tik vieną kartą.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
			Ši informacija nurodoma tik portfelių, kurių identifikavimo kodas susietas su pozicijomis nesant įsipareigojimų neįvykdymo, atveju; ji išreiškiama verte nuo 0 iki 1. Įsipareigojimų neįvykdymo atvejai ir jų datos nurodomi taip, kaip įrašyta taikant įvykio metu galiojančią įsipareigojimų neįvykdymo apibrėžtį, t. y. įstaigos vertinimu, pagal įstaigos tuo metu taikomą įsipareigojimų neįvykdymo apibrėžtį įsipareigojimų neįvykdymas įvyko. Įsipareigojimų neįvykdymo apibrėžties pokyčiai vertinami tik perspektyviai nuo jų įgyvendinimo datos, o retrospektyviai šios apibrėžties pokyčiai po konkretaus įsipareigojimų neįvykdymo įvykio (modeliavimas atgaline data) netaikomi.
0200	Paskutinių 5 metų įsipareigojimų neįvykdymo rodiklis		Nurodomas paskutinių penkerių metų iki ataskaitinės datos įsipareigojimų neįvykdymo rodiklių svertinis vidurkis. Taikoma 0190 skiltyje pateikta įsipareigojimų neįvykdymo rodiklio apibrėžtis. Naudotini svoriniai daugikliai yra pozicijos nesant įsipareigojimų neįvykdymo, naudojamos apskaičiuojant įsipareigojimų neįvykdymo rodiklį pagal 0190 skiltį. Kai pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 180 straipsnio 1 dalies h punktą arba 2 dalies e punktą įstaiga neprivalo apskaičiuoti paskutinių penkerių metų iki ataskaitinės datos įsipareigojimų neįvykdymo rodiklio, ji parengia pakaitinį kintamąjį, naudodama ilgiausio laikotarpio iki penkerių metų iki ataskaitinės datos istorinius duomenis, ir kompetentingai institucijai pateikia skaičiavimus pagrindžiančius dokumentus. Ši informacija nurodoma tik portfelių, kurių identifikavimo kodas susietas su pozicijomis nesant įsipareigojimų neįvykdymo, atveju; ji išreiškiama verte nuo 0 iki 1. Įsipareigojimų neįvykdymo atvejai ir jų datos nurodomi taip, kaip įrašyta taikant įvykio metu galiojančią įsipareigojimų neįvykdymo apibrėžtį, t. y. įstaigos vertinimu, pagal įstaigos tuo metu taikomą įsipareigojimų neįvykdymo apibrėžtį įsipareigojimų neįvykdymas įvyko. Įsipareigojimų neįvykdymo apibrėžties pokyčiai vertinami tik perspektyviai nuo jų įgyvendinimo datos, o retrospektyviai šios apibrėžties pokyčiai po konkretaus įsipareigojimų neįvykdymo įvykio (modeliavimas atgaline data) netaikomi.
0210	Praėjusių metų nuostolio lygis		Paskutiniais metais stebėtas nuostolio lygis nurodomas tik portfelių, kurių identifikavimo kodas susietas su pozicijomis nesant įsipareigojimų neįvykdymo ir pozicijomis esant įsipareigojimų neįvykdymui, atveju. Portfelių, kurių atžvilgiu nėra įsipareigojimų neįvykdymo, atveju nuostolio lygis apskaičiuojamas per metus iki ataskaitinės datos pozicijoms, kurių atžvilgiu lygiai prieš vienus metus iki ataskaitinės datos nebuvo įsipareigojimų neįvykdymo atvejų, bet per metus iki ataskaitinės datos jų atsirado, taikytus kredito rizikos koregavimus ir nurašytas sumas padalijus iš pozicijų, kurių atžvilgiu lygiai prieš vienus metus iki ataskaitinės datos nebuvo įsipareigojimų neįvykdymo atvejų, bet per metus iki ataskaitinės datos jų atsirado, EAD sumos, įvertintos lygiai prieš vienus metus iki ataskaitinės datos.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
			Nuostolio lygio skaitiklis apima visus kredito rizikos koregavimus ir nurašytas sumas, susijusius su pozicijomis, kurių atžvilgiu per metus iki ataskaitinės datos buvo įsipareigojimų neįvykdymo atvejų, įskaitant kredito rizikos koregavimus, taikytus iki įsipareigojimų neįvykdymo datos. Apskaičiuojant neatsižvelgiama į naujas pozicijas, atsiradusias per metus iki ataskaitinės datos. Pozicijos, kurių atžvilgiu per metus iki ataskaitinės datos įsipareigojimų neįvykdymo atvejų buvo, tačiau jų statusas pasikeitė, įtraukiamos į nuostolio lygio vardiklį, o į tų pozicijų kredito rizikos koregavimus ir nurašytas sumas atsižvelgiama nuostolio lygio skaitiklyje. Į to paties įsipareigojančiojo asmens kelių įsipareigojimų neįvykdymą atsižvelgiama tik vieną kartą. Portfelių, kurių atžvilgiu yra neįvykdytų įsipareigojimų, nuostolio lygis apskaičiuojamas vertinant pozicijas, kurių atžvilgiu lygiai prieš vienus metus iki ataskaitinės datos buvo neįvykdytų įsipareigojimų. Ši vertė gaunama sudedant: a) tų pozicijų kredito rizikos koregavimus, atliktus prieš vienus metus iki ataskaitinės datos, ir b) per metus iki ataskaitinės datos taikytus kredito rizikos koregavimus ir nurašytas sumas ir gautą vertę padalijant iš konkrečių pozicijų EAD sumos, įvertintos lygiai prieš vienus metus iki ataskaitinės datos. Apskaičiuojant neatsižvelgiama į naujus įsipareigojimų neįvykdymo atvejus per metus iki ataskaitinės datos. Pozicijos, kurių įsipareigojimų statusas per metus iki ataskaitinės datos vėl pasikeitė iš neįvykdytų į įvykdytus, įtraukiamos į nuostolio lygio vardiklį, o tų pozicijų kredito rizikos koregavimai ir nurašytos sumos įtraukiami į nuostolio lygio skaitiklį. To paties įsipareigojančiojo asmens kelių įsipareigojimų neįvykdymas įtraukiamas tik vieną kartą. Nuostolio lygis išreiškiamas verte nuo 0 iki 1. Įsipareigojimų neįvykdymo atvejai ir jų datos nurodomi taip, kaip įrašyta taikant įvykio metu galiojančią įsipareigojimų neįvykdymo apibrėžtį, t. y. įstaigos vertinimu, pagal įstaigos tuo metu taikomą įsipareigojimų neįvykdymo apibrėžtį įsipareigojimų neįvykdymas įvyko. Įsipareigojimų neįvykdymo apibrėžties pokyčiai vertinami tik perspektyviai nuo jų įgyvendinimo datos, o retrospektyviai šios apibrėžties pokyčiai po konkretaus įsipareigojimų neįvykdymo įvykio (modeliavimas atgaline data) netaikomi.
0220	Paskutinių 5 metų nuostolio lygis		Pagal EAD įvertintas paskutinių penkerių metų iki ataskaitinės datos stebėto nuostolio lygio svertinis vidurkis nurodomas tik portfelių, kurių identifikavimo kodas susietas su pozicijomis nesant įsipareigojimų neįvykdymo ir pozicijomis esant įsipareigojimų neįvykdymui, atveju. Taikoma 0210 skiltyje pateikta nuostolio lygio apibrėžtis. Paskutinių penkerių metų nuostolio lygis vertinamas pagal paskutinių penkerių metų metinius nuostolio lygius, kai šie metiniai nuostolio lygiai analogiškai nustatomi pagal nuostolio lygio apibrėžtį 0210 skiltyje; visų pirma metiniai nuostolio lygiai neapima papildomų kredito rizikos koregavimų ir nurašytų sumų pokyčių, įvykusių po kiekvieno metinio nuostolio lygio stebėto laikotarpio (kalendorinių metų). Kai pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 181 straipsnio 2 dalies paskutinę pastraipą įstaiga neprivalo naudoti paskutinių penkerių metų iki ataskaitinės datos duomenų, ji parengia pakaitinį kintamąjį, naudodama ilgiausio laikotarpio iki penkerių metų iki ataskaitinės datos istorinius duomenis, ir kompetentingai institucijai pateikia skaičiavimus pagrindžiančius dokumentus. Nuostolio lygis išreiškiamas verte nuo 0 iki 1. Įsipareigojimų neįvykdymo atvejai ir jų datos nurodomi taip, kaip įrašyta taikant įvykio metu galiojančią įsipareigojimų neįvykdymo apibrėžtį, t. y. įstaigos vertinimu, pagal įstaigos tuo metu taikomą įsipareigojimų neįvykdymo apibrėžtį įsipareigojimų neįvykdymas įvyko. Įsipareigojimų neįvykdymo apibrėžties pokyčiai vertinami tik perspektyviai nuo jų įgyvendinimo datos, o retrospektyviai šios apibrėžties pokyčiai po konkretaus įsipareigojimų neįvykdymo įvykio (modeliavimas atgaline data) netaikomi.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0250	RWA-		Įstaigos apskaičiuoja ir nurodo RWA- vertę I priedo 103 formoje nurodytiems portfeliams su šiais identifikavimo kodais: 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- yra hipotetinė RWA pritaikius rėmimo koeficientus, kuri būtų gauta kiekvienai pozicijai pritaikius PD- vertes, o ne įstaigos PD vertes. Likusieji skaičiavimams reikalingi parametrai nekeičiami. PD- vertė grindžiama apskaičiavimais, atskirai atliktais kiekvieno įsipareigojančiojo asmens rango atžvilgiu. Naudojami įsipareigojančiojo asmens rangai, nurodyti Komisijos įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 I priedo C 08.02 formos 0005 skiltyje (nurodymai pateikti to reglamento II priedo C 08.01 formos 0010 skiltyje ir C 08.02 formoje). Kiekvieno įsipareigojančiojo asmens rango atveju p^- yra mažiausia teigiama vertė, tenkinanti lygtį $$p^- + \Phi^{-1}(q) \bullet \sqrt{\frac{p^- \bullet (1-p^-)}{n}} \geq DR_{1y}$$ where $DR_{1y} > 0$, ir $p^- = 0$, kai $DR_{1y} = 0$. Čia: Φ^{-1} = standartinio normaliojo (kaupiamojo) pasiskirstymo atvirkštinė funkcija; q = patikimumo lygis – 90 %; DR_{1y} = metų, ėjusių prieš ataskaitinę datą, pagal atvejų skaičių apskaičiuotas svertinis įsipareigojimų neįvykdymo rodiklis, t. y. įsipareigojančiųjų asmenų, kurie lygiai prieš vienus metus iki ataskaitinės datos vykdė įsipareigojimus ir kuriems buvo priskirtas atitinkamas įsipareigojančiojo asmens rangas, bet kurie per paskutinius metus neįvykdė įsipareigojimų, skaičius, padalytas iš įsipareigojančiųjų asmenų, kurie lygiai prieš vienus metus iki ataskaitinės datos vykdė įsipareigojimus ir kuriems buvo priskirtas atitinkamas įsipareigojančiojo asmens rangas, skaičiaus; n = įsipareigojančiųjų asmenų, kurie lygiai prieš vienus metus iki ataskaitinės datos vykdė įsipareigojimus ir kuriems buvo priskirtas atitinkamas įsipareigojančiojo asmens rangas, skaičius. Kiekvieno įsipareigojančiojo asmens atžvilgiu PD- yra lygi p^-, kai p^- yra apskaičiuojama pagal ketvirtoje pastraipoje pateiktą formulę įsipareigojančiųjų asmenų rangui, kuris nustatytas įsipareigojančiajam asmeniui.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0260	RWA+		Įstaigos apskaičiuoja ir nurodo RWA+ vertę I priedo 103 formoje nurodytiems portfeliams su šiais identifikavimo kodais: 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+ yra hipotetinė RWA pritaikius rėmimo koeficientus, kuri būtų gauta kiekvienai pozicijai pritaikius PD+ vertes, o ne įstaigos PD vertes. Likusieji skaičiavimams reikalingi parametrai nekeičiami. PD+ vertė grindžiama apskaičiavimais, atskirai atliktais kiekvieno įsipareigojančiojo asmens rango atžvilgiu. Naudojami įsipareigojančiojo asmens rangai, nurodyti Komisijos įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 I priedo C 08.02 formos 0005 skiltyje (nurodymai pateikti to reglamento II priedo C 08.01 formos 0010 skiltyje ir C 08.02 formoje). Kiekvieno įsipareigojančiojo asmens rango atveju p^{+} yra didžiausia teigiama vertė, tenkinanti lygtį $$p^{+} - \Phi^{-1}(q) \bullet \sqrt{\frac{p^{+} \bullet (1 - p^{+})}{n}} \leq DR_{1y}$$ šioje lygtyje: Φ^{-1} = standartinio normaliojo (kaupiamojo) pasiskirstymo atvirkštinė funkcija; q = patikimumo lygis – 90 %; DR_{1y} = metų, ėjusių prieš ataskaitinę datą, pagal atvejų skaičių apskaičiuotas svertinis įsipareigojimų neįvykdymo rodiklis, t. y. įsipareigojančiųjų asmenų, kurie lygiai prieš vienus metus iki ataskaitinės datos vykdė įsipareigojimus ir kuriems buvo priskirtas atitinkamas įsipareigojančiojo asmens rangas, bet kurie per paskutinius metus neįvykdė įsipareigojimų, skaičius, padalytas iš įsipareigojančiųjų asmenų, kurie lygiai prieš vienus metus iki ataskaitinės datos vykdė įsipareigojimus ir kuriems buvo priskirtas atitinkamas įsipareigojančiojo asmens rangas, skaičiaus; n = įsipareigojančiųjų asmenų, kurie lygiai prieš vienus metus iki ataskaitinės datos vykdė įsipareigojimus ir kuriems buvo priskirtas atitinkamas įsipareigojančiojo asmens rangas, skaičius. Kiekvieno įsipareigojančiojo asmens atžvilgiu PD+ yra lygi p^{+}, kai p^{+} yra apskaičiuojama pagal ketvirtoje pastraipoje pateiktą formulę įsipareigojančiųjų asmenų rangui, kuris nustatytas įsipareigojančiajam asmeniui.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0270	RWA–		Įstaigos apskaičiuoja ir nurodo RWA– vertę I priedo 103 formoje nurodytiems portfeliams su šiais identifikavimo kodais: 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– yra hipotetinė RWA pritaikius rėmimo koeficientus, kuri būtų gauta kiekvienai pozicijai pritaikius PD-- vertes, o ne įstaigos PD vertes. Likusieji skaičiavimams reikalingi parametrai nekeičiami. PD-- vertė grindžiama apskaičiavimais, atskirai atliktais kiekvieno įsipareigojančiojo asmens rango atžvilgiu. Naudojami įsipareigojančiojo asmens rangai, nurodyti Komisijos įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 I priedo C 08.02 formos 0005 skiltyje (nurodymai pateikti to reglamento II priedo C 08.01 formos 0010 skiltyje ir C 08.02 formoje). Kiekvieno įsipareigojančiojo asmens rango atveju p^{--} yra mažiausia teigiama vertė, tenkinanti lygtį $$p^{--} + \Phi^{-1}(q) \cdot \sqrt{\frac{p^{--} \cdot (1 - p^{--})}{n}} \geq DR_{5y}$$ where $DR_{5y} > 0$, ir $p^{--} := 0$, kai $DR_{5y} = 0$ Čia: Φ^{-1} = standartinio normaliojo (kaupiamojo) pasiskirstymo atvirkštinė funkcija; q = patikimumo lygis – 90 %; DR_{5y} = 5 praėjusių metų įsipareigojančiojo asmens rango įsipareigojimų neįvykdymo rodiklis, apskaičiuotas kaip penkių 1 metų pagal atvejų skaičių apskaičiuotas įsipareigojimų neįvykdymo rodiklių paprastasis vidurkis; n = įsipareigojančiųjų asmenų, kurie lygiai prieš vienus metus iki ataskaitinės datos vykdė įsipareigojimus ir kuriems buvo priskirtas atitinkamas įsipareigojančiojo asmens rangas, skaičius. Kiekvieno įsipareigojančiojo asmens atžvilgiu PD-- yra lygi p^{--}, kai p^{--} yra apskaičiuojama pagal ketvirtoje pastraipoje pateiktą formulę įsipareigojančiųjų asmenų rangui, kuris nustatytas įsipareigojančiajam asmeniui.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0280	RWA++		Įstaigos apskaičiuoja ir nurodo RWA++ vertę I priedo 103 formoje nurodytiems portfeliams su šiais identifikavimo kodais: 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++ yra hipotetinė RWA pritaikius rėmimo koeficientus, kuri būtų gauta kiekvienai pozicijai pritaikius PD++ vertes, o ne įstaigos PD vertes. Likusieji skaičiavimams reikalingi parametrai nekeičiami. PD++ vertė grindžiama apskaičiavimais, atskirai atliktais kiekvieno įsipareigojančiojo asmens rango atžvilgiu. Naudojami įsipareigojančiojo asmens rangai, nurodyti Komisijos įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 I priedo C 08.02 formos 0005 skiltyje (nurodymai pateikti to reglamento II priedo C 08.01 formos 0010 skiltyje ir C 08.02 formoje). Kiekvieno įsipareigojančiojo asmens rango atveju p^{++} yra didžiausia teigiama vertė, tenkinanti lygtį $$p^{++} - \Phi^{-1}(q) \bullet \sqrt{\frac{p^{++} \bullet (1 - p^{++})}{n}} \leq DR_{5y}$$ čia: Φ^{-1} = standartinio normaliojo (kaupiamojo) pasiskirstymo atvirkštinė funkcija; q = patikimumo lygis – 90 %; DR_{5y} = 5 praėjusių metų įsipareigojančiojo asmens rango įsipareigojimų neįvykdymo rodiklis, apskaičiuotas kaip penkių 1 metų pagal atvejų skaičių apskaičiuotas įsipareigojimų neįvykdymo rodiklių paprastasis vidurkis; n = įsipareigojančiųjų asmenų, kurie lygiai prieš vienus metus iki ataskaitinės datos vykdė įsipareigojimus ir kuriems buvo priskirtas atitinkamas įsipareigojančiojo asmens rangas, skaičius. Kiekvieno įsipareigojančiojo asmens atžvilgiu PD++ yra lygi p^{++}, kai p^{++} yra apskaičiuojama pagal ketvirtoje pastraipoje pateiktą formulę įsipareigojančiųjų asmenų rangui, kuris nustatytas įsipareigojančiajam asmeniui.

C 105.01 – Vidaus modelių apibrėžtis

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0010	Vidaus modelio identifikavimo kodas		Įstaiga nurodo kompetentingos institucijos priskirtą vidaus modelio identifikavimo kodą. Jei tokio neturi, įstaiga nurodo jos pačios priskirtą vidaus modelio identifikavimo kodą. Unikalus vidaus modelio identifikavimo kodas nurodo vidaus modelį, kurį įstaiga patvirtino ir naudoja apskaičiuodama RWA. Šiuo unikaliu kodu identifikuojama kiekviena formos eilutė.
0020	Modelio pavadinimas		Nurodomas informaciją teikiančios įstaigos priskirtas vidaus modelio pavadinimas.
0030	IRB metodo rizikos parametras		IRB metodo rizikos parametras yra vienas iš šių: a) PD; b) LGD; c) CCF. Pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 153 straipsnio 5 dalį pozicijų klasei „įmonių pozicijos: specializuoto skolinimo pozicijos“ taikomo vidaus modelio atveju („Specializuoto skolinimo skirstymo kriterijai“) laukelis paliekamas tuščias arba užpildomas įrašant nuorodą „NEAKTUALU“.
0040	EAD	Įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 I priedo C 08.01 formos 0110 skiltis	Nurodoma pozicijų, kurioms taikomas reitingavimo modelis, agreguota vertė.
0050	Pagal EAD apskaičiuotas svertinis įsipareigojimų neįvykdymo rodiklio vidurkis, naudojamas kalibruojant		Nurodomas pagal EAD įvertintas svertinis metinių įsipareigojimų neįvykdymo rodiklių vidurkis, kai jis naudojamas PD modelių kalibravimui. Ši informacija nurodoma tik PD modeliams. Naudojami duomenys, naudoti modelio parametrams kalibruoti. Jei vidaus duomenų nėra ir kalibravimas atliekamas naudojant išorės duomenis, nurodomi tie išorės duomenys.
0060	Pagal įsipareigojimų neįvykdymo atvejų skaičių apskaičiuotas svertinis įsipareigojimų neįvykdymo rodiklio vidurkis, naudojamas kalibruojant		Nurodomas pagal įsipareigojimų neįvykdymo atvejų skaičių įvertintų metinių įsipareigojimų neįvykdymo rodiklių paprastasis vidurkis, naudotas PD modeliams kalibruoti. Ši informacija nurodoma tik PD modeliams. Naudojami duomenys, naudoti modelio parametrams kalibruoti. Jei vidaus duomenų nėra ir kalibravimas atliekamas naudojant išorės duomenis, nurodomi tie išorės duomenys.
0070	Ilgalaikė įsipareigojimų neįvykdymo tikimybė		Nurodoma kalibruojant modelius įstaigos naudojama pagrindinė tendencija, apimanti visus apdairius koregavimus, taikomus paprastajam pagal atvejų skaičių apskaičiuotam svertiniam metinių įsipareigojimų neįvykdymo rodiklių vidurkiui, naudojamam PD modelių kalibravimui. Ši informacija nurodoma tik PD modeliams.
0080	Neįvykdytų įsipareigojimų, kurių statusas pasikeitė į įvykdytų, rodiklis		Neįvykdytų įsipareigojimų, kurių statusas pasikeitė, rodiklis – turto pozicijų esant įsipareigojimų neįvykdymui, kurių statusas per 12 mėnesių laikotarpį pasikeičia į įvykdytų įsipareigojimų statusą, procentinė dalis. Įstaiga, neapskaičiuojanti įvykdymo rodiklių konkrečiam modeliui, apskaičiuoja įvykdymo rodiklių pakaitinį kintamąjį atsižvelgdama į pateiktą apibrėžtį. Apie tai, kad naudoja pakaitinį kintamąjį, įstaiga praneša kompetentingai institucijai. Ta informacija nurodoma tik LGD modeliams.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0090	Dėl neįvykdytų įsipareigojimų, kurių statusas nepasikeitė į įvykdytų, perimto turto susigrąžinimo norma		Nurodomas pagal atvejų skaičių apskaičiuotas neįvykdytų įsipareigojimų, kurių statusas nepasikeitė, susigrąžinimo normos svertinis vidurkis, įtrauktas į laiko eilutes, kurias įstaiga naudoja kalibruodama LGD modelius, taikomus turtui, kurio atžvilgiu nebuvo įsipareigojimų neįvykdymo atvejų. Naudojami duomenys, naudoti modelio parametrams kalibruoti. Jei vidaus duomenų nėra ir kalibravimas atliekamas naudojant išorės duomenis, nurodomi tie išorės duomenys. Įstaiga, dėl neužbaigto susigrąžinimo proceso neturinti tikslios neįvykdytų įsipareigojimų, kurių statusas nepasikeitė, susigrąžinimo normos, apskaičiuoja pakaitinį kintamąjį atsižvelgdama į stebėtus susigrąžinimo atvejus ir neužbaigto pertvarkymo susigrąžinimo įverčius. Apie tai, kad naudoja pakaitinį kintamąjį, įstaiga praneša kompetentingai institucijai. Ta informacija nurodoma tik LGD modeliams.
0100	Dėl neįvykdytų įsipareigojimų, kurių statusas nepasikeitė į įvykdytų, perimto turto susigrąžinimo laikotarpio trukmė		Nurodomas pagal atvejų skaičių apskaičiuotas dėl neįvykdytų įsipareigojimų, kurių statusas nepasikeitė, perimto turto susigrąžinimo laikotarpio trukmės (nuo įsipareigojimų neįvykdymo statuso atsiradimo iki susigrąžinimo proceso užbaigimo datos) svertinis vidurkis, įtrauktas į laiko eilutes, kurias įstaiga naudoja kalibruodama LGD modelius, taikomus turtui, kurio atžvilgiu nebuvo įsipareigojimų neįvykdymo atvejų. Pagal atvejų skaičių apskaičiuotas trukmės svertinis vidurkis išreiškiamas dienų skaičiumi. Naudojami duomenys, naudoti modelio parametrams kalibruoti. Jei vidaus duomenų nėra ir kalibravimas atliekamas naudojant išorės duomenis, nurodomi tie išorės duomenys. Įstaiga, dėl neužbaigto susigrąžinimo proceso neturinti tikslios neįvykdytų įsipareigojimų, kurių statusas nepasikeitė, susigrąžinimo laikotarpio trukmės, apskaičiuoja pakaitinį kintamąjį atsižvelgdama į pateiktą apibrėžtį. Apie tai, kad naudoja pakaitinį kintamąjį, įstaiga praneša kompetentingai institucijai. Ta informacija nurodoma tik LGD modeliams.
0110	Bendras sprendimas	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 20 straipsnio 2 dalies a punktas	Įstaiga nurodo, ar yra priimtas konsoliduotos priežiūros institucijos ir priimančiosios šalies kompetentingos institucijos bendras sprendimas dėl rizikos ribojimo reikalavimų, kuriuo leidžiama naudoti IRB metodą apskaičiuojant lyginamųjų portfelių, kurių duomenys teikiami, pozicijų, priklausančių įstaigų patronuojamosioms įstaigoms, rizikos ribojimo reikalavimus.
0120	Konsoliduotos priežiūros institucija	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 20 straipsnis	Nurodomas kompetentingos institucijos, atsakingos už IRB metodą taikančios įstaigos konsoliduotą priežiūrą, kilmės šalies ISO kodas.
0130	RWA	Įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 I priedo C 08.01 formos 0260 skiltis	Nurodoma pozicijų, kurioms taikomas reitingavimo modelis, agreguota RWA vertė pritaikius (MVĮ ir infrastruktūros) rėmimo koeficientus.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0140	RWA padidėjimo koeficientai		RWA padidėjimo koeficientai yra RWA (C 105.01 formos 0130 skiltis) pakategorė („dalis, kurią atitinka“) ir apima: a) RWA vertę, pridedamą prie RWA pritaikius modelio rizikos parametrą (-us) dėl papildomų vidaus konservatyvumo priemonių, tiesiogiai taikomų RWA (jei yra); b) RWA vertę, pridedamą prie RWA pritaikius modelio rizikos parametrą (-us) dėl priežiūros priemonių, tiesiogiai taikomų RWA (jei yra); a ir b punktuose nurodytos sumos neapima priemonių, kurios jau įtrauktos į PD (C 102 ir C 103 formų 0060 skiltis), CCF (C 102 ir C 103 formų 0100 skiltis) ar LGD (C 102 ir C 103 formų 0130 skiltis), nes apima tik priemones, kurios tiesiogiai taikomos RWA, ir atitinkamais atvejais dar konservatyvumo atsargą bei priežiūros priemones (koeficientus, padidėjimo koeficientus, žemiausias ribas ar panašias priemones), kuriomis padidinami rizikos parametrai. Į RWA padidėjimo koeficientus pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 458 straipsnį galimų taikyti priemonių poveikis neįtraukiamas. Kai įstaiga atitinkamų konservatyvių koregavimų atskirti negali, taikomas I dalies 3 punktas.

C 105.02 – Vidaus modelių susiejimas su portfeliais

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0010	Portfelio identifikavimo kodas	C 102 ir C 103 formų 0010 skiltis	Nurodomas unikalus portfelio identifikavimo kodas, kuriuo portfelis žymimas pagal I priedo C 102 ir C 103 formas. 0010 ir 0020 skiltys yra sudėtinis unikalus kiekvienos šios formos eilutės identifikatorius.
0020	Vidaus modelio identifikavimo kodas	C 105.01 formos 0010 skiltis	Nurodomas informaciją teikiančios įstaigos priskirtas vidaus modelio identifikavimo kodas. 0010 ir 0020 skiltys yra sudėtinis unikalus C 105.02 formos kiekvienos eilutės identifikatorius.
0030	EAD	Įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 I priedo C 08.01 formos 0110 skiltis	Nurodoma pozicijų, kurios yra įtrauktos į portfelį, apibrėžtą pagal 0010 skiltį, ir kurioms taikomas reitingavimo modelis, apibrėžtas 0020 skiltyje, agreguota vertė. Kai visoms tam tikro portfelio pozicijoms taikomas vienas specialus modelis, pozicijų vertė yra lygi atitinkamai C 102 arba C 103 formos 0110 skiltyje nurodytai to paties portfelio sumai.
0040	RWA	Įgyvendinimo reglamento (ES) 2021/451 I priedo C 08.01 formos 0260 skiltis	Nurodoma pozicijų, kurios yra įtrauktos į portfelį, apibrėžtą pagal 0010 skiltį, ir kurioms taikomas reitingavimo modelis, apibrėžtas 0020 skiltyje, agreguota RWA vertė pritaikius rėmimo koeficientus. Kai visoms tam tikro portfelio pozicijoms taikomas vienas specialus modelis, RWA yra lygi atitinkamai C 102 arba C 103 formos 0170 skiltyje nurodytai to paties portfelio sumai.

C 105.03 – Vidaus modelių susiejimas su šalimis

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0005	Eilutės Nr.		Šiuo unikaliu kodu identifikuojama kiekviena formos eilutė. Jis nurodomas eilės tvarka (1, 2, 3 ir t. t.).
0010	Vidaus modelio identifikavimo kodas	C 105.01 formos 0010 skiltis	Nurodomas informaciją teikiančios įstaigos priskirtas vidaus modelio identifikavimo kodas. Kai vienas vidaus modelio identifikavimo kodas yra susietas su keliomis šalimis, kiekvienai vidaus modelio identifikavimo kodo ir įstaigos vietos kombinacijai pildoma atskira eilutė. 0010 ir 0020 skiltys yra sudėtinis unikalus kiekvienos lentelės eilutės identifikatorius.
0020	Įstaigos vieta	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 20 straipsnis	Nurodomas kiekvienos patronuojamosios įstaigos, į kurios apskaitą įtrauktos IRB pozicijos, kurių duomenys pateikiami kiekvieno lyginamojo portfelio atžvilgiu, buveinės šalies ISO kodas nepriklausomai nuo priimančiosios šalies priežiūros institucijos suteikto leidimo taikyti IRB metodą.“

II PRIEDAS

„V PRIEDAS

RINKOS RIZIKOS LYGINAMOSIOS PRIEMONĖS IR PORTFELIAI

1 skirsnis. Nurodymai

2 skirsnis. Priemonės

3 skirsnis. Atskiri portfeliai. Viena priemonė

4 skirsnis. Atskiri portfeliai. Kelios priemonės

5 skirsnis. Agreguoti portfeliai

6 skirsnis. Papildomos priemonių specifikacijos

7 skirsnis. SBM patvirtinimo portfeliai

1 skirsnis. Nurodymai

a) Šiame priede:

i) įtraukimo į apskaitą data – data ir laikas, kai įstaigos lyginamosios analizės tikslais į apskaitą įrašo sandorius;

ii) pradinis rinkos vertinimas (angl. IMV) – šio priedo 2 skirsnyje nurodytų priemonių vertė pagal rinkos kainą IMV ataskaitinę datą ir laiku;

iii) IMV ataskaitinė data – data ir laikas, kurių laikydamosi įstaigos nustato lyginamojo portfelio sandorių IMV;

iv) IMV pateikimo data – data, iki kurios įstaigos pateikia lyginamojo portfelio sandorių pradinio rinkos vertinimo rezultatus;

v) VaR – vertės pokyčio rizikos vertė;

vi) sVaR – rizikos vertė nepalankiausiomis sąlygomis;

vii) IRC – kapitalo, reikalingo papildomai rizikai padengti, poreikis;

viii) CTP – koreliacinės prekybos portfelis;

ix) APR – visos kainos rizika, apskaičiuota pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 377 straipsnio 2 dalį;

x) rizikos matai (RM) – šio priedo 3, 4 ir 5 skirsniuose nurodytų portfelių VaR ir sVaR vertės, taip pat prireikus IRC ir APR vertės laikotarpiu nuo RM pradinės iki RM galutinės ataskaitinių datų;

xi) RM pradinė ataskaitinė data – data, kurią įstaigos pradeda skaičiuoti RM vertes;

xii) RM galutinė ataskaitinė data – data, kurią įstaigos baigia skaičiuoti RM vertes;

xiii) RM pateikimo data – data, iki kurios įstaigos pateikia lyginamojo portfelio sandorių rizikos mato rezultatus;

xiv) dabartinė vertė (angl. PV) – šio priedo 3 skirsnyje nurodytų portfelių vertė pagal rinkos kainą RM galutinę ataskaitinę datą;

xv) ATM – neutralus sandoris, vertinant pagal išvestinės finansinės priemonės pagrindinio turto dabartinės ar būsimos kainos ir tos išvestinės finansinės priemonės vykdymo kainos santykį;

xvi) OTM – nuostolingas sandoris, vertinant pagal išvestinės finansinės priemonės pagrindinio turto dabartinės ar būsimos kainos ir tos išvestinės finansinės priemonės vykdymo kainos santykį;

xvii) ITM – pelningas sandoris, vertinant pagal išvestinės finansinės priemonės pagrindinio turto dabartinės ar būsimos kainos ir tos išvestinės finansinės priemonės vykdymo kainos santykį;

xviii) ilgosios pozicijos – pirkimas, trumposios pozicijos – pardavimas;

xix) CDS – kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriai;

xx) CDS atveju ilgosios pozicijos reiškia įsigytą apsaugą, trumposios pozicijos – parduotą apsaugą;

xxi) MLN – milijonai;

xxii) OTC – nebiržinis sandoris;

xxiii) ASA – alternatyvus standartizuotas metodas, kaip nurodyta Reglamento (ES) Nr. 575/2013 trečios dalies IV antraštinės dalies 1a skyriaus 1 skirsnyje;

xxiv) SBM – jautrumu grindžiamas metodas, kaip nurodyta Reglamento (ES) Nr. 575/2013 trečios dalies IV antraštinės dalies 1a skyriaus 2 skirsnyje;

xxv) DRC – reikalavimai įsipareigojimų neįvykdymo rizikai padengti, kaip nurodyta Reglamento (ES) Nr. 575/2013 trečios dalies IV antraštinės dalies 1a skyriaus 5 skirsnyje;

xxvi) RRAO – likutinės rizikos papildomas mokestis, kaip nurodyta Reglamento (ES) Nr. 575/2013 trečios dalies IV antraštinės dalies 1a skyriaus 4 skirsnyje.

b) Lyginamajai analizei taikomos šios datos:

i) įtraukimo į apskaitą data – 2025 m. sausio 30 d.;

ii) IMV (ir pradinio SBM) ataskaitinė data – 2025 m. vasario 6 d. (17.30 Vidurio Europos laiku);

iii) IMV (ir pradinio SBM bei SBM patvirtinimo) pateikimo data – 2025 m. vasario 28 d.;

iv) RM pradinė ataskaitinė data – 2025 m. birželio 2 d.;

v) RM (ir galutinio ASA) galutinė ataskaitinė data – 2025 m. birželio 13 d.;

vi) RM (ir galutinio ASA) pateikimo data – 2025 m. liepos 18 d.

c) Jeigu šio priedo 2 skirsnyje aiškiai nenurodyta kitaip, visos pozicijos yra įtraukiamos į apskaitą šio skirsnio b punkto i papunktyje nurodytą įtraukimo į apskaitą datą. Įtraukus pozicijas į apskaitą kiekvieno portfelio terminas atitinka lyginamosios analizės trukmę, o portfelio vertė apskaičiuojama laikantis prielaidos, kad įstaiga nesiima jokių portfelio valdymo veiksmų visą lyginamosios analizės laikotarpį. Jeigu konkrečios priemonės specifikacijose aiškiai nenurodyta kitaip, pasirinkimo sandorių pozicijų vykdymo kainos nustatomos pagal pagrindinio turto kainas, užfiksuotas rinkos darbo dienos pabaigoje įtraukimo į apskaitą datą.

d) Pradinio rinkos vertinimo tikslu kiekvienos priemonės įvertinimas pateikiamas įstaigos kompetentingai institucijai iki IMV pateikimo datos. Iki tos datos įstaiga pagal e punktą kartu su rezultatais pateikia aiškinamąjį raštą. Jei įmanoma, pateikiamas IMV grindžiamas įstaigos sandorių sudarymo funkciją atliekančių darbuotojų vertinimu. Jeigu įstaigos sandorių sudarymo funkciją atliekantys darbuotojai IMV nepateikia, įstaiga aiškinamajame rašte nurodo IMV duomenų šaltinį.

e) Kartu su IMV įstaigų pateiktiname aiškinamajame rašte pateikiama visa ši informacija apie kiekvieną priemonę:

i) apskaičiuojant priemonės IMV naudoti rizikos veiksniai;

ii) apskaičiuojant priemonės IMV naudotas kainodaros modelis ir šio kainodaros modelio aprašymas;

iii) į priemonės VaR modelį įtraukti rizikos veiksniai;

iv) į VaR modelį įtraukti rizikos veiksniai, kurie yra ir įvesties duomenys atliekant priemonės IMV;

v) VaR modelio detalūs duomenys, susiję su priemone;

vi) turimi priemonės baziniai duomenys įstaigos formatu;

vii) šio skirsnio h, i, k, m, n, o, v, w, x, y, gg ir kk punktuose nurodyti aspektai.

f) Taikant e punkto v papunktį pateikiama visa ši informacija:

i) glausti VaR modelio aprašymai;

ii) taikyti pakartotinio vertinimo metodai;

iii) grąžos modeliavimui taikyta funkcinė forma (kaip antai absoliučioji grąža, santykinė grąža, kiti metodai);

iv) kokybinė informacija apie laiko eilutes, naudotas kalibruojant VaR modelį priemonės atžvilgiu (kaip antai šaltinis, normalizavimo metodika, taikyti intervalai, kita informacija, kurią įstaigos laiko svarbia pateikiamiems rezultatams paaiškinti).

g) Kiekvieną kartą pakartotinai pateikus bet kurią vertę atnaujinamas ir d punkte nurodytas aiškinamasis raštas siekiant paaiškinti laikotarpiu tarp verčių pateikimo įvykusius pokyčius. Viename iš aiškinamojo rašto skirsnių nurodomos visos duomenų pateikimo datos ir pakartotinio pateikimo priežastys.

h) Pozicijų rizika apskaičiuojama neatsižvelgiant į finansavimo išlaidas. Kai įmanoma, įstaigos kaip diskonto normą naudoja priemonės valiutos vienos nakties kursą. Laikoma, kad šio priedo 2 skirsnyje nurodytų išvestinių finansinių priemonių atžvilgiu yra sudarytas užtikrinimo priemonės pateikimo susitarimas. Jei tai neįmanoma, d punkte nurodytame aiškinamajame rašte nurodomos priežastys.

i) Vertinant portfelių riziką, į sandorio šalies kredito riziką ir kredito vertinimo koregavimo (angl. CVA) riziką neatsižvelgiama. Jei tai neįmanoma, šio skirsnio d punkte nurodytame aiškinamajame rašte nurodomos priežastys. Įstaigos praneša apie atvejus, kai į IMV įtraukiami kitų rūšių vertinimo koregavimai, ir šio skirsnio d punkte nurodytame aiškinamajame rašte paaiškina kiekvienai finansinei priemonei taikytą metodiką ir poveikį.

j) Sandorių, susijusių su CDS ilgosiomis pozicijomis, atveju įstaigos daro prielaidą, kad siekiant įgyti poziciją pagal rinkos standartus ir susitarimus sumokamas tiesioginis išankstinis mokestis. Laikoma, kad visų CDS termino pabaigos data atitinka standartines ketvirčio pabaigos datas.

k) Papildomos specifikacijos CDS pozicijų kainodaros apskaičiavimams atlikti atitinka visuotinai taikomus rinkos standartus bei susitarimus ir yra paaiškinamos šio skirsnio d punkte nurodytame aiškinamajame rašte.

l) Naudojama termino pabaigos data, kuria užtikrinama, kad sandoris būtų vykdomas kuo arčiau išpirkimo termino, nurodyto pagal rinkos standartus ir susitarimus.

m) Kalbant apie šio priedo 2 skirsnyje nenurodytų priemonių duomenis, įstaigos šio skirsnio d punkte nurodytame aiškinamajame rašte nurodo naudotas prielaidas, įskaitant dienų skaičiavimo susitarimą ir parduodamos bei likvidžios priemonės pasirinkimą, kai leidžiama, kartu su rezultatais.

n) Įstaigos, manančios, kad analizės tikslu aiškinant rezultatus, be šiame skirsnyje nurodytų prielaidų, yra ir kitų svarbių prielaidų, įskaitant darbo dienos pabaigos laiką, vertybinių popierių keitimo sandorius (angl. *coupon rolls*), priskyrimą pagal indeksus ir kt., pateikia šių prielaidų aprašymą šio skirsnio d punkte nurodytame aiškinamajame rašte.

o) Šio skirsnio d punkte nurodytame aiškinamajame rašte paaiškinama, į kokią riziką šio priedo 2 skirsnyje nurodytų priemonių modeliu neatsižvelgta.

p) Visi pasirinkimo sandoriai laikomi nebiržiniais, išskyrus atvejus, kai aiškiai nurodyta kitaip.

q) Laikomasi standartinių susitarimų dėl nebiržinių pasirinkimo sandorių termino. Laikas iki n-tojo mėnesio pasirinkimo sandorio termino yra n mėnesių. Jei pasirinkimo sandoriai baigia galioti ne prekybos dieną, pagal rinkos standartus ir susitarimus įstaigos jo galiojimo pabaigos datą nukelia į darbo dieną.

r) Visi nebiržiniai pasirinkimo sandoriai laikomi:

   i) amerikietiškais (vieno pavadinimo nuosavybės vertybinių popierių ir biržos prekių sandorių atvejais);

   ii) europietiškais (nuosavybės vertybinių popierių indeksų, užsienio valiutos ir pasirinkimo sandorių dėl apsikeitimo sandorių atvejais).

s) Atliekant visų nebiržinių pasirinkimo sandorių pradinį rinkos vertinimą neįskaičiuojamas priedas, t. y. jie vertinami be priedų.

t) Kalbant apie koreliacinės prekybos portfelius (CTP), įstaigos, kurioms leista CTP naudoti APR modelį, pateikia informaciją apie pačias svarbiausias prielaidas, rinkos standartus ir susitarimus, susijusius su šio priedo 2 skirsnyje nurodytomis CTP priemonėmis, nurodydamos delta koeficientus, kuriuos apskaičiavo siekdamos CTP priemonių CS01 neutralumo įtraukimo į apskaitą datą.

u) Kiekvienos priemonės IMV nurodomas EBI priemonės valiuta, nurodyta tai priemonei šio priedo 2 skirsnyje.

v) Portfelių, kuriuos sudaro viena ar daugiau priemonių, išreikštų EBI priemonių valiutomis, kurios skiriasi nuo EBI portfelio valiutos, atveju rezultatas konvertuojamas į nurodytą EBI portfelio valiutą taikant atitinkamos datos ECB momentinį valiutos kursą. Konvertuotas rezultatas paaiškinamas šio skirsnio d punkte nurodytame aiškinamajame rašte.

w) Įtraukdamos pozicijas į apskaitą įstaigos laikosi atitinkamos rinkos tvarkos, jeigu šiuose nurodymuose pateiktuose priemonių aprašymuose (šio priedo 2 skirsnyje) nenurodyta kitaip.

x) Kai priemonei arba išvestinės finansinės priemonės pagrindinei priemonei taikomas emitento įvykis, darantis poveikį lyginamajai analizei, pavyzdžiui, emitento pasirinkimas pirkti, įsipareigojimų neįvykdymas arba panašūs įvykiai, įstaigos tokią priemonę pašalina iš analizės kartu su visais susijusiais CDS ar pasirinkimo sandoriais.

y) Kalbant apie indekso rinkinius, aktualiausias indekso rinkinys yra to indekso pačių likvidžiausių ir lengviausiai parduodamų akcijų, esančių rinkoje, rinkinys. Įstaigos paaiškina sprendimą pasirinkti aktualiausią indekso rinkinį ir susijusius rezultatus kartu pateikiamame šio skirsnio d punkte nurodytame aiškinamajame rašte.

z) Jeigu nenurodyta kitaip, siekdamos įtraukti į apskaitą šio priedo 2 skirsnyje nurodytas priemones, įstaigos palūkanų normai taiko ES Lyginamųjų indeksų reglamentą. Šių nurodymų d punkte pateiktame aiškinamajame rašte įstaigos nurodo taikomą normą, išskyrus tas, kurios nurodytos šio priedo 2 skirsnyje.

aa) 3, 4 ir 5 skirsniuose nurodytų portfelių rizikos matai ir dabartinė vertė apskaičiuojami laikotarpiu nuo RM pradinės iki RM galutinės ataskaitinių datų. FRTB ASA rizikos matai (SBM, DRC ir RRAO) apskaičiuojami RM galutinei ataskaitinei datai. Tų apskaičiavimų rezultatus įstaigos pateikia savo kompetentingai institucijai iki RM pateikimo datos. Nurodomas kiekvienos priemonės IMV ir SBM. Kiekvieno portfelio rizikos matai ir, kai yra, SBM, DRC, RRAO ir dabartinė vertė pateikiami tiek atskirai, tiek agreguoti. Nurodomi bent tų pačių portfelių, kurių rizikos matai pateikiami, SBM, DRC ir RRAO, kai yra.

bb) 7 skirsnyje nurodytų portfelių atveju įstaigos nurodo SBM rezultatus ir pateikia juos pagal IMV pateikimo ataskaitines datas.

cc) Informaciją apie kredito maržos portfelius teikia tik įstaigos, turinčios leidimą modeliuoti skolos priemonių specifinę riziką. Įstaigos, turinčios leidimą modeliuoti bendrąją palūkanų normos riziką, ir įstaigos, turinčios leidimą modeliuoti bendrąją ir specifinę palūkanų normos riziką, palūkanų normų portfelių, kurie apima riziką, kaip tam tikrų priemonių dalį, atveju modeliuoja atskirus ir agreguotus portfelius.

dd) Tiek atskirų, tiek agreguotų portfelių rezultatai pateikiami tik tuo atveju, jei taip pat pateikiami visų priemonių, kurios juos sudaro, rezultatai.

ee) Šio priedo 2 skirsnyje („Priemonės“) „T m.“ yra 2025 m., „T + X m.“ yra 2025 + X m., kai X yra nurodytas 2 skirsnyje.

ff) Šio priedo 2 skirsnyje („Priemonės“) įstaigos nustato galiojimo pabaigos / termino dieną pagal šiuos nurodymus:

i) jeigu data nustatyta, ta konkreti data ir pateikiama;

ii) jeigu data nenustatyta, taikoma rinkos tvarka, jei yra. Pavyzdžiui, jei taikoma rinkos tvarka, pagal kurią galiojimo pabaigos / termino diena yra trečias mėnesio penktadienis, tuomet „T m. birželio mėn.“ reiškia T metų trečią to mėnesio penktadienį;

iii) kai kalbama apie mėnesio pabaigą, turima omeny paskutinė mėnesio kalendorinė diena;

iv) kai kalbama apie nustatytą laikotarpį po įtraukimo į apskaitą datos, jei laikotarpis išreikštas dienų skaičiumi, turima omeny paskutinė to laikotarpio diena. Jei laikotarpis išreikštas savaitėmis, mėnesiais ar metais, turima omeny ta pati kitos savaitės, mėnesio ar metų diena kaip ir įtraukimo į apskaitą data, arba, jei laikotarpio paskutinis mėnuo arba metai yra trumpesni, paskutinė to mėnesio ar metų diena; jeigu „įtraukimo į apskaitą data + x laikotarpis“ išpuola išeiginę dieną, reikia pasirinkti po jos einančią darbo dieną;

v) jeigu nenurodyta kitaip, taikomos šios prielaidos: dienų skaičiavimo susitarimas: faktinis dienų skaičius / 360, nedarbo dienų kalendorius: 2 tikslas.

gg) Šio priedo 2 skirsnyje („Priemonės“) visiems CDS taikomi šie reikalavimai (jei aiškiai nenurodyta kitaip):

i) atkarpos mokėjimo periodiškumas – kas ketvirtį;

ii) atkarpa (baziniais punktais) – 100;

iii) dienų skaičiavimas – faktinis dienų skaičius / 360;

iv) Tarptautinės apsikeitimo sandorių ir išvestinių finansinių priemonių asociacijos (ISDA) apibrėžčių redakcijos metai – 2014;

v) restruktūrizavimo sąlyga – pakartotinai pakeista restruktūrizavimo sąlyga (angl. *Modified-Modified Restructuring*, MMR);

vi) terminas – T + 4 m. gruodžio mėn.;

vii) skolos rūšis – didesnio prioriteto;

viii) įsipareigojimų įvykdymo terminas – 5 metai;

ix) įsigaliojimo data – įtraukimo į apskaitą data;

x) taikyta diskonto kreivė ir susigrąžinimo norma nurodomos šio priedo d punkte nurodytame aiškinamajame rašte.

hh) Obligacijų finansinių priemonių IMV apima sukauptas palūkanas.

ii) Įstaigos pateikia informaciją, susijusią su dabartinės vertės (PV) vertinimo laiku, tą laiką nurodydamos šio skirsnio d punkte nurodytame aiškinamajame rašte. Kai įmanoma, PV vertę reikėtų apskaičiuoti darbo dienos pabaigoje.

jj) Portfelių rizikos matai yra apskaičiuojami ta pačia portfelio valiuta, neįtraukiant užsienio valiutos kurso (FX) rizikos, taip pat susijusios su įstaigų ataskaitose nurodoma valiuta. Į FX riziką atsižvelgiama tik tais atvejais, kai ji yra neatsiejamai įtraukta į priemones. Kai per šį procesą pateikiami tiek ataskaitoje nurodomos valiutos, tiek portfelio valiutos rezultatai, ASA duomenų rezultatai, apskaičiuoti įstaigos ataskaitose nurodoma valiuta, perskaičiuojami į EBI portfelio valiutą taikant momentinį valiutos kursą pagal ECB momentinį valiutos kursą, siejamą su apskaičiavimo data. Perskaičiavimas į EBI portfelio valiutą nereiškia, kad pasikeičia FX rizikos veiksniai.

kk) Kai taikoma Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325q straipsnio 7 dalis (bazinės valiutos metodas), atlikdamos SBM apskaičiavimus ir teikdamos informaciją apie SBM jautrumą, įstaigos atsižvelgia į FX rizikos veiksnius, atsirandančius taikant bazinės valiutos metodą. Nurodomos vertės išreiškiamos ne pasirinkta bazine valiuta, o įstaigų ataskaitose nurodoma valiuta, taikant momentinį valiutos kursą pagal ECB momentinį valiutos kursą, siejamą su atitinkama data.

2 skirsnis. Priemonės

Kai įstaigos turi teikti 3 ir 4 skirsniuose nurodytų portfelių rizikos matus ir dabartinę vertę, jos nurodo toliau vardijamų finansinių priemonių IMV, laikydamosi šio priedo 1 skirsnio nurodymų.

NUOSAVYBĖS VERTYBINIAI POPIERIAI

101. Ilgoji EURO STOXX 50 indekso (kodas FESX) ateities sandorių pozicija.

Tariamoji vertė – indekso vertės, padaugintos iš 1 000 EUR, ekvivalentas.

Birža – Eurex.

Galiojimo pabaigos data – T m. birželio mėn.

EBI priemonės valiuta – EUR.

102. 10 000 vnt. įmonės BAYER (kodas BAYN GR) akcijų ilgosios pozicijos.

Birža – Xetra.

EBI priemonės valiuta – EUR.

103. Trumpoji įmonės BAYER (kodas BAYN GR) ateities sandorių pozicija.

Tariamoji vertė – pagrindinio turto 10 000 akcijų vertės ekvivalentas.

Birža – Eurex.

Galiojimo pabaigos data – T m. birželio mėn.

EBI priemonės valiuta – EUR.

104. Trumpoji įmonės STELLANTIS (kodas STLA FP) ateities sandorių pozicija.

Tariamoji vertė – pagrindinio turto 10 000 akcijų vertės ekvivalentas.

Birža – Euronext.

Galiojimo pabaigos data – T m. birželio mėn.

EBI priemonės valiuta – EUR.

105. Trumpoji įmonės ALLIANZ (kodas ALV GR) ateities sandorių pozicija.

Tariamoji vertė – pagrindinio turto 10 000 akcijų vertės ekvivalentas.

Birža – Eurex.

Galiojimo pabaigos data – T m. birželio mėn.

EBI priemonės valiuta – EUR.

106. Trumpoji įmonės BARCLAYS (kodas BARC LN) ateities sandorių pozicija.

Tariamoji vertė – pagrindinio turto 10 000 akcijų vertės ekvivalentas.

Birža – Eurex.

Galiojimo pabaigos data – T m. birželio mėn.

EBI priemonės valiuta – GBP.

107. Trumpoji įmonės DEUTSCHE BANK (kodas DBK GR) ateities sandorių pozicija.

Tariamoji vertė – pagrindinio turto 10 000 akcijų vertės ekvivalentas.

Birža – Eurex.

Galiojimo pabaigos data – T m. birželio mėn.

EBI priemonės valiuta – EUR.

108. Trumpoji įmonės CRÉDIT AGRICOLE (kodas ACA FP) ateities sandorių pozicija.

Tariamoji vertė – pagrindinio turto 10 000 akcijų vertės ekvivalentas.

Birža – Euronext.

Galiojimo pabaigos data – T m. birželio mėn.

EBI priemonės valiuta – EUR.

109. Ilgoji pasirinkimo pirkti sandorių pozicija. Pagrindinis turtas – įmonė BAYER (kodas BAYN GR), ATM (1 sutartis atitinka 100 akcijų).

Tariamoji vertė – pagrindinio turto 10 000 akcijų vertės ekvivalentas.

Galiojimo pabaigos data – T m. birželio mėn.

EBI priemonės valiuta – EUR.

110. Trumpoji pasirinkimo pirkti sandorių pozicija. Pagrindinis turtas – įmonė BAYER (kodas BAYN GR), ATM (1 sutartis atitinka 100 akcijų).

Tariamoji vertė – pagrindinio turto 10 000 akcijų vertės ekvivalentas.

Galiojimo pabaigos data – T m. gruodžio mėn.

EBI priemonės valiuta – EUR.

111. Ilgoji pasirinkimo pirkti sandorių pozicija. Pagrindinis turtas – įmonė PFIZER (kodas PFE US), 10 % OTM (1 sutartis atitinka 100 akcijų).

Tariamoji vertė – pagrindinio turto 10 000 akcijų vertės ekvivalentas.

Galiojimo pabaigos data – T m. birželio mėn.

EBI priemonės valiuta – USD.

112. Ilgoji pasirinkimo parduoti sandorių pozicija. Pagrindinis turtas – įmonė PFIZER (kodas PFE US), 10 % OTM (1 sutartis atitinka 100 akcijų).

Tariamoji vertė – pagrindinio turto 10 000 akcijų vertės ekvivalentas.

Galiojimo pabaigos data – T m. birželio mėn.

EBI priemonės valiuta – USD.

113. Ilgoji pasirinkimo pirkti sandorių pozicija. Pagrindinis turtas – įmonė BAYER (kodas BAYN GR), 10 % OTM (1 sutartis atitinka 100 akcijų).

Tariamoji vertė – pagrindinio turto 10 000 akcijų vertės ekvivalentas.

Galiojimo pabaigos data – T m. gruodžio mėn.

EBI priemonės valiuta – EUR.

114. Trumpoji pasirinkimo pirkti sandorių pozicija. Pagrindinis turtas – įmonė BAYER (kodas BAYN GR), 10 % OTM (1 sutartis atitinka 100 akcijų).

Tariamoji vertė – pagrindinio turto 10 000 akcijų vertės ekvivalentas.

Galiojimo pabaigos data – T m. birželio mėn.

EBI priemonės valiuta – EUR.

115. Ilgoji pasirinkimo pirkti sandorių pozicija. Pagrindinis turtas – įmonė AVIVA (kodas AV/LN), 10 % OTM (1 sutartis atitinka 100 akcijų).

Tariamoji vertė – pagrindinio turto 10 000 akcijų vertės ekvivalentas.

Galiojimo pabaigos data – T m. gruodžio mėn.

EBI priemonės valiuta – GBP.

116. Ilgoji pasirinkimo parduoti sandorių pozicija. Pagrindinis turtas – įmonė AVIVA (kodas AV/LN), 10 % OTM (1 sutartis atitinka 100 akcijų).

Tariamoji vertė – pagrindinio turto 10 000 akcijų vertės ekvivalentas.

Galiojimo pabaigos data – T m. gruodžio mėn.

EBI priemonės valiuta – GBP.

117. Trumpoji NIKKEI 225 (kodas NKY) ateities sandorių pozicija.

Tariamoji vertė – indekso vertės, padaugintos iš 20 000 JPY, ekvivalentas.

Birža – CME.

Galiojimo pabaigos data – T m. birželio mėn.

EBI priemonės valiuta – JPY.

118. Automatinio pareikalavimo nuosavybės priemonių produktas.

Ilgoji pozicija

Įtraukta į apskaitą įtraukimo į apskaitą datą.

Tariamoji vertė (kapitalas) – 1 000 000 EUR.

Pagrindinė priemonė – EURO STOXX 50 indeksas (kodas SX5E).

EBI priemonės valiuta – EUR.

Terminas – 5 metai

Metinė išmoka ir metinis stebėjimas (įtraukimo į apskaitą data + 1 m., įtraukimo į apskaitą data + 2 m., įtraukimo į apskaitą data + 3 m., įtraukimo į apskaitą data + 4 m., įtraukimo į apskaitą data + 5 m.). Išmoka išmokama 10 dienų po ataskaitinės datos.

Atkarpa – 6 %.

Automatinio pareikalavimo lygis (pradinė vertė): įtraukimo į apskaitą dienos pabaiga + 1 mėn.

Atkarpos mokėjimo riba – 60 % automatinio pareikalavimo lygio.

Apsaugos riba – 55 % automatinio pareikalavimo lygio.

— kapitalas negarantuojamas, jeigu indeksas nesiekia apsaugos ribos (5-aisiais metais kapitalas grąžinamas proporcingai, kai lygis nesiekia apsaugos ribos, pavyzdžiui, jei SX5E = 40 % jo pradinio lygio, grąžinama 40 % kapitalo);

— jei bet kurių metų pabaigoje SX5E ≥ 60 % (ribos atkarpa) pradinės vertės, išmokama atkarpa lygi 6 %;

— jei bet kurių metų pabaigoje SX5E ≥ 100 % pradinės vertės, produktas pareikalaujamas ir išmoką sudaro atkarpa kartu su kapitalu (100 %);

— jei bet kurių metų pabaigoje SX5E < 60 % (ribos atkarpa) pradinės vertės, atkarpa neišmokama;

— jei 5-ųjų metų pabaigoje SX5E < 55 % (apsaugos riba) pradinės vertės, išmokama tik proporcinga kapitalo dalis. Kitu atveju, jei 5-ųjų metų pabaigoje SX5E >= 55 % (apsaugos riba) pradinės vertės, išmokamas visas kapitalas.

119. Ilgoji pasirinkimo pirkti sandorių pozicija. Pagrindinė priemonė – EURO STOXX 50 indeksas (kodas SX5E), ATM.

Tariamoji vertė – indekso vertės, padaugintos iš 1 000 EUR, ekvivalentas.

Galiojimo pabaigos data – T m. birželio mėn.

EBI priemonės valiuta – EUR.

120. Ilgoji pasirinkimo pirkti sandorių pozicija. Pagrindinė priemonė – EURO STOXX 600 indeksas (kodas SXXP), ATM.

Tariamoji vertė – indekso vertės, padaugintos iš 10 000 EUR, ekvivalentas.

Galiojimo pabaigos data – T m. birželio mėn.

EBI priemonės valiuta – EUR.

121. Ilgoji pasirinkimo pirkti sandorių pozicija. Pagrindinis turtas – įmonė VIX (CBOE), ATM.

Tariamoji vertė – indekso vertės, padaugintos iš 100 000 USD, ekvivalentas.

Galiojimo pabaigos data – T m. birželio mėn.

EBI priemonės valiuta – USD.

PALŪKANŲ NORMA

201. 5 m. IRS EUR – gauti fiksuotąją palūkanų normą ir mokėti kintamąją palūkanų normą.

Fiksuotoji dalis – gaunama kas metus.

Kintamoji palūkanų norma – 6 mėn. EURIBOR, mokama kas pusmetį. Dienų skaičiavimas – faktinis dienų skaičius / 360.

Tariamoji vertė – 10 000 000 EUR.

Atnaujinimo tvarka ir grafikas – standartiniai.

Įsigaliojimo data – įtraukimo į apskaitą data (t. y. taikomos įtraukimo į apskaitą dienos pabaigos rinkos normos).

Terminas – T + 4 m. rugsėjo mėn.

EBI priemonės valiuta – EUR.

202. Dvejų metų pasirinkimo sandoris eurais dėl 5 m. palūkanų normų apsikeitimo sandorio (IRS) eurais – mokėti fiksuotąją palūkanų normą ir gauti kintamąją palūkanų normą.

Tariamoji vertė – 10 000 000 EUR.

Įstaiga yra pasirinkimo sandorio dėl apsikeitimo sandorio pardavėjas. Įstaigos sandorio šalis perka teisę sudaryti apsikeitimo sandorį su įstaiga; jeigu sandorio šalis savo teise pasinaudos, ji gaus fiksuotąją palūkanų normą, o įstaiga gaus kintamąją palūkanų normą.

Pasirinkimo sandoris, kurio terminas – dveji metai (įtraukimo į apskaitą data + 2 m.), dėl palūkanų normų apsikeitimo sandorio (IRS), apibrėžto taip: fiksuotoji dalis – mokama kas metus; kintamoji palūkanų norma – 6 mėn. EURIBOR, gaunama kas pusmetį; tariamoji vertė – 10 000 000 EUR; atnaujinimo tvarka ir grafikas – standartiniai; Pagrindinio apsikeitimo sandorio įsigaliojimo data – įtraukimo į apskaitą data + 2 m.

Pagrindinio apsikeitimo sandorio terminas – įtraukimo į apskaitą data + 7 m.

Priedas mokamas įtraukimo į apskaitą datą (įtraukimo į apskaitą data). Atsiskaitoma pinigais.

Vykdymo kaina grindžiama šioje priemonėje apibrėžtu išankstinio apsikeitimo sandorio ATM kursu.

EBI priemonės valiuta – EUR.

203. 5 m. IRS USD. Gauti fiksuotąją palūkanų normą ir mokėti kintamąją palūkanų normą.

Fiksuotoji norma – gaunama kas metus.

Kintamoji palūkanų norma – 3 mėn. USD SOFR norma, mokama kas ketvirtį.

Tariamoji vertė – 1 000 000 USD.

Atnaujinimo tvarka ir grafikas – standartiniai.

Įsigaliojimo data – įtraukimo į apskaitą data (t. y. taikomos įtraukimo į apskaitą dienos pabaigos rinkos normos).

Termino pabaigos data – T + 4 m. rugsėjo mėn.

EBI priemonės valiuta – USD.

204. 2 m. IRS GBP. Gauti fiksuotąją palūkanų normą ir mokėti kintamąją palūkanų normą.

Fiksuotoji norma – gaunama kas metus.

Kintamoji palūkanų norma – SONIA (vienos nakties) palūkanų norma, sudedama ir mokama kas ketvirtį. Dienų skaičiavimas – faktinis dienų skaičius / 365.

Tariamoji vertė – 10 000 000 GBP.

Atnaujinimo tvarka ir grafikas – standartiniai.

Įsigaliojimo data – įtraukimo į apskaitą data (t. y. taikomos įtraukimo į apskaitą dienos pabaigos rinkos normos).

Terminas – įtraukimo į apskaitą data + 2 m.

EBI priemonės valiuta – GBP.

205. Apribotos 10 m. UBS parduotos kintamosios palūkanų normos obligacijos.

Tariamoji (pagrindinė) vertė – 1 000 000 USD.

Kintamosios palūkanų normos obligacijos (obligacijos) yra įmonės UBS AG (UBS) pirmaeiliai neužtikrinti įsipareigojimai.

EBI priemonės valiuta – USD.

— Obligacijoms skaičiuojamos palūkanos, kurių metinė norma yra lygi 3 mėn. USD SOFR normai plius 1,5 % per metus (kintamoji palūkanų norma) ir kurios negali viršyti 7,5 % metinės palūkanų normos (viršutinės palūkanų normos ribos) ir būti mažesnės nei 2,5 % metinė palūkanų norma (apatinė palūkanų normos riba).

— Visi mokėjimai pagal obligacijas, įskaitant palūkanas ir pagrindinę sumą suėjus terminui, priklauso nuo įmonės UBS AG kreditingumo. Įstaigų prašoma naudoti tinkamą diskonto kreivę ir jos pasirinkimo motyvus pateikti aiškinamajame rašte.

— Pajamos: pagal obligacijas bus kas ketvirtį mokamos palūkanos, kurių norma lygi kintamajai palūkanų normai, šiomis sąlygomis: jeigu bet kurią atkarpos apskaičiavimo dieną: i) kintamoji palūkanų norma nesieks apatinės palūkanų normos ribos, tuomet taikoma palūkanų norma už susijusį palūkanų skaičiavimo laikotarpį bus lygi apatinei palūkanų normos ribai, arba ii) kintamoji palūkanų norma viršys viršutinę palūkanų normos ribą, tuomet taikoma palūkanų norma už susijusį palūkanų skaičiavimo laikotarpį bus lygi viršutinei palūkanų normos ribai.

Palūkanų mokėjimo suma –	palūkanų suma, mokėtina pagal obligacijas už palūkanų skaičiavimo laikotarpį, yra apskaičiuojama sudauginus: a) obligacijų pagrindinę sumą; b) už tą palūkanų skaičiavimo laikotarpį taikytiną palūkanų normą ir c) trupmeną, kurios skaitiklis yra palūkanų skaičiavimo laikotarpio dienų skaičius (apskaičiuotas pagal 360 dienų metus, kuriuos sudaro dvylika 30 dienų mėnesių), o vardiklis – 360.
Prekybos ir atsiskaitymo data –	įtraukimo į apskaitą data.
Palūkanų mokėjimo datos –	kas ketvirtį įtraukimo į apskaitą datą + 3 mėn.; įtraukimo į apskaitą datą + 6 mėn.; įtraukimo į apskaitą datą + 9 mėn. ir įtraukimo į apskaitą datą + 1 m., pradedant palūkanas mokėti įtraukimo į apskaitą datą + 3 mėn. ir mokant jas visą obligacijų laikotarpį (priklausomai nuo čia aprašytų koregavimų).
Termino pabaigos data –	įtraukimo į apskaitą data + 10 m.
Valiuta –	USD.
Dienų skaičiavimo pagrindas –	30/360.
Susitarimas dėl atsiskaitymo darbo dieną –	laikomasi be pakeitimų.
Atkarpos apskaičiavimas –	kiekvieno palūkanų skaičiavimo laikotarpio antroji Londono bankų darbo diena, einanti prieš pat atitinkamų palūkanų datą.
Data –	Londono bankų darbo diena – bet kuri diena, kurią komerciniai bankai vykdo bendrąsias operacijas (įskaitant valiutos keitimą ir indėlių užsienio valiuta tvarkymą) Londone ir kurią operacijos JAV doleriais yra vykdomos Londono tarpbankinėje rinkoje.

206. Ilgoji 1 mln. EUR VOKIETIJOS VYRIAUSYBĖS (infliacinė) pozicija (ISIN DE0001030583).

Terminas – 2033 m. balandžio 15 d.

EBI priemonės valiuta – EUR.

207. Trumpoji 1 mln. EUR VOKIETIJOS VYRIAUSYBĖS pozicija (ISIN DE0001030708).

Terminas – 2030 m. rugpjūčio 15 d.

EBI priemonės valiuta – EUR.

208. Ilgoji 1 mln. EUR ITALIJOS VYRIAUSYBĖS (infliacinė) pozicija (ISIN IT0005138828).

Terminas – 2032 m. rugsėjo 15 d.

EBI priemonės valiuta – EUR.

209. Ilgoji 1 mln. EUR ITALIJOS VYRIAUSYBĖS pozicija (ISIN IT0005340929).

Terminas – 2028 m. gruodžio 1 d.

EBI priemonės valiuta – EUR.

210. Ilgoji 1 mln. EUR ISPANIJOS VYRIAUSYBĖS pozicija (ISIN ES00000127A2).

Terminas – 2030 m. liepos 30 d.

EBI priemonės valiuta – EUR.

211. Trumpoji 1 mln. EUR PRANCŪZIJOS VYRIAUSYBĖS pozicija (ISIN FR0012993103).

Terminas – 2031 m. gegužės 25 d.

EBI priemonės valiuta – EUR.

212. Trumpoji 1 mln. EUR VOKIETIJOS VYRIAUSYBĖS pozicija (ISIN DE0001135176).

Terminas – 2031 m. sausio 4 d.

EBI priemonės valiuta – EUR.

213. Ilgoji 1 mln. GBP JUNGTINĖS KARALYSTĖS VYRIAUSYBĖS pozicija (ISIN GB0004893086).

Terminas – 2032 m. birželio 7 d.

EBI priemonės valiuta – GBP.

214. Ilgoji 1 mln. EUR PORTUGALIJOS VYRIAUSYBĖS pozicija (ISIN PTOTEXOE0024).

Terminas – 2029 m. birželio 15 d.

EBI priemonės valiuta – EUR.

215. Trumpoji 1 mln. USD JUNGTINIŲ VALSTIJŲ VYRIAUSYBĖS pozicija (ISIN US91282CAV37).

Terminas – 2030 m. lapkričio 15 d.

EBI priemonės valiuta – USD.

216. Ilgoji 1 mln. USD BRAZILIJOS VYRIAUSYBĖS (pareikalavimo) pozicija (ISIN US105756BZ27).

Terminas – 2028 m. sausio 13 d.

EBI priemonės valiuta – USD.

217. Ilgoji 1 mln. USD MEKSIKOS VYRIAUSYBĖS (pareikalavimo) pozicija (ISIN US91087BAT70).

Terminas – 2033 m. gegužės 19 d.

EBI priemonės valiuta – USD.

218. 10 metų IRS EURO: gauti kintamąją palūkanų normą ir mokėti fiksuotąją palūkanų normą.

Fiksuotoji dalis – mokama kas metus.

Kintamoji palūkanų norma – 3 mėn. EURIBOR norma, gaunama kas ketvirtį. Dienų skaičiavimas – faktinis dienų skaičius / 360.

Tariamoji vertė – 10 000 000 EUR.

Atnaujinimo tvarka ir grafikas – standartiniai.

Įsigaliojimo data – įtraukimo į apskaitą data (t. y. taikomos įtraukimo į apskaitą datos rinkos uždarymo normos).

Terminas – įtraukimo į apskaitą data + 10 m.

EBI priemonės valiuta – EUR.

219. 5 metų IRS EURO: gauti kintamąją palūkanų normą ir mokėti fiksuotąją palūkanų normą.

Fiksuotoji dalis – mokama kas metus.

Kintamoji palūkanų norma – 6 mėn. EURIBOR norma, gaunama kas 6 mėn. Dienų skaičiavimas – faktinis dienų skaičius / 360.

Tariamoji vertė – 10 000 000 EUR.

Atnaujinimo tvarka ir grafikas – standartiniai.

Įsigaliojimo data – įtraukimo į apskaitą data (t. y. taikomos įtraukimo į apskaitą datos rinkos uždarymo normos).

Terminas – įtraukimo į apskaitą data + 5 m.

EBI priemonės valiuta – EUR.

220. 5 m. rinkos vertės skirtingomis valiutomis (EUR/USD) apsikeitimo sandoris. Gauti USD, mokėti EUR.

EUR: 3 mėn. ESTER, mokama kas ketvirtį su 2 dienų mokėjimo vėlavimu. Dienų skaičiavimas – faktinis dienų skaičius / 360.

USD: 3 mėn. SOFR, gaunama kas ketvirtį su 2 dienų mokėjimo vėlavimu. Dienų skaičiavimas – faktinis dienų skaičius / 360.

1 dalis – USD: 10 mln. EUR tariamosios sumos ekvivalentas, koreguojamas kas ketvirtį.

2 dalis – EUR: tariamoji vertė – 10 000 000 EUR.

Atnaujinimo tvarka ir grafikas – standartiniai.

Įsigaliojimo data – įtraukimo į apskaitą data + 6 mėn.

Terminas – įtraukimo į apskaitą data + 5,5 m.

EBI priemonės valiuta – EUR.

Dar žr. šio priedo 6 skirsnį „Papildomos priemonių specifikacijos“.

221. 10 metų IRS EURO – gauti ESTER ir mokėti EURIBOR.

ESTER dalis – gaunama kas metus. Dienų skaičiavimas – faktinis dienų skaičius / 360.

EURIBOR dalis – 3 mėn. EURIBOR norma + bazė, mokama kas ketvirtį. Dienų skaičiavimas – faktinis dienų skaičius / 360.

Tariamoji vertė – 10 000 000 EUR.

Atnaujinimo tvarka ir grafikas – standartiniai.

Įsigaliojimo data – įtraukimo į apskaitą data (t. y. taikomos įtraukimo į apskaitą dienos pabaigos rinkos normos).

Terminas – T + 9 m. rugsėjo mėn.

EBI priemonės valiuta – EUR.

222. Ilgoji 1 mln. EUR ITALIJOS VYRIAUSYBĖS (infliacinė) pozicija (ISIN IT0005387052).

Terminas – 2030 m. gegužės 15 d.

EBI priemonės valiuta – EUR.

223. 5 m. infliacijos nulinio kupono apsikeitimo sandoris EUR – gaunama indeksuota grąža ir mokama fiksuotoji palūkanų norma (r).

Infliacijos indeksas – CPI (SVKI x T).

Fiksuotoji dalis (mokėti fiks. p. n.) – $[(1 + r)^5 - 1]$

Gauti pagal infliaciją indeksuotą grąžą: $\left[\left(\frac{CPI \text{ at the end (maturity) date}}{CPI \text{ at the start date}}\right) - 1\right]$

Tariamoji vertė – 10 000 000 EUR.

Bazinės palūkanų normos nustatymo data – T – 1 m. birželio mėn.

Galutinis nustatymas – T + 4 m. rugpjūčio mėn.

Terminas – T + 4 m. rugsėjo mėn.

EBI priemonės valiuta – EUR.

224. Dvejų metų pasirinkimo sandoris eurais dėl 5 m. palūkanų normų apsikeitimo sandorio (IRS) eurais – gauti fiksuotąją palūkanų normą ir mokėti kintamąją palūkanų normą.

Tariamoji vertė – 10 000 000 EUR.

Įstaiga yra pasirinkimo sandorio dėl apsikeitimo sandorio pardavėjas. Įstaigos sandorio šalis perka teisę sudaryti apsikeitimo sandorį su įstaiga; jeigu sandorio šalis savo teise pasinaudos, ji gaus kintamąją palūkanų normą, o įstaiga gaus fiksuotąją palūkanų normą.

Pasirinkimo sandoris, kurio terminas – dveji metai (įtraukimo į apskaitą data + 2 m.), dėl palūkanų normų apsikeitimo sandorio (IRS), apibrėžto taip: fiksuotoji dalis – gaunama kas metus; kintamoji palūkanų norma – 6 mėn. EURIBOR, mokama kas 6 mėn.; tariamoji vertė – 10 000 000 EUR; atnaujinimo tvarka ir grafikas – standartiniai; Pagrindinio apsikeitimo sandorio įsigaliojimo data – įtraukimo į apskaitą data + 2 m.

Pagrindinio apsikeitimo sandorio terminas – įtraukimo į apskaitą data + 7 m.

Priedas mokamas įtraukimo į apskaitą datą (įtraukimo į apskaitą data). Atsiskaitoma pinigais.

Vykdymo kaina grindžiama šioje priemonėje apibrėžtu išankstinio apsikeitimo sandorio ATM kursu + 100 bazinių punktų.

EBI priemonės valiuta – EUR.

UŽSIENIO VALIUTA

301. 6 mėn. USD/EUR išankstinis sandoris. Atsiskaitoma pinigais. Ilgosios pozicijos USD, trumposios pozicijos EUR; tariamoji vertė – 10 000 000 USD, išankstinio sandorio vykdymo kaina – lygi 100 % įtraukimo į apskaitą dienos pabaigos atitinkamo ECB pagrindinio momentinio valiutos kurso.

EBI priemonės valiuta – EUR.

302. 6 mėn. EUR/GBP išankstinių sandorių pozicija. Atsiskaitoma pinigais. Ilgosios pozicijos EUR, trumposios pozicijos GBP. Tariamoji vertė –
10 000 000 GBP; išankstinio sandorio vykdymo kaina – lygi 100 % įtraukimo į apskaitą dienos pabaigos atitinkamo ECB pagrindinio momentinio valiutos kurso.

EBI priemonės valiuta – EUR.

303. Ilgoji 10 mln. USD pinigų srauto pozicija.

Pinigų srauto pozicija. Laikytina būdinga valiutos kurso rizika, kaip aprašyta kk punkte.

EBI priemonės valiuta – EUR.

304. Ilgoji EUR/USD pasirinkimo pirkti sandorio pozicija (ilgosios pozicijos EUR, trumposios pozicijos USD). Atsiskaitoma pinigais. Tariamoji vertė – 10 000 000 EUR. Lygiavertė suma, grindžiama įtraukimo į apskaitą dienos pabaigos EUR/USD ECB pagrindiniu momentiniu valiutos kursu.

Vykdymo kaina – 110 % įtraukimo į apskaitą dienos pabaigos EUR/USD ECB pagrindinio aktualaus valiutos kurso.

Galiojimo pabaigos data – įtraukimo į apskaitą data + 1 m.

EBI priemonės valiuta – EUR.

305. Ilgoji EUR/USD pasirinkimo pirkti sandorio pozicija (ilgosios pozicijos EUR, trumposios pozicijos USD). Atsiskaitoma pinigais. Tariamoji vertė – 10 000 000 EUR. Lygiavertė suma, grindžiama įtraukimo į apskaitą dienos pabaigos EUR/USD ECB pagrindiniu momentiniu valiutos kursu.

Vykdymo kaina – 90 % įtraukimo į apskaitą dienos pabaigos EUR/USD ECB pagrindinio aktualaus valiutos kurso.

Galiojimo pabaigos data – įtraukimo į apskaitą data + 1 m.

EBI priemonės valiuta – EUR.

306. Trumpoji EUR/USD pasirinkimo pirkti sandorio pozicija (trumposios pozicijos EUR, ilgosios pozicijos USD). Atsiskaitoma pinigais. Tariamoji vertė – 10 000 000 EUR. Lygiavertė suma, grindžiama įtraukimo į apskaitą dienos pabaigos EUR/USD ECB pagrindiniu momentiniu valiutos kursu.

Vykdymo kaina – 100 % įtraukimo į apskaitą dienos pabaigos EUR/USD ECB pagrindinio aktualaus valiutos kurso.

Galiojimo pabaigos data – įtraukimo į apskaitą data + 1 m.

EBI priemonės valiuta – EUR.

307. Trumpoji EUR/GBP pasirinkimo pirkti sandorio pozicija (trumposios pozicijos EUR, ilgosios pozicijos GBP). Atsiskaitoma pinigais. Tariamoji vertė – 10 000 000 EUR. Lygiavertė suma, grindžiama įtraukimo į apskaitą dienos pabaigos EUR/GBP ECB pagrindiniu momentiniu valiutos kursu.

Vykdymo kaina – 110 % įtraukimo į apskaitą dienos pabaigos EUR/GBP ECB pagrindinio aktualaus valiutos kurso.

Galiojimo pabaigos data – įtraukimo į apskaitą data + 1 m.

EBI priemonės valiuta – EUR.

308. Ilgoji EUR/JPY pasirinkimo parduoti sandorio pozicija (trumposios pozicijos EUR, ilgosios pozicijos JPY). Atsiskaitoma pinigais. Tariamoji vertė – 10 000 000 EUR. Lygiavertė suma, grindžiama įtraukimo į apskaitą dienos pabaigos EUR/JPY ECB pagrindiniu momentiniu valiutos kursu.

Vykdymo kaina – 110 % įtraukimo į apskaitą dienos pabaigos EUR/JPY ECB pagrindinio aktualaus valiutos kurso.

Galiojimo pabaigos data – įtraukimo į apskaitą data + 1 m.

EBI priemonės valiuta – EUR.

309. Trumpoji EUR/AUD pasirinkimo parduoti sandorio pozicija (ilgosios pozicijos EUR, trumposios pozicijos AUD). Atsiskaitoma pinigais. Tariamoji vertė – 10 000 000 EUR. Lygiavertė suma, grindžiama įtraukimo į apskaitą dienos pabaigos EUR/AUD ECB pagrindiniu momentiniu valiutos kursu.

Vykdymo kaina – 110 % įtraukimo į apskaitą dienos pabaigos EUR/AUD ECB pagrindinio aktualaus valiutos kurso.

Galiojimo pabaigos data – įtraukimo į apskaitą data + 1 m.

EBI priemonės valiuta – EUR.

310. 6 mėn. EUR/DKK išankstinis sandoris (ilgosios pozicijos EUR, trumposios pozicijos DKK). Atsiskaitoma pinigais; tariamoji vertė – 10 000 000 EUR, taikant įtraukimo į apskaitą dienos pabaigos EUR/DKK ECB pagrindinį momentinį valiutos kursą, siekiant nustatyti išankstines palūkanų normas.

EBI priemonės valiuta – EUR.

311. 6 mėn. EUR/BRL išankstinis sandoris, kurio pagrindinė suma neperduodama (ilgosios pozicijos EUR, trumposios pozicijos BRL); tariamoji vertė – 10 000 000 EUR, taikant įtraukimo į apskaitą dienos pabaigos EUR/BRL ECB pagrindinį momentinį valiutos kursą, siekiant nustatyti išankstines palūkanų normas.

EBI priemonės valiuta – EUR.

BIRŽOS PREKĖS

401. 6 mėn.
3 500 Trojos uncijų ilgosios pozicijos, Londono aukso išankstinės sutartys (ilgosios pozicijos – auksas, trumposios pozicijos USD). Atsiskaitoma pinigais. Vykdymo kaina – įtraukimo į apskaitą dienos pabaigos išankstinė 6 mėn. laikotarpio kaina

EBI priemonės valiuta – USD.

402. 12 mėn. 3 500 Trojos uncijų trumposios pozicijos, Londono aukso išankstinės sutartys (trumposios pozicijos – auksas, ilgosios pozicijos USD). Atsiskaitoma pinigais. Vykdymo kaina – įtraukimo į apskaitą dienos pabaigos išankstinė 12 mėn. laikotarpio kaina

EBI priemonės valiuta – USD.

403. 30 000 barelių Brent žalios naftos ilgosios pasirinkimo pirkti sandorio pozicijos (ilgosios WTI, trumposios USD). Atsiskaitoma pinigais. Vykdymo kaina – įtraukimo į apskaitą dienos pabaigos išankstinė 12 mėn. laikotarpio kaina. Galiojimo pabaigos data – įtraukimo į apskaitą data + 6 mėn.

EBI priemonės valiuta – USD.

404. 30 000 barelių Brent žalios naftos trumposios pasirinkimo parduoti sandorio pozicijos (ilgosios WTI, trumposios USD). Atsiskaitoma pinigais. Vykdymo kaina – įtraukimo į apskaitą dienos pabaigos išankstinė 12 mėn. laikotarpio kaina. Galiojimo pabaigos data – įtraukimo į apskaitą data + 6 mėn.

EBI priemonės valiuta – USD.

405. 5 000 Trojos uncijų ilgosios pasirinkimo pirkti sandorio pozicijos, Londono aukso sutartys (ilgosios pozicijos – auksas, trumposios USD). Atsiskaitoma pinigais. Vykdymo kaina – įtraukimo į apskaitą dienos pabaigos išankstinė 18 mėn. laikotarpio kaina. Galiojimo pabaigos data – įtraukimo į apskaitą data + 18 mėn.

EBI priemonės valiuta – USD.

KREDITO MARŽA

501. Ilgoji (t. y. apsaugos pirkimo) 1 mln. USD PORTUGALIJOS CDS pozicija.

Restruktūrizavimo sąlyga – VISIŠKAS.

EBI priemonės valiuta – USD.

502. Ilgoji (t. y. apsaugos pirkimo) 1 mln. USD ITALIJOS CDS pozicija.

Restruktūrizavimo sąlyga – VISIŠKAS.
EBI priemonės valiuta – USD.

503. Trumpoji (t. y. apsaugos pardavimo) 1 mln. USD ISPANIJOS CDS pozicija.

Restruktūrizavimo sąlyga – VISIŠKAS.
EBI priemonės valiuta – USD.

504. Ilgoji (t. y. apsaugos pirkimo) 1 mln. USD MEKSIKOS CDS pozicija.

Restruktūrizavimo sąlyga – VISIŠKAS.
EBI priemonės valiuta – USD.

505. Ilgoji (t. y. apsaugos pirkimo) 1 mln. USD BRAZILIJOS CDS pozicija.

Restruktūrizavimo sąlyga – VISIŠKAS.
EBI priemonės valiuta – USD.

506. Ilgoji (t. y. apsaugos pirkimo) 1 mln. USD JK CDS pozicija.

Restruktūrizavimo sąlyga – VISIŠKAS.
EBI priemonės valiuta – USD.

507. Trumpoji (t. y. apsaugos pardavimo) 1 mln. EUR įmonės „Telefonica“ CDS pozicija (kodas TEF SM).

EBI priemonės valiuta – EUR.

508. Ilgoji (t. y. apsaugos pirkimo) 1 mln. EUR įmonės „Telefonica“ CDS pozicija (kodas TEF SM).

Terminas – T + 2 m. gruodžio mėn.
EBI priemonės valiuta – EUR.

509. Trumpoji (t. y. apsaugos pardavimo) 1 mln. EUR įmonės „Aviva“ CDS pozicija (kodas AV LN).

ISDA apibrėžčių redakcija – 2003 m.
EBI priemonės valiuta – EUR.

510. Ilgoji (t. y. apsaugos pirkimo) 1 mln. EUR įmonės „Aviva“ CDS pozicija (kodas AV LN).

ISDA apibrėžčių redakcija – 2003 m.
Terminas – T + 2 m. gruodžio mėn.
EBI priemonės valiuta – EUR.

511. Trumpoji (t. y. apsaugos pardavimo) 1 mln. EUR įmonės „Vodafone“ CDS pozicija (kodas VOD LN).

EBI priemonės valiuta – EUR.

512. Trumpoji (t. y. apsaugos pardavimo) 1 mln. EUR įmonės „ENI SpA“ CDS pozicija (kodas ENI IM).

EBI priemonės valiuta – EUR.

513. Trumpoji (t. y. apsaugos pardavimo) 1 mln. USD įmonės „Eli Lilly“ CDS pozicija (kodas LLY US).

Restruktūrizavimo sąlyga – jokio restruktūrizavimo (XR14).
EBI priemonės valiuta – USD.

514. Trumpoji (t. y. apsaugos pardavimo) 1 mln. EUR įmonės „Unilever“ CDS pozicija (kodas UNA NA).

EBI priemonės valiuta – EUR.

515. Ilgoji (t. y. apsaugos pirkimo) 1 mln. EUR įmonės „Total SA“ CDS pozicija (kodas FP FP).

EBI priemonės valiuta – EUR.

516. Ilgoji (t. y. apsaugos pirkimo) 1 mln. EUR įmonės „Volkswagen Group“ CDS pozicija (kodas VOW GR).

EBI priemonės valiuta – EUR.

517. Ilgoji 1 mln. USD TURKIJOS VYRIAUSYBĖS obligacijų pozicija (ISIN US900123CT57).

Terminas – 2029 m. balandžio 26 d.
EBI priemonės valiuta – USD.

518. Ilgoji (t. y. apsaugos pirkimo) 1 mln. USD TURKIJOS CDS pozicija. Įsigaliojimo data – įtraukimo į apskaitą data.

Restruktūrizavimo sąlyga – VISIŠKAS.
EBI priemonės valiuta – USD.

519. Ilgoji 1 mln. EUR įmonės „Telefonica“ obligacijų pozicija (ISIN XS1681521081).

Terminas – 2028 m. sausio 12 d.
EBI priemonės valiuta – EUR.

520. Ilgoji 1 mln. EUR įmonės „Volkswagen Group“ obligacijų pozicija (ISIN XS2234567233).

Terminas – 2028 m. rugsėjo 22 d.
EBI priemonės valiuta – EUR.

521. Trumpoji 1 mln. EUR įmonės „Volkswagen Group“ obligacijų pozicija (ISIN XS1167667283).

Terminas – 2030 m. sausio 16 d.
EBI priemonės valiuta – EUR.

522. Ilgoji 1 mln. EUR įmonės „Total SA“ obligacijų pozicija (ISIN XS1856281834).

Terminas – 2033 m. liepos 11 d.
EBI priemonės valiuta – EUR.

523. Ilgoji 1 mln. EUR AUSTRIJOS VYRIAUSYBĖS pozicija (ISIN AT0000A04967).

Terminas – 2037 m. kovo 15 d.
EBI priemonės valiuta – EUR.

524. Ilgoji (t. y. apsaugos pirkimo) 1 mln. USD AUSTRIJOS CDS pozicija.

Terminas – T + 15 m. birželio mėn.
EBI priemonės valiuta – USD.

525. Ilgoji 1 mln. EUR NYDERLANDŲ VYRIAUSYBĖS pozicija (ISIN NL0013552060).

Terminas – 2040 m. sausio 15 d.
EBI priemonės valiuta – EUR.

526. Ilgoji (t. y. apsaugos pirkimo) 1 mln. USD NYDERLANDŲ CDS pozicija.

Terminas – T + 20 m. birželio mėn.
EBI priemonės valiuta – USD.

527. Ilgoji 1 mln. EUR BELGIJOS VYRIAUSYBĖS pozicija (ISIN BE0000348574).

Terminas – 2050 m. birželio 22 d.
EBI priemonės valiuta – EUR.

528. Ilgoji (t. y. apsaugos pirkimo) 1 mln. USD BELGIJOS CDS pozicija.

Terminas – T + 30 m. birželio mėn.

EBI priemonės valiuta – USD.

529. Ilgoji (apsaugos pirkimo) 10 mln. EUR „iTraxx Europe“ indekso, aktualiausio indekso rinkinio pozicija.

Terminas – T + 4 m. birželio mėn.

EBI priemonės valiuta – EUR.

530. Trumpoji pasirinkimo parduoti sandorių pozicija. 10 000 000 EUR. „iTraxx Europe“ indekso, aktualiausio indekso rinkinio pagrindinė suma (ta pati 529 priemonė).

Vykdymo kaina – ATM

Galiojimo pabaigos data – įtraukimo į apskaitą data + 6 mėn.

EBI priemonės valiuta – EUR.

531. Ilgoji 1 mln. EUR įmonės „AXA SA“ (pareikalavimo) pozicija (ISIN XS1799611642).

Terminas – 2049 m. gegužės 28 d.

EBI priemonės valiuta – EUR.

532. Ilgoji 1 mln. USD įmonės „AT&T“ obligacijų (pareikalavimo) pozicija (ISIN US00206RFW79).

Terminas – 2037 m. rugpjūčio 15 d.

EBI priemonės valiuta – USD.

533. Ilgoji 1 mln. EUR įmonės „BAYER AG“ (pareikalavimo) pozicija (ISIN XS2199266268).

Terminas – 2030 m. sausio 6 d.

EBI priemonės valiuta – EUR.

534. Ilgoji 1 mln. EUR įmonės „ORANGE SA“ obligacijų (pareikalavimo) pozicija (ISIN FR0013323870).

Terminas – 2028 m. kovo 20 d.

EBI priemonės valiuta – EUR.

KORELIACINĖS PREKYBOS PORTFELIAI (CTP)

601. Trumpoji (t. y. apsaugos pardavimo) „iTraxx Europe“ indekso, aktualiausio indekso rinkinio pozicija.

Nuostolių priskyrimo riba – 3 %.

Nuostolių atskyrimo riba – 6 %.

Tariamoji vertė – 5 000 000 EUR.

Terminas – 5 metai.

EBI priemonės valiuta – EUR.

602. Ilgoji (t. y. apsaugos pirkimo) 5 mln. EUR „iTraxx Europe“ indekso, naujausio aktualiausio indekso rinkinio CDS pozicija.

Terminas – T + 4 m. birželio mėn.

EBI priemonės valiuta – EUR.

Tariamoji vertė pakoreguota, kad būtų visiškai apdrausta 601 CS01 ir nereikėtų papildomo apdraudimo.

603. Ilgoji (t. y. apsaugos pirkimo) „iTraxx Europe“ indekso, aktualiausio indekso rinkinio pozicija.

Nuostolių priskyrimo riba – 3 %.

Nuostolių atskyrimo riba – 6 %.

Tariamoji vertė – 5 000 000 EUR.

Terminas – 5 metai.

EBI priemonės valiuta – EUR.

604. Trumpoji (t. y. apsaugos pardavimo) 5 mln. EUR „iTraxx Europe“ indekso, naujausio aktualiausio indekso rinkinio CDS pozicija.

Terminas – T + 4 m. birželio mėn.

EBI priemonės valiuta – EUR.

Tariamoji vertė pakoreguota, kad būtų visiškai apdrausta 603 CS01 ir nereikėtų papildomo apdraudimo.

605. Trumpoji (t. y. apsaugos pardavimo) „iTraxx Europe“ indekso, aktualiausio indekso rinkinio pozicija.

Nuostolių priskyrimo riba – 12 %.

Nuostolių atskyrimo riba – 100 %.

Tariamoji vertė – 5 000 000 EUR.

Terminas – 5 metai.

EBI priemonės valiuta – EUR.

606. Ilgoji (t. y. apsaugos pirkimo) 5 mln. EUR „iTraxx Europe“ indekso, naujausio aktualiausio indekso rinkinio CDS pozicija.

Terminas – T + 4 m. birželio mėn.

EBI priemonės valiuta – EUR.

Tariamoji vertė pakoreguota, kad būtų visiškai apdrausta 605 CS01 ir nereikėtų papildomo apdraudimo.

607. Ilgoji (t. y. apsaugos pirkimo) „iTraxx Europe“ indekso, aktualiausio indekso rinkinio pozicija.

Nuostolių priskyrimo riba – 12 %.

Nuostolių atskyrimo riba – 100 %.

Tariamoji vertė – 5 000 000 EUR.

Terminas – 5 metai.

EBI priemonės valiuta – EUR.

608. Trumpoji (t. y. apsaugos pardavimo) 5 mln. EUR „iTraxx Europe“ indekso, naujausio aktualiausio indekso rinkinio CDS pozicija.

Terminas – T + 4 m. birželio mėn.

EBI priemonės valiuta – EUR.

Tariamoji vertė pakoreguota, kad būtų visiškai apdrausta 607 CS01 ir nereikėtų papildomo apdraudimo.

609. Trumpoji (t. y. apsaugos pardavimo) „iTraxx Europe“ indekso, aktualiausio indekso rinkinio pozicija.

Nuostolių priskyrimo riba – 3 %.

Nuostolių atskyrimo riba – 6 %.

Tariamoji vertė – 5 000 000 EUR.

Terminas – 5 metai.

EBI priemonės valiuta – EUR.

Susigrąžinimo norma – 40 % fiksuota.

610. Ilgoji (t. y. apsaugos pirkimo) 5 mln. EUR „iTraxx Europe“ indekso, naujausio aktualiausio indekso rinkinio CDS pozicija.

Terminas – T + 4 m. birželio mėn.

EBI priemonės valiuta – EUR.

Tariamoji vertė pakoreguota, kad būtų visiškai apdrausta 609 CS01 ir nereikėtų papildomo apdraudimo.

3 skirsnis. Atskiri portfeliai. Viena priemonė

Įstaigos nurodo šių atskirų portfelių privalomus rizikos matus ir dabartinę vertę:

Portfelis	*Priemonių derinys* Pirmasis skaičius atitinka priemonę (kaip nurodyta šio priedo 2 skirsnyje). Antrasis skaičius atitinka atitinkamai kiekvienos priemonės kiekį arba sutarčių skaičių.	EBI portfelio valiuta	Privalomi rizikos matai
1001	101 – 1 priemonė	EUR	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; SBM; DRC; RRAO
1002	102 – 1 priemonė	EUR	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; SBM; DRC; RRAO
1003	103 – 1 priemonė	EUR	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; SBM; DRC; RRAO
1004	104 – 1 priemonė	EUR	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; SBM; DRC; RRAO
1005	105 – 1 priemonė	EUR	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; SBM; DRC; RRAO
1006	106 – 1 priemonė	GBP	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; SBM; DRC; RRAO
1007	107 – 1 priemonė	EUR	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; SBM; DRC; RRAO
1008	108 – 1 priemonė	EUR	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; SBM; DRC; RRAO
1009	109 – 1 priemonė	EUR	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; SBM; DRC; RRAO
1010	110 – 1 priemonė	EUR	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; SBM; DRC; RRAO
1011	111 – 1 priemonė	USD	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; SBM; DRC; RRAO
1012	112 – 1 priemonė	USD	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; SBM; DRC; RRAO
1013	113 – 1 priemonė	EUR	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; SBM; DRC; RRAO
1014	114 – 1 priemonė	EUR	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; SBM; DRC; RRAO
1015	115 – 1 priemonė	GBP	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; SBM; DRC; RRAO
1016	116 – 1 priemonė	GBP	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; SBM; DRC; RRAO
1017	117 – 1 priemonė	JPY	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; SBM; DRC; RRAO
1018	118 – 1 priemonė	EUR	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; SBM; DRC; RRAO

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

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

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

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

4 skirsnis. Atskiri portfeliai. Kelios priemonės

Įstaigos nurodo šių atskirų portfelių privalomus rizikos matus ir dabartinę vertę:

Portfelis	*Priemonių derinys* Pirmasis skaičius atitinka priemonę (kaip nurodyta šio priedo 2 skirsnyje). Antrasis skaičius atitinka atitinkamai kiekvienos priemonės kiekį arba sutarčių skaičių.	EBI portfelio valiuta	Privalomi rizikos matai
1101	103 – 1 priemonė 104 – 1 priemonė 105 – 1 priemonė	EUR	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; SBM; DRC; RRAO
1102	113 – 1 priemonė 110 – 1 priemonė	EUR	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; SBM; DRC; RRAO
1103	115 – 1 priemonė 116 – 1 priemonė	GBP	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; SBM; DRC; RRAO
1104	109 – 1 priemonė 110 – 1 priemonė	EUR	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; SBM; DRC; RRAO

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

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

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

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

5 skirsnis. Agreguoti portfeliai

Įstaigos nurodo šių finansinių agreguotų portfelių privalomus rizikos matus ir dabartinę vertę:

Agreguotas portfelis	Aprašymas	*Atskirų portfelių derinys* (atskiri portfeliai, nurodomi šio priedo 3 ir 4 skirsniuose priskirtais numeriais)	EBI portfelio valiuta	Privalomi rizikos matai
10000	Konsoliduoti portfeliai, be CTP	1001, 1101, 1104, 1106, 2001, 2002, 2203, 2206, 3301, 3303, 3304, 4401, 4402, 5503, 5506, 5508, 5521	EUR	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; IRC; SBM; DRC; RRAO
11000	NUOSAVYBĖS VERTYBINIAI POPIERIAI, kaupiamasis	1001, 1101, 1104, 1106	EUR	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; SBM; DRC; RRAO
12000	PALŪKANŲ NORMA, kaupiamasis	2001, 2002, 2203, 2206	EUR	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; SBM; DRC; RRAO
13000	UŽSIENIO VALIUTA, kaupiamasis	3301, 3303, 3304	EUR	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; SBM; DRC; RRAO
14000	Biržos prekės, kaupiamasis	4401, 4402	USD	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; SBM; DRC; RRAO
15000	Kredito marža, kaupiamasis	5503, 5506, 5508, 5521	EUR	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; IRC; SBM; DRC; RRAO
16000	CTP, kaupiamasis, EUR	6601, 6602	EUR	VaR; VaR nepalankiausiomis sąlygomis; APR; SBM; DRC; RRAO

6 skirsnis. Papildomos priemonių specifikacijos

Šio priedo 2 skirsnyje aprašytoms finansinėms priemonėms įstaigos taiko šias papildomas specifikacijas:

Priemonė	220
Aprašymas	5 m. rinkos vertės skirtingomis valiutomis (EUR/USD) apsikeitimo sandoris. Gauti USD, mokėti EUR. Tariamoji vertė 10 mln. EUR, (10 mln. EUR * FX USD/EUR) USD.
Mokėti	2 kintamoji dalis
Gauti	1 kintamoji dalis
Tariamosios vertės keitimas ir perskaičiavimas	Įsigaliojimo datą ir termino pabaigos datą. Be to, kiekvieną atkarpos mokėjimo datą mokamas papildomas mokestis, atitinkantis 2 kintamosios dalies tariamosios vertės USD koregavimą. Dvi darbo dienas prieš kiekvieną mokėjimo dieną tariamoji vertė USD yra koreguojama, kad prilygtų 10 mln. EUR, taikant momentinį valiutos kursą.
Pinigai kasoje	Įtraukiama
1 kintamoji dalis	
Tariamoji vertė	10 mln. EUR ekvivalentas, įsigaliojimo dieną konvertuotas į USD taikant momentinį valiutos kursą; ekvivalentas koreguojamas kas ketvirtį.
Įsigaliojimo data	įtraukimo į apskaitą data + 6 mėn.
Termino pabaigos data	įtraukimo į apskaitą data + 5,5 m.
Mokėjimo datos nustatymas	po įsigaliojimo datos
Atkarpos mokėjimo periodiškumas	kas ketvirtį
Atkarpos dydis	3 mėn. SOFR + 0 bazinių punktų
Atkarpos dydžio perskaičiavimo periodiškumas	kas ketvirtį
Susitarimas dėl atkarpos dydžio nustatymo	kasdien susumuojama trijų mėnesių laikotarpiu
Atkarpos dydžio sudarymo periodiškumas	paprastosios palūkanos
Dienų skaičiavimas	faktinis dienų skaičius / 360
Mokėjimas darbo dieną	LON, NYC, TARGET
Susitarimas dėl atsiskaitymo darbo dieną	artimiausią darbo dieną (pakeista)
Tariamosios vertės perskaičiavimas darbo dieną	LON, NYC, TARGET
Susitarimas dėl tariamosios vertės perskaičiavimo darbo dieną	ankstesnę dieną
Atkarpos dydžio perskaičiavimas darbo dieną	LON, NYC, TARGET
Susitarimas dėl atkarpos dydžio perskaičiavimo darbo dieną	ankstesnę dieną

2 kintamoji dalis	
Tariamoji vertė	10 000 000 EUR
Įsigaliojimo data	įtraukimo į apskaitą data + 6 mėn.
Termino pabaigos data	įtraukimo į apskaitą data + 5,5 m.
Mokėjimo datos nustatymas	po įsigaliojimo datos
Atkarpos mokėjimo periodiškumas	kas ketvirtį
Atkarpos dydis	3 mėn. ESTER + 0 bazinių punktų
Atkarpos dydžio perskaičiavimo periodiškumas	kas ketvirtį
Susitarimas dėl atkarpos dydžio nustatymo	kasdien susumuojama trijų mėnesių laikotarpiu
Atkarpos dydžio sudarymo periodiškumas	paprastosios palūkanos
Dienų skaičiavimas	faktinis dienų skaičius / 360
Mokėjimas darbo dieną	LON, NYC, TARGET
Mokėjimas darbo dieną	artimiausią darbo dieną (pakeista)
Tariamosios vertės perskaičiavimas darbo dieną	LON, NYC, TARGET
Susitarimas dėl tariamosios vertės perskaičiavimo darbo dieną	ankstesnę dieną
Atkarpos dydžio perskaičiavimas darbo dieną	LON, NYC, TARGET
Susitarimas dėl atkarpos dydžio perskaičiavimo darbo dieną	ankstesnę dieną.

7 skirsnis. SBM patvirtinimo portfeliai

a) Teikdamos IMV vertes, įstaigos pateikia portfelių, apibrėžtų X priede, SBM rizikos matą pagal IMV pateikimo ataskaitines datas.

b) Teikiant SBM patvirtinimo portfelių rezultatus atitinkančius duomenis taikoma ši tvarka:

i. įstaigos teikia tik C 120.02 formą ir šioje formoje pateikia tik rezultatus ataskaitose nurodoma valiuta (t. y. C 120.02 formos 0060 skiltis nepildoma, o SBM patvirtinimo portfelių atveju nepildomos ir C 106.00 ir C 106.01 formos);

ii. įstaigos daro prielaidą, kad jautrumas rizikai ir kreivumo rizikos pozicijos, apibrėžtos X priede nurodytomis priemonėmis, išreiškiamos įstaigos ataskaitose nurodoma valiuta ir pateikiamos formatu, nurodytu C 106.01 / C 120.01 formų nurodymuose ir atitinkamoje VI priede pateiktoje lentelėje su šių formų pildymo gairėmis (su forma susiję nurodymai).“

III PRIEDAS

„VI PRIEDAS

LYGINAMŲJŲ PORTFELIŲ PRIEŽIŪROS REZULTATAI

SU FORMA SUSIJĘ NURODYMAI

C 106.00. Pradinis rinkos vertinimas ir neįtraukimo pagrindas 57
C 106.01. SBM. Jautrumas rizikai pagal priemones 57
C 107.01. Ne CTP VaR ir sVaR. Duomenys 61
C 107.02. Ne CTP VaR, sVaR ir PV. Rezultatai EBI portfelio valiuta 63
C 108.00. Pelno ir nuostolio laiko eilutės 64
C 109.01. IRC. Modelio duomenys 65
C 109.02. IRC. Duomenys pagal portfelius 65
C 109.03. IRC. Suma pagal portfelį / datą 66
C 110.01. CT. Modelio duomenys 67
C 110.02. CT. Duomenys pagal portfelius 68
C 110.03. CT. APR PAGAL PORTFELĮ / DATĄ 69
C 120.01. SBM. JAUTRUMAS RIZIKAI PAGAL PRIEMONES / PORTFELIUS 69
C 120.02. SBM. OFR SUDĖTIS PAGAL PORTFELIUS 72
C 120.04. DRC. RINKOS VERTĖS IR BENDROSIOS JTD SUMOS PAGAL PRIEMONES / PORTFELIUS 74
C 120.05. DRC. OFR SUDĖTIS PAGAL PORTFELIUS 80
C 120.06. ASA. OFR 82

SU FORMA SUSIJĘ NURODYMAI

C 106.00. Pradinis rinkos vertinimas ir neįtraukimo pagrindas

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0010	Priemonės numeris	V priedo 2 skirsnis	Nurodomas priemonės numeris iš V priedo.
0020	Priemonė sumodeliuota pagal VaR ir sVaR (TAIP / NE)		Nurodoma TAIP arba NE.
0030	Priemonė sumodeliuota pagal IRC (TAIP / NE)		Nurodoma TAIP arba NE.
0040	Priemonė sumodeliuota koreliacinei prekybai (TAIP / NE)		Nurodoma TAIP arba NE.
0050	Neįtraukimo pagrindas	3 straipsnio 2 dalis	Nurodoma viena iš šių parinkčių: (a) modelis reguliavimo institucijos nepatvirtintas; (b) finansinė priemonė arba pagrindinis turtas įstaigos viduje nepatvirtintas; (c) pagrindinio turto arba modeliavimo savybė įstaigos viduje nesvarstyta; (d) kitas neįtraukimo pagrindas. Prašom paaiškinti pagrindą 0060 skiltyje.
0060	Laukelis tekstui laisva forma		Šioje skiltyje įstaiga gali pateikti visą papildomą informaciją.
0070	Pradinis rinkos vertinimas (IMV)		Kiekvienos priemonės vertė pagal rinkos kainą ataskaitinę dieną 17.30 Vidurio Europos laiku (kaip nurodyta V priedo 1 skirsnio b punkte). Laukelis paliekamas tuščias, jeigu įstaiga nenori pateikti tam tikro portfelio IMV (t. y. nulinės vertės nurodomos tik tuo atveju, jei apskaičiuota vertė lygi nuliui).

C 106.01. SBM. Jautrumas rizikai pagal priemones

Įstaigos nurodo jautrumą rizikos veiksniams, kurie kyla priemonei. Kiekvienam rizikos veiksniui / jautrumui pildoma atskira eilutė. Atskirose eilutėse nurodoma to rizikos veiksnio didėjanti grynoji kreivumo rizikos pozicija (CVRk+) arba to rizikos veiksnio mažėjanti grynoji kreivumo rizikos pozicija (CVRk-), kaip nurodyta Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325g straipsnyje. Visos vertės nurodomos IMV (pradinio SBM) ataskaitinę datą, kaip nurodyta šio reglamento V priedo 1 skirsnio b punkto ii papunktyje. Įstaigos nurodo kiekvieną priemonės numerio derinį, rizikos identifikatorių (0010 skiltis), grupę (0020 skiltis) ir papildomą identifikatorių (0030 skiltis) tik vieną kartą.

Su lentelėmis susiję nurodymai (z ašis)

Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
Priemonės numeris	V priedo 2 skirsnis	Nurodomas priemonės numeris iš V priedo.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0010	Rizikos veiksnio identifikatorius	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l, 325m, 325n, 325o, 325p ir 325q straipsniai	Nurodomas rizikos veiksnio identifikatorius, kaip nurodyta šio priedo pabaigoje pateikiamoje lentelėje.
0020	Grupė	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325d straipsnio 3 dalis	Nurodoma grupė, jei 0010 skiltyje pasirinktas rizikos veiksnio identifikatorius atitinka rizikos klasę: — bendroji palūkanų normos rizika – nurodomas atitinkamos nerizikingos palūkanų normos, infliacijos arba skirtingų valiutų bazės rizikos veiksnio valiutos pavadinimas (pagal ISO 4217 valiutos nuorodą, pvz., „EUR“); — pozicijų, kurios nėra pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos, kredito maržos rizika – nurodomas Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325ah straipsnio 1 dalies 4 lentelėje pateiktas grupės numeris; — į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį neįtraukto pakeitimo vertybiniais popieriais kredito maržos rizika – nurodomas to reglamento 325am straipsnio 1 dalies 7 lentelėje pateiktas grupės numeris; — į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį įtraukto pakeitimo vertybiniais popieriais kredito maržos rizika – nurodomas to reglamento 325ak straipsnio 6 lentelėje pateiktas grupės numeris; — nuosavybės vertybinių popierių rizika – nurodomas to reglamento 325ap straipsnio 1 dalies 8 lentelėje pateiktas grupės numeris; — biržos prekių kainos rizika – nurodomas to reglamento 325as straipsnio 9 lentelėje pateiktas grupės numeris; — FX rizika ir delta arba kreivumo sudedamosios dalys – nurodomas valiutos pavadinimas (pvz., USD, pateikiami valiutos kodai atitinka ISO 4217 valiutos nuorodą); — FX rizika ir delta sudedamosios dalys – nurodomas valiutos poros pavadinimas (pvz., „EUR_USD“, pateikiami valiutos kodai atitinka ISO 4217 valiutos nuorodą).
0030	Pirmas papildomas identifikatorius	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l–325q ir 325ai straipsniai	Nurodoma toliau pateikiama informacija, atskiriant rizikos veiksnį grupės viduje. Jei 0010 skiltyje pasirinktas rizikos veiksnio identifikatorius atitinka rizikos klasę: — bendroji palūkanų normos rizika ir delta sudedamoji dalis: nurodomas nerizikingos kreivės pavadinimas arba kitas atitinkamas unikalus identifikatorius; — pozicijų, kurios nėra pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos, kredito maržos rizika arba į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį įtraukto pakeitimo vertybiniais popieriais kredito maržos rizika: nurodomas emitento pavadinimas arba

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
			kitas atitinkamas unikalus identifikatorius, kuris turi būti vienodas bet kurių dviejų nurodytų rūšių jautrumui dviem rizikos veiksniams, kuriems taikomas koreliacijos parametras $\rho_{kl}^{(name)}$, lygus 1 pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325ai straipsnio 1 dalį; — į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį neįtraukto pakeitimo vertybiniais popieriais kredito maržos rizika: nurodomas segmento pavadinimas arba kitas atitinkamas unikalus identifikatorius; — nuosavybės vertybinių popierių rizika: nurodomas nuosavybės vertybinių popierių emitento pavadinimas arba atitinkamas unikalus identifikatorius; — biržos prekių kainos rizika: nurodomas biržos prekių pavadinimas arba kitas atitinkamas unikalus identifikatorius. Kai netinka nė vienas iš pirmiau nurodytų atvejų, įstaigos nurodo, kad aiški vertė netaikytina (NEAKTUALU).
0050	Jautrumas rizikai (rezultatai ataskaitose nurodoma valiuta)	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325d straipsnio 2 dalis ir 325g, 325r, 325s, 325t ir 325ax straipsniai	Jautrumas rizikai (delta / vega jautrumas ir kreivumo rizikos pozicijos) nurodomas kiekvienos priemonės lygmeniu dėl visų atitinkamų rizikos veiksnių, kaip nurodyta 0010–0030 skiltyse. Vertės nurodomos įstaigos ataskaitose nurodoma valiuta. Jei 0010 skiltyje pasirinktas rizikos veiksnio identifikatorius atitinka: — jautrumu grindžiamo metodo delta rizikos sudedamąją dalį, nurodomas grynasis jautrumas rizikos veiksniui (S_k), kaip nurodyta Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325r straipsnyje. Jeigu įstaigos yra gavusios savo kompetentingos institucijos leidimą naudoti alternatyvias jautrumo delta rizikai apibrėžtis pagal to reglamento 325t straipsnio 5 dalį, jos tas alternatyvias apibrėžtis nurodo teikdamos ataskaitas; — jautrumu grindžiamo metodo vega rizikos sudedamąją dalį, nurodomas pasirinkimo sandorio jautrumas vega rizikai konkrečiam rizikos veiksniui (S_k), kaip nurodyta Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325s straipsnyje. Jeigu įstaigos yra gavusios savo kompetentingos institucijos leidimą naudoti alternatyvius jautrumo vega rizikai apskaičiavimus pagal to reglamento 325t straipsnio 6 dalį, jos tuos alternatyvius apskaičiavimus nurodo teikdamos ataskaitas. Neatsižvelgiant į tai, ar įstaiga naudoja 325s straipsnio apibrėžtį, ar alternatyvų apskaičiavimą pagal to reglamento 325t straipsnio 6 dalį, jautrumas nurodomas įvertinus jį pagal atitinkamą numanomą kintamumą; — jautrumu grindžiamo metodo kreivumo rizikos sudedamąją dalį, nurodoma to rizikos veiksnio didėjanti grynoji kreivumo rizikos pozicija (CVR_k^+) arba to rizikos veiksnio mažėjanti grynoji kreivumo rizikos pozicija (CVR_k^-), kaip nurodyta Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325g straipsnyje. Nurodytas skaičius išreikštas dešimtainiu skaičiumi mažiausiai šimtųjų tikslumu. Nulinės vertės nurodomos tik tuo atveju, kai apskaičiuota vertė faktiškai lygi nuliui.
0060	Ataskaitose nurodoma valiuta		Nurodomas įstaigos ataskaitose nurodomos valiutos pavadinimas (nurodoma vertė atitinka ISO 4217 valiutos nuorodą, pvz., EUR).

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0070	Jautrumas rizikai (rezultatai EBI priemonės valiuta)	Šio reglamento V priedo 2 skirsnis ir Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325d straipsnio 2 dalis ir 325g, 325r, 325s straipsniai	Vertės nurodomos laikantis 0050 skilties nurodymų, tačiau perskaičiuojamos taikant ECB momentinį valiutos kursą, siejamą su priemonės valiuta, kaip apibrėžta šio reglamento V priedo 2 skirsnyje.
0080	Kainodaros modelis	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325t straipsnis	Įstaiga nurodo, kuris kainodaros modelis taikomas jautrumui apskaičiuoti. Nurodoma viena iš šių parinkčių: a) „įstaigos kainodaros modeliai, kurių pagrindu vyresniajai vadovybei pranešama apie pelną ir nuostolius“ (kaip nurodyta Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325t straipsnio 1 dalies pirmoje pastraipoje); b) „įstaigos vidaus modelių metodas“ (kaip nurodyta to reglamento 325t straipsnio 1 dalies antroje pastraipoje).
0090	Jautrumo apibrėžtis	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325r, 325s ir 325t straipsniai	Įstaiga nurodo, koks jautrumo apibrėžimas taikomas apskaičiuojant nuosavų lėšų reikalavimus. Nurodoma viena iš šių parinkčių: a) „jautrumo apibrėžtis Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325r ir 325s straipsniuose“; b) „jautrumo apibrėžtis pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325t straipsnio 5 ir 6 dalis“. Jei 0010 skiltyje pasirinktas rizikos veiksnio identifikatorius atitinka jautrumu grindžiamo metodo kreivumo rizikos sudedamąją dalį, nurodoma b punkte nurodyta vertė, jeigu kuris nors jautrumas, naudotas apskaičiuojant nurodytą kreivumo rizikos poziciją, yra pagrįstas jautrumo apibrėžtimi pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325t straipsnio 5 ir 6 dalis, o a punkte nurodyta vertė nurodoma kitais atvejais.
0100	Laukelis tekstui laisva forma		Šioje skiltyje įstaiga gali pateikti papildomos informacijos apie kainodaros modelį ir taikomą jautrumo apibrėžtį.
0110	Antras papildomas identifikatorius	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325p straipsnio 2 dalis	Jei 0010 skiltyje pasirinktas rizikos veiksnio identifikatorius atitinka jautrumu grindžiamo metodo rizikos klasę „Biržos prekių kainos rizika“ ir jautrumu grindžiamo metodo delta rizikos sudedamąją dalį, nurodomos teisinės sąlygos, susijusios su pristatymo vieta, arba kitas atitinkamas unikalus identifikatorius. Kai netinka nė vienas iš pirmiau nurodytų atvejų, įstaigos nurodo, kad aiški vertė netaikytina (NEAKTUALU).

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0120	Kredito kokybės kategorija	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325m straipsnio 1 dalis ir 325ah straipsnio 1 dalis	Jei 0010 skiltyje pasirinktas rizikos veiksnio identifikatorius atitinka jautrumu grindžiamo metodo rizikos klasę „Pozicijų, kurios nėra pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos, kredito maržos rizika“ ir jautrumu grindžiamo metodo delta rizikos sudedamąją dalį, nurodoma viena iš šių parinkčių: a) „1 CQS“; b) „2 CQS“; c) „3 CQS“; d) „4 CQS“; e) „5 CQS“; f) „6 CQS“; g) „CQS nepriskirtas (nereitinguota)“. Kai netinka nė vienas iš pirmiau nurodytų atvejų, įstaigos nurodo, kad aiški vertė netaikytina (NEAKTUALU).

C 107.01. Ne CTP VaR ir sVaR. Duomenys

Eilutė	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0010–-0060	VaR		
0010	Metodika		0010 skiltyje nurodoma viena iš šių parinkčių: a) istorinio rizikos vertės imitavimo metodas; b) Monte Karlo imitavimo metodas; c) parametrų metodika; d) kelių metodų derinys / kita metodika (patikslinti). 0010 skiltyje pateiktą parinktį įstaiga paaiškina 0020 skiltyje. 0010 skiltyje pasirinkus d parinktį įstaiga 0020 skiltyje pateikia išsamesnės informacijos.
0020	10 dienų laikotarpio apskaičiavimas	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 365 straipsnio 1 dalis	0010 skiltyje nurodoma viena iš šių parinkčių: a) 1 diena, perskirstyta 10 dienų; b) 10 dienų su sutampančiais laikotarpiais; c) 10 dienų pagal kitą metodiką. 0010 skiltyje pateiktą parinktį įstaiga paaiškina 0020 skiltyje.
0030	Stebėjimo laikotarpio trukmė	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 365straipsnio1dalies d punktas	0010 skiltyje nurodoma viena iš šių parinkčių: a) iki 1 metų; b) ilgesnė nei 1 metai, bet ne ilgesnė nei 2 metai; c) ilgesnė nei 2 metai, bet ne ilgesnė nei 3 metai; d) ilgesnė nei 3 metai. 0010 skiltyje pateiktą parinktį įstaiga paaiškina 0020 skiltyje.

Eilutė	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0040	Duomenims taikomas koeficientas	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 365 straipsnio 1 dalies d punktas	0010 skiltyje nurodoma viena iš šių parinkčių: a) koeficientas netaikytas (VaR duomenims taikomas koeficientas); b) koeficientas taikytas (VaR duomenims taikomas koeficientas); c) didesnioji iš verčių, kurioms koeficientas taikytas ir netaikytas (VaR duomenims taikomas koeficientas) a ir b punktuose. 0010 skiltyje pateiktą parinktį įstaiga paaiškina 0020 skiltyje.
0050	Grįžtamuoju patikrinimu nustatytas padidėjimo koeficientas	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 366 straipsnio 2 dalis	Grįžtamuoju patikrinimu nustatytas padidėjimo koeficientas – padidėjimo koeficientas, kurio vertė yra nuo 0 iki 1 pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 366 straipsnio 2 dalies 1 lentelę. 0010 skiltyje pateiktą parinktį įstaiga paaiškina 0020 skiltyje.
0060	VaR reguliavimo padidėjimo koeficientas	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 366 straipsnio 2 dalis („ne mažesnė kaip 3“ suma)	VaR reguliavimo padidėjimo koeficientas – papildomas kompetentingos institucijos nustatytas dydis, naudojamas apskaičiuojant VaR multiplikatoriaus koeficientą (ne mažesnis kaip 3) pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 366 straipsnio 2 dalį. VaR reguliavimo padidėjimo koeficientas lygus grįžtamuoju patikrinimu nustatyto padidėjimo koeficiento ir kokybinio padidėjimo koeficiento, jei taikomas, sumai, viršijančiai 3. 0010 skiltyje pateiktą parinktį įstaiga paaiškina 0020 skiltyje.
0070–-0100	SVaR (t. y. VaR nepalankiausiomis sąlygomis)		
0070	Metodika		0010 skiltyje nurodoma viena iš šių parinkčių: a) istorinio rizikos vertės imitavimo metodas; b) Monte Karlo imitavimo metodas; c) parametrų metodika; d) kelių metodų derinys / kita metodika (patikslinti). 0010 skiltyje pateiktą parinktį įstaiga paaiškina 0020 skiltyje. 0010 skiltyje pasirinkus d parinktį įstaiga 0020 skiltyje pateikia išsamesnės informacijos.
0080	10 dienų laikotarpio apskaičiavimas	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 365 straipsnio 1 dalis	0010 skiltyje nurodoma viena iš šių parinkčių: a) 1 diena, perskirstyta 10 dienų; b) 10 dienų su sutampančiais laikotarpiais; c) 10 dienų pagal kitą metodiką. 0010 skiltyje pateiktą parinktį įstaiga paaiškina 0020 skiltyje.
0090	SVaR reguliavimo padidėjimo koeficientas	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 366 straipsnio 2 dalis	Reguliavimo padidėjimo koeficientas – papildomas kompetentingos institucijos nustatytas dydis, naudojamas apskaičiuojant sVaR multiplikatoriaus koeficientą (ne mažesnis kaip 3) pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 366 straipsnio 2 dalį. Reguliavimo padidėjimo koeficientas lygus skaičiaus 3, grįžtamuoju patikrinimu nustatyto padidėjimo koeficiento ir kokybinio padidėjimo koeficiento (jei taikomas) sumai.

Eilutė	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
			0010 skiltyje pateiktą parinktį įstaiga paaiškina 0020 skiltyje.
0100	SVaR laikotarpis	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 365 straipsnio 2 dalis	0010 skiltyje nurodoma viena iš šių parinkčių: a) dienos VaR nepalankiausiomis sąlygomis apskaičiavimas, kalibruotas pagal vieną ištisą 12 mėn. laikotarpį, prasidedantį 0020 skiltyje nurodytą datą; b) savaitės VaR nepalankiausiomis sąlygomis apskaičiavimas, kalibruotas pagal vieną ištisą 12 mėn. laikotarpį, prasidedantį 0020 skiltyje nurodytą datą; c) dienos VaR nepalankiausiomis sąlygomis apskaičiavimas, kalibruotas pagal skirtingus ištisus 12 mėn. laikotarpius VaR nepalankiausiomis sąlygomis ataskaitinėmis datomis, nurodytomis C107.02 formos 0010 skiltyje, ir prasidedančius 0020 skiltyje nurodytomis datomis; d) savaitės VaR nepalankiausiomis sąlygomis apskaičiavimas, kalibruotas pagal skirtingus ištisus 12 mėn. laikotarpius VaR nepalankiausiomis sąlygomis ataskaitinėmis datomis, nurodytomis C107.02 formos 0010 skiltyje, ir prasidedančius 0020 skiltyje nurodytomis datomis; e) dienos VaR nepalankiausiomis sąlygomis apskaičiavimo, kalibruoto pagal daugiau nei vieną 12 mėn. laikotarpį, didžiausia vertė; f) savaitės VaR nepalankiausiomis sąlygomis apskaičiavimo, kalibruoto pagal daugiau nei vieną 12 mėn. laikotarpį, didžiausia vertė; g) kitokio VaR nepalankiausiomis sąlygomis kalibravimo pasirinkimas (prašom nurodyti). 0010 skiltyje nurodžiusios a arba b parinktį įstaigos 0020 skiltyje nurodo pradžios datą mmmm/mm/dd formatu, o 0010 skiltyje nurodžiusios c arba d parinktį – kiekvieno VaR nepalankiausiomis sąlygomis apskaičiavimo pradžios datas mmmm/mm/dd formatu. 0010 skiltyje nurodžiusios e, f ir g parinktis įstaigos 0020 skiltyje taip pat pateikia išsamesnį 12 mėnesių laikotarpio, naudoto atliekant kiekvieną VaR nepalankiausiomis sąlygomis apskaičiavimą, paaiškinimą.

C 107.02. Ne CTP VaR, sVaR ir PV. Rezultatai EBI portfelio valiuta

Su lentelėmis susiję nurodymai (z ašis)

Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
Portfelis	V priedo 3, 4 ir 5 skirsniai	Nurodomas portfelio numeris iš V priedo.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0010	Data		VaR, sVaR ir dabartinė vertė (PV) nurodomos visoms 10 darbo dienų nuo RM (ir galutinio ASA) pradinės ataskaitinės datos iki RM galutinės ataskaitinės datos, kaip nurodyta V priedo 1 skirsnio b punkte. Nurodant datas laikomasi mmmm/mm/dd formato.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0020	VaR	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 365 straipsnis	Nurodoma 10 dienų reguliavimo VaR, apskaičiuota kiekvienam portfeliui, netaikant „ne mažesnio nei 3“ reguliavimo multiplikatoriaus koeficiento. Duomenys nurodomi visoms 0010 skiltyje nurodytoms datoms. Laukelis paliekamas tuščias, kai įstaiga 0010 skiltyje nurodytą datą VaR neapskaičiuoja (t. y. nulinės vertės nurodomos tik tuo atveju, kai apskaičiuota vertė lygi nuliui).
0030	sVaR	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 365 straipsnis	Nurodoma 10 dienų reguliavimo sVaR, apskaičiuota kiekvienam portfeliui, netaikant „ne mažesnio nei 3“ reguliavimo multiplikatoriaus koeficiento. Duomenys nurodomi visoms 0010 skiltyje nurodytoms datoms. Laukelis paliekamas tuščias, kai įstaiga 0010 skiltyje nurodytą datą sVaR neapskaičiuoja (t. y. nulinės vertės nurodomos tik tuo atveju, kai apskaičiuota vertė lygi nuliui).
0040	PV		Nurodoma kiekvieno portfelio dabartinė vertė (PV). Duomenys nurodomi visoms 0010 skiltyje nurodytoms datoms. Laukelis paliekamas tuščias, kai įstaiga 0010 skiltyje nurodytą datą PV neapskaičiuoja (t. y. nulinės vertės nurodomos tik tuo atveju, kai apskaičiuota vertė lygi nuliui).

C 108.00. Pelno ir nuostolio laiko eilutės

C 108.00 formą („Pelno ir nuostolio laiko eilutės“) pildo tik tos įstaigos, kurios apskaičiuoja VaR pagal istorinio rizikos vertės imitavimo metodą.

Su lentelėmis susiję nurodymai (z ašis)

Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
Portfelis	V priedo 3, 4 ir 5 skirsniai	Nurodomas portfelio numeris iš V priedo.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0010	Data	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 365straipsnio1dalies d punktas	Kiekvieną darbo dieną pagal įstaigos jurisdikcijos kalendorių įstaigos pateikia pelno ir nuostolio laiko eilutes, naudojamas VaR apskaičiuoti C107.02 formos 0010 skiltyje ir apimančias bent 250 stebėjimo rezultatų skaičiuojant atgal nuo RM (ir galutinio ASA) galutinės ataskaitinės datos, kaip nurodyta V priedo 1 skirsnio b punkto v papunktyje.
0020	Dienos pelnas ir nuostolis		Įstaigos, kurios apskaičiuoja VaR pagal istorinio rizikos vertės imitavimo metodą, išsamiai užpildo įstaigos naudojamas laiko eilutes bent vienų metų duomenimis, kuriuose nurodo portfelio vertinimo pokytį (t. y. dienos pelną ir nuostolį), apskaičiuotą naudojant istoriškai imituotus dienos rizikos veiksnių pokyčius (t. y. dienos pelno ir nuostolio duomenų eilutes, naudojamas 1 dienos reguliavimo VaR gauti).

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
			Jeigu atitinkamoje jurisdikcijoje konkreti diena yra išeiginė, šis laukelis paliekamas tuščias (t. y. nulinis pelnas ir nuostolis nurodomi tik tuo atveju, kai hipotetinė portfelio vertė konkrečią darbo dieną nesikeitė).

C 109.01. IRC. Modelio duomenys

Eilutė	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0010	Modeliavimo koeficientų skaičius		EBA/GL/2012/3 Nurodomas viso IRC modelio lygmens modeliavimo koeficientų skaičius. Pateikiama viena iš šių parinkčių: a) 1 modeliavimo koeficientas; b) 2 modeliavimo koeficientai; c) daugiau kaip 2 modeliavimo koeficientai. 0010 skiltyje pateiktą parinktį įstaiga paaiškina 0020 skiltyje.
0020	LGD įverčių šaltinis		EBA/GL/2012/3 Nurodomas viso IRC modelio lygmens LGD įverčių šaltinis. Pateikiama viena iš šių parinkčių: a) rinkos tvarka; b) LGD įvertis, naudojamas IRB; c) kitas LGD įverčio šaltinis (nurodyti). 0010 skiltyje pateiktą parinktį įstaiga paaiškina 0020 skiltyje. 0010 skiltyje pasirinkus c parinktį įstaiga šioje skiltyje pateikia išsamesnės informacijos.

C 109.02. IRC. Duomenys pagal portfelius

Su lentelėmis susiję nurodymai (z ašis)

Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
Portfelis	V priedo 3, 4 ir 5 skirsniai	Portfelio numeris iš V priedo nurodomas tik tiems portfeliams, kurių IRC prašoma pateikti.

Eilutė	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0010	Likvidumo terminas	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 374 straipsnio 5 dalis	EBA/GL/2012/3 Nurodomas portfelio lygmeniu taikytas likvidumo terminas. Pateikiama viena iš šių parinkčių: a) iki 3 mėn.; b) ilgesnis nei 3 mėn., bet ne ilgesnis nei 6 mėn.; c) ilgesnis nei 6 mėn., bet ne ilgesnis nei 9 mėn.; d) ilgesnis nei 9 mėn., bet ne ilgesnis nei 12 mėn.
0020	PD šaltinis		EBA/GL/2012/3 Nurodomas portfelio lygmeniu taikytas įsipareigojimų neįvykdymo tikimybės (PD) šaltinis. Pateikiama viena iš šių parinkčių: a) reitingų agentūros; b) IRB metodas; c) PD pagal rinkos tendencijas; d) kitas PD įverčių šaltinis (nurodyti). 0010 skiltyje pateiktą parinktį įstaiga paaiškina 0020 skiltyje. 0010 skiltyje pasirinkus d parinktį įstaiga šioje 0020 skiltyje pateikia išsamesnės informacijos.
0030	Kredito rizikos vertinimų pasikeitimo tikimybių matricų šaltinis		EBA/GL/2012/3 Nurodomas portfelio lygmeniu taikytų kredito rizikos vertinimų pasikeitimo tikimybių matricų šaltinis. Pateikiama viena iš šių parinkčių: a) reitingų agentūros; b) IRB metodas; c) pasikeitimo tikimybių matricos pagal rinkos tendencijas; d) kiti pasikeitimo tikimybių matricų šaltiniai (nurodyti). 0010 skiltyje pateiktą parinktį įstaiga paaiškina 0020 skiltyje. 0010 skiltyje pasirinkus d parinktį įstaiga šioje 0020 skiltyje pateikia išsamesnės informacijos.

C 109.03. IRC. Suma pagal portfelį / datą

Su lentelėmis susiję nurodymai (z ašis)

Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
Portfelis	V priedo 3, 4 ir 5 skirsniai	Portfelio numeris iš V priedo nurodomas tik tiems portfeliams, kurių IRC prašoma pateikti.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0010	Data		IRC nurodomas visoms 10 darbo dienų nuo RM (ir galutinio ASA) pradinės ataskaitinės datos iki RM galutinės ataskaitinės datos, kaip nurodyta V priedo 1 skirsnio b punkte. Nurodant datas laikomasi mmmm/mm/dd formato.
0020	IRC	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 372–376 straipsniai	EBA/GL/2012/3 Nurodomas kiekvieno portfelio apskaičiuotas reguliavimo IRC. Duomenys nurodomi visoms 0010 skiltyje nurodytoms datoms. Laukelis paliekamas tuščias, kai įstaiga 0010 skiltyje nurodytą datą IRC neapskaičiuoja (t. y. nulinės vertės nurodomos tik tuo atveju, kai apskaičiuota vertė lygi nuliui).

C 110.01. CT. Modelio duomenys

Eilutė	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0010	Modeliavimo koeficientų skaičius	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 377 straipsnis	Nurodomas viso koreliacinės prekybos modelio lygmens modeliavimo koeficientų skaičius. Pateikiama viena iš šių parinkčių: a) 1 modeliavimo koeficientas; b) 2 modeliavimo koeficientai; c) daugiau kaip 2 modeliavimo koeficientai. Norėdama patikslinti 0010 skiltyje pateiktą parinktį įstaiga pateikia paaiškinimą 0020 skiltyje.
0020	LGD įverčių šaltinis	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 377 straipsnis	Nurodomas viso koreliacinės prekybos modelio lygmens LGD įverčių šaltinis. Pateikiama viena iš šių parinkčių: a) rinkos tvarka; b) LGD įvertis, naudojamas IRB; c) kiti LGD įverčio šaltiniai (nurodyti). 0010 skiltyje pateiktą parinktį įstaiga paaiškina 0020 skiltyje. 0010 skiltyje pasirinkus c parinktį įstaiga šioje skiltyje pateikia išsamesnės informacijos.

C 110.02. CT. Duomenys pagal portfelius

Su lentelėmis susiję nurodymai (z ašis)

Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
Portfelis	V priedo 3, 4 ir 5 skirsniai	Portfelio numeris iš V priedo nurodomas tik tiems portfeliams, kurių APR prašoma pateikti.

Eilutė	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0010	Likvidumo terminas	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 377 straipsnio 2 dalis	Nurodomas portfelio lygmeniu taikytas likvidumo terminas. Pateikiama viena iš šių parinkčių: a) iki 3 mėn.; b) ilgesnis nei 3 mėn., bet ne ilgesnis nei 6 mėn.; c) ilgesnis nei 6 mėn., bet ne ilgesnis nei 9 mėn.; d) ilgesnis nei 9 mėn., bet ne ilgesnis nei 12 mėn.
0020	PD šaltinis	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 377 straipsnis	Nurodomas portfelio lygmeniu taikytas įsipareigojimų neįvykdymo tikimybės (PD) šaltinis. Pateikiama viena iš šių parinkčių: a) reitingų agentūros; b) IRB metodas; c) PD pagal rinkos tendencijas; d) kitas PD įverčių šaltinis (nurodyti). 0010 skiltyje pateiktą parinktį įstaiga paaiškina 0020 skiltyje. 0010 skiltyje pasirinkus d parinktį įstaiga 0020 skiltyje pateikia išsamesnės informacijos.
0030	Kredito rizikos vertinimų pasikeitimo tikimybių matricų šaltinis	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 377 straipsnis	Nurodomas portfelio lygmeniu taikytų kredito rizikos vertinimų pasikeitimo tikimybių matricų šaltinis. Pateikiama viena iš šių parinkčių: a) reitingų agentūros; b) IRB metodas; c) pasikeitimo tikimybių matricos pagal rinkos tendencijas; d) kitas pasikeitimo tikimybių matricų šaltinis (nurodyti). 0010 skiltyje pateiktą parinktį įstaiga paaiškina 0020 skiltyje. 0010 skiltyje pasirinkus d parinktį įstaiga 0020 skiltyje pateikia išsamesnės informacijos.

C 110.03. CT. APR PAGAL PORTFELĮ / DATĄ

Su lentelėmis susiję nurodymai (z ašis)

Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
Portfelis	V priedo 3, 4 ir 5 skirsniai	Portfelio numeris iš V priedo nurodomas tik tiems portfeliams, kurių APR prašoma pateikti.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0010	Data	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 377 straipsnis	Visos kainos rizika (APR) nurodoma visoms 10 darbo dienų nuo RM (ir galutinio ASA) pradinės ataskaitinės datos iki RM galutinės ataskaitinės datos, kaip nurodyta V priedo 1 skirsnio b punkte. Nurodant datas laikomasi mmmm/mm/dd formato.
0060	APR	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 377 straipsnis	Nurodomi rezultatai, gauti kiekvienam portfeliui taikant reguliavimo koreliacinės prekybos modelį. Duomenys nurodomi visoms 0010 skiltyje nurodytoms datoms. Laukelis paliekamas tuščias, kai įstaiga 0010 skiltyje nurodytą datą koreliacinės prekybos modelio nenaudoja (t. y. nulinės vertės nurodomos tik tuo atveju, kai apskaičiuota vertė lygi nuliui).

C 120.01. SBM. JAUTRUMAS RIZIKAI PAGAL PRIEMONES / PORTFELIUS

Įstaigos nurodo kiekvienos priemonės jautrumą rizikos veiksniams, kurie kyla priemonei. Kiekvienam rizikos veiksniui / jautrumui pildoma atskira eilutė. Atskirose eilutėse nurodoma to rizikos veiksnio didėjanti grynoji kreivumo rizikos pozicija (CVRk+) arba to rizikos veiksnio mažėjanti grynoji kreivumo rizikos pozicija (CVRk-), kaip nurodyta Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325g straipsnyje. Visos vertės nurodomos RM (ir galutinio ASA) galutinę ataskaitinę datą (kaip nurodyta šio reglamento V priedo 1 skirsnio b punkto v papunktyje). Įstaigos nurodo kiekvieną portfelio numerio derinį, priemonės numerį (0010 skiltis), rizikos identifikatorių (0020 skiltis), grupę (0030 skiltis) ir papildomą identifikatorių (0040 skiltis) tik vieną kartą.

Su lentelėmis susiję nurodymai (z ašis)

Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
Portfelis	V priedo 3, 4 ir 5 skirsniai	Nurodomas portfelio numeris iš V priedo.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0010	Priemonės numeris	V priedo 2 skirsnis	Nurodomas priemonės numeris iš V priedo.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0020	Rizikos veiksnio identifikatorius	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l, 325m, 325n, 325o, 325p, 325q straipsniai	Nurodomas rizikos veiksnio identifikatorius, kaip nurodyta šio priedo pabaigoje pateikiamoje lentelėje.
0030	Grupė	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325d straipsnio 3 dalis	Nurodoma grupė, jei 0020 skiltyje pasirinktas rizikos veiksnio identifikatorius atitinka rizikos klasę: — bendroji palūkanų normos rizika. Nurodomas atitinkamos nerizikingos palūkanų normos, infliacijos arba skirtingų valiutų bazės rizikos veiksnio valiutos pavadinimas (pagal ISO 4217 valiutos nuorodą, pvz., „EUR“); — pozicijų, kurios nėra pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos, kredito maržos rizika. Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325ah straipsnio 1 dalies 4 lentelėje nurodomas grupės numeris; — į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį neįtraukto pakeitimo vertybiniais popieriais kredito maržos rizika. To reglamento 325am straipsnio 1 dalies 7 lentelėje nurodomas grupės numeris; — į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį įtraukto pakeitimo vertybiniais popieriais kredito maržos rizika. To reglamento 325ak straipsnio 6 lentelėje nurodomas grupės numeris; — nuosavybės vertybinių popierių rizika. To reglamento 325ap straipsnio 1 dalies 8 lentelėje nurodomas grupės numeris; — biržos prekių kainos rizika. To reglamento 325as straipsnio 9 lentelėje nurodomas grupės numeris; — FX rizika ir delta arba kreivumo sudedamosios dalys. Nurodomas valiutos pavadinimas (pvz., „USD“, nurodomi valiutos kodai atitinka ISO 4217 valiutos nuorodą); — FX rizika ir vega sudedamosios dalys. Nurodomas valiutos poros pavadinimas (pvz., „EUR_USD“, nurodomi valiutos kodai atitinka ISO 4217 valiutos nuorodą).
0040	Pirmas papildomas identifikatorius	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l–325q ir 325ai straipsniai	Nurodoma toliau pateikiama informacija, atskiriant rizikos veiksnį grupės viduje. Jei 0020 skiltyje pasirinktas rizikos veiksnio identifikatorius atitinka rizikos klasę: — bendroji palūkanų normos rizika ir delta sudedamoji dalis: nurodomas nerizikingos kreivės pavadinimas arba kitas atitinkamas unikalus identifikatorius; — pozicijų, kurios nėra pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos, kredito maržos rizika arba į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį įtraukto pakeitimo vertybiniais popieriais kredito maržos rizika: nurodomas emitento pavadinimas arba kitas atitinkamas unikalus identifikatorius, kuris turi būti vienodas bet kurių dviejų nurodytų rūšių jautrumui dviem rizikos veiksniams, kuriems taikomas koreliacijos parametras $\rho_{kl}^{(name)}$, lygus 1 pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325ai straipsnio 1 dalį; — į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį neįtraukto pakeitimo vertybiniais popieriais kredito maržos rizika: nurodomas segmento pavadinimas arba kitas atitinkamas unikalus identifikatorius; — nuosavybės vertybinių popierių rizika: nurodomas nuosavybės vertybinių popierių emitento pavadinimas arba atitinkamas unikalus identifikatorius;

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
			— biržos prekių kainos rizika: nurodomas biržos prekių pavadinimas arba kitas atitinkamas unikalus identifikatorius. Kai netinka nė vienas iš pirmiau nurodytų atvejų, įstaigos nurodo, kad aiški vertė netaikytina (NEAKTUALU).
0060	Jautrumas rizikai (rezultatai ataskaitose nurodoma valiuta)	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325d straipsnio 2 dalis ir 325g, 325r, 325s, 325t ir 325ax straipsniai	Jautrumas rizikai (delta / vega jautrumas ir kreivumo rizikos pozicijos) nurodomas kiekvienos priemonės lygmeniu dėl visų atitinkamų rizikos veiksnių, kaip nurodyta 0020–0040 skiltyse. Vertės nurodomos įstaigos ataskaitose nurodoma valiuta. Jei 0020 skiltyje pasirinktas rizikos veiksnio identifikatorius atitinka: — jautrumu grindžiamo metodo delta rizikos sudedamąją dalį, nurodomas grynasis jautrumas rizikos veiksniui (S_k), kaip nurodyta Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325r straipsnyje. Jeigu įstaigos yra gavusios savo kompetentingos institucijos leidimą naudoti alternatyvius jautrumo delta rizikai apskaičiavimus pagal to reglamento 325t straipsnio 5 dalį, jos tas alternatyvias apibrėžtis nurodo teikdamos ataskaitas; — jautrumu grindžiamo metodo vega rizikos sudedamąją dalį, nurodomas pasirinkimo sandorio jautrumas vega rizikai konkrečiam rizikos veiksniui (S_k), kaip nurodyta Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325s straipsnyje. Jeigu įstaigos yra gavusios savo kompetentingos institucijos leidimą naudoti alternatyvius jautrumo vega rizikai apskaičiavimus pagal to reglamento 325t straipsnio 6 dalį, jos tuos alternatyvius apskaičiavimus nurodo teikdamos ataskaitas. Neatsižvelgiant į tai, ar įstaiga naudoja 325s straipsnio skaičiavimus arba alternatyvų apskaičiavimą pagal to reglamento 325t straipsnio 6 dalį, jautrumas nurodomas įvertinus jį pagal atitinkamą numanomą kintamumą; — jautrumu grindžiamo metodo kreivumo rizikos sudedamąją dalį, nurodoma to rizikos veiksnio didėjanti grynoji kreivumo rizikos pozicija (CVR_k^+) arba to rizikos veiksnio mažėjanti grynoji kreivumo rizikos pozicija (CVR_k^-), kaip nurodyta Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325g straipsnyje. Nurodytas skaičius išreikštas dešimtainiu skaičiumi mažiausiai šimtųjų tikslumu. Nulinės vertės nurodomos tik tuo atveju, kai apskaičiuota vertė faktiškai lygi nuliui.
0070	Ataskaitose nurodoma valiuta		Nurodomas įstaigos ataskaitose nurodomos valiutos pavadinimas (nurodoma vertė atitinka ISO 4217 valiutos nuorodą, pvz., EUR).
0080	Jautrumas rizikai (rezultatai EBI portfelio valiuta)	Šio reglamento V priedo 3 ir 4 skirsniai ir Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325d straipsnio 2 dalis ir 325g, 325r, 325s, 325t ir 325ax straipsniai	Vertės nurodomos laikantis 0060 skilties nurodymų, tačiau perskaičiuojamos taikant ECB momentinį valiutos kursą, siejamą su portfelio valiuta, kaip apibrėžta šio reglamento V priedo 3 ir 4 skirsniuose.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0090	Rizikos koeficientas	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 trečios dalies IV antraštinės dalies 1a skyriaus 6 skirsnis	Nurodomas rizikos koeficientas, atitinkantis 0020–0040 skiltyje nurodytą rizikos veiksnį. Jei 0020 skiltyje pasirinktas rizikos veiksnio identifikatorius atitinka kreivumo rizikos sudedamąją dalį, nurodomas rizikos koeficientas, naudotas taikytinam santykiniam pokyčiui nustatyti. Nurodytas skaičius išreikštas dešimtainiu skaičiumi mažiausiai dešimttūkstantųjų tikslumu.
0110	Antras papildomas identifikatorius	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325p straipsnio 2 dalis	Jei 0010 skiltyje pasirinktas rizikos veiksnio identifikatorius atitinka jautrumu grindžiamo metodo rizikos klasę „Biržos prekių kainos rizika“ ir jautrumu grindžiamo metodo delta rizikos sudedamąją dalį, nurodomos teisinės sąlygos, susijusios su pristatymo vieta, arba kitas atitinkamas unikalus identifikatorius. Kai netinka nė vienas iš pirmiau nurodytų atvejų, įstaigos nurodo, kad aiški vertė netaikytina (NEAKTUALU).
0120	Kredito kokybės kategorija	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325m straipsnio 1 dalis ir 325ah straipsnio 1 dalis	Jei 0010 skiltyje pasirinktas rizikos veiksnio identifikatorius atitinka jautrumu grindžiamo metodo rizikos klasę „Pozicijų, kurios nėra pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos, kredito maržos rizika“ ir jautrumu grindžiamo metodo delta rizikos sudedamąją dalį, nurodoma viena iš šių parinkčių: a) „1 CQS“; b) „2 CQS“; c) „3 CQS“; d) „4 CQS“; e) „5 CQS“; f) „6 CQS“; g) „CQS nepriskirtas (nereitinguota)“. Kai netinka nė vienas iš pirmiau nurodytų atvejų, įstaigos nurodo, kad aiški vertė netaikytina (NEAKTUALU).

C 120.02. SBM. OFR SUDĖTIS PAGAL PORTFELIUS

Su lentelėmis susiję nurodymai (z ašis)

Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
Portfelis	V priedo 3, 4 ir 5 skirsniai	Nurodomas portfelio numeris iš V priedo.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0010	Rizikos klasė	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325d straipsnio 1 dalis	Nurodoma rizikos klasė. Pateikiama viena iš šių parinkčių: a) „bendroji palūkanų normos rizika (GIRR)“; b) „pozicijų, kurios nėra pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos, kredito maržos rizika“; c) „į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį neįtraukto pakeitimo vertybiniais popieriais kredito maržos rizika“; d) „į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį įtraukto pakeitimo vertybiniais popieriais kredito maržos rizika“; e) „nuosavybės vertybinių popierių rizika“; f) „biržos prekių kainos rizika“; g) „užsienio valiutos kurso rizika“.
0020	Sudedamoji dalis	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325e straipsnio 1 dalis	Nurodoma jautrumu grindžiamo metodo sudedamoji dalis. Pateikiama viena iš šių parinkčių: a) „delta rizika“; b) „vega rizika“; c) „kreivumo rizika“.
0030	Koreliacijų scenarijus	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325h straipsnis	Nurodomas koreliacijų scenarijus. Pateikiama viena iš šių parinkčių: a) „vidutinių koreliacijų scenarijus“; b) „didelių koreliacijų scenarijus“; c) „mažų koreliacijų scenarijus“.
0040	Nuosavų lėšų reikalavimai (rezultatai ataskaitose nurodoma valiuta)	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325h straipsnis	Kiekvieno portfelio nuosavų lėšų reikalavimų vertės nurodomos RM (ir galutinio ASA) galutinę ataskaitinę datą (kaip nurodyta šio reglamento V priedo 1 skirsnio b punkte) pagal visus atitinkamus rizikos klasių, sudedamųjų dalių ir koreliacijų scenarijaus derinius. Vertės nurodomos įstaigos ataskaitose nurodoma valiuta ir išreiškiamos mažiausiai šimtųjų tikslumu.
0050	Ataskaitose nurodoma valiuta		Nurodomas įstaigos ataskaitose nurodomos valiutos pavadinimas (nurodoma vertė atitinka ISO 4217 valiutos nuorodą).
0060	Nuosavų lėšų reikalavimai (rezultatai EBI portfelio valiuta)	Šio reglamento V priedo 3 ir 4 skirsniai ir Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325h straipsnis	Vertės nurodomos laikantis 0040 skilties nurodymų, tačiau perskaičiuojamos taikant ECB momentinį valiutos kursą, siejamą su portfelio valiuta, kaip apibrėžta šio reglamento V priedo 3 ir 4 skirsniuose.
0070	Pozicijos be pasirinkimo sandorių, kurioms taikomi nuosavų lėšų reikalavimai kreivumo rizikai padengti	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325e straipsnio 3 dalis	Jei 0020 skiltyje nurodyta sudedamoji dalis atitinka kreivumo riziką: a) jei apskaičiuodama 0040 ir 0060 skiltyse nurodytą rezultatą įstaiga taiko Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325e straipsnio 3 dalies pirmoje pastraipoje nustatytą metodą, nurodoma „TAIP“; b) kitais atvejais reikia žymėti „NE“. Kai netinka nė vienas iš tų atvejų, taip pat nurodoma „NE“.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0080	Bazinės rizikos metodas, taikomas užsienio valiutos kurso rizikos delta ir kreivumo sudedamosioms dalims	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325q straipsnio 7 dalis	Jei 0010 skiltyje nurodyta rizikos klasė atitinka užsienio valiutos kurso riziką, o 0020 skiltyje nurodyta sudedamoji dalis atitinka delta riziką arba kreivumo riziką: a) jei apskaičiuodama 0040 ir 0060 skiltyse nurodytą rezultatą įstaiga taiko Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325q straipsnio 7 dalyje nustatytą metodą, nurodoma „TAIP“; b) kitais atvejais reikia žymėti „NE“. Kai netinka nė vienas iš tų atvejų, taip pat nurodoma „NE“.
0090	Užsienio valiutos kurso rizikos kreivumo rizikos sudedamosios dalies padalijimas pagal skaliarus	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325q straipsnio 6 dalis	Jei 0010 skiltyje nurodyta rizikos klasė atitinka užsienio valiutos kurso riziką, o 0020 skiltyje nurodyta sudedamoji dalis atitinka kreivumo riziką: a) jei apskaičiuodama 0040 ir 0060 skiltyse nurodytą rezultatą įstaiga taiko Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325q straipsnio 6 dalyje nustatytą metodą, nurodoma „TAIP“; b) kitais atvejais reikia žymėti „NE“. Kai netinka nė vienas iš tų atvejų, taip pat nurodoma „NE“.
0095	SBM patvirtinimo portfelių rezultatų pateikimas	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325e straipsnio 1 dalis	Tais atvejais, kai portfelis, kurio informacija teikiama, yra SBM patvirtinimo portfelis, kaip nurodyta V priedo 7 skirsnyje: a) nurodoma „pateikta“, jei įstaiga pateikia šį portfelį atitinkančius rezultatus; b) nurodoma „nepateikta, nes pozicijos rizikos veiksnio atžvilgiu nėra“, jei įstaiga nusprendžia neteikti atitinkamo SBM patvirtinimo portfelio rezultatų, kadangi tos įstaigos vadovybė įstaigos viduje nėra pritarusi veiklai, susijusiai su priemonėmis, dėl kurių atsirastų pozicija atitinkamo rizikos veiksnio atžvilgiu. Nurodoma „neaktualu“, jei portfelis, kurio informacija teikiama, yra portfelis, nurodytas V priedo 3, 4 ar 5 skirsnyje.
0100	Laukelis tekstui laisva forma		Šioje skiltyje įstaiga gali pateikti visą papildomą informaciją.

C 120.04. DRC. RINKOS VERTĖS IR BENDROSIOS JTD SUMOS PAGAL PRIEMONES / PORTFELIUS

Įstaigos nurodo kiekvienos priemonės atitinkamas pozicijas. Kiekvienai priemonei pildoma atskira eilutė. Visos vertės nurodomos RM (ir galutinio ASA) galutinę ataskaitinę datą (kaip nurodyta šio reglamento V priedo 1 skirsnio b punkto v papunktyje). Pozicijos nurodomos prieš atliekant bet kokią užskaitą, bet atlikus atkartojimo arba išskaidymo veiksmus (kaip apibrėžta Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325z ir 325ac straipsniuose), kai taikytina.

Su lentelėmis susiję nurodymai (z ašis)

Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
Portfelis	V priedo 3, 4 ir 5 skirsniai	Nurodomas portfelio numeris iš V priedo.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0010	Priemonės numeris	V priedo 2 skirsnis	Nurodomas priemonės numeris iš V priedo.
0020	Rizikos klasė	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325v straipsnio 2 dalis	Nurodoma rizikos klasė, kuriai skirti reikalavimai įsipareigojimų neįvykdymo rizikai padengti (DRC) nurodomi 0030 ir 0040 skiltyse. Nurodoma viena iš šių priemonių rūšių: a) „priemonės, kurios nėra pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos“; b) „į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį neįtrauktos pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos“; c) „į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį įtrauktos pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos“.
0030	1 grupė	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325y straipsnio 3 dalis, 325aa straipsnio 4 dalis ir 325ad straipsnio 2 dalis	Nurodoma grupė. Jeigu 0020 skiltyje nurodyta rizikos klasė atitinka pozicijas, kurios nėra pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos, nurodoma viena iš šių parinkčių: a) „įmonės“; b) „vyriausybės“; c) „vietos valdžia / savivaldybės“. Jeigu vietoj to 0020 skiltyje nurodyta rizikos klasė atitinka pozicijas, kurios yra į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį neįtrauktos pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos, nurodoma a parinktis arba viena iš šių parinkčių: d) „ABCP. Azija“; e) „ABCP. Europa“; f) „ABCP. Šiaurės Amerika“; g) „ABCP. Kitos pasaulio šalys“; h) „paskolos automobiliams / automobilių išperkamoji nuoma. Azija“; i) „paskolos automobiliams / automobilių išperkamoji nuoma. Europa“; j) „paskolos automobiliams / automobilių išperkamoji nuoma. Šiaurės Amerika“; k) „paskolos automobiliams / automobilių išperkamoji nuoma. Kitos pasaulio šalys“; l) „įkeistu turtu užtikrintas skolos įsipareigojimas kvadratu (CDO kvadratu). Azija“; m) „įkeistu turtu užtikrintas skolos įsipareigojimas kvadratu (CDO kvadratu). Europa“; n) „įkeistu turtu užtikrintas skolos įsipareigojimas kvadratu (CDO kvadratu). Šiaurės Amerika“; o) „įkeistu turtu užtikrintas skolos įsipareigojimas kvadratu (CDO kvadratu). Kitos pasaulio šalys“; p) „užstatu užtikrinti paskolos įsipareigojimai. Azija“; q) „užstatu užtikrinti paskolos įsipareigojimai. Europa“; r) „užstatu užtikrinti paskolos įsipareigojimai. Šiaurės Amerika“; s) „užstatu užtikrinti paskolos įsipareigojimai. Kitos pasaulio šalys“; t) „komerciniai hipoteka užtikrinti vertybiniai popieriai (CMBS). Azija“; u) „komerciniai hipoteka užtikrinti vertybiniai popieriai (CMBS). Europa“; v) „komerciniai hipoteka užtikrinti vertybiniai popieriai (CMBS). Šiaurės Amerika“; w) „komerciniai hipoteka užtikrinti vertybiniai popieriai (CMBS). Kitos pasaulio šalys“; x) „kredito kortelės. Azija“; y) „kredito kortelės. Europa“; z) „kredito kortelės. Šiaurės Amerika“; aa) „kredito kortelės. Kitos pasaulio šalys“; bb) „kitos mažmeninės pozicijos. Azija“; cc) „kitos mažmeninės pozicijos. Europa“; dd) „kitos mažmeninės pozicijos. Šiaurės Amerika“;

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
			ee) „kitos mažmeninės pozicijos. Kitos pasaulio šalys“; ff) „kitos didmeninės pozicijos. Azija“; gg) „kitos didmeninės pozicijos. Europa“; hh) „kitos didmeninės pozicijos. Šiaurės Amerika“; ii) „kitos didmeninės pozicijos. Kitos pasaulio šalys“; jj) „būsto hipoteka užtikrinti vertybiniai popieriai (RMBS). Azija“; kk) „būsto hipoteka užtikrinti vertybiniai popieriai (RMBS). Europa“; ll) „būsto hipoteka užtikrinti vertybiniai popieriai (RMBS). Šiaurės Amerika“; mm) „būsto hipoteka užtikrinti vertybiniai popieriai (RMBS). Kitos pasaulio šalys“; nn) „mažosios ir vidutinės įmonės (MVĮ). Azija“; oo) „mažosios ir vidutinės įmonės (MVĮ). Europa“; pp) „mažosios ir vidutinės įmonės (MVĮ). Šiaurės Amerika“; qq) „mažosios ir vidutinės įmonės (MVĮ). Kitos pasaulio šalys“; rr) „studentų paskolos. Azija“; ss) „studentų paskolos. Europa“; tt) „studentų paskolos. Šiaurės Amerika“; uu) „studentų paskolos. Kitos pasaulio šalys“. Jeigu vietoj to 0020 skiltyje nurodyta rizikos klasė atitinka pozicijas, kurios yra į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį įtrauktos pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos, nurodomos į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį įtrauktos pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos.
0040	2 grupė	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325ad straipsnio 2 dalis	Jeigu 0020 skiltyje nurodyta rizikos klasė atitinka pozicijas, kurios yra į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį įtrauktos pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos, nurodomas indekso pavadinimas, kitu atveju nurodoma (NEAKTUALU).
0050	Įsipareigojantysis asmuo	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325v straipsnio 2 dalis, 325x straipsnio 1 dalis ir 325z ir 325ac straipsniai	Įstaigos nurodo su įsipareigojančiuoju asmeniu susijusią informaciją. Jei 0020 skiltyje nurodyta rizikos klasė atitinka: — „priemones, kurios nėra pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos“, nurodomas įsipareigojančiojo asmens pavadinimas; — „į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį neįtrauktas pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijas“, nurodomas įsipareigojančiojo asmens pavadinimas arba unikalus identifikatorius, žymintis pagrindinio turto grupę ir segmentą; — „į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį įtrauktas pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijas“, nurodomas unikalus identifikatorius, žymintis indekso šeimą, seriją ir segmentą.
0060	Kredito kokybės kategorija	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325y straipsnio 1 ir 2 dalys, 325aa straipsnio 1 dalis ir 325ad straipsnio 1 dalis	Įstaigos nurodo kredito kokybę. Pateikiama viena iš šių parinkčių: a) „1 CQS“; b) „2 CQS“; c) „3 CQS“; d) „4 CQS“; e) „5 CQS“; f) „6 CQS“; g) „CQS nepriskirtas (nereitinguota)“;

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
			h) „CQS nepriskirtas (neįvykdyta)“; i) „CQS nepriskirtas (0 % rizikos koeficientas)“. Jeigu 0020 skiltyje nurodyta rizikos klasė atitinka pozicijas, kurios yra į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį įtrauktos arba neįtrauktos pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos, nurodoma viena iš pirmiau nurodytų arba toliau nurodomų parinkčių: j) „7 CQS“; k) „8 CQS“; l) „9 CQS“; m) „10 CQS“; n) „11 CQS“; o) „12 CQS“; p) „13 CQS“; q) „14 CQS“; r) „15 CQS“; s) „16 CQS“; t) „17 CQS“; u) „Visi kiti CQS“.
0070	Įsipareigojimų neįvykdymo rizikos koeficientas	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325v straipsnio 1 dalis f punktas, 325y straipsnio 1 ir 2 dalys, 325aa straipsnio 1 dalis ir 325ad straipsnio 1 dalis	Įstaigos nurodo atitinkamą rizikos koeficientą. Pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijoms taikomi rizikos koeficientai nurodomi juos padauginus iš 8 % pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325aa straipsnio 1 dalį.
0080	Prioritetas	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325w straipsnio 3 ir 6 dalys	Nurodomas pozicijos prioritetas. Jeigu 0020 skiltyje nurodyta rizikos klasė atitinka priemones, kurios nėra pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos, arba į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį neįtrauktas pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijas, nurodoma viena iš šių parinkčių: a) „nuosavybės finansinės priemonės“; b) „didesnio prioriteto neturinčios skolos finansinės priemonės“; c) „didesnio prioriteto skolos finansinės priemonės“; d) „padengtosios obligacijos“. Kai netinka nė vienas iš tų atvejų, laukelis paliekamas tuščias.
0090	Terminas	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325x, 325z ir 325ac straipsniai	Nurodoma pozicijos termino data. Nurodant datą laikomasi mmmm/mm/dd formato.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0100	Susigrąžinimo norma	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325v straipsnio 1 dalies e punktas	Įstaigos nurodo susigrąžinimo normą. Susigrąžinimo norma apskaičiuojama naudojant taikytiną nuostolį dėl įsipareigojimų neįvykdymo (LGD) = 1 – LGD. Nurodytas susigrąžinimo normos skaičius išreikštas dešimtainiu skaičiumi nuo 0 iki 1 ir mažiausiai dešimttūkstantųjų tikslumu.
0110	Kryptis	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325v straipsnio 1 dalies a ir b punktai	Įstaigos nurodo pozicijos kryptį pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325v straipsnio 1 dalies a ir b punktuose pateiktas apibrėžtis. Pateikiama viena iš šių parinkčių: a) „trumpoji pozicija“; b) „ilgoji pozicija“.
0120	Nuostolių priskyrimo riba (%)	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325aa ir 325ad straipsniai	Kai nurodoma pozicija yra susijusi su segmentu, įstaigos nurodo segmento priskyrimo ribą. Nurodytas skaičius išreikštas dešimtainiu skaičiumi mažiausiai dešimttūkstantųjų tikslumu.
0130	Nuostolių atskyrimo riba (%)	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325aa ir 325ad straipsniai	Kai nurodoma pozicija yra susijusi su segmentu, įstaigos nurodo segmento atskyrimo ribą. Nurodytas skaičius išreikštas dešimtainiu skaičiumi mažiausiai dešimttūkstantųjų tikslumu.
0140–0170	Rezultatai ataskaitose nurodoma valiuta		Vertės nurodomos nurodant įstaigos ataskaitose nurodomą valiutą ir išreiškiamos mažiausiai šimtųjų tikslumu, jei taikoma.
0140	Tariamoji vertė	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325w straipsnio, 1, 2 ir 5 dalys	Jeigu 0020 skiltyje nurodyta rizikos klasė atitinka priemones, kurios nėra pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos, įstaigos nurodo priemonės tariamąją sumą. Vertė atitinka Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325w straipsnio 1 ir 2 dalyse nurodytą terminą $V_{notional}$ arba to reglamento 325w straipsnio 5 dalyje nurodytą terminą V, priklausomai nuo pozicijos rūšies. Kai netinka nė vienas iš tų atvejų arba įstaiga atskirai neapskaičiuoja ar nenaudoja šioje skiltyje nurodytinos sumos bendrajai staigaus įsipareigojimų neįvykdymo rizikos (JTD) sumai įvertinti, laukelis paliekamas tuščias.
0150	Pelnas ir nuostolis + koregavimas	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325w straipsnio, 1, 2 ir 5 dalys	Įstaigos nurodo kiekvienos pozicijos pelno bei nuostolio ir koregavimo sumą: — jeigu 0020 skiltyje nurodyta rizikos klasė atitinka priemones, kurios nėra pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos, o nurodyta pozicija yra ilgoji pozicija, įstaigos nurodo $P\&L_{long}$ ir $Adjustment_{long}$ sumą pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325w straipsnio 1 dalį; — jeigu 0020 skiltyje nurodyta rizikos klasė atitinka priemones, kurios nėra pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos, o nurodyta pozicija yra trumpoji pozicija, įstaigos nurodo $P\&L_{short}$ ir $Adjustment_{short}$ sumą pagal to reglamento 325w straipsnio 2 dalį.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
			Kai netinka nė vienas iš tų atvejų arba įstaiga atskirai neapskaičiuoja ar nenaudoja šioje skiltyje nurodytinos sumos bendrai JTD sumai įvertinti, laukelis paliekamas tuščias.
0160	Bendroji JTD suma	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325v straipsnio 1 dalies c punktas, 325w straipsnio 1, 2 ir 5 dalys, 325z straipsnio 1 dalis ir 325ac straipsnio 2 dalis	Įstaigos nurodo kiekvienos konkrečios pozicijos bendrąją JTD sumą.
0170	Valiuta		Nurodomas įstaigos ataskaitose nurodomos valiutos pavadinimas (nurodoma vertė atitinka ISO 4217 valiutos nuorodą).
0180–0200	Rezultatai EBI portfelio valiuta	Šio reglamento V priedo 3 ir 4 skirsniai ir Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325y, 325aa ir 325ad straipsniai	Vertės nurodomos laikantis 0030 skilties nurodymų, tačiau perskaičiuojamos taikant ECB momentinį valiutos kursą, siejamą su portfelio valiuta, kaip apibrėžta šio reglamento V priedo 3 ir 4 skirsniuose.
0180	Tariamoji vertė	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325w straipsnio, 1, 2 ir 5 dalys	Jeigu 0020 skiltyje nurodyta rizikos klasė atitinka priemones, kurios nėra pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos, įstaigos nurodo priemonės tariamąją sumą. Vertė atitinka Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325w straipsnio 1 ir 2 dalyse nurodytą terminą $V_{notional}$ arba to reglamento 325w straipsnio 5 dalyje nurodytą terminą V, priklausomai nuo pozicijos rūšies. Kai netinka nė vienas iš tų atvejų arba įstaiga atskirai neapskaičiuoja ar nenaudoja šioje skiltyje nurodytinos sumos bendrai JTD sumai įvertinti, laukelis paliekamas tuščias.
0190	Pelnas ir nuostolis + koregavimas	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325w straipsnio, 1, 2 ir 5 dalys	Įstaigos nurodo kiekvienos pozicijos pelno bei nuostolio ir koregavimo sumą: — jeigu 0020 skiltyje nurodyta rizikos klasė atitinka priemones, kurios nėra pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos, o nurodyta pozicija yra ilgoji pozicija, įstaigos nurodo $P\&L_{long}$ ir $Adjustment_{long}$ sumą pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325w straipsnio 1 dalį; — jeigu 0020 skiltyje nurodyta rizikos klasė atitinka priemones, kurios nėra pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos, o nurodyta pozicija yra trumpoji pozicija, įstaigos nurodo $P\&L_{short}$ ir $Adjustment_{short}$ sumą pagal to reglamento 325w straipsnio 2 dalį.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
			Kai netinka nė vienas iš tų atvejų arba įstaiga atskirai neapskaičiuoja ar nenaudoja šioje skiltyje nurodytinos sumos bendrai JTD sumai įvertinti, laukelis paliekamas tuščias.
0200	Bendroji JTD suma	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325v straipsnio 1 dalies c punktas, 325w straipsnio 1, 2 ir 5 dalys, 325z straipsnio 1 dalis ir 325ac straipsnio 2 dalis	Įstaigos nurodo kiekvienos konkrečios pozicijos bendrąją staigaus įsipareigojimų neįvykdymo rizikos (JTD) sumą.

C 120.05. DRC. OFR SUDĖTIS PAGAL PORTFELIUS

Su lentelėmis susiję nurodymai (z ašis)

Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
Portfelis	V priedo 3, 4 ir 5 skirsniai	Nurodomas portfelio numeris iš V priedo.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0010	Rizikos klasė	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325v straipsnio 2 dalis	Nurodoma rizikos klasė, kuriai skirtas reikalavimas įsipareigojimų neįvykdymo rizikai padengti nurodomas 0030 ir 0040 skiltyse. Nurodoma viena iš šių priemonių rūšių: a) „priemonės, kurios nėra pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos“; b) „į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį neįtrauktos pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos“; c) „į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį įtrauktos pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos“.
0020	1 grupė	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325y straipsnio 3 dalis, 325aa straipsnio 4 dalis ir 325ad straipsnio 2 dalis	Nurodoma grupė. Jeigu 0010 skiltyje nurodyta rizikos klasė atitinka priemones, kurios nėra pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos, nurodoma viena iš šių parinkčių: a) „įmonės“; b) „vyriausybės“; c) „vietos valdžia / savivaldybės“.

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
			Jeigu vietoj to 0010 skiltyje nurodyta rizikos klasė atitinka „į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį neįtrauktas pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijas“, nurodoma viena iš šių parinkčių: d) „ABCP. Azija“; e) „ABCP. Europa“; f) „ABCP. Šiaurės Amerika“; g) „ABCP. Kitos pasaulio šalys“; h) „paskolos automobiliams / automobilių išperkamoji nuoma. Azija“; i) „paskolos automobiliams / automobilių išperkamoji nuoma. Europa“; j) „paskolos automobiliams / automobilių išperkamoji nuoma. Šiaurės Amerika“; k) „paskolos automobiliams / automobilių išperkamoji nuoma. Kitos pasaulio šalys“; l) „įkeistu turtu užtikrintas skolos įsipareigojimas kvadratu (CDO kvadratu). Azija“; m) „įkeistu turtu užtikrintas skolos įsipareigojimas kvadratu (CDO kvadratu). Europa“; n) „įkeistu turtu užtikrintas skolos įsipareigojimas kvadratu (CDO kvadratu). Šiaurės Amerika“; o) „įkeistu turtu užtikrintas skolos įsipareigojimas kvadratu (CDO kvadratu). Kitos pasaulio šalys“; p) „užstatu užtikrinti paskolos įsipareigojimai. Azija“; q) „užstatu užtikrinti paskolos įsipareigojimai. Europa“; r) „užstatu užtikrinti paskolos įsipareigojimai. Šiaurės Amerika“; s) „užstatu užtikrinti paskolos įsipareigojimai. Kitos pasaulio šalys“; t) „komerciniai hipoteka užtikrinti vertybiniai popieriai (CMBS). Azija“; u) „komerciniai hipoteka užtikrinti vertybiniai popieriai (CMBS). Europa“; v) „komerciniai hipoteka užtikrinti vertybiniai popieriai (CMBS). Šiaurės Amerika“; w) „komerciniai hipoteka užtikrinti vertybiniai popieriai (CMBS). Kitos pasaulio šalys“; x) „kredito kortelės. Azija“; y) „kredito kortelės. Europa“; z) „kredito kortelės. Šiaurės Amerika“; aa) „kredito kortelės. Kitos pasaulio šalys“; bb) „kitos mažmeninės pozicijos. Azija“; cc) „kitos mažmeninės pozicijos. Europa“; dd) „kitos mažmeninės pozicijos. Šiaurės Amerika“; ee) „kitos mažmeninės pozicijos. Kitos pasaulio šalys“; ff) „kitos didmeninės pozicijos. Azija“; gg) „kitos didmeninės pozicijos. Europa“; hh) „kitos didmeninės pozicijos. Šiaurės Amerika“; ii) „kitos didmeninės pozicijos. Kitos pasaulio šalys“; jj) „būsto hipoteka užtikrinti vertybiniai popieriai (RMBS). Azija“; kk) „būsto hipoteka užtikrinti vertybiniai popieriai (RMBS). Europa“; ll) „būsto hipoteka užtikrinti vertybiniai popieriai (RMBS). Šiaurės Amerika“; mm) „būsto hipoteka užtikrinti vertybiniai popieriai (RMBS). Kitos pasaulio šalys“; nn) „mažosios ir vidutinės įmonės (MVĮ). Azija“; oo) „mažosios ir vidutinės įmonės (MVĮ). Europa“; pp) „mažosios ir vidutinės įmonės (MVĮ). Šiaurės Amerika“; qq) „mažosios ir vidutinės įmonės (MVĮ). Kitos pasaulio šalys“; rr) „studentų paskolos. Azija“;

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
			ss) „studentų paskolos. Europa“; tt) „studentų paskolos. Šiaurės Amerika“; uu) „studentų paskolos. Kitos pasaulio šalys“. Jeigu vietoj to 0010 skiltyje nurodyta rizikos klasė atitinka pozicijas, kurios yra į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį įtrauktos pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos, nurodomos į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį įtrauktos pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos.
0030	2 grupė	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325ad straipsnio 2 dalis	Jeigu 0010 skiltyje nurodyta rizikos klasė atitinka pozicijas, kurios yra į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį įtrauktos pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos, nurodomas indekso pavadinimas, kitu atveju paliekama (NEAKTUALU).
0040	Nuosavų lėšų reikalavimai (rezultatai ataskaitose nurodoma valiuta)	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325y, 325aa ir 325ad straipsniai	Nuosavų lėšų reikalavimai įsipareigojimų neįvykdymo rizikai padengti nurodomi RM (ir galutinio ASA) galutinę ataskaitinę datą (kaip nurodyta šio reglamento V priedo 1 skirsnio b punkte). Vertės nurodomos įstaigos ataskaitose nurodoma valiuta ir išreiškiamos mažiausiai šimtųjų tikslumu.
0050	Ataskaitose nurodoma valiuta		Nurodomas įstaigos ataskaitose nurodomos valiutos pavadinimas (nurodoma vertė atitinka ISO 4217 valiutos nuorodą).
0060	Nuosavų lėšų reikalavimai (rezultatai EBI portfelio valiuta)	Šio reglamento V priedo 3 ir 4 skirsniai ir Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325y, 325aa ir 325ad straipsniai	Vertės nurodomos laikantis 0030 skilties nurodymų, tačiau perskaičiuojamos taikant ECB momentinį valiutos kursą, siejamą su portfelio valiuta, kaip apibrėžta šio reglamento V priedo 3 ir 4 skirsniuose.

C 120.06. ASA. OFR

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0010	Portfelio numeris	V priedo 3, 4 ir 5 skirsniai	Nurodomas portfelio numeris iš V priedo.
0020–0040	Rezultatai ataskaitose nurodoma valiuta	V priedo 3 ir 4 skirsniai	

Skiltis	Pavadinimas	Teisinė nuoroda	Nurodymai
0020	SBM OFR	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325h straipsnis	Kiekvieno portfelio nuosavų lėšų reikalavimai pagal jautrumu grindžiamą metodą remiantis alternatyviu standartizuotu metodu nurodomi RM (ir galutinio ASA) galutinę ataskaitinę datą (kaip nurodyta šio reglamento V priedo 1 skirsnio b punkte).
0030	DRC OFR	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325v straipsnis	Kiekvieno portfelio nuosavų lėšų reikalavimai dėl reikalavimo įsipareigojimų neįvykdymo rizikai padengti remiantis alternatyviu standartizuotu metodu nurodomi RM (ir galutinio ASA) galutinę ataskaitinę datą (kaip nurodyta šio reglamento V priedo 1 skirsnio b punkte).
0040	RRAO OFR	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325u straipsnis	Kiekvieno portfelio nuosavų lėšų reikalavimai dėl likutinės rizikos papildomo mokesčio remiantis alternatyviu standartizuotu metodu nurodomi RM (ir galutinio ASA) galutinę ataskaitinę datą (kaip nurodyta šio reglamento V priedo 1 skirsnio b punkte).
0050–0070	Rezultatai EBI portfelio valiuta	V priedo 3 ir 4 skirsniai	Kai įstaigos ataskaitose nurodomos valiutos skiriasi nuo V priedo 3 ir 4 skirsniuose nurodytų EBI portfelių valiutų, įstaigos ataskaitose nurodytas valiutas perskaičiuoja pagal taikomą ECB momentinį valiutos kursą.
0050	SBM OFR	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325h straipsnis	Kiekvieno portfelio nuosavų lėšų reikalavimai pagal jautrumu grindžiamą metodą remiantis alternatyviu standartizuotu metodu nurodomi RM (ir galutinio ASA) galutinę ataskaitinę datą (kaip nurodyta šio reglamento V priedo 1 skirsnio b punkte).
0060	DRC OFR	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325v straipsnis	Kiekvieno portfelio nuosavų lėšų reikalavimai dėl reikalavimo įsipareigojimų neįvykdymo rizikai padengti remiantis alternatyviu standartizuotu metodu nurodomi RM (ir galutinio ASA) galutinę ataskaitinę datą (kaip nurodyta šio reglamento V priedo 1 skirsnio b punkte).
0070	RRAO OFR	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325u straipsnis	Kiekvieno portfelio nuosavų lėšų reikalavimai dėl likutinės rizikos papildomo mokesčio remiantis alternatyviu standartizuotu metodu nurodomi RM (ir galutinio ASA) galutinę ataskaitinę datą (kaip nurodyta šio reglamento V priedo 1 skirsnio b punkte).

Lentelė. Duomenų teikimo 106.01 (0010 skiltis) ir 120.01 (0020 skiltis) formose gairės

— Skiltis „rizikos klasė“ susijusi su Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325d straipsnio 1 dalimi. Rizikos klasėms žymėti naudojamos šios santrumpos:

a) GIRR (bendroji palūkanų normos rizika);

b) CSR_NON_SEC (pozicijų, kurios nėra pakeitimo vertybiniais popieriais pozicijos, kredito maržos rizika);

c) CSR_SEC_NON_ACTP (į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį neįtraukto pakeitimo vertybiniais popieriais kredito maržos rizika);

d) CSR_SEC_ACTP (į alternatyvų koreliacinės prekybos portfelį įtraukto pakeitimo vertybiniais popieriais kredito maržos rizika);

e) EQ (nuosavybės vertybinių popierių rizika);

f) CM (biržos prekių kainos rizika);

g) FX (užsienio valiutos kurso rizika).

— Skiltis „sudedamosios dalys“ susijusi su Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325e straipsnio 1 dalimi. Jautrumu grindžiamo metodo sudedamosioms dalims žymėti naudojamos šios santrumpos:

a) DELTA (delta rizika);

b) VEGA (vega rizika);

c) KREIVUMAS (kreivumo rizika).

— Skiltyje „terminas“ nurodomas rizikos veiksnio terminas, kai rizikos veiksniai apibrėžiami pagal nurodytas trajektorijų viršūnes pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l, 325m, 325n, 325o, 325p ir 325q straipsnius. Vega bendrosios palūkanų normos rizikos veiksnių, nurodytų to reglamento 325l straipsnio 7 dalyje, atveju nurodomi du terminai atskiriami brūkšneliu (pvz., „0,5 metų – 0,5 metų“), pirmasis – pasirinkimo sandorio terminas, o antrasis – likutinis pasirinkimo sandorio pagrindinės finansinės priemonės terminas pasirinkimo sandorio galiojimo pabaigos dieną.

— Skiltyje „papildomos specifikacijos“ toliau nurodomas atitinkamas rizikos veiksnys, susijęs su infliacijos rizikos ir skirtingų valiutų bazės rizikos veiksnių atskyrimu pagal Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnį, rizikos veiksnių, susijusių su skolos finansinėmis priemonėmis, ir rizikos veiksnių, susijusių su kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriais, atskyrimu pagal to reglamento 325m ir 325n straipsnius, nuosavybės vertybinių popierių neatidėliotino sandorio kainos ir nuosavybės vertybinių popierių atpirkimo sandorių palūkanų normos rizikos veiksnių atskyrimu pagal to reglamento 325o straipsnį ir to rizikos veiksnio didėjimo grynoji kreivumo rizikos pozicijos (CVRk+) arba to rizikos veiksnio mažėjančios grynosios kreivumo rizikos pozicijos (CVRk-) atskyrimu, kaip nurodyta to reglamento 325g straipsnyje.

Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Terminas	Papildoma specifikacija	Rizikos veiksnio identifikatorius	Teisinė nuoroda
CM	DELTA	0 metų		CM_D_00.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325p straipsnis
CM	DELTA	0,25 metų		CM_D_00.25	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325p straipsnis
CM	DELTA	0,5 metų		CM_D_00.50	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325p straipsnis
CM	DELTA	1 metai		CM_D_01.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325p straipsnis
CM	DELTA	2 metai		CM_D_02.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325p straipsnis
CM	DELTA	3 metai		CM_D_03.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325p straipsnis
CM	DELTA	5 metai		CM_D_05.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325p straipsnis
CM	DELTA	10 metų		CM_D_10.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325p straipsnis
CM	DELTA	15 metų		CM_D_15.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325p straipsnis
CM	DELTA	20 metų		CM_D_20.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325p straipsnis
CM	DELTA	30 metų		CM_D_30.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325p straipsnis
CM	VEGA	0,5 metų		CM_V_00.50	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325p straipsnis
CM	VEGA	1 metai		CM_V_01.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325p straipsnis
CM	VEGA	3 metai		CM_V_03.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325p straipsnis
CM	VEGA	5 metai		CM_V_05.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325p straipsnis
CM	VEGA	10 metų		CM_V_10.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325p straipsnis
CM	KREIVUMAS		Poslinkis į viršų	CM_CU	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325p, 325g straipsniai

Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Terminas	Papildoma specifikacija	Rizikos veiksnio identifikatorius	Teisinė nuoroda
CM	KREIVUMAS		Poslinkis į apačią	CM_CD	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325p, 325g straipsniai
CSR_NON_SEC	DELTA	0,5 metų	Skolos priemonė	CSR_NON_SEC_D_00.50_DEBT	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325m straipsnis
CSR_NON_SEC	DELTA	1 metai	Skolos priemonė	CSR_NON_SEC_D_01.00_DEBT	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325m straipsnis
CSR_NON_SEC	DELTA	3 metai	Skolos priemonė	CSR_NON_SEC_D_03.00_DEBT	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325m straipsnis
CSR_NON_SEC	DELTA	5 metai	Skolos priemonė	CSR_NON_SEC_D_05.00_DEBT	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325m straipsnis
CSR_NON_SEC	DELTA	10 metų	Skolos priemonė	CSR_NON_SEC_D_10.00_DEBT	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325m straipsnis
CSR_NON_SEC	DELTA	0,5 metų	Kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris	CSR_NON_SEC_D_00.50_CDS	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325m straipsnis
CSR_NON_SEC	DELTA	1 metai	Kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris	CSR_NON_SEC_D_01.00_CDS	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325m straipsnis
CSR_NON_SEC	DELTA	3 metai	Kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris	CSR_NON_SEC_D_03.00_CDS	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325m straipsnis
CSR_NON_SEC	DELTA	5 metai	Kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris	CSR_NON_SEC_D_05.00_CDS	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325m straipsnis
CSR_NON_SEC	DELTA	10 metų	Kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris	CSR_NON_SEC_D_10.00_CDS	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325m straipsnis
CSR_NON_SEC	VEGA	0,5 metų		CSR_NON_SEC_V_00.50	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325m straipsnis
CSR_NON_SEC	VEGA	1 metai		CSR_NON_SEC_V_01.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325m straipsnis
CSR_NON_SEC	VEGA	3 metai		CSR_NON_SEC_V_03.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325m straipsnis
CSR_NON_SEC	VEGA	5 metai		CSR_NON_SEC_V_05.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325m straipsnis
CSR_NON_SEC	VEGA	10 metų		CSR_NON_SEC_V_10.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325m straipsnis
CSR_NON_SEC	KREIVUMAS		Poslinkis į viršų	CSR_NON_SEC_CU	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325m, 325g straipsniai

Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Terminas	Papildoma specifikacija	Rizikos veiksnio identifikatorius	Teisinė nuoroda
CSR_NON_SEC	KREIVUMAS		Poslinkis į apačią	CSR_NON_SEC_CD	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325m, 325g straipsniai
CSR_SEC_ACTP	DELTA	0,5 metų	Skolos priemonė	CSR_SEC_ACTP_D_00.50_DEBT	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_ACTP	DELTA	1 metai	Skolos priemonė	CSR_SEC_ACTP_D_01.00_DEBT	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_ACTP	DELTA	3 metai	Skolos priemonė	CSR_SEC_ACTP_D_03.00_DEBT	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_ACTP	DELTA	5 metai	Skolos priemonė	CSR_SEC_ACTP_D_05.00_DEBT	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_ACTP	DELTA	10 metų	Skolos priemonė	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_DEBT	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_ACTP	DELTA	0,5 metų	Kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris	CSR_SEC_ACTP_D_00.50_CDS	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_ACTP	DELTA	1 metai	Kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris	CSR_SEC_ACTP_D_01.00_CDS	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_ACTP	DELTA	3 metai	Kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris	CSR_SEC_ACTP_D_03.00_CDS	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_ACTP	DELTA	5 metai	Kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris	CSR_SEC_ACTP_D_05.00_CDS	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_ACTP	DELTA	10 metų	Kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_CDS	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_ACTP	VEGA	0,5 metų		CSR_SEC_ACTP_V_00.50	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_ACTP	VEGA	1 metai		CSR_SEC_ACTP_V_01.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_ACTP	VEGA	3 metai		CSR_SEC_ACTP_V_03.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_ACTP	VEGA	5 metai		CSR_SEC_ACTP_V_05.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_ACTP	VEGA	10 metų		CSR_SEC_ACTP_V_10.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_ACTP	KREIVUMAS		Poslinkis į viršų	CSR_SEC_ACTP_CU	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n, 325g straipsniai

Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Terminas	Papildoma specifikacija	Rizikos veiksnio identifikatorius	Teisinė nuoroda
CSR_SEC_ACTP	KREIVUMAS		Poslinkis į apačią	CSR_SEC_ACTP_CD	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n, 325g straipsniai
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	0,5 metų	Skolos priemonė	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_00.50_DEBT	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	1 metai	Skolos priemonė	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_01.00_DEBT	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	3 metai	Skolos priemonė	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_03.00_DEBT	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	5 metai	Skolos priemonė	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_05.00_DEBT	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	10 metų	Skolos priemonė	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_10.00_DEBT	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	0,5 metų	Kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_00.50_CDS	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	1 metai	Kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_01.00_CDS	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	3 metai	Kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_03.00_CDS	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	5 metai	Kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_05.00_CDS	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	10 metų	Kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_10.00_CDS	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	0,5 metų		CSR_SEC_NON_ACTP_V_00.50	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	1 metai		CSR_SEC_NON_ACTP_V_01.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	3 metai		CSR_SEC_NON_ACTP_V_03.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	5 metai		CSR_SEC_NON_ACTP_V_05.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	10 metų		CSR_SEC_NON_ACTP_V_10.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n straipsnis
CSR_SEC_NO-N_ACTP	KREIVUMAS		Poslinkis į viršų	CSR_SEC_NON_ACTP_CU	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n, 325g straipsniai

Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Terminas	Papildoma specifikacija	Rizikos veiksnio identifikatorius	Teisinė nuoroda
CSR_SEC_NO-N_ACTP	KREIVUMAS		Poslinkis į apačią	CSR_SEC_NON_ACTP_CD	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325n, 325g straipsniai
EQ	DELTA		Neatidėliotino sandorio kaina	EQ_D_SPOT	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325o straipsnis
EQ	DELTA		Atpirkimo sandorių palūkanų norma	EQ_D_REPO	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325o straipsnis
EQ	VEGA	0,5 metų		EQ_V_00.50	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325o straipsnis
EQ	VEGA	1 metai		EQ_V_01.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325o straipsnis
EQ	VEGA	3 metai		EQ_V_03.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325o straipsnis
EQ	VEGA	5 metai		EQ_V_05.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325o straipsnis
EQ	VEGA	10 metų		EQ_V_10.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325o straipsnis
EQ	KREIVUMAS		Poslinkis į viršų	EQ_CU	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325o, 325g straipsniai
EQ	KREIVUMAS		Poslinkis į apačią	EQ_CD	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325o, 325g straipsniai
FX	DELTA			FX_D	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325q straipsnis
FX	VEGA	0,5 metų		FX_V_00.50	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325q straipsnis
FX	VEGA	1 metai		FX_V_01.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325q straipsnis
FX	VEGA	3 metai		FX_V_03.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325q straipsnis
FX	VEGA	5 metai		FX_V_05.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325q straipsnis
FX	VEGA	10 metų		FX_V_10.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325q straipsnis
FX	KREIVUMAS		Poslinkis į viršų	FX_CU	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325q, 325g straipsniai

Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Terminas	Papildoma specifikacija	Rizikos veiksnio identifikatorius	Teisinė nuoroda
FX	KREIVUMAS		Poslinkis į apačią	FX_CD	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325q, 325g straipsniai
GIRR	DELTA	0,25 metų		GIRR_D_00.25	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	DELTA	0,5 metų		GIRR_D_00.50	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	DELTA	1 metai		GIRR_D_01.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	DELTA	2 metai		GIRR_D_02.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	DELTA	3 metai		GIRR_D_03.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	DELTA	5 metai		GIRR_D_05.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	DELTA	10 metų		GIRR_D_10.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	DELTA	15 metų		GIRR_D_15.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	DELTA	20 metų		GIRR_D_20.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	DELTA	30 metų		GIRR_D_30.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	DELTA		Infliacija	GIRR_D_INF	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	DELTA		Skirtingų valiutų bazė (euro atžvilgiu)	GIRR_D_CRO_EUR	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	DELTA		Skirtingų valiutų bazė (JAV dolerio atžvilgiu)	GIRR_D_CRO_USD	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	0,5 metų – 0,5 metų		GIRR_V_00.50_00.50	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	1 metai – 0,5 metų		GIRR_V_01.00_00.50	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	3 metai – 0,5 metų		GIRR_V_03.00_00.50	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis

Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Terminas	Papildoma specifikacija	Rizikos veiksnio identifikatorius	Teisinė nuoroda
GIRR	VEGA	5 metai – 0,5 metų		GIRR_V_05.00_00.50	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	10 metų – 0,5 metų		GIRR_V_10.00_00.50	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	0,5 metų – 1 metai		GIRR_V_00.50_01.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	1 metai – 1 metai		GIRR_V_01.00_01.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	3 metai – 1 metai		GIRR_V_03.00_01.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	5 metai – 1 metai		GIRR_V_05.00_01.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	10 metų – 1 metai		GIRR_V_10.00_01.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	0,5 metų – 3 metai		GIRR_V_00.50_03.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	1 metai – 3 metai		GIRR_V_01.00_03.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	3 metai – 3 metai		GIRR_V_03.00_03.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	5 metai – 3 metai		GIRR_V_05.00_03.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	10 metų – 3 metai		GIRR_V_10.00_03.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	0,5 metų – 5 metai		GIRR_V_00.50_05.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	1 metai – 5 metai		GIRR_V_01.00_05.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	3 metai – 5 metai		GIRR_V_03.00_05.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	5 metai – 5 metai		GIRR_V_05.00_05.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	10 metų – 5 metai		GIRR_V_10.00_05.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis

Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Terminas	Papildoma specifikacija	Rizikos veiksnio identifikatorius	Teisinė nuoroda
GIRR	VEGA	0,5 metų – 10 metų		GIRR_V_00.50_10.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	1 metai – 10 metų		GIRR_V_01.00_10.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	3 metai – 10 metų		GIRR_V_03.00_10.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	5 metai – 10 metų		GIRR_V_05.00_10.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	10 metų – 10 metų		Bendrosios palūkanų normos rizika_V_10.00_10.00	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	0,5 metų	Infliacija	GIRR_V_00.50_INF	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	1 metai	Infliacija	GIRR_V_01.00_INF	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	3 metai	Infliacija	GIRR_V_03.00_INF	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	5 metai	Infliacija	GIRR_V_05.00_INF	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	10 metų	Infliacija	GIRR_V_10.00_INF	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	0,5 metų	Skirtingų valiutų bazė (euro atžvilgiu)	GIRR_V_00.50_CRO_EUR	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	1 metai	Skirtingų valiutų bazė (euro atžvilgiu)	GIRR_V_01.00_CRO_EUR	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	3 metai	Skirtingų valiutų bazė (euro atžvilgiu)	GIRR_V_03.00_CRO_EUR	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	5 metai	Skirtingų valiutų bazė (euro atžvilgiu)	GIRR_V_05.00_CRO_EUR	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	10 metų	Skirtingų valiutų bazė (euro atžvilgiu)	GIRR_V_10.00_CRO_EUR	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	0,5 metų	Skirtingų valiutų bazė (JAV dolerio atžvilgiu)	GIRR_V_00.50_CRO_USD	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	1 metai	Skirtingų valiutų bazė (JAV dolerio atžvilgiu)	GIRR_V_01.00_CRO_USD	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis

Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Terminas	Papildoma specifikacija	Rizikos veiksnio identifikatorius	Teisinė nuoroda
GIRR	VEGA	3 metai	Skirtingų valiutų bazė (JAV dolerio atžvilgiu)	GIRR_V_03.00_CRO_USD	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	5 metai	Skirtingų valiutų bazė (JAV dolerio atžvilgiu)	GIRR_V_05.00_CRO_USD	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	VEGA	10 metų	Skirtingų valiutų bazė (JAV dolerio atžvilgiu)	GIRR_V_10.00_CRO_USD	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l straipsnis
GIRR	KREIVUMAS		Poslinkis į viršų	GIRR_CU	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l, 325g straipsniai
GIRR	KREIVUMAS		Poslinkis į apačią	GIRR_CD	Reglamento (ES) Nr. 575/2013 325l, 325g straipsniai“

IV PRIEDAS

„VII PRIEDAS.

Portfelių priežiūros lyginamosios analizės rezultatai. RINKOS RIZIKA

PORTFELIŲ LYGINAMOSIOS ANALIZĖS REZULTATAI. RINKOS RIZIKA			
Formos numeris	**Formos kodas**	**Formos (formų grupės) pavadinimas**	**Trumpasis pavadinimas**
		PRADINIS RINKOS VERTINIMAS	
106,1	C 106.00	PRADINIS RINKOS VERTINIMAS IR NEĮTRAUKIMO PAGRINDAS	IMV
106,2	C 106.01	JAUTRUMAS RIZIKAI PAGAL PRIEMONES	JAUTRUMAS
		VaR, sVaR ir PV	
107,1	C 107.01	DUOMENYS	VaR ir SVaR 1
107,2	C 107.02	REZULTATAI **EBI PORTFELIO** VALIUTA	VaR ir SVaR 2
		PELNO IR NUOSTOLIO LAIKO EILUTĖS	
108	C 108.00	PELNO IR NUOSTOLIO LAIKO EILUTĖS	PELNAS IR NUOSTOLIS
		KAPITALO, REIKALINGO PAPILDOMAI RIZIKAI PADENGTI, POREIKIS (IRC)	
109,1	C 109.01	IRC. MODELIO DUOMENYS	IRC 1
109,2	C 109.02	IRC. DUOMENYS PAGAL PORTFELIUS	IRC 2
109,3	C 109.03	IRC. SUMA PAGAL PORTFELĮ / DATĄ	IRC 3
		KORELIACINĖ PREKYBA (CT)	
110,1	C 110.01	CT. MODELIO DUOMENYS	CT 1
110,2	C 110.02	CT. DUOMENYS PAGAL PORTFELIUS	CT 2
110,3	C 110.03	CT. SUMA PAGAL PORTFELĮ / DATĄ	CT 3
		ASA (SBM ir DRC)	
120,1	C 120.01	SBM. JAUTRUMAS RIZIKAI PAGAL PRIEMONES / PORTFELIUS	SBM 1
120,2	C 120.02	SBM. OFR (NUOSAVŲ LĖŠŲ REIKALAVIMO) SUDĖTIS PAGAL PORTFELIUS	SBM 2
120,4	C 120.04	DRC. RINKOS VERTĖS IR BENDROSIOS JTD SUMOS PAGAL PRIEMONES / PORTFELIUS	DRC 1
120,5	C 120.05	DRC. OFR SUDĖTIS PAGAL PORTFELIUS	DRC 2
120,6	C 120.06	ASA. OFR SUDĖTIS PAGAL PORTFELIUS	ASA OFR

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

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

C 106.00 – PRADINIS RINKOS VERTINIMAS IR NEĮTRAUKIMO PAGRINDAS

Priemonės numeris	Priemonė sumodeliuota pagal VaR ir sVaR (TAIP / NE)	Priemonė sumodeliuota pagal IRC (TAIP / NE)	Priemonė sumodeliuota koreliacinei prekybai (TAIP / NE)	Neįtraukimo pagrindas	Laukelis tekstui laisva forma	Pradinis rinkos vertinimas
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070

C 106.01. JAUTRUMAS RIZIKAI PAGAL PRIEMONES

Priemonės numeris

Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Jautrumas rizikai (rezultatai ataskaitose nurodoma valiuta)	Ataskaitose nurodoma valiuta	Jautrumas rizikai (rezultatai EBI priemonės valiuta)	Kainodaros modelis	Jautrumo apibrėžtis	Laukelis tekstui laisva forma	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija
0010	0020	0030	0050	0060	0070	0080	0090	0100	110	120

C 107.01 – VAR, SVAR ir PV. DUOMENYS

		Parinktis	Laukelis tekstui laisva forma
		0010	0020
VaR			
0010	**Metodika**		
0020	**10 dienų laikotarpio apskaičiavimas**		

		Parinktis	Laukelis tekstui laisva forma
		0010	0020
0030	**Stebėjimo laikotarpio trukmė**		
0040	**Duomenims taikomas koeficientas**		
0050	**Grįžtamuoju patikrinimu nustatytas padidėjimo koeficientas**		
0060	**VaR reguliavimo padidėjimo koeficientas**		
sVaR			
0070	**Metodika**		
0080	**10 dienų laikotarpio apskaičiavimas**		
0090	**SVaR reguliavimo padidėjimo koeficientas**		
0100	**SVaR laikotarpis**		

C 107.02 – Ne CTP VaR ir sVaR. REZULTATAI EBI PORTFELIO VALIUTA

Portfelis

Data	VaR	sVaR	PV
0010	0020	0030	0040

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

C 108.00 – PELNO IR NUOSTOLIO LAIKO EILUTĖ

Portfelis

Data	**Dienos pelnas ir nuostolis**
0010	0020

C 109.01 – IRC. MODELIO DUOMENYS

		Parinktis	**Laukelis tekstui laisva forma**
Eilutė	**Punktas**	0010	0020
0010	**Modeliavimo koeficientų skaičius**		
0020	**LGD įverčių šaltinis**		

C 109.02 – IRC. DUOMENYS PAGAL PORTFELIUS

Portfelis

		Parinktis	Laukelis tekstui laisva forma
Eilutė	**Punktas**	0010	0020
0010	**Likvidumo terminas**		
0020	**PD šaltinis**		
0030	**Kredito rizikos vertinimų pasikeitimo tikimybių matricų šaltinis**		

C 109.03 – IRC. SUMA PAGAL PORTFELĮ / DATĄ

Portfelis

Data	IRC
0010	0020

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

C 110.01 – CT. MODELIO DUOMENYS

		Parinktis	Laukelis tekstui laisva forma
Eilutė	**Punktas**	0010	0020
0010	**Modeliavimo koeficientų skaičius**		
0020	**LGD įverčių šaltinis**		

C 110.02 – CT. DUOMENYS PAGAL PORTFELIUS

Portfelis

		Parinktis	Laukelis tekstui laisva forma
Eilutė	**Punktas**	0010	0020
0010	**Likvidumo terminas**		
0020	**PD šaltinis**		
0030	**Kredito rizikos vertinimų pasikeitimo tikimybių matricų šaltinis**		

C 110.03 – CT. APR PAGAL PORTFELĮ / DATĄ

Portfelis

Data	**APR**
0010	0060

C 120.01. SBM. JAUTRUMAS RIZIKAI PAGAL PRIEMONES / PORTFELIUS

Portfelis

Priemonės numeris	**Rizikos veiksnio identifikatorius**	**Grupė**	**Papildomas identifikatorius**	**Jautrumas rizikai (rezultatai ataskaitose nurodoma valiuta)**	**Ataskaitose nurodoma valiuta**	**Jautrumas rizikai (rezultatai EBI portfelio valiuta)**	**Rizikos koeficientas**	**Antras papildomas identifikatorius**	**Kredito kokybės kategorija**
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 SUDĖTIS PAGAL PORTFELIUS

Portfelis

Rizikos klasė	Rizikos komponentas	Koreliacijų scenarijus	Nuosavų lėšų reikalavimai (rezultatai ataskaitose nurodoma valiuta)	Ataskaitose nurodoma valiuta	Nuosavų lėšų reikalavimai (rezultatai EBI portfelio valiuta)	Pozicijos be pasirinkimo sandorių, kurioms taikomi nuosavų lėšų reikalavimai kreivumo rizikai padengti	Bazinės rizikos metodas, taikomas užsienio valiutos kurso rizikos delta ir kreivumo sudedamosioms dalims	Užsienio valiutos kurso rizikos kreivumo rizikos sudedamosios dalies padalijimas pagal skaliarus	SBM patvirtinimo portfelių rezultatų pateikimas	Laukelis tekstui laisva forma
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0950	0100

C 120.04. DRC. Rinkos vertės ir bendrosios JTD sumos pagal priemones / portfelius

Portfelis

Sveikasis skaičius

Priemonės numeris	Rizikos klasė	1 grupė	2 grupė	Įsipareigojantysis asmuo	Kredito kokybės kategorija	Įsipareigojimų neįvykdymo rizikos koeficientas	Prioritetas	Terminas	Susigrąžinimo norma	Kryptis	Nuostolių priskyrimo riba (%)	Nuostolių atskyrimo riba (%)	Rezultatai ataskaitose nurodoma valiuta				Rezultatai EBI portfelio valiuta		
													Tariamoji vertė	Pelnas ir nuostolis + koregavimas	Bendroji JTD suma	Valiuta	Tariamoji vertė	Pelnas ir nuostolis + koregavimas	Bendroji JTD suma
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 SUDĖTIS PAGAL PORTFELIUS

Portfelis

Sveikasis skaičius

Rizikos klasė	1 grupė	2 grupė	Nuosavų lėšų reikalavimai (rezultatai ataskaitose nurodoma valiuta)	Ataskaitose nurodoma valiuta	Nuosavų lėšų reikalavimai (rezultatai EBI portfelio valiuta)
0010	0020	0030	0040	0050	0060

C 120.06. ASA. OFR

Portfelio numeris	Rezultatai ataskaitose nurodoma valiuta			Rezultatai EBI portfelio valiuta		
	SBM OFR	DRC OFR	RRAO OFR	SBM OFR	DRC OFR	RRAO OFR
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070“

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

V PRIEDAS

„X PRIEDAS.

SBM patvirtinimo portfeliai

Lapo pavadinimas	Aprašymas
Priemonės	SBM patvirtinimui naudojamos priemonės (jautrumas ir kreivumo rizikos pozicijos)
Portfeliai	SBM patvirtinimo portfeliai, apibrėžti kaip šiame priede apibrėžtų priemonių deriniai

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
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

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
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

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
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	3 mėn. LIBOR			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	3 mėn. LIBOR			– 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	3 mėn. LIBOR			10 000,00
S_IRD_d8#	GIRR_D_15.00	CLP	OIS			70 000,00

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
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	3 mėn. LIBOR			– 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	3 mėn. LIBOR			– 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	3 mėn. LIBOR			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	3 mėn. LIBOR			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	3 mėn. LIBOR			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	3 mėn. LIBOR			– 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

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
S_IRD_c1#	GIRR_D_00.25	USD	3 mėn. LIBOR			– 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

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
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	EMITENTAS A			100,00

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
S_EQV_aa4#	EQ_V_5.00	5	EMITENTAS AA			1 200,00
S_EQV_ac1#	EQ_V_5.00	7	EMITENTAS AC			– 50,00
S_EQV_ae4#	EQ_V_5.00	9	EMITENTAS AE			600,00
S_EQV_af4#	EQ_V_5.00	10	EMITENTAS AF			375,00
S_EQV_b4#	EQ_V_5.00	1	EMITENTAS B			50,00
S_EQV_f4#	EQ_V_5.00	5	EMITENTAS F			450,00
S_EQV_j4#	EQ_V_5.00	9	EMITENTAS J			– 200,00
S_EQV_k4#	EQ_V_5.00	10	EMITENTAS K			– 825,00
S_EQV_m1#	EQ_V_5.00	11	EMITENTAS M			– 700,00
S_EQV_n4#	EQ_V_5.00	12	INDEKSAS N			850,00
S_EQV_o4#	EQ_V_5.00	12	INDEKSAS O			150,00
S_EQV_y1#	EQ_V_5.00	3	EMITENTAS Y			700,00
S_EQV_a4#	EQ_V_3.00	1	EMITENTAS A			– 500,00
S_EQV_aa3#	EQ_V_3.00	5	EMITENTAS AA			– 850,00
S_EQV_ad1#	EQ_V_3.00	8	EMITENTAS AD			300,00
S_EQV_ae3#	EQ_V_3.00	9	EMITENTAS AE			– 450,00
S_EQV_af3#	EQ_V_3.00	10	EMITENTAS AF			– 725,00
S_EQV_b3#	EQ_V_3.00	1	EMITENTAS B			– 500,00

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
S_EQV_f3#	EQ_V_3.00	5	EMITENTAS F			250,00
S_EQV_j3#	EQ_V_3.00	9	EMITENTAS J			– 900,00
S_EQV_k3#	EQ_V_3.00	10	EMITENTAS K			– 975,00
S_EQV_n3#	EQ_V_3.00	12	INDEKSAS N			– 1 250,00
S_EQV_o3#	EQ_V_3.00	12	INDEKSAS O			100,00
S_EQV_x1#	EQ_V_3.00	2	EMITENTAS X			– 200,00
S_EQV_z1#	EQ_V_3.00	4	EMITENTAS Z			– 800,00
S_EQV_a6#	EQ_V_10.00	1	EMITENTAS A			100,00
S_EQV_aa5#	EQ_V_10.00	5	EMITENTAS AA			– 300,00
S_EQV_ab1#	EQ_V_10.00	6	EMITENTAS AB			– 400,00
S_EQV_ae5#	EQ_V_10.00	9	EMITENTAS AE			– 850,00
S_EQV_af5#	EQ_V_10.00	10	EMITENTAS AF			525,00
S_EQV_b5#	EQ_V_10.00	1	EMITENTAS B			500,00
S_EQV_f5#	EQ_V_10.00	5	EMITENTAS F			600,00
S_EQV_j5#	EQ_V_10.00	9	EMITENTAS J			150,00
S_EQV_k5#	EQ_V_10.00	10	EMITENTAS K			300,00
S_EQV_n5#	EQ_V_10.00	12	INDEKSAS N			225,00
S_EQV_o5#	EQ_V_10.00	12	INDEKSAS O			– 200,00

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
S_EQV_q1#	EQ_V_10.00	13	INDEKSAS Q			– 800,00
S_EQV_a3#	EQ_V_1.00	1	EMITENTAS A			400,00
S_EQV_aa2#	EQ_V_1.00	5	EMITENTAS AA			– 400,00
S_EQV_ae2#	EQ_V_1.00	9	EMITENTAS AE			– 250,00
S_EQV_af2#	EQ_V_1.00	10	EMITENTAS AF			– 1 150,00
S_EQV_b2#	EQ_V_1.00	1	EMITENTAS B			200,00
S_EQV_f2#	EQ_V_1.00	5	EMITENTAS F			– 750,00
S_EQV_j2#	EQ_V_1.00	9	EMITENTAS J			350,00
S_EQV_k2#	EQ_V_1.00	10	EMITENTAS K			1 050,00
S_EQV_n2#	EQ_V_1.00	12	INDEKSAS N			– 800,00
S_EQV_o2#	EQ_V_1.00	12	INDEKSAS O			400,00
S_EQV_a1#	EQ_V_0.50	1	EMITENTAS A			– 100,00
S_EQV_a2#	EQ_V_0.50	1	EMITENTAS A			700,00
S_EQV_aa1#	EQ_V_0.50	5	EMITENTAS AA			950,00
S_EQV_ae1#	EQ_V_0.50	9	EMITENTAS AE			50,00
S_EQV_af1#	EQ_V_0.50	10	EMITENTAS AF			– 300,00
S_EQV_b1#	EQ_V_0.50	1	EMITENTAS B			900,00
S_EQV_c1#	EQ_V_0.50	2	EMITENTAS C			– 500,00

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
S_EQV_d1#	EQ_V_0.50	3	EMITENTAS D			600,00
S_EQV_e1#	EQ_V_0.50	4	EMITENTAS E			– 800,00
S_EQV_f1#	EQ_V_0.50	5	EMITENTAS F			1 000,00
S_EQV_g1#	EQ_V_0.50	6	EMITENTAS G			– 400,00
S_EQV_h1#	EQ_V_0.50	7	EMITENTAS H			– 50,00
S_EQV_i1#	EQ_V_0.50	8	EMITENTAS I			300,00
S_EQV_j1#	EQ_V_0.50	9	EMITENTAS J			50,00
S_EQV_k1#	EQ_V_0.50	10	EMITENTAS K			– 300,00
S_EQV_l1#	EQ_V_0.50	11	EMITENTAS L			1 000,00
S_EQV_n1#	EQ_V_0.50	12	INDEKSAS N			750,00
S_EQV_o1#	EQ_V_0.50	12	INDEKSAS O			– 500,00
S_EQV_p1#	EQ_V_0.50	13	INDEKSAS P			40,00
S_EQD_a1#	EQ_D_SPOT	1	EMITENTAS A			16 500,00
S_EQD_a2#	EQ_D_SPOT	1	EMITENTAS A			– 35 000,00
S_EQD_b1#	EQ_D_SPOT	1	EMITENTAS B			20 000,00
S_EQD_c1#	EQ_D_SPOT	2	EMITENTAS C			66 000,00
S_EQD_d1#	EQ_D_SPOT	3	EMITENTAS D			1 700,00
S_EQD_e1#	EQ_D_SPOT	4	EMITENTAS E			1 100,00

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
S_EQD_f1#	EQ_D_SPOT	5	EMITENTAS F			25 000,00
S_EQD_g1#	EQ_D_SPOT	5	EMITENTAS G			8 400,00
S_EQD_h1#	EQ_D_SPOT	6	EMITENTAS H			22 500,00
S_EQD_i1#	EQ_D_SPOT	7	EMITENTAS I			– 12 300,00
S_EQD_j1#	EQ_D_SPOT	8	EMITENTAS J			– 450,00
S_EQD_k1#	EQ_D_SPOT	9	EMITENTAS K			– 143,00
S_EQD_l1#	EQ_D_SPOT	9	EMITENTAS L			– 143,00
S_EQD_m1#	EQ_D_SPOT	10	EMITENTAS M			– 100,00
S_EQD_n1#	EQ_D_SPOT	10	EMITENTAS N			– 100,00
S_EQD_o1#	EQ_D_SPOT	11	EMITENTAS O			– 19 600,00
S_EQD_q1#	EQ_D_SPOT	12	INDEKSAS Q			1 100,00
S_EQD_r1#	EQ_D_SPOT	12	INDEKSAS R			– 40 000,00
S_EQD_s1#	EQ_D_SPOT	13	INDEKSAS S			– 1 950,00
S_EQD_s2#	EQ_D_SPOT	13	INDEKSAS S			280,00
S_EQD_t2#	EQ_D_SPOT	13	INDEKSAS T			3 150,00
S_EQD_u1#	EQ_D_SPOT	9	EMITENTAS U			– 57,00
S_EQD_v1#	EQ_D_SPOT	10	EMITENTAS V			– 100,00

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
S_EQD_a3#	EQ_D_REPO	1	EMITENTAS A			50 000,00
S_EQD_aa1#	EQ_D_REPO	6	EMITENTAS AA			79 000,00
S_EQD_ab1#	EQ_D_REPO	7	EMITENTAS AB			31 000,00
S_EQD_ac1#	EQ_D_REPO	8	EMITENTAS AC			– 10 000,00
S_EQD_b2#	EQ_D_REPO	1	EMITENTAS B			– 39 000,00
S_EQD_f2#	EQ_D_REPO	5	EMITENTAS F			90 000,00
S_EQD_g2#	EQ_D_REPO	5	EMITENTAS G			60 000,00
S_EQD_k2#	EQ_D_REPO	9	EMITENTAS K			– 14 250,00
S_EQD_l2#	EQ_D_REPO	9	EMITENTAS L			– 150 000,00
S_EQD_m2#	EQ_D_REPO	10	EMITENTAS M			– 85 000,00
S_EQD_n2#	EQ_D_REPO	10	EMITENTAS N			– 72 000,00
S_EQD_p1#	EQ_D_REPO	11	EMITENTAS P			48 000,00
S_EQD_q2#	EQ_D_REPO	12	INDEKSAS Q			85 000,00
S_EQD_r2#	EQ_D_REPO	12	INDEKSAS R			– 40 000,00
S_EQD_t1#	EQ_D_REPO	13	INDEKSAS T			– 125 000,00
S_EQD_x1#	EQ_D_REPO	2	EMITENTAS X			75 000,00
S_EQD_y1#	EQ_D_REPO	3	EMITENTAS Y			4 800,00

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
S_EQD_z1#	EQ_D_REPO	4	EMITENTAS Z			– 15 000,00
S_EQC_a1#	EQ_CU	1	EMITENTAS A			– 37 820,00
S_EQC_a2#	EQ_CU	1	EMITENTAS A			77 655,00
S_EQC_aa1#	EQ_CU	2	EMITENTAS AA			39 300,00
S_EQC_ab1#	EQ_CU	4	EMITENTAS AB			17 262,00
S_EQC_ac1#	EQ_CU	5	EMITENTAS AC			7 139,60
S_EQC_ad1#	EQ_CU	6	EMITENTAS AD			– 3 642,50
S_EQC_ae1#	EQ_CU	7	EMITENTAS AE			3 900,00
S_EQC_af1#	EQ_CU	8	EMITENTAS AF			41 550,00
S_EQC_ag1#	EQ_CU	9	EMITENTAS AG			36 860,00
S_EQC_ah1#	EQ_CU	10	EMITENTAS AH			22 150,00
S_EQC_b1#	EQ_CU	1	EMITENTAS B			20 677,50
S_EQC_c1#	EQ_CU	2	EMITENTAS C			– 31 440,00
S_EQC_d1#	EQ_CU	3	EMITENTAS D			6 238,00
S_EQC_e1#	EQ_CU	4	EMITENTAS E			– 21 605,00
S_EQC_f1#	EQ_CU	5	EMITENTAS F			– 2 850,00
S_EQC_g1#	EQ_CU	6	EMITENTAS G			– 3 642,50

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
S_EQC_h1#	EQ_CU	7	EMITENTAS H			– 7 800,00
S_EQC_i1#	EQ_CU	8	EMITENTAS I			– 29 550,00
S_EQC_j1#	EQ_CU	9	EMITENTAS J			– 216 320,00
S_EQC_k1#	EQ_CU	10	EMITENTAS K			1 950,00
S_EQC_q1#	EQ_CU	11	EMITENTAS Q			– 19 142,00
S_EQC_r1#	EQ_CU	11	EMITENTAS R			28 713,00
S_EQC_s1#	EQ_CU	3	EMITENTAS S			– 17 025,00
S_EQC_t1#	EQ_CU	12	EMITENTAS T			7 466,67
S_EQC_u1#	EQ_CU	13	EMITENTAS U			11 160,00
S_EQC_v1#	EQ_CU	12	EMITENTAS V			– 39 200,00
S_EQC_w1#	EQ_CU	13	EMITENTAS W			– 58 590,00
S_EQC_y1#	EQ_CU	1	EMITENTAS Y			– 23 930,00
S_EQC_z1#	EQ_CU	1	EMITENTAS Z			– 47 860,00
S_EQC_a1#	EQ_CD	1	EMITENTAS A			39 157,50
S_EQC_a2#	EQ_CD	1	EMITENTAS A			– 80 349,00
S_EQC_aa1#	EQ_CD	2	EMITENTAS AA			– 30 600,00
S_EQC_ab1#	EQ_CD	4	EMITENTAS AB			– 9 826,00
S_EQC_ac1#	EQ_CD	5	EMITENTAS AC			– 5 414,60

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
S_EQC_ad1#	EQ_CD	6	EMITENTAS AD			2 617,50
S_EQC_ae1#	EQ_CD	7	EMITENTAS AE			– 2 720,00
S_EQC_af1#	EQ_CD	8	EMITENTAS AF			– 28 250,00
S_EQC_ag1#	EQ_CD	9	EMITENTAS AG			– 30 935,00
S_EQC_ah1#	EQ_CD	10	EMITENTAS AH			– 15 025,00
S_EQC_b1#	EQ_CD	1	EMITENTAS B			– 238 910,00
S_EQC_c1#	EQ_CD	2	EMITENTAS C			24 480,00
S_EQC_d1#	EQ_CD	3	EMITENTAS D			– 6 068,00
S_EQC_e1#	EQ_CD	4	EMITENTAS E			12 310,00
S_EQC_f1#	EQ_CD	5	EMITENTAS F			2 160,00
S_EQC_g1#	EQ_CD	6	EMITENTAS G			2 617,50
S_EQC_h1#	EQ_CD	7	EMITENTAS H			5 440,00
S_EQC_i1#	EQ_CD	8	EMITENTAS I			20 050,00
S_EQC_j1#	EQ_CD	9	EMITENTAS J			181 560,00
S_EQC_k1#	EQ_CD	10	EMITENTAS K			– 2 900,00
S_EQC_q1#	EQ_CD	11	EMITENTAS Q			20 052,00
S_EQC_r1#	EQ_CD	11	EMITENTAS R			– 30 078,00
S_EQC_s1#	EQ_CD	3	EMITENTAS S			– 9 435,00

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
S_EQC_t1#	EQ_CD	12	EMITENTAS T			– 7 400,00
S_EQC_u1#	EQ_CD	13	EMITENTAS U			– 11 040,00
S_EQC_v1#	EQ_CD	12	EMITENTAS V			38 850,00
S_EQC_w1#	EQ_CD	13	EMITENTAS W			57 960,00
S_EQC_y1#	EQ_CD	1	EMITENTAS Y			13 590,00
S_EQC_z1#	EQ_CD	1	EMITENTAS Z			27 180,00
S_CNV_a5#	CSR_NON_SEC_V_5.00	1	EMITENTAS A			100,00
S_CNV_b4#	CSR_NON_SEC_V_5.00	1	EMITENTAS B			50,00
S_CNV_c4#	CSR_NON_SEC_V_5.00	3	EMITENTAS C			150,00
S_CNV_hb1#	CSR_NON_SEC_V_5.00	9	EMITENTAS HA			– 750,00
S_CNV_a4#	CSR_NON_SEC_V_3.00	1	EMITENTAS A			– 500,00
S_CNV_ab1#	CSR_NON_SEC_V_3.00	2	EMITENTAS AB			325,00
S_CNV_b3#	CSR_NON_SEC_V_3.00	1	EMITENTAS B			– 500,00
S_CNV_c3#	CSR_NON_SEC_V_3.00	3	EMITENTAS C			100,00
S_CNV_v1#	CSR_NON_SEC_V_3.00	20	INDEKSAS V			500,00
S_CNV_a6#	CSR_NON_SEC_V_10.00	1	EMITENTAS A			100,00
S_CNV_b5#	CSR_NON_SEC_V_10.00	1	EMITENTAS B			500,00

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
S_CNV_c5#	CSR_NON_SEC_V_10.00	3	EMITENTAS C			– 200,00
S_CNV_a3#	CSR_NON_SEC_V_1.00	1	EMITENTAS A			400,00
S_CNV_b2#	CSR_NON_SEC_V_1.00	1	EMITENTAS B			200,00
S_CNV_c2#	CSR_NON_SEC_V_1.00	3	EMITENTAS C			400,00
S_CNV_a1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	EMITENTAS A			– 100,00
S_CNV_a2#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	EMITENTAS A			700,00
S_CNV_b1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	EMITENTAS B			900,00
S_CNV_c1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	3	EMITENTAS C			– 500,00
S_CNV_d1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	4	EMITENTAS D			700,00
S_CNV_e1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	5	EMITENTAS E			– 800,00
S_CNV_f1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	6	EMITENTAS F			700,00
S_CNV_g1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	7	EMITENTAS G			– 400,00
S_CNV_h1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	8	EMITENTAS H			– 50,00
S_CNV_i1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	10	EMITENTAS I			300,00
S_CNV_j1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	11	EMITENTAS J			50,00
S_CNV_k1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	12	EMITENTAS K			– 300,00
S_CNV_l1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	13	EMITENTAS L			1 000,00

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
S_CNV_m1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	14	EMITENTAS M			– 350,00
S_CNV_n1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	15	EMITENTAS N			950,00
S_CNV_o1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	16	EMITENTAS O			– 900,00
S_CNV_p1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	17	EMITENTAS P			200,00
S_CNV_q1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	18	EMITENTAS Q			400,00
S_CNV_r1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	18	EMITENTAS R			– 300,00
S_CNV_s1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	19	INDEKSAS S			850,00
S_CNV_t1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	20	INDEKSAS T			– 650,00
S_CNV_u1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	19	INDEKSAS U			– 350,00
S_CND_hb2#	CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT	9	EMITENTAS HB			– 17 000,00
S_CND_t1#	CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT	3	EMITENTAS T			– 6 000,00
S_CND_y1#	CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT	20	INDEKSAS Y			9 000,00
S_CND_ab2#	CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS	2	EMITENTAS AC			14 000,00
S_CND_b2#	CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS	1	EMITENTAS B			– 17 000,00
S_CND_w1#	CSR_NON_-SEC_D_10.00_DEBT	10	EMITENTAS W		1 KREDITO KOKYBĖS ŽINGSNIS	9 000,00
S_CND_a4#	CSR_NON_-SEC_D_1.00_DEBT	1	EMITENTAS A			– 10 000,00
S_CND_s1#	CSR_NON_-SEC_D_1.00_DEBT	3	EMITENTAS S			– 6 000,00

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
S_CND_x1#	CSR_NON_SEC_D_1.00_CDS	19	INDEKSAS X			– 18 500,00
S_CND_a1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	1	EMITENTAS A			20 000,00
S_CND_a2#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	1	EMITENTAS A			– 30 000,00
S_CND_b1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	1	EMITENTAS B			12 000,00
S_CND_c1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	3	EMITENTAS C			– 6 000,00
S_CND_d1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	4	EMITENTAS D			25 000,00
S_CND_e1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	5	EMITENTAS E			– 4 000,00
S_CND_f1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	6	EMITENTAS F			– 8 000,00
S_CND_g1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	7	EMITENTAS G			8 000,00
S_CND_h1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	8	EMITENTAS H			3 000,00
S_CND_hb1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	9	EMITENTAS HA			– 23 000,00
S_CND_i1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	10	EMITENTAS I		2 KREDITO KOKYBĖS ŽINGSNIS	– 5 000,00
S_CND_j1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	11	EMITENTAS J			2 000,00
S_CND_k1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	12	EMITENTAS K			7 000,00
S_CND_l1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	13	EMITENTAS L			– 9 000,00
S_CND_m1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	14	EMITENTAS M			10 000,00
S_CND_n1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	15	EMITENTAS N			– 20 000,00

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
S_CND_o1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	16	EMITENTAS O			5 000,00
S_CND_p1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	17	EMITENTAS P			– 3 000,00
S_CND_q1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	18	EMITENTAS Q			10 000,00
S_CND_r1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	18	EMITENTAS R			– 5 000,00
S_CND_a3#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	1	EMITENTAS A			15 000,00
S_CND_ab1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	2	EMITENTAS AB			21 000,00
S_CND_u1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	19	INDEKSAS U			– 32 000,00
S_CND_v1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	20	INDEKSAS V			– 13 000,00
S_CND_x2#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	19	INDEKSAS X			52 500,00
S_CNC_a1#	CSR_NON_SEC_CU	1	EMITENTAS A			– 2 338,64
S_CNC_a2#	CSR_NON_SEC_CU	1	EMITENTAS A			35 116,67
S_CNC_aa1#	CSR_NON_SEC_CU	10	EMITENTAS AA		1 KREDITO KOKYBĖS ŽINGSNIS	– 1 212,50
S_CNC_ab1#	CSR_NON_SEC_CU	2	EMITENTAS AB1			– 247,47
S_CNC_b1#	CSR_NON_SEC_CU	1	EMITENTAS B			890,91
S_CNC_c1#	CSR_NON_SEC_CU	3	EMITENTAS C			– 500,00
S_CNC_d1#	CSR_NON_SEC_CU	4	EMITENTAS D			415,00
S_CNC_e1#	CSR_NON_SEC_CU	5	EMITENTAS E			– 1 050,00

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

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
S_CNC_f1#	CSR_NON_SEC_CU	6	EMITENTAS F			– 150,00
S_CNC_g1#	CSR_NON_SEC_CU	7	EMITENTAS G			– 318,75
S_CNC_h1#	CSR_NON_SEC_CU	8	EMITENTAS H			– 425,00
S_CNC_hb1#	CSR_NON_SEC_CU	9	EMITENTAS HB1			– 500,00
S_CNC_i1#	CSR_NON_SEC_CU	10	EMITENTAS I		2 KREDITO KOKYBĖS ŽINGSNIS	– 937,50
S_CNC_j1#	CSR_NON_SEC_CU	11	EMITENTAS J			– 4 650,00
S_CNC_k1#	CSR_NON_SEC_CU	12	EMITENTAS K			– 425,00
S_CNC_l1#	CSR_NON_SEC_CU	13	EMITENTAS L			– 27 660,00
S_CNC_m1#	CSR_NON_SEC_CU	14	EMITENTAS M			– 488,00
S_CNC_n1#	CSR_NON_SEC_CU	15	EMITENTAS N			13 237,50
S_CNC_o1#	CSR_NON_SEC_CU	16	EMITENTAS O			– 1 127,50
S_CNC_p1#	CSR_NON_SEC_CU	17	EMITENTAS P			– 5 775,00
S_CNC_q1#	CSR_NON_SEC_CU	18	EMITENTAS Q			– 7 842,00
S_CNC_r1#	CSR_NON_SEC_CU	18	EMITENTAS R			15 684,00
S_CNC_s1#	CSR_NON_SEC_CU	4	EMITENTAS S			– 750,00
S_CNC_t1#	CSR_NON_SEC_CU	19	EMITENTAS T			3 550,00
S_CNC_u1#	CSR_NON_SEC_CU	20	EMITENTAS U			1 660,00
S_CNC_v1#	CSR_NON_SEC_CU	19	EMITENTAS V			– 18 637,50

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
S_CNC_w1#	CSR_NON_SEC_CU	20	EMITENTAS W			– 8 715,00
S_CNC_x1#	CSR_NON_SEC_CU	3	EMITENTAS X			– 500,00
S_CNC_y1#	CSR_NON_SEC_CU	1	EMITENTAS Y			– 249,95
S_CNC_z1#	CSR_NON_SEC_CU	1	EMITENTAS Z			– 249,95
S_CNC_a1#	CSR_NON_SEC_CD	1	EMITENTAS A			2 363,38
S_CNC_a2#	CSR_NON_SEC_CD	1	EMITENTAS A			– 35 314,65
S_CNC_aa1#	CSR_NON_SEC_CD	10	EMITENTAS AA		1 KREDITO KOKYBĖS ŽINGSNIS	1 150,00
S_CNC_ab1#	CSR_NON_SEC_CD	2	EMITENTAS AB1			247,47
S_CNC_b1#	CSR_NON_SEC_CD	1	EMITENTAS B			– 5 543,43
S_CNC_c1#	CSR_NON_SEC_CD	3	EMITENTAS C			500,00
S_CNC_d1#	CSR_NON_SEC_CD	4	EMITENTAS D			– 385,00
S_CNC_e1#	CSR_NON_SEC_CD	5	EMITENTAS E			575,00
S_CNC_f1#	CSR_NON_SEC_CD	6	EMITENTAS F			75,00
S_CNC_g1#	CSR_NON_SEC_CD	7	EMITENTAS G			287,50
S_CNC_h1#	CSR_NON_SEC_CD	8	EMITENTAS H			400,00
S_CNC_hb1#	CSR_NON_SEC_CD	9	EMITENTAS HB1			500,00
S_CNC_i1#	CSR_NON_SEC_CD	10	EMITENTAS I		2 KREDITO KOKYBĖS ŽINGSNIS	750,00
S_CNC_j1#	CSR_NON_SEC_CD	11	EMITENTAS J			4 100,00

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
S_CNC_k1#	CSR_NON_SEC_CD	12	EMITENTAS K			387,50
S_CNC_l1#	CSR_NON_SEC_CD	13	EMITENTAS L			22 130,00
S_CNC_m1#	CSR_NON_SEC_CD	14	EMITENTAS M			160,00
S_CNC_n1#	CSR_NON_SEC_CD	15	EMITENTAS N			– 23 437,50
S_CNC_o1#	CSR_NON_SEC_CD	16	EMITENTAS O			1 246,25
S_CNC_p1#	CSR_NON_SEC_CD	17	EMITENTAS P			6 225,00
S_CNC_q1#	CSR_NON_SEC_CD	18	EMITENTAS Q			8 752,00
S_CNC_r1#	CSR_NON_SEC_CD	18	EMITENTAS R			– 17 504,00
S_CNC_s1#	CSR_NON_SEC_CD	4	EMITENTAS S			– 250,00
S_CNC_t1#	CSR_NON_SEC_CD	19	EMITENTAS T			– 3 500,00
S_CNC_u1#	CSR_NON_SEC_CD	20	EMITENTAS U			– 1 540,00
S_CNC_v1#	CSR_NON_SEC_CD	19	EMITENTAS V			18 375,00
S_CNC_w1#	CSR_NON_SEC_CD	20	EMITENTAS W			8 085,00
S_CNC_x1#	CSR_NON_SEC_CD	3	EMITENTAS X			500,00
S_CNC_y1#	CSR_NON_SEC_CD	1	EMITENTAS Y			– 226,77
S_CNC_z1#	CSR_NON_SEC_CD	1	EMITENTAS Z			– 226,77
S_CMV_a5#	CM_V_5.00	1	ANGLYS			– 300,00

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
S_CMV_b4#	CM_V_5.00	1	URANAS			450,00
S_CMV_a4#	CM_V_3.00	1	ANGLYS			800,00
S_CMV_b3#	CM_V_3.00	1	URANAS			800,00
S_CMV_a6#	CM_V_10.00	1	ANGLYS			100,00
S_CMV_b5#	CM_V_10.00	1	URANAS			– 250,00
S_CMV_a3#	CM_V_1.00	1	ANGLYS			– 200,00
S_CMV_b2#	CM_V_1.00	1	URANAS			– 750,00
S_CMV_d1#	CM_V_1.00	2	WTI ŽALIA NAFTA			– 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	VARIS			– 200,00
S_CMV_l1#	CM_V_1.00	6	SUSKYSTINTOS GAMTINĖS DUJOS			1 000,00
S_CMV_n1#	CM_V_1.00	7	SIDABRAS			500,00
S_CMV_p1#	CM_V_1.00	8	KUKURŪZAI			– 1 000,00
S_CMV_r1#	CM_V_1.00	9	IŠRŪGOS			– 125,00
S_CMV_t1#	CM_V_1.00	10	KAUČIUKAS			– 50,00
S_CMV_v1#	CM_V_1.00	11	POTAŠAS			– 1 800,00

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
S_CMV_a1#	CM_V_0.50	1	ANGLYS			1 000,00
S_CMV_a2#	CM_V_0.50	1	ANGLYS			– 350,00
S_CMV_b1#	CM_V_0.50	1	URANAS			150,00
S_CMV_c1#	CM_V_0.50	2	BRENT ŽALIA NAFTA			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	PLIENAS			550,00
S_CMV_k1#	CM_V_0.50	6	GAMTINĖS DUJOS			400,00
S_CMV_m1#	CM_V_0.50	7	AUKSAS			– 200,00
S_CMV_o1#	CM_V_0.50	8	SOJOS			– 750,00
S_CMV_q1#	CM_V_0.50	9	ŽUVIS			250,00
S_CMV_s1#	CM_V_0.50	10	KAKAVA			350,00
S_CMV_u1#	CM_V_0.50	11	PLOKŠČIASIS STIKLAS			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	KUKURŪZAI	OKLAHOMA		– 10 000,00
S_CMD_f1#	CM_D_3.00	3	FWD ELECTRICITY NE	TEKSASAS		– 4 500,00

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
S_CMD_h1#	CM_D_3.00	4	PANAMAX	NAUJASIS ORLEANAS		– 68 750,00
S_CMD_n1#	CM_D_20.00	7	SIDABRAS	EU1		5 000,00
S_CMD_r1#	CM_D_20.00	9	IŠRŪGOS	NIUKASLAS		– 1 250,00
S_CMD_d1#	CM_D_2.00	2	WTI ŽALIA NAFTA	OKLAHOMA		– 1 750,00
S_CMD_l1#	CM_D_15.00	6	SUSKYSTINTOS GAMTINĖS DUJOS	OKLAHOMA		10 000,00
S_CMD_t1#	CM_D_15.00	10	KAUČIUKAS	NIUKASLAS		– 500,00
S_CMD_j1#	CM_D_10.00	5	VARIS	OKLAHOMA		– 2 000,00
S_CMD_v1#	CM_D_10.00	11	POTAŠAS	NIUKASLAS		– 18 000,00
S_CMD_b1#	CM_D_1.00	1	URANAS	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	NAUJASIS ORLEANAS		187 500,00
S_CMD_a4#	CM_D_0.50	1	ANGLYS	NIUKASLAS		8 000,00
S_CMD_a1#	CM_D_0.00	1	ANGLYS	NIUKASLAS		10 000,00
S_CMD_a2#	CM_D_0.00	1	ANGLYS	NIUKASLAS		– 3 500,00
S_CMD_a3#	CM_D_0.00	1	ANGLYS	LONDONAS		– 2 000,00
S_CMD_c1#	CM_D_0.00	2	BRENT ŽALIA NAFTA	HAVRAS		2 000,00

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
S_CMD_e1#	CM_D_0.00	3	SPOT ELECTRICITY SE	LONDONAS		– 3 000,00
S_CMD_i1#	CM_D_0.00	5	PLIENAS	HAVRAS		5 500,00
S_CMD_k1#	CM_D_0.00	6	GAMTINĖS DUJOS	HAVRAS		4 000,00
S_CMD_m1#	CM_D_0.00	7	AUKSAS	UK1		– 2 000,00
S_CMD_o1#	CM_D_0.00	8	SOJOS	HAVRAS		– 7 500,00
S_CMD_q1#	CM_D_0.00	9	ŽUVIS	LONDONAS		2 500,00
S_CMD_s1#	CM_D_0.00	10	KAKAVA	LONDONAS		3 500,00
S_CMD_u1#	CM_D_0.00	11	PLOKŠČIASIS STIKLAS	LONDONAS		30 000,00
S_CMC_a1#	CM_CU	1	ANGLYS			17 335,00
S_CMC_a2#	CM_CU	1	ANGLYS			36 936,00
S_CMC_b1#	CM_CU	1	URANAS			6 635,00
S_CMC_c1#	CM_CU	2	BRENT ŽALIA NAFTA			– 11 600,00
S_CMC_d1#	CM_CU	2	WTI ŽALIA NAFTA			– 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

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
S_CMC_i1#	CM_CU	5	PLIENAS			– 5 850,00
S_CMC_j1#	CM_CU	5	VARIS			14 644,80
S_CMC_k1#	CM_CU	6	GAMTINĖS DUJOS			– 6 147,50
S_CMC_l1#	CM_CU	6	SUSKYSTINTOS GAMTINĖS DUJOS			– 6 147,50
S_CMC_m1#	CM_CU	7	AUKSAS			– 1 486,67
S_CMC_n1#	CM_CU	7	SIDABRAS			743,33
S_CMC_o1#	CM_CU	8	SOJOS			– 14 535,00
S_CMC_p1#	CM_CU	8	KUKURŪZAI			20 475,00
S_CMC_q1#	CM_CU	9	ŽUVIS			– 19 900,00
S_CMC_r1#	CM_CU	9	IŠRŪGOS			3 387,00
S_CMC_s1#	CM_CU	10	KAKAVA			1 005,00
S_CMC_t1#	CM_CU	10	KAUČIUKAS			10 892,20
S_CMC_u1#	CM_CU	11	PLOKŠČIASIS STIKLAS			– 13 790,00
S_CMC_v1#	CM_CU	11	POTAŠAS			20 685,00
S_CMC_x1#	CM_CU	9	PIENAS			– 6 300,00
S_CMC_y1#	CM_CU	1	URANAS			– 65 864,00
S_CMC_z1#	CM_CU	4	PANAMAX			29 472,00

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
S_CMC_a1#	CM_CD	1	ANGLYS			– 18 260,00
S_CMC_a2#	CM_CD	1	ANGLYS			– 37 630,00
S_CMC_b1#	CM_CD	1	URANAS			– 70 460,00
S_CMC_c1#	CM_CD	2	BRENT ŽALIA NAFTA			8 320,00
S_CMC_d1#	CM_CD	2	WTI ŽALIA NAFTA			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	PLIENAS			4 080,00
S_CMC_j1#	CM_CD	5	VARIS			– 10 219,80
S_CMC_k1#	CM_CD	6	GAMTINĖS DUJOS			4 222,50
S_CMC_l1#	CM_CD	6	SUSKYSTINTOS GAMTINĖS DUJOS			4 222,50
S_CMC_m1#	CM_CD	7	AUKSAS			1 353,33
S_CMC_n1#	CM_CD	7	SIDABRAS			– 676,67
S_CMC_o1#	CM_CD	8	SOJOS			10 435,00
S_CMC_p1#	CM_CD	8	KUKURŪZAI			– 14 735,00

Priemonė	Rizikos veiksnio identifikatorius	Grupė	Papildomas identifikatorius	Antras papildomas identifikatorius	Kredito kokybės kategorija	Jautrumas rizikai
S_CMC_q1#	CM_CD	9	ŽUVIS			6 700,00
S_CMC_r1#	CM_CD	9	IŠRŪGOS			– 3 012,00
S_CMC_s1#	CM_CD	10	KAKAVA			– 1 415,00
S_CMC_t1#	CM_CD	10	KAUČIUKAS			– 7 817,20
S_CMC_u1#	CM_CD	11	PLOKŠČIASIS STIKLAS			14 200,00
S_CMC_v1#	CM_CD	11	POTAŠAS			– 21 300,00
S_CMC_x1#	CM_CD	9	PIENAS			– 4 700,00
S_CMC_y1#	CM_CD	1	URANAS			– 66 344,00
S_CMC_z1#	CM_CD	4	PANAMAX			– 22 856,00

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

Portfelis	Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Priemonės
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#

Portfelis	Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Priemonės
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#

Portfelis	Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Priemonės
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	KREIVUMAS	S_IRC_b1#
G047	GIRR	KREIVUMAS	S_IRC_c1#
G048	GIRR	KREIVUMAS	S_IRC_a1# S_IRC_b1#
G049	GIRR	KREIVUMAS	S_IRC_d1#
G050	GIRR	KREIVUMAS	S_IRC_b1# S_IRC_c1#
G051	GIRR	KREIVUMAS	S_IRC_c1# S_IRC_e1#
G052	GIRR	KREIVUMAS	S_IRC_d1# S_IRC_e1#
G053	GIRR	KREIVUMAS	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#

Portfelis	Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Priemonės
G054	GIRR	VISOS	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#

Portfelis	Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Priemonės
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#

Portfelis	Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Priemonės
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#

Portfelis	Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Priemonės
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#

Portfelis	Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Priemonės
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	KREIVUMAS	S_EQC_b1#
E089	EQ	KREIVUMAS	S_EQC_c1#
E090	EQ	KREIVUMAS	S_EQC_d1#
E091	EQ	KREIVUMAS	S_EQC_e1#
E092	EQ	KREIVUMAS	S_EQC_f1#
E093	EQ	KREIVUMAS	S_EQC_g1#
E094	EQ	KREIVUMAS	S_EQC_h1#
E095	EQ	KREIVUMAS	S_EQC_i1#
E096	EQ	KREIVUMAS	S_EQC_j1#
E097	EQ	KREIVUMAS	S_EQC_k1#
E098	EQ	KREIVUMAS	S_EQC_q1#
E099	EQ	KREIVUMAS	S_EQC_t1#
E100	EQ	KREIVUMAS	S_EQC_u1#
E101	EQ	KREIVUMAS	S_EQC_a1# S_EQC_a2#
E102	EQ	KREIVUMAS	S_EQC_a1# S_EQC_b1#
E103	EQ	KREIVUMAS	S_EQC_f1# S_EQC_ac1#
E104	EQ	KREIVUMAS	S_EQC_j1# S_EQC_ag1#
E105	EQ	KREIVUMAS	S_EQC_k1# S_EQC_ah1#
E106	EQ	KREIVUMAS	S_EQC_q1# S_EQC_r1#
E107	EQ	KREIVUMAS	S_EQC_t1# S_EQC_v1#

Portfelis	Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Priemonės
E108	EQ	KREIVUMAS	S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_y1# S_EQC_z1#
E109	EQ	KREIVUMAS	S_EQC_s1#
E110	EQ	KREIVUMAS	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	KREIVUMAS	S_EQC_a2# S_EQC_q1#
E112	EQ	KREIVUMAS	S_EQC_t1# S_EQC_u1#
E113	EQ	KREIVUMAS	S_EQC_a2# S_EQC_t1#
E114	EQ	KREIVUMAS	S_EQC_a1# S_EQC_b1# S_EQC_d1# S_EQC_s1#
E115	EQ	KREIVUMAS	S_EQC_a1# S_EQC_b1# S_EQC_t1# S_EQC_u1#
E116	EQ	KREIVUMAS	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	VISOS	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#

Portfelis	Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Priemonės
			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#

Portfelis	Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Priemonės
F015	FX	KREIVUMAS	S_FXC_b1#
F016	FX	KREIVUMAS	S_FXC_c1#
F017	FX	KREIVUMAS	S_FXC_a1# S_FXC_b1#
F018	FX	KREIVUMAS	S_FXC_d1#
F019	FX	KREIVUMAS	S_FXC_b1# S_FXC_c1#
F020	FX	KREIVUMAS	S_FXC_c1# S_FXC_e1#
F021	FX	KREIVUMAS	S_FXC_b1# S_FXC_d1# S_FXC_e1#
F022	FX	KREIVUMAS	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	VISOS	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	KREIVUMAS	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#

Portfelis	Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Priemonės
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#

Portfelis	Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Priemonės
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#

Portfelis	Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Priemonės
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	KREIVUMAS	S_CNC_b1#
N066	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_c1#
N067	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_d1#
N068	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_e1#
N069	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_f1#
N070	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_g1#
N071	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_h1#
N072	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_i1#
N073	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_aa1#
N074	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_j1#
N075	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_k1#
N076	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_l1#
N077	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_m1#
N078	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_n1#
N079	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_o1#
N080	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_p1#

Portfelis	Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Priemonės
N081	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_q1#
N082	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_t1#
N083	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_u1#
N084	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_a1# S_CNC_a2#
N085	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_a1# S_CNC_b1#
N086	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_q1# S_CNC_r1#
N087	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_t1# S_CNC_v1#
N088	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_u1# S_CNC_w1#
N089	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_y1# S_CNC_z1#
N090	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_s1#
N091	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	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	KREIVUMAS	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	KREIVUMAS	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	KREIVUMAS	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	KREIVUMAS	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	KREIVUMAS	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	KREIVUMAS	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	KREIVUMAS	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	KREIVUMAS	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	KREIVUMAS	S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N101	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_c1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_z1#
N102	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_a1# S_CNC_b1# S_CNC_d1# S_CNC_s1#

Portfelis	Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Priemonės
N103	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	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	VISOS	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#

Portfelis	Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Priemonės
N104(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	S_CNC_ab1#
N105(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	KREIVUMAS	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#

Portfelis	Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Priemonės
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#

Portfelis	Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Priemonės
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	KREIVUMAS	S_CMC_b1#
C052	CM	KREIVUMAS	S_CMC_c1#
C053	CM	KREIVUMAS	S_CMC_e1#
C054	CM	KREIVUMAS	S_CMC_g1#
C055	CM	KREIVUMAS	S_CMC_i1#
C056	CM	KREIVUMAS	S_CMC_k1#
C057	CM	KREIVUMAS	S_CMC_m1#
C058	CM	KREIVUMAS	S_CMC_o1#
C059	CM	KREIVUMAS	S_CMC_q1#
C060	CM	KREIVUMAS	S_CMC_s1#
C061	CM	KREIVUMAS	S_CMC_u1#
C062	CM	KREIVUMAS	S_CMC_a1# S_CMC_a2#
C063	CM	KREIVUMAS	S_CMC_a1# S_CMC_b1#
C064	CM	KREIVUMAS	S_CMC_c1# S_CMC_d1#
C065	CM	KREIVUMAS	S_CMC_e1# S_CMC_f1#
C066	CM	KREIVUMAS	S_CMC_g1# S_CMC_h1#
C067	CM	KREIVUMAS	S_CMC_i1# S_CMC_j1#
C068	CM	KREIVUMAS	S_CMC_k1# S_CMC_l1#
C069	CM	KREIVUMAS	S_CMC_m1# S_CMC_n1#
C070	CM	KREIVUMAS	S_CMC_o1# S_CMC_p1#
C071	CM	KREIVUMAS	S_CMC_q1# S_CMC_r1#
C072	CM	KREIVUMAS	S_CMC_s1# S_CMC_t1#
C073	CM	KREIVUMAS	S_CMC_u1# S_CMC_v1#
C074	CM	KREIVUMAS	S_CMC_a2# S_CMC_b1#
C075	CM	KREIVUMAS	S_CMC_g1# S_CMC_z1#

Portfelis	Rizikos klasė	Sudedamoji dalis	Priemonės
C076	CM	KREIVUMAS	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	KREIVUMAS	S_CMC_a2# S_CMC_u1#
C078	CM	KREIVUMAS	S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_y1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_x1#
C079	CM	KREIVUMAS	S_CMC_x1# S_CMC_g1# S_CMC_z1#
C080	CM	KREIVUMAS	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	VISOS	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#“