Eiropas Savienības
Oficiālais Vēstnesis

LV
L sērija

2025/379

12.3.2025.

KOMISIJAS ĪSTENOŠANAS REGULA (ES) 2025/379

(2025. gada 26. februāris),

ar ko Īstenošanas regulā (ES) 2016/2070 noteiktos īstenošanas tehniskos standartus groza attiecībā uz salīdzinošās vērtēšanas portfeļiem, pārskatu sniegšanas veidnēm un pārskatu sniegšanas norādījumiem, kas piemērojami Savienībā attiecībā uz Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvas 2013/36/ES 78. panta 2. punktā noteikto ziņošanu

(Dokuments attiecas uz EEZ)

EIROPAS KOMISIJA,

ņemot vērā Līgumu par Eiropas Savienības darbību,

ņemot vērā Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvu 2013/36/ES (2013. gada 26. jūnijs) par piekļuvi kredītiestāžu darbībai un kredītiestāžu un ieguldījumu brokeru sabiedrību prudenciālo uzraudzību, ar ko groza Direktīvu 2002/87/EK un atceļ Direktīvas 2006/48/EK un 2006/49/EK ([1]), un jo īpaši tās 78. panta 8. punkta trešo daļu,

tā kā:

(1) Saskaņā ar Direktīvas 2013/36/ES 78. panta 1. punktu iestādēm, kurām atļauts izmantot iekšējās pieejas, ir pienākums pietiekami bieži, bet ne retāk kā reizi gadā iesniegt savai kompetentajai iestādei savu riska darījumu riska svērto vērtību vai pašu kapitāla prasību aprēķinu rezultātus, kas iegūti saskaņā ar to iekšējām pieejām riska darījumiem vai pozīcijām, kuras iekļautas etalona portfeļos, lai minētā kompetentā iestāde varētu novērtēt minēto iekšējo pieeju kvalitāti ("salīdzinošā novērtēšana"). Saskaņā ar minētās direktīvas 78. panta 3. punkta otro daļu Eiropas Banku iestādei (EBI) ir jāsagatavo ziņojums, lai palīdzētu kompetentajām iestādēm novērtēt iestāžu iekšējo pieeju kvalitāti, pamatojoties uz salīdzinošās novērtēšanas rezultātiem. Pārskatu sniegšanas prasības attiecībā uz salīdzinošo novērtēšanu ir noteiktas Komisijas Īstenošanas regulā (ES) 2016/2070 ([2]), kas tikusi vairākkārt grozīta. Lai atspoguļotu izmaiņas kompetento iestāžu novērtējumu un EBI ziņojumu fokusā, un ņemot vērā izmaiņas tiesību aktos tirgus riska jomā, ir atkārtoti jāatjaunina salīdzinošās vērtēšanas portfeļi kopā ar minētajā īstenošanas regulā noteiktajām pārskatu sniegšanas prasībām.

(2) Attiecībā uz kredītriska salīdzinošo novērtēšanu norādījumi būtu jāmaina, lai precizētu, ka pārskatu sniegšanai par saistību nepildīšanas varbūtības (*PD*) un saistību nepildīšanas zaudējumu (*LGD*) riska parametriem ir obligāts raksturs attiecībā uz piesardzības rezervi (PR), regulatīvo palielinājumu un lejupslīdes (*DWT*) komponentiem, kas var būt par pamatu modeļu mainīgumam. Turklāt, lai vienkāršotu paziņoto datu turpmāku izmantošanu, būtu jāprecizē, ka iestādēm ir jāziņo modeļu identifikators, ko piešķīrusi kompetentā iestāde.

(3) Ar Komisijas Deleģēto regulu (ES) 2024/2795 ([3]) tika atlikta jauno pašu kapitāla prasību attiecībā uz tirgus risku piemērošanas diena. Tāpēc šajā novērtēšanā netiek aizstātas pašreizējā iekšējā modeļa pieejas veidnes. Vienlaikus, lai iekļautu papildu portfeļus salīdzinājumā ar 2024. gada novērtēšanu, kuras tvērumā bija tikai procentu likmju instrumenti, būtu jāparedz izvērstākas veidnes standartizētās pieejas validēšanai. Tas tiek darīts ar mērķi nodrošināt pienācīgu uzraudzību un jaunās standartizētās pieejas, ko izmanto pašu kapitāla minimālās robežvērtības aprēķināšanai, netraucētu īstenošanu.

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

([2]) Komisijas Īstenošanas regula (ES) 2016/2070 (2016. gada 14. septembris), ar ko nosaka īstenošanas tehniskos standartus attiecībā uz veidnēm, definīcijām un IT risinājumiem, kas jāizmanto iestādēm, ziņojot Eiropas Banku iestādei un kompetentajām iestādēm saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvas 2013/36/ES 78. panta 2. punktu (OV L 328, 2.12.2016., 1. lpp., ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2016/2070/oj).

([3]) Komisijas Deleģētā regula (ES) 2024/2795 (2024. gada 24. jūlijs), ar ko attiecībā uz datumu, kurā sāk piemērot pašu kapitāla prasības attiecībā uz tirgus risku, groza Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 575/2013 (OV L, 2024/2795, 31.10.2024., ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2024/2795/oj).

(4) Tāpēc Īstenošanas regula (ES) 2016/2070 būtu attiecīgi jāgroza.

(5) Šī regula ir balstīta uz īstenošanas tehnisko standartu projektu, ko Komisijai iesniegusi EBI.

(6) EBI ir īstenojusi atklātu sabiedrisko apspriešanu par īstenošanas tehnisko standartu projektu, kurš ir šīs regulas pamatā, analizējusi iespējamās saistītās izmaksas un ieguvumus un lūgusi konsultāciju Banku nozares ieinteresēto personu grupai, kas izveidota saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 1093/2010 ([4]) 37. pantu,

IR PIEŅĒMUSI ŠO REGULU.

1. pants

Īstenošanas regulu (ES) 2016/2070 groza šādi:

1) regulas IV pielikumu aizstāj ar šīs regulas I pielikuma tekstu;

2) regulas V pielikumu aizstāj ar šīs regulas II pielikuma tekstu;

3) regulas VI pielikumu aizstāj ar šīs regulas III pielikuma tekstu;

4) regulas VII pielikumu aizstāj ar šīs regulas IV pielikuma tekstu;

5) regulas X pielikumu aizstāj ar šīs regulas V pielikuma tekstu.

2. pants

Šī regula stājas spēkā divdesmitajā dienā pēc tās publicēšanas *Eiropas Savienības Oficiālajā Vēstnesī.*

Šī regula uzliek saistības kopumā un ir tieši piemērojama visās dalībvalstīs.

Briselē, 2025. gada 26. februāri

Komisijas vārdā –
priekšsēdētāja
Ursula VON DER LEYEN

([4]) Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) Nr. 1093/2010 (2010. gada 24. novembris), ar ko izveido Eiropas Uzraudzības iestādi (Eiropas Banku iestādi), groza Lēmumu Nr. 716/2009/EK un atceļ Komisijas Lēmumu 2009/78/EK (OV L 331, 15.12.2010., 12. lpp., ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2010/1093/oj).

I PIELIKUMS

"IV PIELIKUMS

REZULTĀTU UZRAUDZĪBAS SALĪDZINOŠĀS VĒRTĒŠANAS PORTFEĻI

I DAĻA. VISPĀRĪGI NORĀDĪJUMI

II DAĻA. NORĀDĪJUMI SAISTĪBĀ AR VEIDNI

C 101 – Sīkāka informācija par riska darījumiem zemas iespējamības saistību neizpildes portfeļos pa darījumu partneriem

C 102 – Sīkāka informācija par riska darījumiem zemas iespējamības saistību neizpildes portfeļos

C 103 – Sīkāka informācija par riska darījumiem augstas iespējamības saistību neizpildes portfeļos

C 105.01 – Iekšējo modeļu definīcija

C 105.02 – Iekšējo modeļu attiecināšana uz portfeļiem

C 105.03 – Iekšējo modeļu attiecināšana uz valstīm

I DAĻA. VISPĀRĪGI NORĀDĪJUMI

1. Informāciju iesniedz tikai par tiem darījumu partneriem un portfeļiem, kuros atsauces datumā pastāv faktisks riska darījums vai nu kā sākotnējais riska darījums vai kā riska darījums pēc kredītriska mazināšanas. Informāciju neiesniedz par tiem darījumu partneriem un portfeļiem, kuriem atsauces datumā nav riska darījuma.

2. Informāciju iesniedz tikai par tiem riska darījumiem, kuriem kompetentā iestāde apstiprinājusi iekšējo modeli riska darījumu riska svērtās vērtības (RDRSV) aprēķināšanai. C 101. veidnē nenorāda darījumu partneru kodus, kas beidzas ar "STDA". Pārējiem darījumu partneru kodiem, kas norādīti I pielikuma C 101. veidnē, un salīdzinošās novērtēšanas portfeļiem, kas minēti C 102. un C 103. veidnē, izslēdz riska darījumus saskaņā ar standartizēto pieeju un riska darījumus, attiecībā uz kuriem attiecīgā kompetentā iestāde ir atļāvusi uz laiku vai pastāvīgi daļēji izmantot standartizēto pieeju.

3. Laukus, kuros vāc informāciju, kas nav skaidri formulēta vai nav piemērojama, vai nu atstāj tukšus, vai iekļauj norādi "*NULL*". Tas attiecas arī uz riska darījumu, kurā netiek pildītas saistības (*EAD*), svērtajiem daudzumiem vai parametriem, kurus nevar aprēķināt. Tāpat arī datu laukus, kuros ziņošana nav obligāta, var atstāt neaizpildītus vai iesniegt kā "*NULL*". Nulles vērtības uzrāda tikai tad, ja mērķis ir uzrādīt daudzumu vai parametru nulles apmērā. Nevienu no norādēm "tukšs" vai "*NULL*" neizmanto, lai paziņotu nulles daudzumus vai parametrus.

4. Naudas summas uzrāda tādā pašā veidā, kā tās uzrāda pašu kapitāla prasību aprēķināšanai konkrētā atsauces datumā saskaņā ar Komisijas Īstenošanas regulu (ES) 2021/451 ([1]).

([1]) Komisijas Īstenošanas regula (ES) 2021/451 (2020. gada 17. decembris), ar ko nosaka īstenošanas tehniskos standartus Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 575/2013 piemērošanai attiecībā uz iestāžu sniegtajiem uzraudzības pārskatiem un atceļ Īstenošanas regulu (ES) Nr. 680/2014 (OV L 97, 19.3.2021., 1. lpp., ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2021/451/oj).

C 101 – Sīkāka informācija par riska darījumiem zemas iespējamības saistību neizpildes portfeļos pa darījumu partneriem

Specializētās kreditēšanas riska darījumus neiekļauj.

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0010	Darījumu partnera kods	I pielikuma C 101. veidnes 0010. sleja	Uzrāda zemas iespējamības saistību neizpildes ("LDP") izlases portfeļos iekļauto darījumu partnera kodu, kas darījumu partnerim piešķirts I pielikuma C101. veidnes 0010. slejā. Šis kods ir rindas identifikators, un tas ir unikāls katrai veidnes rindai.
0020	Riska darījumu klase	Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 II pielikuma 76. punkts	Katru darījumu partneri iedala vienā no šādām riska darījumu kategorijām: a) centrālās bankas un centrālās valdības; b) iestādes; c) komercsabiedrības – MVU (mazie un vidējie uzņēmumi); d) komercsabiedrības – specializētā kreditēšana; e) komercsabiedrības – citas; f) privātpersonas vai MVU – nodrošināti ar MVU nekustamo īpašumu; g) privātpersonas vai MVU – nodrošināti ar nekustamo īpašumu, kas nav MVU nekustamais īpašums; h) privātpersonas vai MVU – atbilstīgi atjaunojami; i) privātpersonas vai MVU – citi MVU; j) privātpersonas vai MVU – citi, kas nav MVU; k) nepiemēro. "Nepiemēro" izmanto, ja neviena no sarakstā minētajām atbildēm nav piemērojama, kad riska darījumus ar darījumu partneri klasificē dažādās riska darījumu kategorijās, no kurām neviena nav skaidri dominējoša.
0040	Reitings		Uzrāda iekšējā reitinga kategorijas pakāpi, kas piešķirta darījumu partnerim iestādes piemērojamajā iekšējā reitingu skalā. Tas atbilst numerācijas secībai 1, 2, 3 u. c. no zemākā riska līdz augstākajam riskam, izņemot saistību neizpildi ar *PD*, kas atbilst 100 %. Ja iestāde izmanto nepārtrauktu reitingu skalu saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 575/2013 ([2]) 169. panta 3. punktu, izmanto reitingu kategorijas, kas uzrādītas Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 I pielikuma C 08.02. veidnes 0005. slejā. Ja riska darījumi ar darījumu partneri ir iedalīti vairākās reitingu kategorijās saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 172. panta 1. punkta e) apakšpunkta i) vai iii) punktu, uzrāda nulles reitingu kategoriju (0).

([2]) Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) Nr. 575/2013 (2013. gada 26. jūnijs) par prudenciālajām prasībām attiecībā uz kredītiestādēm un ieguldījumu brokeru sabiedrībām, un ar ko groza Regulu (ES) Nr. 648/2012 (OV L 176, 27.6.2013., 1. lpp., ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2013/575/oj).

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0050	Jaunākais darījumu partnera reitinga noteikšanas datums		Uzrāda jaunāko darījumu partnera reitinga noteikšanas datumu.
0060	*PD*	Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 I pielikuma C 08.01. veidnes 0010. sleja	Uzrāda darījumu partnerim piešķirto *PD*. *PD* ir *PD*, ko izmanto RDRSV aprēķināšanā, izņemot to pasākumu ietekmi, kas ieviesti saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 458. pantu. *PD*, kas izteikta kā vērtība no 0 līdz 1.
0070	Saistību neizpildes statuss		Uzrāda darījumu partnera saistību neizpildes statusu. Saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 178. pantu tas ir viens no turpmāk minētajiem: a) ar saistību neizpildi; b) bez saistību neizpildes.
0080	Sākotnējā riska darījuma vērtība pirms korekcijas pakāpēm	Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 I pielikuma C 08.01. veidnes 0020. sleja	Uzrāda sākotnējo riska darījuma vērtību, pirms ir ņemtas vērā jebkādas vērtības korekcijas, uzkrājumi vai ietekme, ko rada kredītriska mazināšanas metodes vai korekcijas pakāpes.
0090	Riska darījuma vērtība pēc KRM aizstāšanas ietekmes, pirms korekcijas pakāpēm	Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 I pielikuma C 08.01. veidnes 0090. sleja	Uzrāda summu, kurai piemēro kredīta korekcijas pakāpes (*CCF*), lai iegūtu *EAD* (0110. sleja). To dara, ņemot vērā kredītriska mazināšanas metodes ar aizstāšanas ietekmi uz riska darījumu.
0100	*CCF* (kredīta korekcijas pakāpes)	Regulas (ES) Nr. 575/2013 166. panta 8. punkts.	Uzrāda svērtās vidējās kredīta korekcijas pakāpes. Izmantotie svērumi ir summas, kurām piemēro kredīta korekcijas pakāpes, lai iegūtu *EAD*. Darījumu partneriem, kuru kredītiespējas atbilst tikai Regulas (ES) Nr. 575/2013 166. panta 8. punktā minētajiem posteņiem, kredīta korekcijas pakāpju vidējo svērto vērtību nosaka, balstoties uz visām kredītiespējām. Darījumu partneriem, uz kuru kredītiespējām neattiecas Regulas (ES) Nr. 575/2013 166. panta 8. punktā minētie posteņi, kredīta korekcijas pakāpes vai nu atstāj tukšas, vai ievieto norādi "*NULL*".

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
			Darījumu partneriem ar kredītiespējām, kas atbilst Regulas (ES) Nr. 575/2013 166. panta 8. punktā minētajiem posteņiem, un ar kredītiespējām, kas neietilpst minētās regulas 166. panta 8. punktā minētajos posteņos, kredīta korekcijas pakāpes uzrādīto kredīta korekcijas pakāpes vidējo svērto vērtību balsta tikai uz kredītiespējām, kas atbilst Regulas (ES) Nr. 575/2013 166. panta 8. punktā minētajiem posteņiem. Aprēķinā jo īpaši neņem vērā kredītiespējas, kas atbilst minētās regulas 166. panta 10. punktā minētajiem posteņiem. Ja iestāde piemēro pašu aplēses attiecībā uz kredīta korekcijas pakāpēm Regulas (ES) Nr. 575/2013 166. panta 8. punktā minētajiem posteņiem, minētās kredīta korekcijas pakāpes izmanto, lai aprēķinātu kredīta korekcijas pakāpju vidējo svērto vērtību. Ja iestāde nepiemēro pašu aplēses attiecībā uz kredīta korekcijas pakāpēm Regulas (ES) Nr. 575/2013 166. panta 8. punktā minētajiem posteņiem, izmanto Regulas (ES) Nr. 575/2013 166. panta 8. punktā minētās regulatīvās kredīta korekcijas pakāpes. *CCF*, kas izteikta kā vērtība no 0 līdz 1.
0110	Riska darījums, kurā netiek pildītas saistības (*EAD*)	Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 I pielikuma C 08.01. veidnes 0110. sleja	Uzrāda riska darījuma vērtību.
0120	Nodrošinājuma vērtība	Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 I pielikuma C 08.01. veidnes 0150.–0210. sleja	Uzrāda nodrošinājuma tirgus vērtību.
0130	Augstākās prioritātes nenodrošināti *Hyp LGD* (zaudējumi, kas var rasties saistību nepildīšanas gadījumā) bez negatīvas ķīlas	Regulas (ES) Nr. 575/2013 161. pants	Iespējamās pašu aplēses attiecībā uz zaudējumiem, kas var rasties saistību nepildīšanas gadījumā (“*LGD*”), ko iestāde piemērotu riska darījumiem ar darījumu partneri, uzrāda saskaņā ar šādiem noteikumiem: a) riska darījumu apjoms ir tāds pats kā *LGD* vērtībai, kas uzrādīta 0150. slejā; b) riska darījumiem ir augstāka prioritāte, un tie ir nenodrošināti; c) negatīvas ķīlas klauzulas nav. Negatīvas ķīlas klauzula ir klauzula, kas paredz, ka aizņēmējs vai parāda emitents savus aktīvus neieķīlās citai personai.

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0140	Augstākās prioritātes nenodrošināti *Hyp LGD* (zaudējumi, kas var rasties saistību nepildīšanas gadījumā) ar negatīvu ķīlu	Regulas (ES) Nr. 575/2013 161. pants	Iespējamās pašu aplēses attiecībā uz zaudējumiem, kas var rasties saistību nepildīšanas gadījumā (*LGD*), ko iestāde piemērotu riska darījumiem ar darījumu partneri, uzrāda saskaņā ar šādiem noteikumiem: a) riska darījumu apjoms ir tāds pats kā *LGD* vērtībai, kas uzrādīta 0150. slejā; b) riska darījumiem ir augstāka prioritāte, un tie ir nenodrošināti; c) ir negatīvas ķīlas klauzula. Negatīvas ķīlas klauzula ir klauzula, kas paredz, ka aizņēmējs vai parāda emitents savus aktīvus neieķīlās citai personai.
0150	*LGD* (zaudējumi, kas var rasties saistību nepildīšanas gadījumā)	Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 I pielikuma C 08.01. veidnes 0230. un 0240. sleja	Uzrāda *EAD* vidējo svērto vērtību attiecībā uz riska darījumu *LGD* vērtību darījumos ar katru darījumu partneri. *LGD* ir tie, kurus izmanto riska darījumu riska svērtās vērtības aprēķināšanai. Konkrētāk, ja iestāde ir saņēmusi kompetentās iestādes atļauju izmantot pašu aplēses attiecībā uz *LGD*, *LGD* pamatā ir pašas iestādes aplēses, pretējā gadījumā *LGD* pamatā ir regulatīvās *LGD* vērtības, ņemot vērā piemērojamo riska mazināšanu. Ietver *LGD* lielām regulētām finanšu sektora sabiedrībām un neregulētam finanšu sektora sabiedrībām. Izslēdz to pasākumu ietekmi, kas ieviesti saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 458. pantu. *LGD* izsaka kā vērtību no 0 līdz 1.
0160	Termiņš	Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 I pielikuma C 08.01. veidnes 0250. sleja	Uzrāda *EAD* svērto termiņu riska darījumiem ar konkrēto darījumu partneri. To izsaka kā dienu skaitu.
0170	RDRSV	Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 I pielikuma C 08.01. veidnes 0260. sleja	Uzrāda riska darījumu riska svērto vērtību pēc atbalsta faktoriem (MVU un infrastruktūras atbalsta faktoriem). Riska darījumu riska svērtā vērtība neietver iespējamo pasākumu ietekmi, kas veikti saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 458. pantu.

C 102 – Sīkāka informācija par riska darījumiem zemas iespējamības saistību neizpildes portfeļos

Attiecībā uz I pielikumā minētajiem portfeļiem ar nodrošinājuma statusu, kas nav "Nepiemēro", šādu informāciju var nesniegt, ja apstiprinātajam modelim nav pielāgotu atsevišķu *LGD* aprēķinu riska darījuma nodrošinātajām un nenodrošinātajām daļām: *LGD* (0130. sleja), *LGD* bez uzraudzības pasākumiem (0131. sleja), *LGD* bez piesardzības rezerves (PR) un uzraudzības pasākumiem (0132. sleja), *LGD* bez PR, uzraudzības pasākumiem un lejupslīdes komponenta (0133. sleja), paredzamo zaudējumu summa (0150. sleja) un RDRSV (0170. sleja).

Attiecībā uz portfeļiem ar regulatīvo pieeju, kas definēta kā "specializētās kreditēšanas iedalījuma kritēriji", šādu informāciju var nenorādīt: *PD* (0060. sleja), *PD* bez uzraudzības pasākumiem (0061. sleja), *PD* bez PR un uzraudzības pasākumiem (0062. sleja), *LGD* (0130. sleja), *LGD* bez uzraudzības pasākumiem (0131. sleja), *LGD* bez PR un uzraudzības pasākumiem (0132. sleja), *LGD* bez PR, uzraudzības pasākumiem un lejupslīdes komponenta (0133. sleja).

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0010	Portfeļa ID	I pielikuma C 102. veidnes 0010. sleja	Uzrāda portfeļa ID I pielikuma C 102. veidnes 0010. slejā, kurā definēts portfelis. Šis ID ir rindas identifikators, un tas ir unikāls katrai veidnes rindai. Riska darījumu iedalīšana portfeļa ID nav izslēdzoša: riska darījumus vai riska darījumu daļas uzrāda saskaņā ar katru piemērojamo portfeļa ID.
0040	Parādnieku skaits		Uzrāda parādnieku skaitu. To balsta uz parādniekiem, kuru riska darījumu vērtība ir izteikti pozitīva un uzrādīta vai nu 0080. slejā, vai 0090. slejā. Ja kredītriska mazināšanas metodes dēļ piemēro pilnīgu aizstāšanu, sākotnējo parādnieku pievieno tā sākotnējā portfeļa "Parādnieku skaitam", un garantijas devēju pievieno garantijas devēju portfeļa "Parādnieku skaitam".
0060	*PD*	Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 I pielikuma C 08.01. veidnes 0010. sleja	*PD* ir *PD*, ko izmanto RDRSV aprēķināšanā, izņemot to iespējamo pasākumu ietekmi, kas ieviesti saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 458. pantu. Attiecībā uz portfeļiem, kuri atbilst individuālai kategorijai vai portfelim, uzrāda konkrētajai parādnieku kategorijai vai portfelim noteikto *PD*. Attiecībā uz portfeļiem, kuri atbilst atšķirīgu kategoriju vai portfeļu parādnieku apkopojumam, uzrāda *EAD* svērto vidējo *PD*, kas noteikta apkopojumā ietvertajiem riska darījumiem. *PD*, kas izteikta kā vērtība no 0 līdz 1.
0061	*PD* bez uzraudzības pasākumiem		*PD* bez uzraudzības pasākumiem ir *PD*, kuras pamatā ir Regulas (ES) Nr. 575/2013 179. un 180. panta noteikumi, kas ietver iestādes pievienoto PR, bet neietver kompetento iestāžu noteiktos pasākumus (reizinātājus, papildinājumus, minimālās robežvērtības vai līdzīgus pasākumus, kas tieši palielina *PD*). Attiecībā uz portfeļiem, kas atbilst atsevišķai kategorijai vai portfelim, uzrāda *PD* šai kategorijai, ieskaitot PR, bet neieskaitot uzraudzības pasākumus. Attiecībā uz portfeļiem, kuri atbilst atšķirīgu kategoriju vai portfeļu parādnieku apkopojumam, uzrāda *EAD* svērto vidējo *PD* attiecīgajiem riska darījumiem, ieskaitot PR, bet neieskaitot uzraudzības pasākumus. *PD* bez uzraudzības pasākumiem, kas izteikta kā vērtība no 0 līdz 1. Ja iestāde nespēj izolēt attiecīgās konservatīvās korekcijas, piemēro I daļas 3. punktu.

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0062	*PD* bez PR un uzraudzības pasākumiem		*PD* bez PR un uzraudzības pasākumiem ir *PD*, kas neietver ne PR, ko iestāde pievienojusi saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 179. panta 1. punkta f) apakšpunktu un 180. panta 1. punkta e) apakšpunktu, ne kompetento iestāžu noteikto pasākumu ietekmi (reizinātāji, papildinājumi, minimālās robežvērtības vai līdzīgi pasākumi, kas tieši palielina *PD*). Attiecībā uz portfeļiem, kas atbilst atsevišķai kategorijai vai portfelim, uzrāda *PD* šai kategorijai, neieskaitot PR un neieskaitot uzraudzības pasākumus. Attiecībā uz portfeļiem, kuri atbilst atšķirīgu kategoriju vai portfeļu parādnieku apkopojumam, uzrāda *EAD* svērto vidējo *PD* attiecīgajiem riska darījumiem, neieskaitot PR un neieskaitot uzraudzības pasākumus. *PD* bez PR un uzraudzības pasākumiem, kas izteikta kā vērtība no 0 līdz 1. Ja iestāde nespēj izolēt attiecīgās konservatīvās korekcijas, piemēro I daļas 3. punktu.
0080	Sākotnējā riska darījuma vērtība pirms korekcijas pakāpēm	Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 I pielikuma C 08.01. veidnes 0020. sleja	Uzrāda sākotnējo riska darījuma vērtību, pirms ir ņemtas vērā jebkādas vērtības korekcijas, uzkrājumi vai ietekme, ko rada kredītriska mazināšanas metodes vai korekcijas pakāpes.
0090	Riska darījuma vērtība pēc KRM aizstāšanas ietekmes, pirms korekcijas pakāpēm	Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 I pielikuma C 08.01. veidnes 0090. sleja	Uzrāda summu, kurai piemēro kredīta korekcijas pakāpes (*CCF*), lai iegūtu *EAD* (0110. sleja). To dara, ņemot vērā kredītriska mazināšanas metodes ar aizstāšanas ietekmi uz riska darījumu.
0100	*CCF* (kredīta korekcijas pakāpes)	Regulas (ES) Nr. 575/2013 166. panta 8. punkts.	Uzrāda svērtās vidējās kredīta korekcijas pakāpes. Izmantotie svērumi ir summas, kurām piemēro kredīta korekcijas pakāpes, lai iegūtu *EAD*. Portfeļiem, kuriem ir kredītiespējas tikai attiecībā uz Regulas (ES) Nr. 575/2013 166. panta 8. punktā minētajiem posteņiem, kredīta korekcijas pakāpju vidējo svērto vērtību nosaka, balstoties uz visām kredītiespējām. Portfeļiem, kuriem ir tikai kredītiespējas, uz kuriem neattiecas neviens no Regulas (ES) Nr. 575/2013 166. pantā minētajiem posteņiem, kredīta korekcijas pakāpju vidējo svērto vērtību vai nu atstāj tukšu, vai ievieto norādi "*NULL*". Portfeļiem, kas ietver kredītiespējas, kuras atbilst Regulas (ES) Nr. 575/2013 166. panta 8. punktā minētajiem posteņiem, un ar kredītiespējām, kas neietilpst minētās regulas 166. panta 8. punktā minētajos posteņos, kredīta korekcijas pakāpes uzrādīto vidējo svērto vērtību balsta tikai uz kredītiespējām, kas atbilst Regulas (ES) Nr. 575/2013 166. panta 8. punktā minētajiem

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

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
			posteņiem. Aprēķinā jo īpaši neņem vērā kredītiespējas, kas atbilst minētās regulas 166. panta 10. punktā minētajiem posteņiem. Ja iestāde piemēro pašu aplēses attiecībā uz kredīta korekcijas pakāpēm Regulas (ES) Nr. 575/2013 166. panta 8. punktā minētajiem posteņiem, minētās kredīta korekcijas pakāpes izmanto, lai aprēķinātu kredīta korekcijas pakāpju vidējo svērto vērtību. Ja iestāde nepiemēro *CCF* pašu aplēses attiecībā uz Regulas (ES) Nr. 575/2013 166. panta 8. punktā minētajiem posteņiem, izmanto Regulas (ES) Nr. 575/2013 166. panta 8. punktā minētās regulatīvās kredīta korekcijas pakāpes. *CCF*, kas izteikta kā vērtība no 0 līdz 1.
0110	Riska darījums, kurā netiek pildītas saistības (*EAD*)	Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 I pielikuma C 08.01. veidnes 0110. sleja	Uzrāda riska darījuma vērtību.
0120	Nodrošinājuma vērtība	Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 I pielikuma C 08.01. veidnes 0150.–0210. sleja	Uzrāda nodrošinājuma tirgus vērtību.
0130	*LGD* (zaudējumi, kas var rasties saistību nepildīšanas gadījumā)	Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 I pielikuma C 08.01. veidnes 0230. un 0240. sleja	Uzrāda *EAD* vidējo svērto vērtību attiecībā uz riska darījumu *LGD* vērtību attiecīgajā portfelī. *LGD* ir tie, kurus izmanto riska darījumu riska svērtās vērtības aprēķināšanai. Konkrētāk, ja iestāde ir saņēmusi kompetentās iestādes atļauju izmantot pašu aplēses attiecībā uz *LGD*, *LGD* pamatā ir pašu iestāžu aplēses, pretējā gadījumā *LGD* pamatā ir regulatīvās *LGD* vērtības, ņemot vērā piemērojamo riska mazināšanu. Ietver riska darījumus un attiecīgos *LGD* lielām regulētām finanšu sektora sabiedrībām un neregulētam finanšu sektora sabiedrībām. Izslēdz to pasākumu ietekmi, kas ieviesti saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 458. pantu. *LGD*, kas izteikta kā vērtība no 0 līdz 1.

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0131	*LGD* bez uzraudzības pasākumiem		*LGD* bez uzraudzības pasākumiem ir *LGD*, kuras pamatā ir Regulas (ES) Nr. 575/2013 179. un 181. panta noteikumi, kas ietver iestādes pievienoto PR, bet neietver kompetento iestāžu noteiktos pasākumus (reizinātājus, papildinājumus, minimālās robežvērtības vai līdzīgus pasākumus, kas tieši palielina *LGD*). Attiecībā uz portfeļiem, kas atbilst atsevišķai kategorijai vai portfelim, uzrāda *LGD* šai kategorijai, ieskaitot PR, bet neieskaitot uzraudzības pasākumus. Attiecībā uz portfeļiem, kuri atbilst atšķirīgu kategoriju vai portfeļu parādnieku apkopojumam, uzrāda *EAD* svērto vidējo *LGD* attiecīgajiem riska darījumiem, ieskaitot PR, bet neieskaitot uzraudzības pasākumus. *LGD* bez uzraudzības pasākumiem, kas izteikta kā vērtība no 0 līdz 1. Ja iestāde nespēj izolēt attiecīgās konservatīvās korekcijas, piemēro I daļas 3. punktu.
0132	*LGD* bez PR un uzraudzības pasākumiem		*LGD* bez PR un uzraudzības pasākumiem ir *LGD*, kas neietver ne PR, ko iestāde pievienojusi saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 179. panta 1. punkta f) apakšpunktu un 181. pantu, ne kompetento iestāžu noteikto pasākumu ietekmi (reizinātāji, papildinājumi, minimālās robežvērtības vai līdzīgi pasākumi, kas tieši palielina *LGD*). Attiecībā uz portfeļiem, kas atbilst atsevišķai kategorijai vai portfelim, uzrāda *LGD* šai kategorijai, neieskaitot PR un neieskaitot uzraudzības pasākumus. Attiecībā uz portfeļiem, kuri atbilst atšķirīgu kategoriju vai portfeļu parādnieku apkopojumam, uzrāda *EAD* svērto vidējo *LGD* attiecīgajiem riska darījumiem, neieskaitot PR un neieskaitot uzraudzības pasākumus. *LGD* bez PR un uzraudzības pasākumiem, kas izteikta kā vērtība no 0 līdz 1. Ja iestāde nespēj izolēt attiecīgās konservatīvās korekcijas, piemēro I daļas 3. punktu.
0133	*LGD* bez PR, uzraudzības pasākumiem un lejupslīdes komponenta,		*LGD* bez PR, uzraudzības pasākumiem un lejupslīdes komponenta ir *LGD*, kas neietver ne PR, ko iestāde pievienojusi saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 179. panta 1. punkta f) apakšpunktu un 181. pantu, ne kompetento iestāžu noteikto pasākumu ietekmi (reizinātāji, papildinājumi, minimālās robežvērtības vai līdzīgi pasākumi, kas tieši palielina *LGD*), ne lejupslīdes komponentu, kas prasīts minētās regulas 181. panta 1. punkta b) apakšpunktā. Attiecībā uz portfeļiem, kas atbilst atsevišķai kategorijai vai portfelim, uzrāda *LGD* šai kategorijai, neieskaitot PR, uzraudzības pasākumus un lejupslīdes komponentu. Attiecībā uz portfeļiem, kuri atbilst atšķirīgu kategoriju vai portfeļu parādnieku apkopojumam, uzrāda *EAD* svērto vidējo *LGD* attiecīgajiem riska darījumiem, neieskaitot PR, uzraudzības pasākumus un lejupslīdes komponentu.

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

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
			LGD bez PR, uzraudzības pasākumiem un lejupslīdes komponenta, kas izteikti kā vērtība no 0 līdz 1. Ja iestāde nespēj izolēt attiecīgās konservatīvās korekcijas, piemēro I daļas 3. punktu.
0140	Termiņš	Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 I pielikuma C 08.01. veidnes 0250. sleja	Uzrāda *EAD* svērto termiņu. To izsaka kā dienu skaitu. Minēto informāciju neuzrāda attiecībā uz riska darījumiem, kuros termiņš nav riska darījumu riska svērtās vērtības aprēķina elements. Minēto informāciju nesniedz par portfeļiem, kas veido riska darījumu kategorijas "Privātpersonas vai MVU" riska darījumus.
0150	Paredzamo zaudējumu apmērs	Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 I pielikuma C 08.01. veidnes 0280. sleja	Uzrāda paredzamo zaudējumu apmēru.
0160	Uzkrājumi riska darījumiem, kuros netiek pildītas saistības	Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 I pielikuma C 09.02. veidnes 0050., 0055. un 0060. sleja	Uzrāda rezerves riska darījumiem, kuros netiek pildītas saistības. Tie ietver visas vispārējās un specifiskās kredītriska korekcijas attiecībā uz riska darījumiem, kuriem iestājusies saistību neizpilde, kā norādīts Regulas (ES) Nr. 575/2013 110. pantā. (Vienreizējas) kredītriska korekcijas, ko iestāde piemēro saistībā ar saistību neizpildes definīcijas (*DoD*) īstenošanas izmaiņām, uzrāda, kā reģistrēts iestādes datubāzē.
0170	RDRSV	Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 I pielikuma C 08.01. veidnes 0260. sleja	Uzrāda riska svērtos aktīvus pēc atbalsta faktoriem (MVU un infrastruktūras atbalsta faktoriem). RDRSV neietver iespējamo pasākumu ietekmi, kas ieviesti saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 458. pantu.
0180	Standartizēta RDRSV	Regulas (ES) Nr. 575/2013 trešās daļas II sadaļas 2. nodaļa	Standartizēta RDRSV ir hipotētiskā RDRSV summa, kas iegūta, riska darījumiem piemērojot standartizēto pieeju kredītriskam, nevis *IRB* pieeju.

C 103 – Sīkāka informācija par riska darījumiem augstas iespējamības saistību neizpildes portfeļos

Attiecībā uz I pielikumā minētajiem portfeļiem ar nodrošinājuma statusu, kas nav "Nepiemēro", šādu informāciju var nesniegt, ja apstiprinātajam paraugam nav pielāgotu atsevišķu *LGD* aprēķinu riska darījuma nodrošinātajām un nenodrošinātajām daļām: *LGD* (0130. sleja), *LGD* bez uzraudzības pasākumiem (0131. sleja), *LGD* bez PR un uzraudzības pasākumiem (0132. sleja), *LGD* bez PR, uzraudzības pasākumiem un lejupslīdes komponenta (0133. sleja), paredzamo zaudējumu summa (0150. sleja), RDRSV (0170. sleja), zaudējumu likme pēdējā gadā (0210. sleja) un zaudējumu likme pēdējos 5 gados (0220. sleja).

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0010	Portfeļa ID		Uzrāda portfeļa ID I pielikuma C 103. veidnes 0010. slejā, kurā definēts portfelis. Šis ID ir rindas identifikators, un tas ir unikāls katrai veidnes rindai. Riska darījumu iedalīšana portfeļa ID nav izslēdzoša: riska darījumus vai riska darījumu daļas uzrāda saskaņā ar katru piemērojamo portfeļa ID.
0040	Parādnieku skaits		Piemēro norādījumus attiecībā uz I pielikuma C 102. veidnes 0040. sleju.
0060	*PD*		Piemēro norādījumus attiecībā uz I pielikuma C 102. veidnes 0060. sleju.
0061	*PD* bez uzraudzības pasākumiem		Piemēro norādījumus attiecībā uz I pielikuma C 102. veidnes 0061. sleju.
0062	*PD* bez PR un uzraudzības pasākumiem		Piemēro norādījumus attiecībā uz I pielikuma C 102. veidnes 0062. sleju.
0080	Sākotnējā riska darījuma vērtība pirms korekcijas pakāpēm		Piemēro norādījumus attiecībā uz I pielikuma C 102. veidnes 0080. sleju.
0090	Riska darījuma vērtība pēc KRM aizstāšanas ietekmes, pirms korekcijas pakāpēm		Piemēro norādījumus attiecībā uz I pielikuma C 102. veidnes 0090. sleju.
0100	*CCF* (kredīta korekcijas pakāpes)		Piemēro norādījumus attiecībā uz I pielikuma C 102. veidnes 0100. sleju.
0110	Riska darījums, kurā netiek pildītas saistības (*EAD*)		Piemēro norādījumus attiecībā uz I pielikuma C 102. veidnes 0110. sleju.
0120	Nodrošinājuma vērtība		Piemēro norādījumus attiecībā uz I pielikuma C 102. veidnes 0120. sleju.
0130	*LGD* (zaudējumi, kas var rasties saistību nepildīšanas gadījumā)		Piemēro norādījumus attiecībā uz I pielikuma C 102. veidnes 0130. sleju.

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0131	*LGD* bez uzraudzības pasākumiem		Piemēro norādījumus attiecībā uz I pielikuma C 102. veidnes 0131. sleju.
0132	*LGD* bez PR un uzraudzības pasākumiem		Piemēro norādījumus attiecībā uz I pielikuma C 102. veidnes 0132. sleju.
0133	*LGD* bez PR, uzraudzības pasākumiem un lejupslīdes komponenta		Piemēro norādījumus attiecībā uz I pielikuma C 102. veidnes 0133. sleju.
0140	Termiņš		Piemēro norādījumus attiecībā uz I pielikuma C 102. veidnes 0140. sleju.
0150	Paredzamo zaudējumu apmērs		Piemēro norādījumus attiecībā uz I pielikuma C 102. veidnes 0150. sleju.
0160	Uzkrājumi riska darījumiem, kuros netiek pildītas saistības		Piemēro norādījumus attiecībā uz I pielikuma C 102. veidnes 0160. sleju.
0170	RDRSV		Piemēro norādījumus attiecībā uz I pielikuma C 102. veidnes 0170. sleju.
0180	Standartizēta RDRSV		Piemēro norādījumus attiecībā uz I pielikuma C 102. veidnes 0180. sleju.
0190	Saistību neizpildes rādītājs pēdējā gadā		Uzrāda saistību neizpildes rādītāju par pēdējo gadu. Šajā nolūkā saistību neizpildes rādītāju definē kā attiecību starp turpmāk norādītajām vērtībām: a) to riska darījumu summu (sākotnējais riska darījums (0080. sleja), ko mēra atsauces datumā, no kura atskaitīts viens gads), kuriem nebija iestājusies saistību neizpilde tieši vienu gadu pirms atsauces datuma un kuriem bija iestājusies saistību neizpilde starp atsauces datumu, no kura atskaitīts viens gads, un atsauces datumu; b) to riska darījumu summu (sākotnējais riska darījums (0080. sleja), ko mēra atsauces datumā, no kura atskaitīts viens gads), kuriem nebija iestājusies saistību neizpilde atsauces datumā, no kura atskaitīts viens gads. Neiekļauj jaunus riska darījumus, kas tika veikti iepriekšējā gadā pirms atsauces datuma. Riska darījumus, kuriem iestājās saistību neizpilde un kuri atkal atveseļoti iepriekšējā gadā pirms atsauces datuma, iekļauj gan skaitītājā, gan saucējā. Viena un tā paša parādnieka vairākus saistību neizpildes gadījumus iekļauj tikai vienu reizi.

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
			Šo informāciju uzrāda portfeļa ID, kas attiecas tikai uz riska darījumiem, kuros nav saistību neizpildes; tā izteikta kā vērtība no 0 līdz 1. Saistību neizpildes un saistību neizpildes datumus izmanto, kā reģistrēts, īstenojot *DoD*, kas piemērojams notikuma laikā, t. i., iestāde uzskata, ka ir iestājusies saistību neizpilde attiecībā uz *DoD*, ko iestāde piemēroja notikuma reģistrēšanas laikā. Izmaiņas *DoD* ņem vērā tikai perspektīvi no to īstenošanas dienas, savukārt *DoD* izmaiņu retrospektīvu piemērošanu pēc attiecīgā saistību neizpildes notikuma (atpakaļejoša simulācija) neizmanto.
0200	Saistību neizpildes rādītājs pēdējos piecos gados		Uzrāda svērtos vidējos saistību neizpildes rādītājus, kas novēroti pēdējos piecos gados pirms atsauces datuma. Piemēro 0190. slejā minēto saistību neizpildes rādītāja definīciju. Svērumi, kas ir jāizmanto, ir riska darījumi, kuros tiek pildītas saistības un kuri izmantoti saistību neizpildes rādītāja aprēķināšanai saskaņā ar 0190. sleju. Ja iestādei nav jāaprēķina saistību neizpildes rādītājs par pēdējiem pieciem gadiem pirms atsauces datuma saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 180. panta 1. punkta h) apakšpunktu vai 180. panta 2. punkta e) apakšpunktu, tā izstrādā aizstājējvērtību, izmantojot ilgākos vēsturiskos datus līdz pieciem gadiem pirms atsauces datuma, un savai kompetentajai iestādei iesniedz dokumentāciju, kurā ir sīkāk izklāstīts aprēķins. Šo informāciju uzrāda portfeļa ID, kas attiecas tikai uz riska darījumiem, kuros nav saistību neizpildes; tā izteikta kā vērtība no 0 līdz 1. Saistību neizpildes un saistību neizpildes datumus izmanto, kā reģistrēts, īstenojot *DoD*, kas piemērojams notikuma laikā, t. i., iestāde uzskata, ka ir iestājusies saistību neizpilde attiecībā uz *DoD*, ko iestāde piemēroja notikuma reģistrēšanas laikā. Izmaiņas *DoD* ņem vērā tikai perspektīvi no to īstenošanas dienas, savukārt *DoD* izmaiņu retrospektīvu piemērošanu pēc attiecīgā saistību neizpildes notikuma (atpakaļejoša simulācija) neizmanto.
0210	Zaudējumu rādītājs pēdējā gadā		Pēdējā gadā novēroto zaudējumu rādītāju uzrāda tikai par portfeļa ID, kuri attiecas tikai uz riska darījumiem, kuriem nav iestājusies saistību neizpilde, un riska darījumiem, kuriem ir iestājusies saistību neizpilde. Portfeļiem bez saistību neizpildes zaudējumu rādītājs ir kredītriska korekciju un norakstījumu summa, kas iepriekšējā gadā pirms atsauces datuma piemērota riska darījumiem bez saistību neizpildes tieši vienu gadu pirms atsauces datuma un kuriem saistību neizpilde iestājās iepriekšējā gadā pirms atsauces datuma, dalīta ar *EAD* summu, ko mēra tieši vienu gadu pirms atsauces datuma, riska darījumiem bez saistību neizpildes tieši vienu gadu pirms atsauces datuma un kuriem saistību neizpilde iestājās iepriekšējā gadā pirms atsauces datuma.

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

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
			Zaudējumu rādītāja skaitītājā iekļauj visas kredītriska korekcijas un norakstījumus, kuri saistīti ar riska darījumiem, kuriem gada laikā pirms atsauces datuma nav izpildītas saistības, tostarp kredītriska korekcijas, kuras piemērotas pirms saistību neizpildes dienas. Neiekļauj jaunus riska darījumus, kas tika veikti iepriekšējā gadā pirms atsauces datuma. Riska darījumus, kuriem iestājās saistību neizpilde un kuri atkal atveseļoti iepriekšējā gadā pirms atsauces datuma, iekļauj zaudējumu rādītāja saucējā, un šo riska darījumu norakstījumus ņem vērā zaudējumu rādītāja skaitītājā. Viena un tā paša parādnieka vairākus saistību neizpildes gadījumus ņem vērā tikai vienu reizi. Attiecībā uz portfeļiem, kuros netiek pildītas saistības, zaudējumu rādītājā ņem vērā riska darījumus, kuros nebija izpildītas saistības tieši vienu gadu pirms atsauces datuma. Tā ir šādu lielumu summa: a) šo riska darījumu kredītriska korekcijas vienu gadu pirms atsauces datuma; un b) kredītriska korekcijas un norakstījumi, ko piemēro gadā pirms atsauces datuma, dalīts ar *EAD* summu, ko mēra tieši vienu gadu pirms attiecīgo riska darījumu atsauces datuma. Neiekļauj jaunus saistību neizpildes gadījumus iepriekšējā gadā pirms atsauces datuma. Riska darījumus, kuri atkal atveseļoti iepriekšējā gadā pirms atsauces datuma, iekļauj zaudējumu rādītāja saucējā, un šo riska darījumu norakstījumus iekļauj zaudējumu rādītāja skaitītājā. Viena un tā paša parādnieka vairākus saistību neizpildes gadījumus iekļauj tikai vienu reizi. Zaudējumu rādītāju izsaka kā vērtību no 0 līdz 1. Saistību neizpildes un saistību neizpildes datumus izmanto, kā reģistrēts, īstenojot *DoD*, kas piemērojams notikuma laikā, t. i., iestāde uzskata, ka ir iestājusies saistību neizpilde attiecībā uz *DoD*, ko iestāde piemēroja notikuma reģistrēšanas laikā. Izmaiņas *DoD* ņem vērā tikai perspektīvi no to īstenošanas dienas, savukārt *DoD* izmaiņu retrospektīvu piemērošanu pēc attiecīgā saistību neizpildes notikuma (atpakaļejoša simulācija) neizmanto.
0220	Zaudējumu rādītājs pēdējos piecos gados		*EAD* svērtos vidējos zaudējumu rādītājus, kas novēroti pēdējos piecos gados pirms atsauces datuma, uzrāda tikai attiecībā uz portfeļa ID, kuri attiecas tikai uz riska darījumiem, kuriem nav iestājusies saistību neizpilde, un riska darījumiem, kuriem ir iestājusies saistību neizpilde. Piemēro 0210. slejā minēto zaudējumu rādītāja definīciju. Pēdējo piecu gadu zaudējumu rādītāja pamatā ir gada zaudējumu rādītāji pēdējos piecos gados, ja šie gada zaudējumu rādītāji ir definēti pēc analoģijas ar zaudējumu rādītāja definīciju 0210. slejā; jo īpaši gada zaudējumu rādītāji neietver papildu izmaiņas kredītriska korekcijās un norakstījumos, kas notikuši pēc katra gada zaudējumu rādītāja novērošanas perioda (kalendārā gada). Ja iestādei nav jāizmanto dati par pēdējiem pieciem gadiem pirms atsauces datuma saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 181. panta 2. punkta pēdējo daļu, tā izstrādā aizstājējvērtību, izmantojot ilgākos vēsturiskos datus līdz pieciem gadiem pirms atsauces datuma, un savai kompetentajai iestādei iesniedz dokumentāciju, kurā ir sīkāk izklāstīts aprēķins. Zaudējumu rādītāju izsaka kā vērtību no 0 līdz 1. Saistību neizpildes un saistību neizpildes datumus izmanto, kā reģistrēts, īstenojot *DoD*, kas piemērojams notikuma laikā, t. i., iestāde uzskata, ka ir iestājusies saistību neizpilde attiecībā uz *DoD*, ko iestāde piemēroja notikuma reģistrēšanas laikā. Izmaiņas *DoD* ņem vērā tikai perspektīvi no to īstenošanas dienas, savukārt *DoD* izmaiņu retrospektīvu piemērošanu pēc attiecīgā saistību neizpildes notikuma (atpakaļejoša simulācija) neizmanto.

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0250	RDRSV-		Iestādes aprēķina un uzrāda RDRSV- portfeļiem, kas minēti I pielikuma 103. veidnē, ar šādiem portfeļa ID: 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 RDRSV- ir hipotētiskā riska darījuma riska svērtā vērtība pēc atbalsta faktoru piemērošanas, kas rodas, katram riska darījumam piemērojot *PD*- vērtības, nevis iestādes *PD* vērtības. Pārējie parametri, kas vajadzīgi aprēķinā, nevar tikt mainīti. *PD*- pamatā ir aprēķins, kas veikts katrai parādnieku kategorijai atsevišķi. Izmanto parādnieku kategorijas, kā norādīts Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 I pielikuma C 08.02. veidnes 0005. slejā (norādījumus skatīt minētās regulas II pielikuma C 08.01. veidnes 0010. slejā un C 08.02. veidnē). Katrai parādnieku kategorijai p^- ir vismazākā pozitīvā vērtība, kas atbilst vienādojumam $$p^- + \Phi^{-1}(q) \bullet \sqrt{\frac{p^- \bullet (1-p^-)}{n}} \geq DR_{1y}$$ kur $DR_{1y} > 0$, un $p^- = 0$, kur $DR_{1y} = 0$. Proti: Φ^{-1} = standartizētā normālā (kumulatīvā) sadalījuma apgrieztā funkcija; q = uzticības līmenis, kas noteikts 90 % apmērā; DR_{1y} = atsevišķo gadījumu svērtais saistību neizpildes rādītājs iepriekšējā gadā pirms atsauces datuma, t. i., parādnieku skaits, kuriem nebija saistību neizpildes un kuriem piešķirta attiecīgā parādnieka kategorija tieši vienu gadu pirms atsauces datuma, un kuriem saistību neizpilde iestājās pēdējā gada laikā, dalīts ar parādnieku skaitu, kuriem nebija saistību neizpildes un kuriem piešķirta attiecīgā parādnieku kategorija tieši vienu gadu pirms atsauces datuma; n = to parādnieku skaits, kuriem nebija saistību neizpildes un kuriem piešķirta attiecīgā parādnieka kategorija tieši vienu gadu pirms atsauces datuma. Katrai parādnieku kategorijai *PD*- ir p^-, kur p^- aprēķina saskaņā ar ceturtajā daļā izklāstīto formulu parādnieku kategorijai, kas piešķirta parādniekam.

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0260	RDRSV+		Iestādes aprēķina un uzrāda RDRSV+ attiecībā uz portfeļiem, kas ir minēti I pielikuma 103. veidnē ar šādu portfeļa ID: 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 RDRSV+ ir hipotētiskā riska darījumu riska svērtā vērtība pēc atbalsta faktora piemērošanas, kas rodas, katram riska darījumam piemērojot *PD*+ vērtības, nevis iestādes *PD* vērtības. Pārējie parametri, kas vajadzīgi aprēķinā, nevar tikt mainīti. *PD*+ pamatā ir aprēķins, kas veikts katrai parādnieku kategorijai atsevišķi. Izmanto parādnieku kategorijas, kā norādīts Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 I pielikuma C 08.02. veidnes 0005. slejā (norādījumus skatīt minētās regulas II pielikuma C 08.01. veidnes 0010. slejā un C 08.02. veidnē). Katrai parādnieku kategorijai p^+ ir vislielākā pozitīvā vērtība, kas atbilst vienādojumam $$p^+ - \Phi^{-1}(q) \bullet \sqrt{\frac{p^+ \bullet (1-p^+)}{n}} \leq DR_{1y}$$ Šādā formulā: Φ^{-1} = standartizētā normālā (kumulatīvā) sadalījuma apgrieztā funkcija; q = uzticības līmenis, kas noteikts 90 % apmērā; DR_{1y} = atsevišķo gadījumu svērtais saistību neizpildes rādītājs iepriekšējā gadā pirms atsauces datuma, t. i., parādnieku skaits, kuriem nebija saistību neizpildes un kuriem piešķirta attiecīgā parādnieka kategorija tieši vienu gadu pirms atsauces datuma, un kuriem saistību neizpilde iestājās pēdējā gada laikā, dalīts ar parādnieku skaitu, kuriem nebija saistību neizpildes un kuriem piešķirta attiecīgā parādnieku kategorija tieši vienu gadu pirms atsauces datuma; n = to parādnieku skaits, kuriem nebija saistību neizpildes un kuriem piešķirta attiecīgā parādnieka kategorija tieši vienu gadu pirms atsauces datuma. Katrai parādnieku kategorijai *PD*+ ir p^+, kur p^+ aprēķina saskaņā ar ceturtajā daļā izklāstīto formulu parādnieku kategorijai, kas piešķirta parādniekam.

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0270	RDRSV–		Iestādes aprēķina un uzrāda RDRSV- attiecībā uz portfeļiem, kas ir minēti I pielikuma 103. veidnē ar šādu portfeļa identifikatoru (ID): 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 RDRSV– ir hipotētiskā riska darījuma riska svērtā vērtība pēc atbalsta faktoru piemērošanas, kas rodas, katram riska darījumam piemērojot *PD*– vērtības, nevis iestādes *PD* vērtības. Pārējie parametri, kas vajadzīgi aprēķinā, nevar tikt mainīti. *PD*– pamatā ir aprēķins, kas veikts katrai parādnieku kategorijai atsevišķi. Izmanto parādnieku kategorijas, kā norādīts Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 I pielikuma C 08.02. veidnes 0005. slejā (norādījumus skatīt minētās regulas II pielikuma C 08.01. veidnes 0010. slejā un C 08.02. veidnē). Katrai parādnieku kategorijai p^{--} ir vismazākā pozitīvā vērtība, kas atbilst vienādojumam $$p^{--} + \Phi^{-1}(q) \bullet \sqrt{\frac{p^{--} \bullet (1 - p^{--})}{n}} \geq DR_{5y}$$ kur $DR_{5y} > 0$, un $p^{--} := 0$, kur $DR_{5y} = 0$ Proti: Φ^{-1} = standartizētā normālā (kumulatīvā) sadalījuma apgrieztā funkcija; q = uzticības līmenis, kas noteikts 90 % apmērā; DR_{5y} = saistību neizpildes rādītājs pēdējo piecu gadu laikā attiecībā uz parādnieku kategoriju, ko aprēķina kā vienkāršu vidējo rādītāju no pieciem viena gada atsevišķo gadījumu svērtajiem saistību neizpildes rādītājiem; n = to parādnieku skaits, kuriem nebija saistību neizpildes un kuriem piešķirta attiecīgā parādnieka kategorija tieši vienu gadu pirms atsauces datuma. Katrai parādnieku kategorijai *PD*– ir p^{--}, kur p^{--} aprēķina saskaņā ar ceturtajā daļā izklāstīto formulu parādnieku kategorijai, kas piešķirta parādniekam.

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0280	RDRSV++		Iestādes aprēķina un uzrāda RDRSV++ attiecībā uz portfeļiem, kas ir minēti I pielikuma 103. veidnē ar šādu portfeļa ID: 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 RDRSV++ ir hipotētiskā riska darījuma riska svērtā vērtība pēc atbalsta faktoru piemērošanas, kas rodas, katram riska darījumam piemērojot *PD*++ vērtības, nevis iestādes *PD* vērtības. Pārējie parametri, kas vajadzīgi aprēķinā, nevar tikt mainīti. *PD*++ pamatā ir aprēķins, kas veikts katrai parādnieku kategorijai atsevišķi. Izmanto parādnieku kategorijas, kā norādīts Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 I pielikuma C 08.02. veidnes 0005. slejā (norādījumus skatīt minētās regulas II pielikuma C 08.01. veidnes 0010. slejā un C 08.02. veidnē). Katrai parādnieku kategorijai p^{++} ir vislielākā pozitīvā vērtība, kas atbilst vienādojumam $$p^{++} - \Phi^{-1}(q) \bullet \sqrt{\frac{p^{++} \bullet (1 - p^{++})}{n}} \leq DR_{5y}$$ kur Φ^{-1} = standartizētā normālā (kumulatīvā) sadalījuma apgrieztā funkcija; q = uzticības līmenis, kas noteikts 90 % apmērā; DR_{5y} = saistību neizpildes rādītājs pēdējo piecu gadu laikā attiecībā uz parādnieku kategoriju, ko aprēķina kā vienkāršu vidējo rādītāju no pieciem viena gada atsevišķo gadījumu svērtajiem saistību neizpildes rādītājiem; n = to parādnieku skaits, kuriem nebija saistību neizpildes un kuriem piešķirta attiecīgā parādnieka kategorija tieši vienu gadu pirms atsauces datuma. Katrai parādnieku kategorijai *PD*++ ir p^{++}, kur p^{++} aprēķina saskaņā ar ceturtajā daļā izklāstīto formulu parādnieku kategorijai, kas piešķirta parādniekam.

C 105.01 – Iekšējo modeļu definīcija

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0010	Iekšējā modeļa ID		Iestāde uzrāda kompetentās iestādes piešķirto iekšējā modeļa ID. Ja tas nav pieejams, iestāde uzrāda pašas piešķirto iekšējā modeļa ID. Iekšējā modeļa ID ir unikāla atsauce uz iekšējo modeli, ko apstiprinājusi kompetentā iestāde un ko izmanto RDRSV aprēķināšanai. Tas ir rindas identifikators, un tas ir unikāls katrai veidnes rindai.
0020	Modeļa nosaukums		Uzrāda modeļa nosaukumu, ko iekšējam modelim piešķīrusi pārskatu sniedzēja iestāde.
0030	*IRBA* riska parametrs		*IRB* pieejas riska parametrs ir viens no šādiem: a) *PD*; b) *LGD*; c) *CCF*. Attiecībā uz iekšējo modeli komercsabiedrību un specializētās kreditēšanas riska darījumiem saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 153. panta 5. punktu ("Specializētās kreditēšanas iedalījuma kritēriji") lauku atstāj tukšu vai iekļauj "*NULL*".
0040	Riska darījums, kurā netiek pildītas saistības (*EAD*)	Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 I pielikuma C 08.01. veidnes 0110. sleja	Uzrāda kopējo riska darījumu vērtību darījumiem konkrētā reitingu modeļa piemērošanas jomā.
0050	*EAD* svērtais vidējais saistību neizpildes rādītājs attiecībā uz kalibrēšanu		Uzrāda *EAD* svērtos vidējos ikgadējos saistību neizpildes rādītājus, ko izmanto *PD* modeļu kalibrēšanai. Šo informāciju norāda tikai par *PD* modeļiem. Izmanto datus, kas izmantoti modeļa parametru kalibrēšanā. Ja iekšējo datu nav un kalibrēšana pamatojas uz ārējiem datiem, tad paziņo ārējos datus.
0060	Atsevišķo gadījumu svērtais vidējais saistību neizpildes rādītājs attiecībā uz kalibrēšanu		Uzrāda atsevišķo gadījumu svērto ikgadējo saistību neizpildes rādītāju vidējo aritmētisko, ko izmanto *PD* modeļu kalibrēšanai. Šo informāciju norāda tikai par *PD* modeļiem. Izmanto datus, kas izmantoti modeļa parametru kalibrēšanā. Ja iekšējo datu nav un kalibrēšana pamatojas uz ārējiem datiem, tad paziņo ārējos datus.
0070	Ilgtermiņa saistību neizpildes varbūtība (*PD*)		Uzrāda galveno tendenci, ko iestāde izmanto, kalibrējot modeļus, kas ietver jebkuras saprātīgas korekcijas attiecībā uz vienkāršajiem atsevišķo gadījumu svērtajiem vidējiem ikgadējiem saistību neizpildes rādītājiem, ko izmanto *PD* modeļu kalibrēšanai. Šo informāciju norāda tikai par *PD* modeļiem.
0080	Atveseļošanas rādītāja aktīvs, kuram iestājusies saistību neizpilde		Atveseļošanas rādītājs aktīvam, kam iestājusies saistību neizpilde, ir to nenokārtoto aktīvu, kuriem iestājusies saistību neizpilde, procentuālā attiecība, kas 12 mēnešu laikā atgūst statusu "to saistības ir izpildītas". Ja iestāde neaprēķina atveseļošanas rādītāju attiecībā uz konkrēto modeli, tā aprēķina aizstājējvērtību, ņemot vērā sniegto definīciju. Iestāde ziņo kompetentajai iestādei par aizstājējvērtības izmantošanu. Minēto informāciju norāda tikai par *LGD* modeļiem.

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0090	Atgūšanas likme neatveseļotajiem atsavinātajiem aktīviem		Uzrāda atsevišķo gadījumu svērto vidējo atgūšanas likmi attiecībā uz neatveseļotajām saistību neizpildēm, kas iekļautas laikrindās, ko iestāde izmanto, lai kalibrētu *LGD* modeļus attiecībā uz aktīviem, kuriem nav iestājusies saistību neizpilde. Izmanto datus, kas izmantoti modeļa parametru kalibrēšanā. Ja iekšējo datu nav un kalibrēšana pamatojas uz ārējiem datiem, tad paziņo ārējos datus. Iestāde, kurai sakarā ar nepabeigtu atgūšanas procedūru nav konkrēta atgūšanas likmes attiecībā uz neatveseļotajām saistību neizpildēm, aprēķina aizstājējvērtību, ņemot vērā novērotos rādītājus par atgūšanu, kā arī aplēses par atgūšanu saistībā ar nepilnīgu restrukturizāciju. Iestāde ziņo kompetentajai iestādei par aizstājējvērtības izmantošanu. Minēto informāciju norāda tikai par *LGD* modeļiem.
0100	Atgūšanas laikposma ilgums neatveseļotajiem atsavinātajiem aktīviem		Uzrāda atsevišķo gadījumu svērto vidējo atgūšanas laikposmu (no saistību neizpildes statusa sākuma līdz atgūšanas procedūras pabeigšanas dienai) attiecībā uz neatveseļotajām saistību neizpildēm, kas iekļautas laikrindās, ko iestāde izmanto, lai kalibrētu *LGD* modeļus attiecībā uz aktīviem, kuriem nav iestājusies saistību neizpilde. Atsevišķo gadījumu svērto vidējo ilgumu izsaka kā dienu skaitu. Izmanto datus, kas izmantoti modeļa parametru kalibrēšanā. Ja iekšējo datu nav un kalibrēšana pamatojas uz ārējiem datiem, tad paziņo ārējos datus. Ja iestādei sakarā ar nepabeigtu atgūšanas procedūru nav konkrēta atgūšanas laikposma ilguma attiecībā uz neatveseļotajām saistību neizpildēm, tā aprēķina aizstājējvērtību, ņemot vērā sniegto definīciju. Iestāde ziņo kompetentajai iestādei par aizstājējvērtības izmantošanu. Minēto informāciju norāda tikai par *LGD* modeļiem.
0110	Kopīgs lēmums	Regulas (ES) Nr. 575/2013 20. panta 2. punkta a) apakšpunkts	Iestāde uzrāda, vai starp konsolidējošo iestādi un uzņēmēju kompetento iestādi pastāv vai nepastāv kopīgs lēmums par prudenciālajām prasībām attiecībā uz atļauju izmantot *IRB* pieeju, lai aprēķinātu prudenciālās prasības attiecībā uz riska darījumiem, kurus iestāžu meitasuzņēmumi tur uzrādītajos salīdzinošās vērtēšanas portfeļos.
0120	Konsolidētās uzraudzības iestāde	Regulas (ES) Nr. 575/2013 20. pants	Uzrāda tās kompetentās iestādes izcelsmes valsts *ISO* kodu, kas ir atbildīga par *IRB* pieeju izmantojošas iestādes konsolidēto uzraudzību.
0130	RDRSV	Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 I pielikuma C 08.01. veidnes 0260. sleja	Uzrāda riska darījumu kopējo riska svērto vērtību pēc atbalsta faktoriem (MVU un infrastruktūras atbalsta faktoriem) reitingu modeļa piemērošanas diapazonā.

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0140	RDRSV papildinājumi		RDRSV papildinājumi ir RDRSV apakšpozīcija (“tostarp”) (C 105.01. veidnes 0130. sleja), un tie ietver: a) RDRSV, ko pieskaita RDRSV, kas izriet no modeļa riska parametra(-u) piemērošanas saistībā ar papildu iekšējiem saglabāšanas pasākumiem, kurus tieši piemēro RDRSV, ja tādi ir; b) RDRSV, ko pieskaita RDRSV, kas izriet no modeļa riska parametra(-u) piemērošanas saistībā ar uzraudzības pasākumiem, kurus tieši piemēro RDRSV, ja tādi ir. Šā punkta a) un b) apakšpunktā minētajās summās neiekļauj pasākumus, kas jau ir atspoguļoti *PD* (C 102. un C 103. veidnes 0060. sleja), *CCF* (C 102. un C 103. veidnes 0100. sleja) vai *LGD* (C 102. un C 103. veidnes 0130. sleja), bet attiecas tikai uz pasākumiem, ko tieši piemēro RDRSV, un attiecīgā gadījumā papildus piesardzības rezervēm un uzraudzības pasākumiem (reizinātāji, papildinājumi, minimālās robežvērtības vai līdzīgi pasākumi), kas palielina riska parametrus. RDRSV papildinājums neietver iespējamo pasākumu ietekmi, kuri ieviesti saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 458. pantu. Ja iestāde nespēj izolēt attiecīgās konservatīvās korekcijas, piemēro I daļas 3. punktu.

C 105.02 – Iekšējo modeļu attiecināšana uz portfeļiem

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0010	Portfeļa ID	C 102. un C 103. veidnes 0010. sleja	Uzrāda portfeļa ID, kas unikāli identificē portfeli saskaņā ar I pielikuma C 102. un C 103. veidni. 0010. un 0020. sleja ir salikts rindas identifikators, un to kombinācija ir unikāla katrai šīs veidnes rindai.
0020	Iekšējā modeļa ID	C 105.01. veidne, 0010. sleja	Uzrāda iekšējā modeļa ID, ko piešķīrusi ziņojumu sniedzošā iestāde. 0010. un 0020. sleja ir salikts rindas identifikators, un to kombinācija ir unikāla katrai C 105.02. veidnes rindai.
0030	Riska darījums, kurā netiek pildītas saistības (*EAD*)	Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 I pielikuma C 08.01. veidnes 0110. sleja	Uzrāda riska darījumu kopējo vērtību riska darījumiem, kas iekļauti portfelī, kurš definēts 0010. slejā, un 0020. slejā definētā reitingu modeļa piemērošanas diapazonā. Ja attiecīga portfeļa visiem riska darījumiem izmanto vienu konkrētu modeli, riska darījuma vērtība ir vienāda ar vērtību, kas par to pašu portfeli uzrādīta attiecīgi C 102. vai C 103. veidnes 0110. slejā.
0040	RDRSV	Īstenošanas regulas (ES) 2021/451 I pielikuma C 08.01. veidnes 0260. sleja	Uzrāda kopējo riska darījumu riska svērto vērtību pēc atbalsta faktoriem riska darījumiem, kas iekļauti portfelī, kurš definēts 0010. slejā, un 0020. slejā definētā reitinga modeļa piemērošanas diapazonā. Ja attiecīga portfeļa visiem riska darījumiem izmanto vienu konkrētu modeli, RDRSV ir vienāda ar vērtību, kas par to pašu portfeli uzrādīta attiecīgi C 102. vai C 103. veidnes 0170. slejā.

C 105.03 – Iekšējo modeļu attiecināšana uz valstīm

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0005	Rindas ID		Šis kods ir rindas identifikators, un tas ir unikāls katrai veidnes rindai. Tajā ievērota numerācijas kārība 1, 2, 3 utt.
0010	Iekšējā modeļa ID	C 105.01. veidnes 0010. sleja	Uzrāda iekšējā modeļa ID, ko piešķīrusi ziņojumu sniedzošā iestāde. Ja viens iekšējā modeļa ID ir saistīts ar vairākām valstīm, katru "Iekšējā modeļa ID" un "Iestādes atrašanās vietu" uzrāda atsevišķās rindās. 0010.un 0020. sleja ir salikts rindas identifikators, un to kombinācija ir vienreizēja attiecībā uz katru tabulas rindu.
0020	Iestādes atrašanās vieta	Regulas (ES) Nr. 575/2013 20. pants	Uzrāda katra meitasuzņēmuma likumīgās rezidences *ISO* kodu, kur IRB riska darījumi tiek iegrāmatoti par katru salīdzinošās vērtēšanas portfeli, neatkarīgi no tā, vai pastāv atļauja, ko uzņēmējas valsts uzraudzības iestāde piešķīrusi IRB pieejas piemērošanai."

II PIELIKUMS

"V PIELIKUMS

TIRGUS RISKA SALĪDZINOŠĀS VĒRTĒŠANAS INSTRUMENTI UN PORTFEĻI

1. iedaļa. Norādījumi
2. iedaļa. Instrumenti
3. iedaļa. Atsevišķi portfeļi – viens instruments
4. iedaļa. Atsevišķi portfeļi – vairāki instrumenti
5. iedaļa. Apkopotie portfeļi
6. iedaļa. Papildu specifikācijas instrumentiem
7. iedaļa. *SBM* validācijas portfeļi

1. iedaļa. Norādījumi

a) Šajā pielikumā piemēro šādas definīcijas:

i) "reģistrācijas datums" ir datums un laiks, kurā iestādes reģistrē darījumus salīdzinošās novērtēšanas vajadzībām;

ii) "sākotnējais tirgus novērtējums (*IMV*)" ir šā pielikuma 2. iedaļā minēto instrumentu tirgus cenas vērtība *IMV* atsauces datumā un laikā;

iii) "*IMV* atsauces datums" ir datums un laiks, uz kuru atsaucoties iestādes nosaka salīdzinošās novērtēšanas portfeļa darījumu *IMV*;

iv) "*IMV* iesniegšanas datums" ir datums, līdz kuram iestādes iesniedz salīdzinošās vērtēšanas portfeļa darījumu *IMV* rezultātus;

v) "*VaR*" ir riskam pakļautā vērtība;

vi) "*sVaR*" ir riskam pakļautā vērtība spriedzes apstākļos;

vii) "*IRC*" ir inkrementālā riska prasība;

viii) "*CTP*" ir korelācijas tirdzniecības portfelis;

ix) "*APR*" ir viss cenas risks, kas aprēķināts saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 377. panta 2. punktu;

x) "Riska mēri" (RM) ir *VaR*, *sVaR* vērtība un, ja vajadzīgs, *IRC* un *APR* portfeļiem, kā noteikts šā pielikuma 3.,4. un 5. iedaļā, starp RM sākotnējo atsauces datumu un RM pēdējo atsauces datumu;

xi) "RM sākotnējais atsauces datums" ir datums, kurā iestādes sāk aprēķināt RM vērtības;

xii) "RM pēdējais atsauces datums" ir datums, kurā iestādes pabeidz aprēķināt RM vērtības;

xiii) "RM iesniegšanas datums" ir datums, līdz kuram iestādes iesniedz salīdzinošās vērtēšanas portfeļa darījumu RM rezultātus;

xiv) "Pašreizējā vērtība (PV)" ir portfeļa tirgus cenas vērtība, kas noteikta šā pielikuma 3. iedaļā, RM pēdējā atsauces datumā;

xv) "*ATM*" ("*at the money*") ir "ar iekšējo vērtību, kas vienāda ar pamatā esošā instrumenta cenu" atvasinātā instrumenta pamatā esošā aktīva pašreizējās vai nākotnes cenas relatīvās pozīcijas attiecībā pret minētā atvasinātā instrumenta norunas cenu;

xvi) "*OTM*" ("*out of the money*") ir "bez iekšējās vērtības" atvasinātā instrumenta pamatā esošā aktīva pašreizējās vai nākotnes cenas relatīvās pozīcijas attiecībā pret minētā atvasinātā instrumenta norunas cenu;

xvii) "*ITM*" ("*in the money*") ir "ar pozitīvu iekšējo vērtību" atvasinātā instrumenta pamatā esošā aktīva pašreizējās vai nākotnes cenas relatīvās pozīcijas attiecībā pret minētā atvasinātā instrumenta norunas cenu;

xviii) "garā pozīcija" ir "pirkts" un "īsā pozīcija" ir "pārdots";

xix) "*CDS*" ir kredītriska mijmaiņas darījums;

xx) attiecībā uz kredītriska mijmaiņas darījumiem "garā pozīcija" ir "pirktā aizsardzība" un "īsā pozīcija" ir "pārdotā aizsardzība";

xxi) "MLN" ir miljoni;

xxii) "*OTC*" ir ārpus biržas;

xxiii) "*ASA*" ir ar alternatīvā standartizētā pieeja, kā minēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 trešās daļas IV sadaļas 1.a nodaļas 1. iedaļā.

xxiv) "*SBM*" ir ar jutīgumu saistītā metode, kā minēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 trešās daļas IV sadaļas 1.a nodaļas 2. iedaļā.

xxv) "*DRC*" ir saistību neizpildes riska prasība, kā minēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 trešās daļas IV sadaļas 1.a nodaļas 5. iedaļā.

xxvi) "*RRAO*" ir atlikušā riska papildinājums, kā minēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 trešās daļas IV sadaļas 1.a nodaļas 4. iedaļā.

b) "Salīdzinošajai novērtēšanai" piemēro šādus datumus:

i) reģistrācijas datums ir 2025. gada 30. janvāris;

ii) sākotnējā tirgus vērtējuma (un sākotnējās ar jutīgumu saistītās metodes) atsauces datums ir 2025. gada 6. februāris (plkst. 17.30 pēc Viduseiropas laika);

iii) *IMV* (un sākotnējā *SBM*,un *SBM* validācijas) iesniegšanas datums ir 2025. gada 28. februāris;

iv) RM sākotnējais atsauces datums ir 2025. gada 2. jūnijs;

v) RM (un pēdējās *ASA*) pēdējais atsauces datums ir 2025. gada 13. jūnijs;

vi) RM (un pēdējās *ASA*) iesniegšanas datums ir 2025. gada 18. jūlijs.

c) Ja vien šā pielikuma 2. iedaļā nav skaidri noteikts citādi, visas pozīcijas reģistrē šīs iedaļas b) punkta i) apakšpunktā minētajā reģistrācijas datumā. Kad pozīcijas ir reģistrētas, katrs portfelis tiek attīstīts salīdzinošās novērtēšanas laikā, un to aprēķina, pieņemot, ka iestāde neveic pilnīgi nekādas darbības portfeļa pārvaldīšanai visā salīdzinošās novērtēšanas periodā. Ja konkrētā instrumenta specifikācijā nav skaidri norādīts citādi, norunas cenas attiecībā uz iespēju pozīcijām nosaka attiecībā pret pamatā esoša instrumenta cenām, kādas tās bija tirgus slēgšanas brīdī reģistrācijas datumā.

d) Lai validētu sākotnējo tirgus novērtējumu, katra instrumenta vērtējumu iestādes kompetentajām iestādēm iesniedz līdz *IMV* iesniegšanas datumam. Līdz minētajam datumam iestādes iesniedz rezultātiem pievienotu paskaidrojumu saskaņā ar e) punktu. Ja iespējams, *IMV* sniedz saskaņā ar iestādes darījumu nodaļas novērtējumu. Ja iestādes darījumu nodaļa nav sniegusi *IMV*, iestāde paskaidrojumā norāda, kurš ir *IMV* datu avota sniedzējs.

e) Paskaidrojumā, kas iestādēm jāiesniedz kopā ar *IMV*, par katru instrumentu iekļauj visu turpmāk minēto:

i) riska faktorus, kurus izmanto instrumenta *IMV* aprēķināšanai;

ii) cenu noteikšanas modeli, ko izmanto instrumenta *IMV* aprēķināšanai, un šā cenu noteikšanas modeļa aprakstu;

iii) riska faktorus, kas iekļauti instrumenta *VaR* modelī;

iv) riska faktorus, kas iekļauti *VaR* modelī un kas ir arī instrumenta *IMV* vērtēšanas dati;

v) *VaR* modeļa specifiku attiecībā uz instrumentu;

vi) instrumenta atsauces datus, kas pieejami iestādes pašas formātā;

vii) aspektus, kas minēti šīs iedaļas h), i), k), m), n), o), p), v), w), y), gg), un kk) punktā.

f) Šīs iedaļas e) punkta v) apakšpunkta vajadzībām uzrāda visu turpmāk minēto:

i) īsus *VaR* modeļa aprakstus;

ii) izmantotās pārvērtēšanas metodes;

iii) funkcionālo formu, ko izmanto atdeves modelēšanai (piemēram, absolūtās, relatīvās un citas metodes;

iv) kvalitatīvu informāciju par laikrindām, ko izmanto, lai kalibrētu *VaR* modeli attiecībā uz instrumentu (piemēram, avots, normalizācijas metodika, izmantotās kopas, cita informācija, ko iestādes uzskata par būtisku sniegto rezultātu skaidrošanai).

g) Paskaidrojumu, kas minēts d) punktā, atjaunina ar katru atkārtotu jebkuras vērtības iesniegšanu, norādot izmaiņas iesniegtajā informācijā. Paskaidrojumā ir viena iedaļa, kurā uzskaitīti visi iesniegšanas datumi un atkārtotas iesniegšanas iemesli.

h) Pozīciju risku aprēķina, neņemot vērā finansējuma izmaksas. Attiecīgā gadījumā iestādes par diskonta likmi izmanto instrumenta valūtas uz nakti izsniegto kredītu procentu likmi; Tiek uzskatīts, ka ir ieviests nodrošinājuma līgums attiecībā uz atvasinātajiem instrumentiem, kas minēti šā pielikuma 2. iedaļā. Ja tas nav iespējams, d) punktā minētajā paskaidrojumā norāda iemeslus.

i) Darījuma partnera kredītrisku un kredīta vērtības korekcijas (*CVA*) risku neņem vērā, novērtējot portfeļu riskus. Ja tas nav iespējams, šīs iedaļas d) punktā minētajā paskaidrojumā norāda iemeslus. Iestādes ziņo par gadījumiem, kad *IMV* ir iekļautas citas vērtēšanas korekciju tipoloģijas, un šīs iedaļas d) punktā minētajā paskaidrojumā attiecībā uz katru finanšu instrumentu paskaidro metodiku un ietekmi.

j) Attiecībā uz darījumiem, kas ietver garās pozīcijas kredītriska mijmaiņas līgumos ("*CDS*"), iestādes pieņem, ka ir samaksāta tūlītēja priekšapmaksa, lai reģistrētu pozīciju saskaņā ar tirgus standartiem un principiem. Visu *CDS* termiņš atbilst parastajiem ceturkšņa beigu datumiem.

k) Papildu specifikācijas, kas vajadzīgas, lai veiktu *CDS* pozīcijām nepieciešamos cenu aprēķinus, atbilst vispārpieņemtajiem tirgus standartiem un principiem, un tās paskaidro šīs iedaļas d) punktā minētajā paskaidrojumā.

l) Termiņš nodrošina, ka darījums ir vistuvāk noteiktajam periodam līdz beigu termiņam, kas norādīts atbilstīgi tirgus standartiem un principiem.

m) Attiecībā uz sīkāku informāciju par instrumentiem, kas nav minēti šā pielikuma 2. iedaļā, iestādes šīs iedaļas d) punktā minētajā paskaidrojumā kopā ar rezultātiem norāda izmantotos pieņēmumus, tostarp vienošanos par dienu aprēķinu un tirgojama un likvīda instrumenta izvēli, ja tas ir atļauts.

n) Iestādes, kas uzskata, ka papildus šajā iedaļā norādītajiem pieņēmumiem pastāv būtiski pieņēmumi tās salīdzinošās novērtēšanas rezultātu interpretācijai, tostarp darījumdarbības grafika beigas, kupona pārskatīšana (*coupon rolls*), kartēšana attiecībā uz indeksiem un citi, šo pieņēmumu aprakstu iesniedz šīs iedaļas d) punktā minētajā paskaidrojumā.

o) Paskaidrojumā, kas minēts šīs iedaļas d) punktā, ietver skaidrojumus par riskiem, kas nav ietverti šā pielikuma 2. iedaļā minētajā instrumentu modelī.

p) Visi iespējas līgumi tiek uzskatīti par tādiem, kuros tirgo ārpus biržas ("*OTC*"), izņemot gadījumus, kad ir skaidri noteikts citādi.

q) Attiecībā uz ārpusbiržas iespējas līgumiem ievēro standarta laika noteikumus. Līdz termiņam atlikušais laiks attiecībā uz "n-mēneša" iespējas līgumu ir n mēneši. Ja iespējas līgums beidzas netirdzniecības dienā, iestādes beigu dienu pielāgo attiecībā uz katru darbdienu saskaņā ar tirgus standartiem un principiem.

r) Tiek uzskatīts, ka visi ārpusbiržas iespējas līgumi ir:

   i) ar vienu parādnieku saistītu kapitāla vērtspapīru un preču gadījumā – Amerikas ārpusbiržas iespējas līgumi;

   ii) kapitāla vērtspapīru indeksu, ārvalstu valūtas un mijmaiņas iespējas līgumu gadījumā – Eiropas ārpusbiržas iespējas līgumi.

s) Visus ārpusbiržas iespējas līgumus uzskata par "nesegtiem", lai prēmiju izslēgtu no sākotnējā tirgus novērtējuma.

t) Attiecībā uz *CTP* iestādes, kurām ir atļauja izmantot *APR* modeli attiecībā uz *CTP*, sniedz sīku informāciju par saviem visbūtiskākajiem pieņēmumiem, tirgus standartiem un principiem attiecībā uz *CTP* instrumentiem, kas minēti šā pielikuma 2. iedaļā, tostarp riska ierobežošanas koeficientiem, ko tās aprēķinājušas, lai *CTP* instrumentus padarītu CS01 neitrālus reģistrācijas datumā.

u) *IMV* katram instrumentam norāda EBI instrumenta valūtā, kas attiecīgajam instrumentam noteikta šā pielikuma 2. iedaļā.

v) Portfeļiem, ko veido viens vai vairāki instrumenti, kuri denominēti EBI instrumentu valūtās, kas atšķiras no EBI portfeļa valūtas, rezultātu konvertē uzrādītajā EBI portfeļa valūtā, izmantojot ECB tūlītējo maiņas kursu attiecīgajā datumā. Konvertēto rezultātu paskaidro šīs iedaļas d) punktā minētajā paskaidrojumā.

w) Reģistrējot pozīcijas, iestādes ievēro attiecīgus tirgus principus, ja vien šajos norādījumos instrumentu aprakstos nav noteikts citādi (šā pielikuma 2. iedaļa).

x) Ja uz instrumentu vai atvasinātā instrumenta pamatā esošo instrumentu attiecas korporatīva darbība, kas skar šo salīdzinošo novērtēšanu, piem., emitenta pirkšanas iespējas līgums, saistību neizpilde vai tamlīdzīgi, iestādes izslēdz šādu instrumentu no salīdzinošās novērtēšanas kopā ar jebkādu ar to saistītu *CDS* vai iespējas līgumu.

y) Attiecībā uz indeksa sēriju aktuālā ("*on-the-run*") ir vislikvīdākā un tirgojamākā minētā konkrētā tirgū pieejamā indeksa sērija. Iestādes paskaidro savu izvēli par "*on-the-run*" sēriju kopā ar attiecīgajiem rezultātiem pievienotajā paskaidrojumā, kas minēts šīs iedaļas d) punktā.

z) Ja nav norādīts citādi, iestādes piemēro ES Etalonu regulu procentu likmei, lai iegrāmatotu šā pielikuma 2. iedaļā norādītos instrumentus. Iestādes šo norādījumu d) apakšpunktā minētajā paskaidrojumā precizē piemēroto likmi, izņemot to, kas noteikta šā pielikuma 2. iedaļā.

aa) Riska mērus portfeļiem, kas minēti 3.,4. un 5. iedaļā, kopā ar pašreizējo vērtību aprēķina no "RM sākotnējās atsauces datuma" līdz "RM pēdējam atsauces datumam". *FRTB ASA* riska mērus (*SMB*, *DRC* un *RRAO*) aprēķina par "RM pēdējo atsauces datumu". Iestādes iesniedz šo aprēķinu rezultātus savai kompetentajai iestādei līdz RM iesniegšanas datumam. *IMV* un *SMB* uzrāda par katru instrumentu. Riska mērus, *SBM*, *DRC*, *RRAO* un pašreizējo vērtību, ja pieejama, uzrāda katram portfelim, gan atsevišķajam, gan kopīgajam. *SBM*, *DRC* un *RRAO* attiecīgā gadījumā uzrāda vismaz par tiem pašiem portfeļiem, par kuriem uzrāda riska mērus.

bb) Attiecībā uz 7. iedaļā minētajiem portfeļiem iestādes uzrāda *SBM* rezultātus un iesniedz tos atbilstīgi *IMV* iesnieguma pārskata sniegšanas datumiem.

cc) Kredītriska starpības portfeļus norāda tikai tās iestādes, kurām ir piešķirta atļauja modelēt specifisku risku. Attiecībā uz procentu likmju portfeļiem, kas ietver risku kā daļu no konkrētiem instrumentiem, atsevišķus un apkopotus portfeļus modelē iestādes, kurām ir piešķirta atļauja modelēt vispārējo procentu likmju risku, kā arī iestādes, kurām ir piešķirta atļauja modelēt vispārējo un specifisko procentu likmju risku.

dd) Rezultātus attiecībā gan uz atsevišķajiem, gan apkopotajiem portfeļiem iesniedz tikai tad, ja ir iesniegti arī to instrumentu rezultāti, kas ir daļa no šiem portfeļiem.

ee) Šā pielikuma 2. iedaļā ("Instrumenti") "T gads" nozīmē "2025. gads" un "T + X gads" nozīmē "2025. +X gads", kur X ir noteikts 2. iedaļā.

ff) Šā pielikuma 2. iedaļā (Instrumenti) iestādes nosaka beigu/termiņa dienu saskaņā ar šādiem norādījumiem:

i) ja datums ir norādīts, izmanto šo konkrēto datumu;

ii) ja datums nav norādīts, izmanto tirgus praksi, ja tāda ir. Piemēram, ja pastāv tirgus vienošanās, ka beigu/termiņa diena ir mēneša 3. piektdiena, tad "T gada jūnijs" ir T gada attiecīgā mēneša 3. piektdiena;

iii) mēneša beigās, ja ir norādīts "beigās", tas nozīmē mēneša pēdējo kalendāro dienu;

iv) fiksētam laikposmam pēc "reģistrācijas datuma", ja periodu definē kā dienu skaitu, tā ir perioda pēdējā diena. Ja periodu definē nedēļās, mēnešos vai gados, tā ir tā pati nākamās nedēļas, mēneša vai gada diena attiecībā uz reģistrācijas datumu vai, ja perioda pēdējais mēnesis vai gads ir īsāks, tā ir šā mēneša vai gada pēdējā diena; ja "reģistrācijas datums + x periods" ir brīvdiena, izvēlās nākamo darbdienu.

v) Ja nav norādīts citādi, izmanto šādus pieņēmumus: Vienošanās par dienu aprēķinu: Faktiskais dienu skaits/360, brīvdienu kalendārs: *Target2*.

gg) Ja vien nav skaidri norādīts citādi, šā pielikuma 2. iedaļā (Instrumenti) attiecībā uz visiem *CDS* piemēro šādas prasības:

i) kupona biežums: reizi ceturksnī;

ii) kupons (bāzes punkti - *bps*) 100;

iii) dienu skaits: Faktiskais dienu skaits/360;

iv) *ISDA* definīciju gads: 2014.;

v) Pārstrukturizācijas klauzula: grozīta-grozīta pārstrukturēšana (*MMR*);

vi) Termiņš: T+4 gada decembris;

vii) parāda veids: augstākās prioritātes;

viii) periods līdz beigu termiņam: 5 gadi;

ix) spēkā stāšanās datums kā reģistrācijas datums;

x) izmantoto diskonta līkni un atgūšanas rādītāju norāda paskaidrojumā, kas minēts šā pielikuma d) punktā.

hh) Obligāciju instrumentu *IMV* ietver uzkrātos procentus.

ii) Iestādes sniedz informāciju par PV vērtēšanas laiku, norādot laiku šīs iedaļas d) punktā minētajā paskaidrojumā. Ja iespējams, PV novērtējumu aprēķina darbdienas beigās.

jj) Portfeļu riska mērus aprēķina tajā pašā portfeļa valūtā, neieskaitot ārvalstu valūtas risku, arī attiecībā uz iestāžu pārskata sniegšanas valūtu. Ārvalstu valūtas risku ņem vērā tikai tad, ja tas pēc būtības iekļauts instrumentos. Ja salīdzinošās novērtēšanas ietvaros uzrāda gan pārskata sniegšanas, gan portfeļa valūtas rezultātus, attiecībā uz *ASA* rādītājiem rezultātus, kas aprēķināti iestādes pārskata sniegšanas valūtā, pārrēķina EBI portfeļa valūtā, veicot tūlītēju konvertāciju ar ECB tūlītējo valūtas kursu aprēķina datumā. Pārrēķināšana EBI portfeļa valūtā nenozīmē ārvalstu valūtas riska faktoru izmaiņas.

kk) Ja piemēro Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.q panta 7. punktu ("bāzes valūtas" pieeja), veicot *SBM* aprēķinus un sniedzot pārskatu par *SBM* jutīgumu, iestādes ņem vērā ārvalstu valūtas riska faktorus, kas izriet no bāzes valūtas pieejas piemērošanas. Uzrādītās vērtības izsaka nevis izvēlētajā bāzes valūtā, bet gan iestāžu pārskata sniegšanas valūtā, piemērojot tūlītēju konvertāciju ar ECB tūlītējo valūtas kursu attiecīgajā datumā.

2. iedaļa. Instrumenti

Iestādes uzrāda *IMV* saskaņā ar šā pielikuma 1. iedaļā sniegtajiem norādījumiem attiecībā uz šādiem finanšu instrumentiem, ja iestādes nodrošina riska mērus un 3. un 4. iedaļā norādīto portfeļu pašreizējo vērtību:

KAPITĀLA VĒRTSPAPĪRI

101. Garās pozīcijas *EURO STOXX* 50 indeksa (burtkods: FESX) regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi.

Nosacītā summa: indeksa vērtība ir vienāda ar 1 000 EUR

Birža: *Eurex*

Derīguma termiņa beigu datums: T gada jūnijs

EBI instrumenta valūta: EUR

102. Garās pozīcijas 10 000 *BAYER* (burtkods: BAYN GR) akcijas.

Birža: *Xetra*

EBI instrumenta valūta: EUR

103. Īsās pozīcijas regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums *BAYER* (burtkods: BAYN GR).

Nosacītā summa: ekvivalents 10 000 pamatā esošā aktīva akciju vērtībai

Birža: *Eurex*

Derīguma termiņa beigu datums: T gada jūnijs

EBI instrumenta valūta: EUR

104. Īsās pozīcijas regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums *STELLANTIS* (burtkods: STLA FP).

Nosacītā summa: ekvivalents 10 000 pamatā esošā aktīva akciju vērtībai

Birža: *Euronext*

Derīguma termiņa beigu datums: T gada jūnijs

EBI instrumenta valūta: EUR

105. Īsās pozīcijas regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums *ALLIANZ* (burtkods: ALV GR).

Nosacītā summa: ekvivalents 10 000 pamatā esošā aktīva akciju vērtībai

Birža: *Eurex*

Derīguma termiņa beigu datums: T gada jūnijs

EBI instrumenta valūta: EUR

106. Īsās pozīcijas regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums *BARCLAYS* (burtkods: BARC LN).

Nosacītā summa: ekvivalents 10 000 pamatā esošā aktīva akciju vērtībai

Birža: *Eurex*

Derīguma termiņa beigu datums: T gada jūnijs

EBI instrumenta valūta: GBP

107. Īsās pozīcijas regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums *DEUTSCHE BANK* (burtkods: DBK GR).

Nosacītā summa: ekvivalents 10 000 pamatā esošā aktīva akciju vērtībai

Birža: *Eurex*

Derīguma termiņa beigu datums: T gada jūnijs

EBI instrumenta valūta: EUR

108. Īsās pozīcijas regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums *CRÉDIT AGRICOLE* (burtkods: ACA FP).

Nosacītā summa: ekvivalents 10 000 pamatā esošā aktīva akciju vērtībai

Birža: *Euronext*

Derīguma termiņa beigu datums: T gada jūnijs

EBI instrumenta valūta: EUR

109. Garās pozīcijas pirkšanas iespējas līgumi. Pamatā esošs *BAYER* (burtkods: BAYNGR), ATM (1 līgums = 100 akcijas).

Nosacītā summa: ekvivalents 10 000 pamatā esošā aktīva akciju vērtībai

Derīguma termiņa beigu datums: T gada jūnijs

EBI instrumenta valūta: EUR

110. Īsās pozīcijas pirkšanas iespējas līgumi. Pamatā esošs *BAYER* (burtkods: BAYN GR), *ATM* (1 līgums = 100 akcijas).

Nosacītā summa: ekvivalents 10 000 pamatā esošā aktīva akciju vērtībai

Derīguma termiņa beigu datums: T gada decembris

EBI instrumenta valūta: EUR

111. Garās pozīcijas pirkšanas iespējas līgumi. Pamatā esošs *PFIZER* (burtkods: PFE US) 10 % OTM, (1 līgums = 100 akcijas).

Nosacītā summa: ekvivalents 10 000 pamatā esošā aktīva akciju vērtībai

Derīguma termiņa beigu datums: T gada jūnijs

EBI instrumenta valūta: USD

112. Garās pozīcijas pārdošanas iespējas līgumi. Pamatā esošs *PFIZER* (burtkods PFE US) 10 % OTM, (1 līgums = 100 akcijas).

Nosacītā summa: ekvivalents 10 000 pamatā esošā aktīva akciju vērtībai

Derīguma termiņa beigu datums: T gada jūnijs

EBI instrumenta valūta: USD

113. Garās pozīcijas pirkšanas iespējas līgumi. Pamatā esošs *BAYER* (burtkods: BAYN GR), 10 % OTM (1 līgums = 100 akcijas).

Nosacītā summa: ekvivalents 10 000 pamatā esošā aktīva akciju vērtībai

Derīguma termiņa beigu datums: T gada decembris

EBI instrumenta valūta: EUR

114. Īsās pozīcijas pirkšanas iespējas līgumi. Pamatā esošs *BAYER* (burtkods: BAYN GR), 10 % OTM (1 līgums = 100 akcijas).

Nosacītā summa: ekvivalents 10 000 pamatā esošā aktīva akciju vērtībai

Derīguma termiņa beigu datums: T gada jūnijs

EBI instrumenta valūta: EUR

115. Garās pozīcijas pirkšanas iespējas līgumi. Pamatā esošs *AVIVA* (burtkods: AV/LN), 10 % OTM (1 līgums = 100 akcijas).

Nosacītā summa: ekvivalents 10 000 pamatā esošā aktīva akciju vērtībai

Derīguma termiņa beigu datums: T gada decembris

EBI instrumenta valūta: GBP

116. Garās pozīcijas pārdošanas iespējas līgumi. Pamatā esošs *AVIVA* (burtkods: AV/LN), 10 % OTM (1 līgums = 100 akcijas).

Nosacītā summa: ekvivalents 10 000 pamatā esošā aktīva akciju vērtībai

Derīguma termiņa beigu datums: T gada decembris

EBI instrumenta valūta: GBP

117. Īsās pozīcijas regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi *NIKKEI* 225 (burtkods: NKY).

Nosacītā summa: indeksa vērtība ir vienāda ar 20 000 JPY

Birža: *CME*

Derīguma termiņa beigu datums: T gada jūnijs

EBI instrumenta valūta: JPY

118. Automātiski atpērkams kapitāla vērtspapīru produkts.

Garā pozīcija

Reģistrācija "reģistrācijas datumā"

Nosacītā summa ("kapitāls"): 1 000 000 EUR

Pamatā esošais instruments *EURO STOXX* 50 indekss (burtkods: SX5E).

EBI instrumenta valūta: EUR

Termiņš: 5 gadi

Ikgadējā izmaksa un gada novērojumi ("Reģistrācijas datums + 1 gads", "Reģistrācijas datums + 2 gadi", "Reģistrācijas datums + 3 gadi", "Reģistrācijas datums + 4 gadi", "Reģistrācijas datums + 5 gadi"). Izmaksa tiek veikta 10 dienas pēc atsauces datuma.

Kupons: 6 %

Automātiskas atpirkšanas līmenis ("sākotnējā vērtība"): Reģistrācijas datuma dienas beigas + 1 mēnesis

Barjeras kuponu maksājums 60 % apmērā no automātiskas atpirkšanas līmeņa

Aizsargbarjera: 55 % no automātiskas atpirkšanas līmeņa

— Kapitāls, kas nav garantēts, ja indekss nepārsniedz aizsargbarjeru (kapitāls, kas atdots 5. gadā, būs *pro rata*, ja līmenis nepārsniedz aizsargbarjeru: piemēram, ja SX5E = 40 % no tā sākotnējā līmeņa, tad atdotais kapitāls ir 40 %),

— ja SX5E ≥ 60 % (barjeras kupons) no sākotnējās vērtības jebkura gada beigās, tad kupons tiek izmaksāts 6 % apmērā,

— ja SX5E ≥ 100 % no tā sākotnējās vērtības jebkura gada beigās, tad produkts tiek pārdots un izmaksa ir kupons plus kapitāls (100 %),

— ja SX5E < 60 % (barjeras kupons) no sākotnējās vērtības jebkura gada beigās, tad kupons netiek izmaksāts,

— ja SX5E < 55 % (aizsargbarjera) no sākotnējās vērtības 5. gada beigās, tad kapitālu izmaksā tikai pro rata; ja SX5E >= 55 % (aizsargbarjera) no sākotnējās vērtības 5. gada beigās, tad kapitālu izmaksā pilnā apmērā.

119. Garās pozīcijas pirkšanas iespējas līgumi. Pamatā esošais *EURO STOXX 50* indekss (burtkods: SX5E), *ATM*.

Nosacītā summa: indeksa vērtība ir vienāda ar 1 000 EUR

Derīguma termiņa beigu datums: T gada jūnijs

EBI instrumenta valūta: EUR

120. Garās pozīcijas pirkšanas iespējas līgumi. Pamatā esošais *EURO STOXX 600* indekss (burtkods: SXXP), *ATM*.

Nosacītā summa: indeksa vērtība ir vienāda ar 10 000 EUR

Derīguma termiņa beigu datums: T gada jūnijs

EBI instrumenta valūta: EUR

121. Garās pozīcijas pirkšanas iespējas līgumi. Pamatā esošais VIX (*CBOE*), *ATM*.

Nosacītā summa: indeksa vērtība ir vienāda ar 100 000 USD

Derīguma termiņa beigu datums: T gada jūnijs

EBI instrumenta valūta: USD

IR

201. 5 gadu *IRS* EUR – saņem fiksētu likmi un maksā mainīgu procentu likmi.

Fiksētā daļa: saņem katru gadu

Mainīgā likme: 6 mēnešu *EURIBOR*, maksā reizi pusgadā Dienu skaits: Faktiskais dienu skaits/360

Nosacītā summa: 10 000 000 EUR

Darbdienu un brīvdienu (*roll*) principi un kalendārs: standarta

Spēkā stāšanās datums kā reģistrācijas datums (t. i., izmantojamās likmes ir tādas, kādas tās bija tirgū reģistrācijas datumā).

Termiņš: T+4 gada septembris.

EBI instrumenta valūta: EUR

202. Divu gadu EUR mijmaiņas iespējas līgums par 5 gadu *IRS* EUR – maksā fiksētu likmi un saņem mainīgu likmi.

Nosacītā summa: 10 000 000 EUR.

Iestāde pārdod iespējas līgumu attiecībā uz mijmaiņas līgumu. Iestādes darījumu partneris pērk tiesības noslēgt mijmaiņas līgumu ar iestādi; ja darījumu partneris izmanto savas tiesības, tas saņem fiksēto likmi, savukārt iestāde saņem mainīgo likmi.

Mijmaiņas iespējas līgums ar divu gadu termiņu (reģistrācijas datums + 2 gadi) par *IRS*, kas definēts šādi: fiksētā daļa: maksā katru gadu; mainīgā likme: 6 mēnešu *EURIBOR*, saņem reizi pusgadā; nosacītā summa: 10 000 000 EUR; darbdienu un brīvdienu (*roll*) principi un kalendārs: standarta; pamatā esošā mijmaiņas līguma spēkā stāšanās datums: reģistrācijas datums + 2 gadi.

Pamatā esošā mijmaiņas līguma termiņš: reģistrācijas datums + 7 gadi.

Prēmija, kas samaksāta reģistrācijas datumā (reģistrācijas datums). Skaidrā naudā

Norunas cenas pamatā ir nākotnes mijmaiņas darījuma (*forward starting swap*) *ATM* likme, kas definēta šajā instrumentā.

EBI instrumenta valūta: EUR

203. 5 gadu *IRS* USD. Saņem fiksētu likmi un maksā mainīgu likmi.

Fiksētā likme: saņem katru gadu

Mainīgā likme: 3 mēnešu USD *SOFR* likme, maksā reizi ceturksnī

Nosacītā summa: 1 000 000 USD

Darbdienu un brīvdienu (*roll*) principi un kalendārs: standarta

Spēkā stāšanās datums kā reģistrācijas datums (t. i., izmantojamās likmes ir tādas, kādas tās bija tirgū reģistrācijas datumā).

Termiņš : T+4 gada septembris.

EBI instrumenta valūta: USD

204. 2 gadu *IRS* GBP. Saņem fiksētu likmi un maksā mainīgu likmi.

Fiksētā likme: saņem katru gadu

Mainīgā likme: *SONIA* (uz nakti) likme, ko kumulē un apmaksā reizi ceturksnī Dienu skaits: *ACT*/365

Nosacītā summa: 10 000 000 GBP

Darbdienu un brīvdienu (*roll*) principi un kalendārs: standarta

Spēkā stāšanās datums kā reģistrācijas datums (t. i., izmantojamās likmes ir tādas, kādas tās bija tirgū reģistrācijas datumā).

Termiņš: Reģistrācijas datums + 2 gadi

EBI instrumenta valūta: GBP

205. *UBS* tirgota 10 g. mainīgā likme ar peļņas ierobežojumu

Nosacītā summa (pamatsumma): 1 000 000 USD

Parādzīmes ar mainīgu likmi (“parādzīmes”) ir *UBS AG* augstākās prioritātes nenodrošinātas saistības (“UBS”).

EBI instrumenta valūta: USD

— Pa parādzīmēm maksā procentus saskaņā ar gada likmi, kas ir vienāda ar USD trīs mēnešu *SOFR* plus 1,5 % gadā (“mainīgā procentu likme”), ievērojot maksimālo likmi 7,5 % apmērā gadā (“procentu likmes maksimālā robežvērtība”) un minimālo likmi 2,5 % apmērā gadā (“procentu likmes minimālā robežvērtība”).

— Jebkuram maksājumam par parādzīmēm, tostarp procentiem un pamatsummai, sasniedzot termiņu, piemēro *UBS AG* kredītspēju. Iestādēm ir lūgts izmantot piemērotu diskonta līkni, kuru izskaidro paskaidrojumā.

— Ienākumi: Parādzīmes maksās procentus reizi ceturksnī ar likmi, kas vienāda ar mainīgo procentu likmi, ja kādā kupona noteikšanas datumā i) mainīgā procentu likme ir mazāka par procentu likmes minimālo robežvērtību, tad piemērojamā procentu likme attiecīgajam procentu periodam būs vienāda ar procentu likmes minimālo robežvērtību, vai ja ii) mainīgā procentu likme ir lielāka par procentu likmes maksimālo robežvērtību, tad attiecīgajam procentu periodam piemērojamā procentu likme būs vienāda ar procentu likmes maksimālo robežvērtību.

Procentu maksājuma summa	Procentu summa, kas jāmaksā par procentu perioda parādzīmēm, ir vienāda ar summu, ko veido a) parādzīmju pamatsumma, b) piemērojamā procentu likme attiecīgajam procentu periodam un c) daļa, kuras skaitītājs ir dienu skaits procentu periodā (ko aprēķina, pamatojoties uz 360 dienu gadu divpadsmit 30 dienu mēnešos) un kuras saucējs ir 360.
Tirdzniecības un norēķinu datums	"Reģistrācijas datums"
Procentu maksājumu datumi	Reizi ceturksnī, reģistrācijas datumā + 3 mēneši, reģistrācijas datumā + 6 mēneši, reģistrācijas datumā + 9 mēneši un reģistrācijas datumā + 1 gads, sākot no reģistrācijas datuma + 3 mēneši, parādzīmju darbības laikā (ievērojot korekcijas, kā aprakstīts šeit).
Termiņš	Reģistrācijas datums + 10 gadi
Valūta	USD
Dienu aprēķina princips	30/360
Vienošanās par brīvdienās iekrītošajiem maksājumiem	Nākamā diena, nekoriģēta
Kupona noteikšana Datums	Attiecībā uz katru procentu periodu otrā Londonas banku darbdiena, kas ir tieši pirms attiecīgā procentu datuma. "Londonas banku darbdiena" ir jebkura diena, kurā komercbankas ir atvērtas vispārējai darbībai (t. sk. darījumiem ar ārvalstu valūtu un noguldījumiem ārvalstu valūtā) Londonā un kurā notiek darījumi ASV dolāros Londonas starpbanku tirgū.

206. Garās pozīcijas GERMANY GOVT (Vācijas valdība) (inflācija) 1 000 000 EUR (*ISIN* DE0001030583).

Termiņš: 2033. gada 15. aprīlis

EBI instrumenta valūta: EUR

207. Īsās pozīcijas GERMANY GOVT (Vācijas valdība) 1 000 000 EUR (*ISIN* DE0001030708).

Termiņš: 2030. gada 15. augusts

EBI instrumenta valūta: EUR

208. Garā pozīcija attiecībā uz ITALY GOVT (Itālijas valdība) (inflācija) 1 000 000 EUR apmērā (*ISIN* IT0005138828).

Termiņš: 2032. gada 15. septembris

EBI instrumenta valūta: EUR

209. Garās pozīcijas ITALY GOVT (Itālijas valdība) 1 000 000 EUR (*ISIN* IT0005340929).

Termiņš: 2028. gada 1. decembris

EBI instrumenta valūta: EUR

210. Garās pozīcijas SPAIN GOVT (Spānijas valdība) 1 000 000 EUR (*ISIN* ES00000127A2)

Termiņš: 2030. gada 30. jūlijs

EBI instrumenta valūta: EUR

211. Īsās pozīcijas FRANCE GOVT (Francijas valdība) 1 000 000 EUR (*ISIN* FR0012993103)

Termiņš: 2031. gada 25. maijs

EBI instrumenta valūta: EUR

212. Īsās pozīcijas GERMANY GOVT (Vācijas valdība) 1 000 000 EUR (*ISIN* DE0001135176))

Termiņš: 2031. gada 4. janvāris

EBI instrumenta valūta: EUR

213. Garās pozīcijas UNITED KINGDOM GOVT (Apvienotās Karalistes valdība) 1 000 000 GBP (*ISIN* GB0004893086)

Termiņš: 2032. gada 7. jūnijs

EBI instrumenta valūta: GBP

214. Garās pozīcijas PORTUGAL GOVT (Portugāles valdība) 1 000 000 EUR (*ISIN* PTOTEXOE0024)

Termiņš: 2029. gada 15. jūnijs

EBI instrumenta valūta: EUR

215. Īsās pozīcijas UNITED STATES GOVT (Amerikas Savienoto Valstu valdība) 1 000 000 USD (*ISIN* US91282CAV37)

Termiņš: 2030. gada 15. novembrī

EBI instrumenta valūta: USD

216. Garā pozīcija BRAZIL GOVT (Brazīlijas valdība) (atpērkama) 1 000 000 USD (*ISIN* US105756BZ27)

Termiņš: 2028. gada 13. janvāris

EBI instrumenta valūta: USD

217. Garā pozīcija MEXICO GOVT (Meksikas valdība) (atpērkama) 1 000 000 USD (*ISIN* US91087BAT70)

Termiņš: 2033. gada 19. maijs

EBI instrumenta valūta: USD

218. 10 gadu *IRS* EURO – saņem mainīgu likmi un maksā fiksētu procentu likmi.

Fiksētā daļa: maksā katru gadu.

Mainīgā likme: 3 mēnešu *EURIBOR*, saņem reizi ceturksnī. Dienu skaits: Faktiskais dienu skaits/360

Nosacītā summa: 10 000 000 EUR

Darbdienu un brīvdienu (*roll*) principi un kalendārs: standarta

Spēkā stāšanās datums kā reģistrācijas datums (t. i., izmantojamās likmes ir tādas, kādas tās bija tirdzniecības sesijas slēgšanas brīdī reģistrācijas datumā).

Termiņš: Reģistrācijas datums + 10 gadi

EBI instrumenta valūta: EUR

219. 5 gadu *IRS* EURO – saņem mainīgu likmi un maksā fiksētu procentu likmi.

Fiksētā daļa: maksā katru gadu.

Mainīgā likme: 6 mēnešu *EURIBOR*, saņem reizi 6 mēnešos. Dienu skaits: Faktiskais dienu skaits/360

Nosacītā summa: 10 000 000 EUR

Darbdienu un brīvdienu (*roll*) principi un kalendārs: standarta

Spēkā stāšanās datums kā reģistrācijas datums (t. i., izmantojamās likmes ir tādas, kādas tās bija tirdzniecības sesijas slēgšanas brīdī reģistrācijas datumā).

Termiņš: Reģistrācijas datums + 5 gadi

EBI instrumenta valūta: EUR

220. 5 gadu pēc tirgus vērtības novērtēts (*MtM*) EUR/USD ārvalstu valūtas maiņas līgums. Saņem USD un maksā EUR.

EUR: 3 mēnešu *ESTER*, maksā reizi ceturksnī kopā ar 2 dienu maksājuma intervālu Dienu skaits: Faktiskais dienu skaits/360

USD: 3 mēnešu *SOFR*, saņem reizi ceturksnī kopā ar 2 dienu maksājuma intervālu Dienu skaits: Faktiskais dienu skaits/360

1. daļa – USD: Nosacītā summa 10 000 000 EUR, kuru koriģē reizi ceturksnī

2. daļa – EUR: Nosacītā summa 10 000 000 EUR apmērā;

Darbdienu un brīvdienu (*roll*) principi un kalendārs: standarta

Spēkā stāšanās datums kā reģistrācijas datums + 6 mēneši

Termiņš: Reģistrācijas datums + 5,5 gadi

EBI instrumenta valūta: EUR

Sk. arī šā pielikuma 6. iedaļu – Papildu specifikācijas instrumentiem

221. 10 gadu *IRS* EURO – saņem *ESTER* un maksā *EURIBOR*.

ESTER daļa: saņem katru gadu. Dienu skaits: Faktiskais dienu skaits/360

EURIBOR daļa: 3 mēnešu *EURIBOR* likme + bāzes punkti, maksā reizi ceturksnī Dienu skaits: Faktiskais dienu skaits/360

Nosacītā summa: 10 000 000 EUR

Darbdienu un brīvdienu (*roll*) principi un kalendārs: standarta

Spēkā stāšanās datums kā reģistrācijas datums (t. i., izmantojamās likmes ir tādas, kādas tās bija tirgū reģistrācijas datumā).

Termiņš: T+ 9 gada septembris

EBI instrumenta valūta: EUR

222. Garā pozīcija attiecībā uz ITALY GOVT (Itālijas valdība) (inflācija) 1 000 000 EUR apmērā (*ISIN* IT0005387052).

Termiņš: 2030. gada 15. maijs

EBI instrumenta valūta: EUR

223. 5 gadu nulles kupona inflācijas mijmaiņas līgums EUR – saņem atbilstīgi indeksācijas līmenim indeksētu atdevi un maksā fiksētu likmi (r).

Inflācijas indekss: *CPI* (HICPxT)

Fiksētā daļa (maksā fiksētu likmi): $[(1 + r)^5 - 1]$

Atbilstīgi indeksācijas līmenim indeksēta atdeve: $\left[\left(\frac{CPI \text{ at the end (maturity) date}}{CPI \text{ at the start date}}\right) - 1\right]$

Nosacītā summa: 10 000 000 EUR

Bāzes noteikšanas datums: T-1 gada jūnijs

Galīgā noteikšana: T+4 gada augusts

Termiņš: T+4 gada septembris

EBI instrumenta valūta: EUR

224. Divu gadu EUR mijmaiņas iespējas līgums attiecībā uz 5 gadu procentu likmju mijmaiņas līgumu EUR – saņem fiksētu likmi un maksā mainīgu procentu likmi.

Nosacītā summa: 10 000 000 EUR.

Iestāde pārdod iespējas līgumu attiecībā uz mijmaiņas līgumu. Iestādes darījumu partneris pērk tiesības noslēgt mijmaiņas līgumu ar iestādi; ja darījumu partneris izmanto savas tiesības, tas saņem mainīgo likmi, savukārt iestāde saņem fiksēto likmi.

Mijmaiņas iespējas līgums ar divu gadu termiņu (reģistrācijas datums + 2 gadi) par *IRS*, kas definēts šādi: fiksētā daļa: saņem katru gadu; Mainīgā likme: 6 mēnešu *EURIBOR*, maksā reizi 6 mēnešos; Nosacītā summa: 10 000 000 EUR. Darbdienu un brīvdienu (*roll*) principi un kalendārs: standarta; Pamatā esošā mijmaiņas līguma spēkā stāšanās datums: Reģistrācijas datums + 2 gadi

Pamatā esošā mijmaiņas līguma termiņš: Reģistrācijas datums + 7 gadi

Prēmija, kas samaksāta reģistrācijas datumā (reģistrācijas datums). Norēķini skaidrā naudā.

Norunas cenas pamatā ir nākotnes mijmaiņas darījuma (*forward starting swap*) *ATM* likme, kas definēta šajā instrumentā, + 100 bāzes punkti

EBI instrumenta valūta: EUR

FX

301. 6 mēnešu USD/EUR regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums. Norēķini skaidrā naudā. Garā pozīcija USD – īsā pozīcija EUR; Nosacītā summa 10 000 000 USD apmērā; Regulētā tirgū netirgotu nākotnes līgumu norunas cena: vienāda ar 100 % no attiecīgā ECB atsauces tūlītējā kursa reģistrācijas datuma beigās.

EBI instrumenta valūta: EUR

302. 6 mēnešu EUR/GBP regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums. Norēķini skaidrā naudā. Garā pozīcija EUR – īsā pozīcija GBP; Nosacītā summa 10 000 000 GBP apmērā: Regulētā tirgū netirgotu nākotnes līgumu norunas cena: vienāda ar 100 % no attiecīgā ECB atsauces tūlītējā kursa reģistrācijas datuma beigās.

EBI instrumenta valūta: EUR

303. Garā pozīcija 10 000 000 USD skaidrā naudā.

Kases stāvoklis. Jāuzskata par tādu, kam ir raksturīgs ārvalstu valūtas risks, kā aprakstīts kk) apakšpunktā

EBI instrumenta valūta: EUR

304. Garās pozīcijas EUR/USD pirkšanas iespējas līgums (garā pozīcija EUR, īsā pozīcija USD). Norēķini skaidrā naudā. Nosacītā summa: 10 000 000 EUR. Līdzvērtīga summa, kuras pamatā ir EUR/USD ECB atsauces tūlītējais kurss reģistrācijas datuma beigās.

Norunas cena: 110 % no EUR/USD ECB atsauces likmes reģistrācijas datuma beigās.

Derīguma termiņa beigu datums: Reģistrācijas datums + 1 gads

EBI instrumenta valūta: EUR

305. Garās pozīcijas EUR/USD pirkšanas iespējas līgums (garā pozīcija EUR, īsā pozīcija USD). Norēķini skaidrā naudā. Nosacītā summa: 10 000 000 EUR. Līdzvērtīga summa, kuras pamatā ir EUR/USD ECB atsauces tūlītējais kurss reģistrācijas datuma beigās.

Norunas cena: 90 % no EUR/USD ECB atsauces likmes reģistrācijas dienas beigās.

Derīguma termiņa beigu datums: Reģistrācijas datums + 1 gads

EBI instrumenta valūta: EUR

306. Īsās pozīcijas EUR/USD pirkšanas iespējas līgums (īsā pozīcija EUR, garā pozīcija USD). Norēķini skaidrā naudā. Nosacītā summa: 10 000 000 EUR. Līdzvērtīga summa, kuras pamatā ir EUR/USD ECB atsauces tūlītējais kurss reģistrācijas datuma beigās.

Norunas cena: 100 % no EUR/USD ECB atsauces likmes reģistrācijas datuma beigās.

Derīguma termiņa beigu datums: Reģistrācijas datums + 1 gads

EBI instrumenta valūta: EUR

307. Īsās pozīcijas EUR/GBP pirkšanas iespējas līgums (īsā pozīcija EUR, garā pozīcija GBP). Norēķini skaidrā naudā. Nosacītā summa: 10 000 000 EUR. Līdzvērtīga summa, kuras pamatā ir EUR/GBP ECB atsauces tūlītējais kurss reģistrācijas datuma beigās.

Norunas cena: 110 % no EUR/GBP ECB atsauces likmes reģistrācijas datuma beigās.

Derīguma termiņa beigu datums: Reģistrācijas datums + 1 gads

EBI instrumenta valūta: EUR

308. Garās pozīcijas EUR/JPY pārdošanas iespējas līgums (īsā pozīcija EUR, garā pozīcija JPY). Norēķini skaidrā naudā. Nosacītā summa: 10 000 000 EUR. Līdzvērtīga summa, kuras pamatā ir EUR/JPY ECB atsauces tūlītējais kurss reģistrācijas datuma beigās.

Norunas cena: 110 % no EUR/JPY ECB atsauces likmes reģistrācijas datuma beigās.

Derīguma termiņa beigu datums: Reģistrācijas datums + 1 gads

EBI instrumenta valūta: EUR

309. Īsās pozīcijas EUR/AUD pārdošanas iespējas līgums (garā pozīcija EUR, īsā pozīcija AUD). Norēķini skaidrā naudā. Nosacītā summa: 10 000 000 EUR. Līdzvērtīga summa, kuras pamatā ir EUR/AUD ECB atsauces tūlītējais kurss reģistrācijas datuma beigās.

Norunas cena: 110 % no EUR/AUD ECB atsauces likmes reģistrācijas dienas beigās.

Derīguma termiņa beigu datums Reģistrācijas datums + 1 gads

EBI instrumenta valūta: EUR

310. 6 mēnešu EUR/DKK regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums (garā pozīcija EUR, īsā pozīcija DKK). Norēķini skaidrā naudā. Nosacītā summa 10 000 000 EUR apmērā; EUR/DKK ECB atsauce kā tūlītējais kurss reģistrācijas datuma beigās, lai noteiktu nākotnes procentu likmi.

EBI instrumenta valūta: EUR

311. 6 mēnešu EUR/BRL regulētā tirgū netirgots nepiegādājams nākotnes līgums (garā pozīcija EUR, īsā pozīcija BRL); Nosacītā summa 10 000 000 EUR apmērā; EUR/BRL ECB atsauce kā tūlītējais kurss reģistrācijas datuma beigās, lai noteiktu nākotnes procentu likmi.

EBI instrumenta valūta: EUR

PRECES

401. Garās pozīcijas sešu mēnešu
3 500 Trojas unces Londonas zelta regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi (garā pozīcija zelts, īsā pozīcija USD). Norēķini skaidrā naudā. Norunas cena: Sešu mēnešu dienas beigu regulētā tirgū netirgotu nākotnes līgumu cena reģistrācijas dienā

EBI instrumenta valūta: USD

402. Īsās pozīcijas 12 mēnešu 3 500 Trojas unces Londonas zelta regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi (īsā pozīcija zelts, garā pozīcija USD). Norēķini skaidrā naudā. Norunas cena: 12 mēnešu dienas beigu regulētā tirgū netirgotu nākotnes līgumu cena reģistrācijas dienā

EBI instrumenta valūta: USD

403. Garās pozīcijas *Brent* jēlnaftas pirkšanas iespējas līgums, apjoms – 30 000 bareli (garā pozīcija WTI, īsā pozīcija USD). Norēķini skaidrā naudā. Norunas cena: 12 mēnešu dienas beigu regulētā tirgū netirgota nākotnes darījuma cena reģistrācijas dienā. Derīguma termiņa beigu datums: Reģistrācijas datums + 6 mēneši

EBI instrumenta valūta: USD

404. Īsās pozīcijas *Brent* jēlnaftas pārdošanas iespējas līgums – 30 000 bareli (garā pozīcija WTI, īsā pozīcija USD). Norēķini skaidrā naudā. Norunas cena: 12 mēnešu regulētā tirgū netirgota nākotnes darījuma cena dienas beigās rezervācijas dienā. Derīguma termiņa beigu datums: Reģistrācijas datums + 6 mēneši

EBI instrumenta valūta: USD

405. Garās pozīcijas pirkšanas iespējas līgums – 5 000 Trojas unces Londonas zelta (garā pozīcija zelts, īsā – USD). Norēķini skaidrā naudā. Norunas cena: 18 mēnešu regulētā tirgū netirgota nākotnes darījuma cena dienas beigās rezervācijas dienā. Derīguma termiņa beigu datums: Reģistrācijas datums + 18 mēneši

EBI instrumenta valūta: USD

KREDĪTRISKA STARPĪBA

501. Garās pozīcijas (t. i., aizsardzības pirkšana) *CDS* 1 000 000 USD apmērā attiecībā uz PORTUGĀLI

Pārstrukturizācijas klauzula: PILNĪGA

EBI instrumenta valūta: USD

502. Garās pozīcijas (t. i., aizsardzības pirkšana) *CDS* 1 000 000 USD apmērā attiecībā uz ITĀLIJU.

Pārstrukturizācijas klauzula: PILNĪGA
EBI instrumenta valūta: USD

503. Īsās pozīcijas (t. i., aizsardzības pārdošana) CDS 1 000 000 USD apmērā attiecībā uz SPĀNIJU

Pārstrukturizācijas klauzula: PILNĪGA
EBI instrumenta valūta: USD

504. Garās pozīcijas (t. i., aizsardzības pirkšana) *CDS* 1 000 000 USD apmērā attiecībā uz MEKSIKU

Pārstrukturizācijas klauzula: PILNĪGA
EBI instrumenta valūta: USD

505. Garās pozīcijas (t. i., aizsardzības pirkšana) *CDS* 1 000 000 USD apmērā attiecībā uz BRAZĪLIJU.

Pārstrukturizācijas klauzula: PILNĪGA
EBI instrumenta valūta: USD

506. Garās pozīcijas (t. i., aizsardzības pirkšana) *CDS* 1 000 000 USD apmērā attiecībā uz APVIENOTO KARALISTI.

Pārstrukturizācijas klauzula: PILNĪGA
EBI instrumenta valūta: USD

507. Īsās pozīcijas (t. i., aizsardzības pārdošana) *CDS* 1 000 000 EUR apmērā attiecībā uz *Telefonica* (burtkods: TEF SM)

EBI instrumenta valūta: EUR

508. Garās pozīcijas (t. i., aizsardzības pirkšana) *CDS* 1 000 000 EUR apmērā attiecībā uz *Telefonica* (burtkods: TEF SM)

Termiņš: T+2 gada decembris
EBI instrumenta valūta: EUR

509. Īsās pozīcijas (t. i., aizsardzības pārdošana) *CDS* 1 000 000 USD apmērā attiecībā uz *Aviva* (burtkods: AV LN).

ISDA definīcijas, 2003. gads
EBI instrumenta valūta: EUR

510. Garās pozīcijas (t. i., aizsardzības pirkšana) *CDS* 1 000 000 EUR apmērā attiecībā uz *Aviva* (burtkods: AV LN)

ISDA definīcijas, 2003. gads
Termiņš: T+2 gada decembris
EBI instrumenta valūta: EUR

511. Īsās pozīcijas (t. i., aizsardzības pārdošana) *CDS* 1 000 000 EUR apmērā attiecībā uz *Vodafone* (burtkods: VOD LN)

EBI instrumenta valūta: EUR

512. Īsās pozīcijas (t. i., aizsardzības pārdošana) *CDS* 1 000 000 EUR apmērā attiecībā uz *ENI SpA* (burtkods ENI IM).

EBI instrumenta valūta: EUR

513. Īsās pozīcijas (t. i., aizsardzības pārdošana) *CDS* 1 000 000 USD attiecībā uz *Eli Lilly* (burtkods: LLY US).

Pārstrukturizācijas klauzula: Pārstrukturizācijas nav (XR14)
EBI instrumenta valūta: USD

514. Īsās pozīcijas (t. i., aizsardzības pārdošana) *CDS* 1 000 000 EUR apmērā attiecībā uz *Unilever* (burtkods: UNA NA).

EBI instrumenta valūta: EUR

515. Garās pozīcijas (t. i., aizsardzības pirkšana) *CDS* 1 000 000 EUR apmērā attiecībā uz *Total SA* (burtkods: FP FP).

EBI instrumenta valūta: EUR

516. Garās pozīcijas (t. i., aizsardzības pirkšana) *CDS* 1 000 000 EUR apmērā attiecībā uz *Volkswagen Group* (burtkods: VOW GR).

EBI instrumenta valūta: EUR

517. Garā pozīcija attiecībā uz TURCIJAS valsts parādzīmēm 1 000 000 USD (*ISIN* US900123CT57)

Termiņš: 2029. gada 26. aprīlis

EBI instrumenta valūta: USD

518. Garās pozīcijas (t. i., pirkšanas aizsardzība) *CDS* 1 000 000 USD apmērā attiecībā uz TURCIJU Spēkā stāšanās datums ir reģistrācijas datums.

Pārstrukturizācijas klauzula: PILNĪGA

EBI instrumenta valūta: USD

519. Garā pozīcija attiecībā uz *Telefonica* parādzīmēm 1 000 000 EUR apmērā (*ISIN* XS1681521081)

Termiņš: 2028. gada 12. janvāris

EBI instrumenta valūta: EUR

520. Garā pozīcija attiecībā uz *Volkswagen Group* parādzīmēm 1 000 000 EUR apmērā (*ISIN* XS2234567233).

Termiņš: 2028. gada 22. septembris

EBI instrumenta valūta: EUR

521. Īsā pozīcija attiecībā uz *Volkswagen Group* parādzīmēm 1 000 000 EUR apmērā (*ISIN* XS1167667283).

Termiņš: 2030. gada 16. janvāris

EBI instrumenta valūta: EUR

522. Garā pozīcija attiecībā uz *Total SA* parādzīmēm 1 000 000 EUR apmērā (*ISIN* XS1856281834).

Termiņš: 2033. gada 11. jūlijs

EBI instrumenta valūta: EUR

523. Garās pozīcijas AUSTRIA GOVT (Austrijas valdība) 1 000 000 EUR (*ISIN* AT0000A04967).

Termiņš: 2037. gada 15. marts

EBI instrumenta valūta: EUR

524. Garās pozīcijas (t. i., aizsardzības pirkšana) *CDS* 1 000 000 USD apmērā attiecībā uz AUSTRIJU.

Termiņš: T+15 gada jūnijs

EBI instrumenta valūta: USD

525. Garās pozīcijas NETHERLANDS GOVT (Nīderlandes valdība) 1 000 000 EUR (*ISIN* NL0013552060).

Termiņš: 2040. gada 15. janvāris

EBI instrumenta valūta: EUR

526. Garās pozīcijas (t. i., aizsardzības pirkšana) *CDS* 1 000 000 USD apmērā attiecībā uz NĪDERLANDI.

Termiņš: T+20 gada jūnijs

EBI instrumenta valūta: USD

527. Garās pozīcijas BELGIUM GOVT (Beļģijas valdība) 1 000 000 EUR (*ISIN* BE0000348574).

Termiņš: 2050. gada 22. jūnijs

EBI instrumenta valūta: EUR

528. Garās pozīcijas (t. i., aizsardzības pirkšana) *CDS* 1 000 000 USD apmērā attiecībā uz BEĻĢIJU.

Termiņš: T+30 gada jūnijs

EBI instrumenta valūta: USD

529. Garās pozīcijas (aizsardzības pirkšana) *CDS* 10 000 000 EUR apmērā attiecībā uz *iTraxx Europe* indeksa aktuālo (*on-the-run*) sēriju.

Termiņš: T+4 gada jūnijs

EBI instrumenta valūta: EUR

530. Īsās pozīcijas pārdošanas iespējas līgums. 10 000 000 EUR. Pamatā esošā *iTraxx Europe* indeksa aktuālā sērija (tas pats instruments 529).

Norunas cena: *ATM*

Derīguma termiņa beigu datums: Reģistrācijas datums + 6 mēneši

EBI instrumenta valūta: EUR

531. Garā pozīcija attiecībā uz *AXA SA* (atpērkama) 1 000 000 EUR apmērā (*ISIN* XS1799611642).

Termiņš: 2049. gada 28. maijs

EBI instrumenta valūta: EUR

532. Garās pozīcijas *AT&T* obligācijās (atpērkamas) 1 000 000 USD (*ISIN* US00206RFW79).

Termiņš: 2037. gada 15. augusts

EBI instrumenta valūta: USD

533. Garā pozīcija attiecībā uz *BAYER AG* (atpērkama) 1 000 000 EUR apmērā (*ISIN* XS2199266268).

Termiņš: 2030. gada 6. janvāris

EBI instrumenta valūta: EUR

534. Garās pozīcijas *ORANGE* obligācijās (atpērkamas) 1 000 000 EUR (*ISIN* FR0013323870).

Termiņš: 2028. gada 20. marts

EBI instrumenta valūta: EUR

CTP

601. Īsā pozīcija (t. i., aizsardzības pārdošana) *iTraxx Europe* indeksa aktuālā (*on-the-run*) sērijā.

Piesaistes punkts: 3 %

Atsaistes punkts: 6 %

Nosacītā summa: 5 000 000 EUR

Termiņš: 5 gadi

EBI instrumenta valūta: EUR

602. Garās pozīcijas (t. i. aizsardzības pirkšana) *CDS* 5 000 000 EUR apmērā attiecībā uz *iTraxx Europe* indeksa aktuālo (*on-the-run*) sēriju.

Termiņš: T+4 gada jūnijs

EBI instrumenta valūta: EUR

Koriģēta nosacītā summa, lai pilnībā ierobežotu 601 instrumenta CS01 risku bez atkārtotas riska ierobežošanas

603. Garā pozīcija (t. i., aizsardzības pirkšana) *iTraxx Europe* indeksa aktuālā (*on-the-run*) sērijā.

Piesaistes punkts: 3 %

Atsaistes punkts: 6 %

Nosacītā summa: 5 000 000 EUR

Termiņš: 5 gadi

EBI instrumenta valūta: EUR

604. Īsās pozīcijas (t. i., aizsardzības pirkšana) *CDS* 5 000 000 EUR apmērā attiecībā uz *iTraxx Europe* indeksa aktuālo (*on-the-run*) sēriju.

Termiņš: T+4 gada jūnijs

EBI instrumenta valūta: EUR

Koriģēta nosacītā summa, lai pilnībā ierobežotu 603 instrumenta CS01 risku bez atkārtotas riska ierobežošanas

605. Īsā pozīcija (t. i., aizsardzības pārdošana) *iTraxx Europe* indeksa aktuālā (*on-the-run*) sērijā.

Piesaistes punkts: 12 %

Atsaistes punkts: 100 %

Nosacītā summa: 5 000 000 EUR

Termiņš: 5 gadi

EBI instrumenta valūta: EUR

606. Garās pozīcijas (t. i. aizsardzības pirkšana) *CDS* 5 000 000 EUR apmērā attiecībā uz *iTraxx Europe* indeksa aktuālo (*on-the-run*) sēriju.

Termiņš: T+4 gada jūnijs

EBI instrumenta valūta: EUR

Koriģēta nosacītā summa, lai pilnībā ierobežotu 605 instrumenta CS01 risku bez atkārtotas riska ierobežošanas

607. Garā pozīcija (t. i., aizsardzības pirkšana) *iTraxx Europe* indeksa aktuālā (*on-the-run*) sērijā.

Piesaistes punkts: 12 %

Atsaistes punkts: 100 %

Nosacītā summa: 5 000 000 EUR

Termiņš: 5 gadi

EBI instrumenta valūta: EUR

608. Īsās pozīcijas (t. i., aizsardzības pirkšana) *CDS* 5 000 000 EUR apmērā attiecībā uz *iTraxx Europe* indeksa aktuālo (*on-the-run*) sēriju.

Termiņš: T+4 gada jūnijs

EBI instrumenta valūta: EUR

Koriģēta nosacītā summa, lai pilnībā ierobežotu 607 instrumenta CS01 risku bez atkārtotas riska ierobežošanas

609. Īsā pozīcija (t. i., aizsardzības pārdošana) *iTraxx Europe* indeksa aktuālā (*on-the-run*) sērijā.

Piesaistes punkts: 3 %

Atsaistes punkts: 6 %

Nosacītā summa: 5 000 000 EUR

Termiņš: 5 gadi

EBI instrumenta valūta: EUR

Atgūšanas rādītājs 40 % fiksēts.

610. Garās pozīcijas (t. i. aizsardzības pirkšana) *CDS* 5 000 000 EUR apmērā attiecībā uz *iTraxx Europe* indeksa aktuālo (*on-the-run*) sēriju.

Termiņš: T+4 gada jūnijs

EBI instrumenta valūta: EUR

Koriģēta nosacītā summa, lai pilnībā ierobežotu 609 instrumenta CS01 risku bez atkārtotas riska ierobežošanas

3. iedaļa. Atsevišķi portfeļi – viens instruments

Iestādes sniedz nepieciešamos riska mērus, kā arī pašreizējo vērtību šādiem atsevišķiem portfeļiem:

Portfelis	*Instrumentu kombinācija:* pirmais cipars atspoguļo instrumentu (kā minēts šā pielikuma 2. iedaļā). Otrais cipars norāda katra instrumenta daudzumu vai attiecīgā gadījumā līgumu skaitu.	EBI portfeļa valūta	Nepieciešamie riska mēri
1001	101 – 1 instruments	EUR	*VaR*; *sVaR*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*
1002	102 – 1 instruments	EUR	*VaR*; *sVaR*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*
1003	103 – 1 instruments	EUR	*VaR*; *sVaR*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*
1004	104 – 1 instruments	EUR	*VaR*; *sVaR*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*
1005	105 – 1 instruments	EUR	*VaR*; *sVaR*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*
1006	106 – 1 instruments	GBP	*VaR*; *sVaR*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*
1007	107 – 1 instruments	EUR	*VaR*; *sVaR*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*
1008	108 – 1 instruments	EUR	*VaR*; *sVaR*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*
1009	109 – 1 instruments	EUR	*VaR*; *sVaR*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*
1010	110 – 1 instruments	EUR	*VaR*; *sVaR*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*
1011	111 – 1 instruments	USD	*VaR*; *sVaR*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*
1012	112 – 1 instruments	USD	*VaR*; *sVaR*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*
1013	113 – 1 instruments	EUR	*VaR*; *sVaR*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*
1014	114 – 1 instruments	EUR	*VaR*; *sVaR*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*
1015	115 – 1 instruments	GBP	*VaR*; *sVaR*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*
1016	116 – 1 instruments	GBP	*VaR*; *sVaR*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*
1017	117 – 1 instruments	JPY	*VaR*; *sVaR*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*
1018	118 – 1 instruments	EUR	*VaR*; *sVaR*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*

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

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

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

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

4. iedaļa. Atsevišķi portfeļi – vairāki instrumenti

Iestādes sniedz nepieciešamos riska mērus, kā arī pašreizējo vērtību šādiem atsevišķiem portfeļiem:

Portfelis	*Instrumentu kombinācija:* pirmais cipars atspoguļo instrumentu (kā minēts šā pielikuma 2. iedaļā). Otrais cipars norāda katra instrumenta daudzumu vai attiecīgā gadījumā līgumu skaitu.	EBI portfeļa valūta	Nepieciešamie riska mēri
1101	103 – 1 instruments 104 – 1 instruments 105 – 1 instruments	EUR	*VaR*; *sVaR*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*
1102	113 – 1 instruments 110 – 1 instruments	EUR	*VaR*; *sVaR*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*
1103	115 – 1 instruments 116 – 1 instruments	GBP	*VaR*; *sVaR*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*
1104	109 – 1 instruments 110 – 1 instruments	EUR	*VaR*; *sVaR*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*

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

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

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

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

5. iedaļa. Apkopotie portfeļi

Iestādes sniedz nepieciešamos riska mērus, kā arī pašreizējo vērtību šādiem apkopotiem finanšu portfeļiem:

Apkopots portfelis	Apraksts	*Atsevišķu portfeļu kombinācija* (atsevišķi portfeļi, kā norādīts pēc to numura šā pielikuma 3. un 4. iedaļā)	EBI portfeļa valūta	Nepieciešamie riska mēri
10000	Visaptveroši, bez *CTP*	1001, 1101, 1104, 1106, 2001, 2002, 2203, 2206, 3301, 3303, 3304, 4401, 4402, 5503, 5506, 5508, 5521	EUR	*VaR*; *sVaR*; *IRC*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*
11000	Kumulatīvi KAPITĀLA VĒRTSPAPĪRI	1001, 1101, 1104, 1106	EUR	*VaR*; *sVaR*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*
12000	Kumulatīvs *IR*	2001, 2002, 2203, 2206	EUR	*VaR*; *sVaR*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*
13000	Kumulatīvs *FX*	3301, 3303, 3304	EUR	*VaR*; *sVaR*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*
14000	Kumulatīvs preču apjoms	4401, 4402	USD	*VaR*; *sVaR*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*
15000	Kumulatīva kredītriska starpība	5503, 5506, 5508, 5521	EUR	*VaR*; *sVaR*; *IRC*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*
16000	*CTP* kumulatīvs EUR	6601, 6602	EUR	*VaR*; *sVaR*; *APR*; *SBM*; *DRC*; *RRAO*

6. iedaļa. Papildu specifikācijas instrumentiem

Šā pielikuma 2. iedaļā aprakstītajiem finanšu instrumentiem iestādes piemēro šādas papildu specifikācijas:

Instruments	220
Apraksts	5 gadu pēc tirgus vērtības novērtēts (*MtM*) EUR/USD ārvalstu valūtas maiņas līgums Saņem USD un maksā EUR Nosacītā summa: 10 000 000 EUR, USD (EUR 10 000 000 * FX USD/EUR)
Maksā:	2. mainīgā daļa
Saņem:	1. mainīgā daļa
Nosacītā apmaiņa un pārskatīšana:	Spēkā stāšanās dienā un termiņa beigu dienā. Turklāt katrā kupona maksājuma dienā tiek veikts papildu maksājums, kas atbilst USD nosacītās summas korekcijai 2. mainīgajā daļā. USD nosacīto summu koriģē, lai tā būtu vienāda ar 10 000 000 EUR atbilstoši tūlītējiem valūtas kursiem 2 darbdienas pirms katra maksājuma datuma.
Naudas atlikums	Iekļauj
1. mainīgā daļa	
Nosacītā summa:	10 000 000 EUR ekvivalents, kas konvertēts USD tūlīt pēc spēkā stāšanās datuma, ekvivalents, kas koriģēts reizi ceturksnī
Spēkā stāšanās diena:	Reģistrācijas datums + 6 mēneši
Termiņa datums:	Reģistrācijas datums + 5,5 gadi
Maksājuma datuma ģenerēšana:	Pēc spēkā stāšanās datuma
Kupona izmaksas biežums:	Reizi ceturksnī
Kupona likme:	3 mēnešu *SOFR* + 0 bāzes punkti.
Kupona likmes pārskatīšanas biežums:	Reizi ceturksnī
Kupona likmes noteikšanas biežums:	Kumulē ikdienu 3 mēnešu periodā
Kupona likmes kumulēšanas biežums:	Vienkārša procentu likme
Dienu aprēķins:	Faktiskais dienu skaits/360
Maksājumu darbdiena:	*LON, NYC, TARGET*
Vienošanās par darbdienu, kurā veic maksājumu:	Grozīta nākamā darbdiena
Nosacītās summas pārskatīšanas darbdiena:	*LON, NYC, TARGET*
Vienošanās par nosacītās summas pārskatīšanas darbdienu:	Iepriekšējā
upona likmes pārskatīšanas darbdiena:	*LON, NYC, TARGET*
Vienošanās par kupona likmes pārskatīšanas darbdienu:	Iepriekšējā

2. mainīgā daļa	
Nosacītā summa:	10 000 000 EUR
Spēkā stāšanās diena:	Reģistrācijas datums + 6 mēneši
Termiņa datums:	Reģistrācijas datums + 5,5 gadi
Maksājuma datuma ģenerēšana:	Pēc spēkā stāšanās datuma
Kupona izmaksas biežums:	Reizi ceturksnī
Kupona likme:	3 mēnešu *ESTER* + 0 bāzes punkti.
Kupona likmes pārskatīšanas biežums:	Reizi ceturksnī
Kupona likmes noteikšanas biežums:	Kumulē ikdienu 3 mēnešu periodā
Kupona likmes kumulēšanas biežums:	Vienkārša procentu likme
Dienu aprēķins:	Faktiskais dienu skaits/360
Maksājumu darbdiena:	*LON, NYC, TARGET*
Vienošanās par maksājumu darbdienu:	Grozīta nākamā darbdiena
Nosacītās summas pārskatīšanas darbdiena:	*LON, NYC, TARGET*
Vienošanās par nosacītās summas pārskatīšanas darbdienu:	Iepriekšējā
Kupona likmes pārskatīšanas darbdiena:	*LON, NYC, TARGET*
Vienošanās par kupona likmes pārskatīšanas darbdienu:	Iepriekšējā

7. iedaļa. *SBM* validācijas portfeļi

a) Iestādes norāda X pielikumā definēto portfeļu (*SBM* validācijas portfeļi) *SBM* riska mēru kā daļu no *IMV* iesnieguma un iesniedz tos saskaņā ar *IMV* iesniegšanas pārskata datumiem.

b) Lai iesniegtu rezultātus, kas atbilst *SBM* validācijas portfeļiem, piemēro šādus noteikumus:

i) Iestādes uzrāda tikai C120.02 veidni un šajā veidnē norāda tikai pārskatu sniegšanas valūtas rezultātus (t. i., C120.02 veidnes 0060. sleju neaizpilda un veidnes C 106.00 un C 106.01 neuzrāda par *SBM* validācijas portfeļiem);

ii) Iestādes pieņem, ka riska jutīgums un līknes riska darījumi, kas definēti X pielikumā norādītajos instrumentos, ir izteikti iestādes pārskata sniegšanas valūtā un ka informācija ir sniegta formātā, kas norādīts pārskatu sniegšanas norādēs attiecībā uz veidnēm C 106.01/C 120.01 un atbilstošajā tabulā ar norādījumiem par šo veidņu uzrādīšanu VI pielikumā (Norādījumi par veidni).”

III PIELIKUMS

"VI PIELIKUMS

REZULTĀTU UZRAUDZĪBAS SALĪDZINOŠĀS VĒRTĒŠANAS PORTFEĻI

NORĀDĪJUMI SAISTĪBĀ AR VEIDNI

C 106.00 – Sākotnējais tirgus vērtējums un izslēgšanas pamatojums 57
C 106.01 – Ar jutīgumu saistītā metode (*SBM*). Riska jutīgums pa instrumentiem 57
C 107.01 – *VaR* un *sVaR*, kas nav korelācijas tirdzniecības portfelī (*CTP*). Sīkāka informācija 61
C 107.02 – *VaR*, *sVaR* un PV, kas nav korelācijas tirdzniecības portfelī (*CTP*). EBI portfeļa valūtas rezultāti 63
C 108.00 – Peļņas un zaudējumu laikrindas 64
C 109.01 – Inkrementālā riska prasība (*IRC*). Sīkāka informācija par modeli 65
C 109.02 – Inkrementālā riska prasība (*IRC*). Sīkāka informācija pa portfeļiem 65
C 109.03 – Inkrementālā riska prasība (*IRC*). Summa pa portfeļiem/datumiem 66
C 110.01 – Korelācijas tirdzniecība (*CT*). Sīkāka informācija par modeli 67
C 110.02 – Korelācijas tirdzniecība (*CT*). Sīkāka informācija pa portfeļiem 68
C 110.03 – KORELĀCIJAS TIRDZNIECĪBA (*CT*). Viss cenas risks (*APR*) pa portfeļiem/datumiem 69
C 120.01 – AR JUTĪGUMU SAISTĪTĀ METODE (*SBM*). RISKA JUTĪGUMS PA INSTRUMENTIEM/PORTFEĻIEM 69
C 120.02 – AR JUTĪGUMU SAISTĪTĀ METODE (*SBM*). PAŠU KAPITĀLA PRASĪBU (*OFR*) SASTĀVS PA PORTFEĻIEM .72
C 120.04 – SAISTĪBU NEIZPILDES RISKA PRASĪBA (*DRC*). TIRGUS VĒRTĪBAS UN PĒKŠŅAS SAISTĪBU NEIZPILDES (*JTD*) BRUTO SUMMAS PA INSTRUMENTIEM/PORTFEĻIEM 74
C 120.05 – SAISTĪBU NEIZPILDES RISKA PRASĪBA (*DRC*). PAŠU KAPITĀLA PRASĪBU (*OFR*) SASTĀVS PA PORTFEĻIEM 80
C 120.06 – *ASA. OFR* 82

NORĀDĪJUMI SAISTĪBĀ AR VEIDNI

C 106.00 – Sākotnējais tirgus vērtējums un izslēgšanas pamatojums

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0010	Instrumenta numurs	V pielikuma 2. iedaļa	Uzrāda instrumenta numuru, kas minēts V pielikumā.
0020	Instruments modelēts attiecībā uz *VaR* un *sVaR* (JĀ/NĒ)		Norāda JĀ vai NĒ.
0030	Instruments modelēts attiecībā uz *IRC* (JĀ/NĒ)		Norāda JĀ vai NĒ.
0040	Instruments modelēts attiecībā uz korelācijas tirdzniecību (JĀ/NĒ)		Norāda JĀ vai NĒ.
0050	Izslēgšanas pamatojums	3. panta 2. punkts	Uzrāda vienu no šādiem punktiem: a) modeli nav apstiprinājusi regulējošā iestāde; b) instrumentam vai pamatā esošajam instrumentam nav izsniegta iekšēja atļauja; c) pamatā esošā vai modelēšanas iezīme nav iekšēji paredzēta; d) cits izslēgšanas pamatojums. Lūdzu, paskaidrojiet pamatojumu 0060. slejā.
0060	Atbilde brīvā tekstā		Iestāde šajā slejā var sniegt papildu informāciju.
0070	Sākotnējais tirgus novērtējums (“*IMV*”)		Katra instrumenta tirgus cenas vērtība atsauces datumā plkst. 17.30 pēc Viduseiropas laika (kā minēts V pielikuma 1. iedaļas b) punktā). Šo šūnu neaizpilda, ja iestāde nevēlas norādīt *IMV* par konkrētu portfeli (t. i., nulles vērtības uzrāda tikai tad, ja aprēķina rezultāts ir nulle).

C 106.01 – Ar jutīgumu saistītā metode (*SBM*). Riska jutīgums pa instrumentiem

Iestādes uzrāda jutīgumu pret riska faktoriem, kuriem instruments ir pakļauts. Par katru riska faktoru/jutīgumu uzrāda vienu rindu. Minētā riska faktora augšupvērsto neto līknes riska pozīciju (*CVRk+*) vai minētā riska faktora lejupvērsto neto līknes riska pozīciju (*CVRk-*), kā precizēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.g pantā, uzrāda atsevišķās rindās. Visas vērtības attiecas uz “*IMV* (un sākotnējās *SBM*) atsauces datumu”, kā norādīts šīs regulas V pielikuma 1. iedaļas b) punkta ii) apakšpunktā. Iestādes katru instrumenta numura, riska identifikatora (0010. sleja), kopas (0020. sleja) un papildu identifikatora (0030. sleja) kombināciju uzrāda tikai vienu reizi.

Norādījumi par lapām (z-ass)

Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
Instrumenta numurs	V pielikuma 2. iedaļa	Uzrāda instrumenta numuru, kas minēts V pielikumā.

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0010	Riska faktora identifikators	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l, 325.m, 325.n, 325.o, 325.p un 325.q pants	Uzrāda riska faktora identifikatoru, kā norādīts tabulā šā pielikuma beigās.
0020	Kopa	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.dpanta 3.punkts.	Kopu uzrāda, ja 0010. slejā izvēlētais riska faktora identifikators atbilst riska klasei: — vispārīgais procentu likmju risks – atbilde ir riska faktora, kas atbilst attiecīgajam bezriska likmes, inflācijas vai starpvalūtu bāzes riska faktoram, valūtas nosaukums (saskaņā ar ISO 4217 valūtu apzīmējumiem, piem., "EUR"), — nevērtspapīrošanas kredītriska starpības risks – atbilde ir Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.ah panta 1. punkta 4. tabulā norādītais kopas numurs, — alternatīvā korelācijas tirdzniecības portfelī neiekļautas vērtspapīrošanas kredītriska starpības risks (*non-ACTP CSR*) – atbilde ir minētās regulas 325.am panta 1. punkta 7. tabulā norādītais kopas numurs, — alternatīvā korelācijas tirdzniecības portfelī iekļautas vērtspapīrošanas kredītriska starpības risks (*ACTP CSR*) – atbilde ir minētās regulas 325.ak panta 6. tabulā norādītais kopas numurs, — kapitāla vērtspapīru risks – atbilde ir minētās regulas 325.ap panta 1. punkta 8. tabulā norādītais kopas numurs; — preču risks – atbilde ir minētās regulas 325.as panta 9. tabulā norādītais kopas numurs, — ārvalstu valūtas risks un delta vai līknes komponenti – atbilde ir valūtas nosaukums (piem., "USD", uzrādītie valūtas kodi atbilst ISO 4217 valūtu apzīmējumiem), — ārvalstu valūtas risks un vega komponents – atbilde ir valūtu pāra nosaukums (piem., "EUR USD", uzrādītie valūtas kodi atbilst ISO 4217 valūtu apzīmējumiem).
0030	Papildu identifikators1	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l līdz 325.q pants un 325.ai pants	Uzrāda šādu informāciju, nošķirot riska faktoru kopas iekšējā līmenī. Ja 0010. slejā izvēlētais riska faktora identifikators atbilst riska klasei: — vispārīgais procentu likmju risks un delta komponents – atbilde ir bezriska līknes nosaukums vai cits atbilstošs unikālais identifikators, — nevērtspapīrošanas kredītriska starpības risks vai alternatīvajā korelācijas tirdzniecības portfelī iekļautas vērtspapīrošanas kredītriska starpības riska klase (*ACTP CSR*) – atbilde ir emitenta nosaukums vai cits atbilstošs unikālais identifikators, un

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
			tas ir identisks jebkuriem diviem uzrādītajiem jutīgumiem pret diviem riska faktoriem, kas saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.ai panta 1. punktu saņem korelācijas parametru $\rho_{kl}^{(nosaukums)}$, kurš vienāds ar 1, — alternatīvā korelācijas tirdzniecības portfelī neiekļautas vērtspapīrošanas kredītriska starpības risks (*non-ACTP CSR*) – atbilde ir laidiena nosaukums vai cits atbilstošs unikālais identifikators, — kapitāla vērtspapīru risks – atbilde ir kapitāla vērtspapīru emitenta nosaukums vai cits atbilstošs unikālais identifikators, — preču risks – atbilde ir preces nosaukums vai cits atbilstošs unikālais identifikators. Ja neviens no minētajiem gadījumiem nav piemērojams, iestādes uzrāda skaidri izteiktu vērtību (*NULL*) kā nepiemērojamu.
0050	Riska jutīgums (pārskata sniegšanas valūtas rezultāti)	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.d panta 2. punkts un 325.g, 325.r, 325.s, 325.t un 325.ax pants	Riska jutīgums (delta/vega jutīgums un līknes riska pozīcijas) uzrāda katra instrumenta līmenī visiem attiecīgajiem riska faktoriem, kā precizēts 0010. līdz 0030. slejā. Vērtības uzrāda iestādes pārskata sniegšanas valūtā. Ja 0010. slejā izvēlētais riska faktora identifikators atbilst: — uzrāda ar jutīgumu saistītās metodes delta riska komponentu, neto jutīgumu pret riska faktoru (S_k), kā precizēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.r pantā. Ja iestādes no to kompetentās iestādes ir saņēmušas atļauju izmantot alternatīvas delta riska jutīguma definīcijas saskaņā ar minētās regulas 325.t panta 5. punktu, tās pārskatu sniegšanas nolūkā atsaucas uz minētajām alternatīvajām definīcijām, — uzrāda ar jutīgumu saistītās metodes vega riska komponentu, iespējas līguma vega riska jutīgumu pret attiecīgu riska faktoru (S_k), kā precizēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.s pantā. Ja iestādes no to kompetentās iestādes ir saņēmušas atļauju izmantot alternatīvus vega riska jutīguma aprēķinus saskaņā ar minētās regulas 325.t panta 6. punktu, tās pārskatu sniegšanas nolūkā atsaucas uz minētajiem alternatīvajiem aprēķiniem. Neatkarīgi no tā, vai iestāde izmanto minētās regulas 325.s pantā norādīto definīciju vai 325.t panta 6. punktā norādīto alternatīvo aprēķinu, jutīgumu uzrāda pēc tam, kad tas svērts ar attiecīgo implicēto svārstīgumu, — uzrāda ar jutīgumu saistītās metodes līknes riska komponentu, minētā riska faktora augšupvērsto neto līknes riska pozīciju (CVR_k^+) vai minētā riska faktora lejupvērsto neto līknes riska pozīciju (CVR_k^-), kā precizēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.g pantā. Paziņoto skaitli izsaka kā decimāldaļu ar precizitāti vismaz divas zīmes aiz komata. Nulles vērtības uzrāda tikai tad, ja aprēķina rezultāts ir faktiski nulle.
0060	Pārskata sniegšanas valūta		Uzrāda iestādes pārskata sniegšanas valūtas nosaukumu (uzrādāmā vērtība atbilst ISO 4217 valūtas apzīmējumam, piemēram, "EUR").

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0070	Riska jutīgums (EBI instrumentu valūtas rezultāti)	Šīs regulas V pielikuma 2. iedaļa un Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.d panta 2. punkts un 325.g, 325.r un 325.s pants	Vērtības uzrāda saskaņā ar 0050. slejā sniegtajiem norādījumiem, bet pārrēķina pēc ECB tagadnes kursa, kas saistīts ar instrumenta valūtu, kā noteikts šīs regulas V pielikuma 2. iedaļā.
0080	Cenu noteikšanas modelis	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.t pants	Iestāde norāda, kādu cenas noteikšanas modeli piemēro jutīguma noteikšanai. Uzrāda vienu no šādiem punktiem: a) "iestādes cenu noteikšanas modeļi, kas kalpo par pamatu pārskatu sniegšanai par peļņu un zaudējumiem augstākajai vadībai" (tāpat kā Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.t panta 1. punkta pirmajā daļā); b) "iestādes iekšējā modeļa pieeja" (tāpat kā minētās regulas 325.t panta 1. punkta otrajā daļā).
0090	Jutīguma definīcija	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.r, 325.s un 325.t pants	Iestāde precizē, kuras jutīguma definīcijas piemēro, aprēķinot pašu kapitāla prasības. Uzrāda vienu no šādiem punktiem: a) "jutīguma definīcija Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.r un 325.s pantā"; b) "jutīguma definīcija saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.t panta 5. un 6. punktu". Gadījumos, kad 0010. slejā izvēlētais riska faktora identifikators atbilst ar jutīgumu saistītās metodes līknes riska komponentam, uzrāda b) punktā norādīto vērtību, ja uzrādītās līknes riska pozīcijas aprēķinā izmantotais jutīgums ir balstīts uz Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.t panta 5. un 6. punktā noteikto jutīguma definīciju; citādāk uzrāda a) punktā norādīto vērtību.
0100	Atbilde brīvā tekstā		Iestāde šajā slejā var sniegt papildu informāciju par piemēroto cenu noteikšanas modeli un jutīguma definīciju.
0110	Papildu identifikators2	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.ppanta2.punkts.	Ja 0010. slejā izvēlētais riska faktora identifikators atbilst riska klasei "Preču risks" un uz jutīgumu balstītās metodes delta riska komponentam, atbilde ir juridisko noteikumu kopa attiecībā uz piegādes vietu vai cits atbilstošs unikālais identifikators. Ja neviens no minētajiem gadījumiem nav piemērojams, iestādes uzrāda skaidri izteiktu vērtību (*NULL*) kā nepiemērojamu.

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0120	Kredītkvalitātes kategorija	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.mpanta1.punkts un 325.ahpanta 1.punkts	Ja 0010. slejā izvēlētais riska faktora identifikators atbilst riska klasei "Nevērtspapīrošanas kredītriska starpības risks" un uz jutīgumu balstītās metodes delta riska komponentam, atbilde ir viena no turpmāk minētajām: a) "1. KKP"; b) "2. KKP"; c) "3. KKP"; d) "4. KKP"; e) "5. KKP"; f) "6. KKP"; g) "KKP nav piešķirta (bez reitinga)". Ja neviens no minētajiem gadījumiem nav piemērojams, iestādes uzrāda skaidri izteiktu vērtību (*NULL*) kā nepiemērojamu.

C 107.01 – *VaR* un *sVaR*, kas nav korelācijas tirdzniecības portfelī (*CTP*). Sīkāka informācija

Rinda	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0010-0060	*VaR*		
0010	Metodika		0010. slejā uzrāda vienu no šādiem: a) vēsturiskā simulācija; b) Montekarlo simulācija; c) parametriskā metodika; d) kombinācija/cita metodika (lūdzu, precizējiet). Iestāde izmanto 0020. sleju, lai precizētu 0010. slejā sniegto atbildi. Ja 0010. slejā izvēlēts d) variants, iestāde 0020. slejā sniedz sīkāku informāciju.
0020	10 dienu laikposma aprēķināšana	Regulas (ES) Nr. 575/2013 365. panta 1. punkts	0010. slejā uzrāda vienu no šādiem: a) 1 diena, kuras mērogs pārrēķināts 10 dienās; b) 10 dienas ar laikposmiem, kas pārklājas; c) 10 dienas saskaņā ar citu metodiku. Iestāde izmanto 0020. sleju, lai precizētu 0010. slejā sniegto atbildi.
0030	Novērošanas laikposma ilgums	Regulas (ES) Nr. 575/2013 365.panta 1. punkta d) apakšpunkts	0010. slejā uzrāda vienu no šādiem: a) līdz 1 gadam; b) pārsniedz 1 gadu – līdz 2 gadiem; c) pārsniedz 2 gadus – līdz 3 gadiem; d) pārsniedz 3 gadus. Iestāde izmanto 0020. sleju, lai precizētu 0010. slejā sniegto atbildi.

Rinda	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0040	Datu svēršana	Regulas (ES) Nr. 575/2013 365. panta 1. punkta d) apakšpunkts	0010. slejā uzrāda vienu no šādiem: a) nesvērts (*VaR* datu svērums); b) svērts (*VaR* datu svērums); c) augstākais no svērtā un nesvērtā (*VaR* datu svērums) a) un b) punktā. Iestāde izmanto 0020. sleju, lai precizētu 0010. slejā sniegto atbildi.
0050	Atpakaļejošas pārbaudes palielinājums	Regulas (ES) Nr. 575/2013 366. panta 2. punkts	Atpakaļejošas pārbaudes palielinājums ir saskaitāmais, kura vērtība ir starp 0 un 1 saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 366. panta 2. punkta 1. tabulu. Iestāde izmanto 0020. sleju, lai precizētu 0010. slejā sniegto atbildi.
0060	*VaR* regulatīvs palielinājums	Regulas (ES) Nr. 575/2013 366. panta 2. punkts (“vismaz 3”)	*VaR* regulatīvais palielinājums ir papildu maksa, ko kompetentā iestāde noteikusi attiecībā uz *VaR* reizināšanas koeficientu (vismaz 3) saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 366. panta 2. punktu. *VaR* regulatīvais palielinājums ir atpakaļejošās pārbaudes palielinājums un attiecīgā gadījumā kvalitatīvā palielinājuma summa, kas pārsniedz 3. Iestāde izmanto 0020. sleju, lai precizētu 0010. slejā sniegto atbildi.
0070-0100	*sVaR* (t. i., spriedzes *VaR*)		
0070	Metodika		0010. slejā uzrāda vienu no šādiem: a) vēsturiskā simulācija; b) Montekarlo simulācija; c) parametriskā metodika; d) kombinācija/cita metodika (lūdzu, precizējiet). Iestāde izmanto 0020. sleju, lai precizētu 0010. slejā sniegto atbildi. Ja 0010. slejā izvēlēts d) variants, iestāde 0020. slejā sniedz sīkāku informāciju.
0080	10 dienu laikposma aprēķināšana	Regulas (ES) Nr. 575/2013 365. panta 1. punkts	0010. slejā uzrāda vienu no šādiem: a) 1 diena, kuras mērogs pārrēķināts 10 dienās; b) 10 dienas ar laikposmiem, kas pārklājas; c) 10 dienas saskaņā ar citu metodiku. Iestāde izmanto 0020. sleju, lai precizētu 0010. slejā sniegto atbildi.
0090	*sVaR* regulatīvs palielinājums	Regulas (ES) Nr. 575/2013 366. panta 2. punkts	Regulatīvais palielinājums ir papildu maksa, ko kompetentā iestāde noteikusi attiecībā uz *sVaR* reizināšanas koeficientu (vismaz 3) saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 366. panta 2. punktu. Regulatīvais palielinājums ir summa, ko veido 3, atpakaļejošās pārbaudes palielinājums un kvalitatīvais palielinājums (ja piemērojams).

Rinda	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
			Iestāde izmanto 0020. sleju, lai precizētu 0010. slejā sniegto atbildi.
0100	*sVaR* periods	Regulas (ES) Nr. 575/2013 365. panta 2. punkts	0010. slejā uzrāda vienu no šādiem: a) spriedzes *VaR* dienas aprēķināšana, kas kalibrēta ar vienu nepārtrauktu 12 mēnešu periodu, sākot no 0020. slejā precizētā datuma; b) spriedzes *VaR* nedēļas aprēķināšana, kas kalibrēta ar vienu nepārtrauktu 12 mēnešu periodu, sākot no 0020. slejā precizētā datuma; c) spriedzes *VaR* dienas aprēķināšana, kas kalibrēta ar dažādiem nepārtrauktiem 12 mēnešu periodiem spriedzes *VaR* ziņošanas datumos, kas norādīti C107.02. veidnes 0010. slejā, sākot no 0020. slejā precizētā datuma; d) spriedzes *VaR* nedēļas aprēķināšana, kas kalibrēta ar dažādiem nepārtrauktiem 12 mēnešu periodiem spriedzes VaR ziņošanas datumos, kas norādīti C107.02. veidnes 0010. slejā, sākot no 0020. slejā precizētā datuma; e) maksimums spriedzes *VaR* dienas aprēķināšanai, kas kalibrēta ar vairāk nekā vienu 12 mēnešu periodu; f) maksimums spriedzes *VaR* nedēļas aprēķināšanai, kas kalibrēta ar vairāk nekā vienu 12 mēnešu periodu; g) citas izvēles attiecībā uz spriedzes *VaR* kalibrēšanu (lūdzu, precizējiet). Iestāde izmanto 0020. sleju, lai norādītu sākuma datumu formātā "dd/mm/gggg" 0010. slejā norādīto a) vai b) iespēju gadījumā un sākuma datumu formātā "dd/mm/gggg", ko izmanto katrai spriedzes riskam pakļautās vērtības aprēķināšanai 0010. slejā norādīto c) vai d) iespēju gadījumā. Iestāde izmanto arī 0020. sleju, lai sniegtu sīkākus paskaidrojumus par 12 mēnešu periodu, ko izmanto katrai spriedzes *VaR* aprēķināšanai, kuru veic 0010. slejā norādīto e), f) vai g) variantu gadījumā.

C 107.02 – *VaR, sVaR* un PV, kas nav korelācijas tirdzniecības portfelī (*CTP*). EBI portfeļa valūtas rezultāti

Norādījumi par lapām (z-ass)

Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
Portfelis	V pielikuma 3., 4. un 5. iedaļa	Uzrāda portfeļa numuru, kas minēts V pielikumā.

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0010	Datums		*VaR*, *sVaR* un pašreizējās vērtības (PV) rezultātus uzrāda par visām 10 darbdienām starp "RM sākotnējo atsauces datumu" un "RM (un pēdējās *ASA*) pēdējo atsauces datumu", kā noteikts V pielikuma 1. iedaļas b) punktā. Datumu paziņošanai pieņem formātu "dd/mm/gggg".

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0020	*VaR*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 365. pants	Uzrāda 10 dienu regulatīvo *VaR*, kas iegūts attiecībā uz katru portfeli, nepiemērojot regulatīvo reizināšanas koeficientu "vismaz 3". Uzrāda skaitļus par katru 0010. slejā noteikto datumu. Šo šūnu neaizpilda, ja iestāde neaprēķina *VaR* tajā datumā, kas norādīts 0010. slejā (t. i., nulles vērtības uzrāda tikai tad, ja aprēķina rezultāts ir nulle).
0030	*sVaR*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 365. pants	Uzrāda 10 dienu regulatīvo *sVaR*, kas iegūts attiecībā uz katru portfeli, nepiemērojot regulatīvo reizināšanas koeficientu "vismaz 3". Uzrāda skaitļus par katru 0010. slejā noteikto datumu. Šo šūnu neaizpilda, ja iestāde neaprēķina *VaR* tajā datumā, kas norādīts 0010. slejā (t. i., nulles vērtības uzrāda tikai tad, ja aprēķina rezultāts ir nulle).
0040	PV		Uzrāda pašreizējo vērtību (PV) attiecībā uz katru portfeli. Uzrāda skaitļus par katru 0010. slejā noteikto datumu. Šo šūnu neaizpilda, ja iestāde neaprēķina PV tajā datumā, kas norādīts 0010. slejā (t. i., nulles vērtības uzrāda tikai tad, ja aprēķina rezultāts ir nulle).

C 108.00 – Peļņas un zaudējumu laikrindas

C 108.00. veidni ("Peļņas un zaudējumu laikrindas") aizpilda tikai iestādes, kas aprēķina *VaR*, izmantojot vēsturisko simulāciju.

Norādījumi par lapām (z-ass)

Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
Portfelis	V pielikuma 3., 4. un 5. iedaļa	Uzrāda portfeļa numuru, kas minēts V pielikumā.

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0010	Datums	Regulas (ES) Nr. 575/2013 365. panta 1. punkta d) apakšpunkts	Katrā darbdienā, ko nosaka saskaņā ar iestādes jurisdikcijas kalendāru, iestādes sniedz peļņas un zaudējumu (*P&L*) laikrindas, ko izmanto, lai aprēķinātu *VaR* C 107.02 veidnes 0010. slejā, ar vismaz 250 novērojumiem, sākot no RM (un pēdējā *ASA*) pēdējā atsauces datuma, kā noteikts V pielikuma 1. iedaļas b) punkta v) apakšpunktā, un atpakaļejošā virzienā.
0020	Dienas *P&L*		Iestādes, kas aprēķina *VaR*, izmantojot vēsturisko simulāciju, aizpilda iestādes izmantotās pilna garuma vēsturiskās laikrindas ar vismaz viena gada datu laikrindām, portfeļa vērtēšanas izmaiņas (t. i., dienas *P&L*), kas iegūtas, izmantojot vēsturiski simulētas dienas riska faktoru izmaiņas (t. i., dienas peļņas un zaudējumu laikrindas, ko izmanto, lai atvasinātu regulatīvo 1 dienas *VaR*).

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
			Ja diena ir svētku diena attiecīgajā jurisdikcijā, šo šūnu atstāj neaizpildītu (t. i., peļņu un zaudējumus uzrāda kā nulli tikai tad, ja attiecīgajā darbdienā patiešām nav notikušas nekādas izmaiņas portfeļa iespējamajā vērtībā).

C 109.01 – Inkrementālā riska prasība *(IRC)*. Sīkāka informācija par modeli

Rinda	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0010	Modelēšanas faktoru skaits		EBA/GL/2012/3 Uzrāda modelēšanas faktoru skaitu kopējā *IRC* modeļa līmenī. Atbilde ir viena no turpmāk minētajām: a) 1 modelēšanas faktors; b) 2 modelēšanas faktori; c) vairāk nekā 2 modelēšanas faktori. Iestāde izmanto 0020. sleju, lai precizētu 0010. slejā sniegto atbildi.
0020	*LGD* avots		EBA/GL/2012/3 Uzrāda *LGD* avotu kopējā *IRC* modeļa līmenī. Atbilde ir viena no turpmāk minētajām: a) tirgus principi; b) *LGD*, ko izmanto IRB; c) cits *LGD* avots (lūdzu, precizējiet). Iestāde izmanto 0020. sleju, lai precizētu 0010. slejā sniegto atbildi. Ja 0010. slejā izvēlēts c) variants, iestāde šajā slejā sniedz sīkāku informāciju.

C 109.02 – Inkrementālā riska prasība (*IRC*). Sīkāka informācija pa portfeļiem

Norādījumi par lapām (z-ass)

Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
Portfelis	V pielikuma 3., 4. un 5. iedaļa	Uzrāda portfeļa numuru, kas minēts V pielikumā, tikai attiecībā uz tiem portfeļiem, kuru gadījumā tiek pieprasīts *IRC*.

Rinda	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0010	Likviditātes periods	Regulas (ES) Nr. 575/2013 374. panta 5. punkts	EBA/GL/2012/3 Uzrāda likviditātes periodu, ko piemēro portfeļa līmenī. Atbilde ir viena no turpmāk minētajām: a) līdz 3 mēnešiem; b) pārsniedz 3 mēnešus – līdz 6 mēnešiem; c) pārsniedz 6 mēnešus – līdz 9 mēnešiem; d) pārsniedz 9 mēnešus – līdz 12 mēnešiem.
0020	*PD* avots		EBA/GL/2012/3 Uzrāda *PD* avotu, ko piemēro portfeļa līmenī. Atbilde ir viena no turpmāk minētajām: a) kredītreitingu aģentūras; b) IRB; c) tirgus implicētais *PD*; d) cits *PD* avots (lūdzu, precizējiet). Iestāde izmanto 0020. sleju, lai precizētu 0010. slejā sniegto atbildi. Ja 0010. slejā izvēlēts d) variants, iestāde šajā 0020. slejā sniedz sīkāku informāciju.
0030	Pārejas matriču avots		EBA/GL/2012/3 Uzrāda pārejas matriču avotu, ko piemēro portfeļa līmenī. Atbilde ir viena no turpmāk minētajām: a) kredītreitingu aģentūras; b) IRB; c) tirgus implicētas pārejas matricas; d) cits pārejas matricu avots (lūdzu, precizējiet). Iestāde izmanto 0020. sleju, lai precizētu 0010. slejā sniegto atbildi. Ja 0010. slejā izvēlēts d) variants, iestāde šajā 0020. slejā sniedz sīkāku informāciju.

C 109.03 – Inkrementālā riska prasība (*IRC*). Summa pa portfeļiem/datumiem

Norādījumi par lapām (z-ass)

Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
Portfelis	V pielikuma 3., 4. un 5. iedaļa	Uzrāda portfeļa numuru, kas minēts V pielikumā, tikai attiecībā uz tiem portfeļiem, kuru gadījumā tiek pieprasīts *IRC*.

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0010	Datums		*IRC* uzrāda par visām 10 darbdienām starp "RM sākotnējo atsauces datumu" un "RM (un pēdējās *ASA*) pēdējo atsauces datumu", kā noteikts V pielikuma 1. iedaļas b) punktā. Datumu paziņošanai pieņem formātu "dd/mm/gggg".
0020	*IRC*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 372.–376. pants	EBA/GL/2012/3 Uzrāda regulatīvo *IRC*, kas iegūta attiecībā uz katru portfeli. Uzrāda skaitļus par katru 0010. slejā noteikto datumu. Šo šūnu neaizpilda, ja iestāde neaprēķina *IRC* tajā datumā, kas uzrādīts 0010. slejā (t. i., nulles vērtības uzrāda tikai tad, ja aprēķina rezultāts ir nulle).

C 110.01 – Korelācijas tirdzniecība (*CT*). Sīkāka informācija par modeli

Rinda	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0010	Modelēšanas faktoru skaits	Regulas (ES) Nr. 575/2013 377. pants	Uzrāda modelēšanas faktoru skaitu kopējā korelācijas tirdzniecības modeļa līmenī. Atbilde ir viena no turpmāk minētajām: a) 1 modelēšanas faktors; b) 2 modelēšanas faktori; c) vairāk nekā 2 modelēšanas faktori. Iestāde izmanto 0020. sleju, ja tā vēlas precizēt 0010. slejā sniegto atbildi.
0020	*LGD* avots	Regulas (ES) Nr. 575/2013 377. pants	Uzrāda *LGD* avotu kopējā korelācijas tirdzniecības modeļa līmenī. Atbilde ir viena no turpmāk minētajām: a) tirgus principi; b) *LGD*, ko izmanto IRB; c) cits *LGD* avots (lūdzu, precizējiet). Iestāde izmanto 0020. sleju, lai precizētu 0010. slejā sniegto atbildi. Ja 0010. slejā izvēlēts c) variants, iestāde šajā slejā sniedz sīkāku informāciju.

C 110.02 – Korelācijas tirdzniecība (*CT*). Sīkāka informācija pa portfeļiem

Norādījumi par lapām (z-ass)

Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
Portfelis	V pielikuma 3., 4. un 5. iedaļa	Uzrāda portfeļa numuru, kas minēts V pielikumā, tikai attiecībā uz tiem portfeļiem, kuru gadījumā tiek pieprasīts *APR*.

Rinda	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0010	Likviditātes periods	Regulas (ES) Nr. 575/2013 377. panta 2. punkts	Uzrāda likviditātes periodu, ko piemēro portfeļa līmenī. Atbilde ir viena no turpmāk minētajām: a) līdz 3 mēnešiem; b) pārsniedz 3 mēnešus – līdz 6 mēnešiem; c) pārsniedz 6 mēnešus – līdz 9 mēnešiem; d) pārsniedz 9 mēnešus – līdz 12 mēnešiem.
0020	*PD* avots	Regulas (ES) Nr. 575/2013 377. pants	Uzrāda *PD* avotu, ko piemēro portfeļa līmenī. Atbilde ir viena no turpmāk minētajām: a) kredītreitingu aģentūras; b) IRB; c) tirgus implicētais *PD*; d) cits *PD* avots (lūdzu, precizējiet). Iestāde izmanto 0020. sleju, lai precizētu 0010. slejā sniegto atbildi. Ja 0010. slejā izvēlēts d) variants, iestāde 0020. slejā sniedz sīkāku informāciju.
0030	Pārejas matriču avots	Regulas (ES) Nr. 575/2013 377. pants	Uzrāda pārejas matriču avotu, ko piemēro portfeļa līmenī. Atbilde ir viena no turpmāk minētajām: a) kredītreitingu aģentūras; b) IRB; c) tirgus implicētas pārejas matricas; d) cits pārejas matricu avots (lūdzu, precizējiet). Iestāde izmanto 0020. sleju, lai precizētu 0010. slejā sniegto atbildi. Ja 0010. slejā izvēlēts d) variants, iestāde 0020. slejā sniedz sīkāku informāciju.

C 110.03 – KORELĀCIJAS TIRDZNIECĪBA (*CT*). Viss cenas risks (*APR*) pa portfeļiem/datumiem

Norādījumi par lapām (z-ass)

Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
Portfelis	V pielikuma 3., 4. un 5. iedaļa	Uzrāda portfeļa numuru, kas minēts V pielikumā, tikai attiecībā uz tiem portfeļiem, kuru gadījumā tiek pieprasīts *APR*.

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0010	Datums	Regulas (ES) Nr. 575/2013 377. pants	Visu cenas risku ("*APR*") uzrāda par visām 10 darbdienām starp "RM sākotnējo atsauces datumu" un "RM (un pēdējās *ASA*) pēdējo atsauces datumu", kā minēts V pielikuma 1. iedaļas b) punktā. Datumu paziņošanai pieņem formātu "dd/mm/gggg".
0060	*APR*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 377. pants	Uzrāda rezultātus, kas iegūti, piemērojot regulatīvo korelācijas tirdzniecības modeli attiecībā uz katru portfeli. Uzrāda skaitļus par katru 0010. slejā noteikto datumu. Šo šūnu neaizpilda, ja iestāde neizmanto korelācijas tirdzniecības modeli tajā datumā, kas norādīts 0010. slejā (t. i., nulles vērtības uzrāda tikai tad, ja aprēķina rezultāts ir nulle).

C 120.01 – AR JUTĪGUMU SAISTĪTĀ METODE (*SBM*). RISKA JUTĪGUMS PA INSTRUMENTIEM/PORTFEĻIEM

Iestādes, pa instrumentiem, uzrāda jutīgumu pret riska faktoriem, kuriem instruments ir pakļauts. Par katru riska faktoru/jutīgumu uzrāda vienu rindu. Minētā riska faktora augšupvērsto neto līknes riska pozīciju (*CVRk+*) vai minētā riska faktora lejupvērsto neto līknes riska pozīciju (*CVRk-*), kā precizēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.g pantā, uzrāda atsevišķās rindās. Visas vērtības attiecas uz "RM (un pēdējās *ASA*) pēdējo atsauces datumu" (kā definēts šīs regulas V pielikuma 1. iedaļas b) punkta v) apakšpunktā). Iestādes katru portfeļa, instrumenta numura (0010. sleja), riska identifikatora (0020. sleja), kopas (0030. sleja) un papildu identifikatora (0040. sleja) kombināciju uzrāda tikai vienu reizi.

Norādījumi par lapām (z-ass)

Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
Portfelis	V pielikuma 3., 4. un 5. iedaļa	Uzrāda portfeļa numuru, kas minēts V pielikumā.

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0010	Instrumenta numurs	V pielikuma 2. iedaļa	Uzrāda instrumenta numuru, kas minēts V pielikumā.

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0020	Riska faktora identifikators	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l, 325.m, 325.n, 325.o, 325.p un 325.q pants	Uzrāda riska faktora identifikatoru, kā norādīts tabulā šā pielikuma beigās.
0030	Kopa	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.dpanta 3.punkts.	Kopu uzrāda, ja 0020. slejā izvēlētais riska faktora identifikators atbilst riska klasei: — vispārīgais procentu likmju risks – atbilde ir riska faktora, kas atbilst attiecīgajam bezriska likmes, inflācijas vai starpvalūtu bāzes riska faktoram, valūtas nosaukums (saskaņā ar ISO 4217 valūtu apzīmējumiem, piem., "EUR"), — nevērtspapīrošanas kredītriska starpības risks – atbilde ir Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.ah panta 1. punkta 4. tabulā minētais kopas numurs, — alternatīvā korelācijas tirdzniecības portfelī neiekļautas vērtspapīrošanas kredītriska starpības risks (*non-ACTP CSR*) – atbilde ir minētās regulas 325.am panta 1. punkta 7. tabulā minētais kopas numurs, — vērtspapīrošanas, kas ietverta alternatīvas korelācijas tirdzniecības portfelī, kredītriska starpības risks (*ACTP CSR*) – atbilde ir minētās regulas 325.ak panta 6. tabulā minētais kopas numurs, — kapitāla vērtspapīru risks – atbilde ir minētās regulas 325.ap panta 1. punkta 8. tabulā minētais kopas numurs; — preču risks – atbilde ir minētās regulas 325.as panta 9. tabulā minētais kopas numurs, — ārvalstu valūtas risks un delta vai līknes komponenti – atbilde ir valūtas nosaukums (piem., "USD", uzrādītie valūtas kodi atbilst ISO 4217 valūtu apzīmējumiem), — ārvalstu valūtas risks un vega komponents – atbilde ir valūtu pāra nosaukums (piem., "EUR USD", uzrādītie valūtas kodi atbilst ISO 4217 valūtu apzīmējumiem).
0040	Papildu identifikators1	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l līdz 325.q pants un 325.ai pants	Uzrāda šādu informāciju, nošķirot riska faktoru kopas iekšējā līmenī. Ja 0020. slejā izvēlētais riska faktora identifikators atbilst riska klasei: — vispārīgais procentu likmju risks un delta komponents – atbilde ir bezriska līknes nosaukums vai cits atbilstošs unikālais identifikators, — nevērtspapīrošanas kredītriska starpības risks vai alternatīvajā korelācijas tirdzniecības portfelī iekļautas vērtspapīrošanas kredītriska starpības riska klase (*ACTP CSR*) – atbilde ir emitenta nosaukums vai cits atbilstošs unikālais identifikators, un tas ir identisks jebkuriem diviem uzrādītajiem jutīgumiem pret diviem riska faktoriem, kas saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.ai panta 1. punktu saņem korelācijas parametru $\rho_{kl}^{(nosaukums)}$, kurš vienāds ar 1, — alternatīvā korelācijas tirdzniecības portfelī neiekļautas vērtspapīrošanas kredītriska starpības risks (*non-ACTP CSR*) – atbilde ir laidiena nosaukums vai cits atbilstošs unikālais identifikators, — kapitāla vērtspapīru risks – atbilde ir kapitāla vērtspapīru emitenta nosaukums vai cits atbilstošs unikālais identifikators,

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
			— preču risks – atbilde ir preces nosaukums vai cits atbilstošs unikālais identifikators. Ja neviens no minētajiem gadījumiem nav piemērojams, iestādes uzrāda skaidri izteiktu vērtību (*NULL*) kā nepiemērojamu.
0060	Riska jutīgums (pārskata sniegšanas valūtas rezultāti)	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.d panta 2. punkts un 325.g, 325.r, 325.s, 325.t un 325.ax pants	Riska jutīgums (delta/vega jutīgums un līknes riska pozīcijas) uzrāda katra instrumenta līmenī visiem attiecīgajiem riska faktoriem, kā precizēts 0020. līdz 0040. slejā. Vērtības uzrāda iestādes pārskata sniegšanas valūtā. Ja 0020. slejā izvēlētais riska faktora identifikators atbilst: — uzrāda ar jutīgumu saistītās metodes delta riska komponentu, neto jutīgumu pret riska faktoru (S_k), kā precizēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.r pantā. Ja iestādes no to kompetentās iestādes ir saņēmušas atļauju izmantot alternatīvus delta riska jutīguma aprēķinus saskaņā ar minētās regulas 325.t panta 5. punktu, tās pārskatu sniegšanas nolūkā atsaucas uz šīm alternatīvajām definīcijām, — uzrāda ar jutīgumu saistītās metodes vega riska komponentu, iespējas līguma vega riska jutīgumu pret attiecīgu riska faktoru (S_k), kā precizēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.s pantā. Ja iestādes no to kompetentās iestādes ir saņēmušas atļauju izmantot alternatīvus vega riska jutīguma aprēķinus saskaņā ar minētās regulas 325.t panta 6. punktu, tās pārskatu sniegšanas nolūkā atsaucas uz minētajiem alternatīvajiem aprēķiniem. Neatkarīgi no tā, vai iestāde izmanto minētās regulas 325.s pantā norādīto aprēķinu vai 325.t panta 6. punktā norādīto alternatīvo aprēķinu, jutīgumu uzrāda pēc tam, kad tas svērts ar attiecīgo izsecināto [implicēto] svārstīgumu, — uzrāda ar jutīgumu saistītās metodes līknes riska komponentu, minētā riska faktora augšupvērsto neto līknes riska pozīciju (CVR_k^+) vai minētā riska faktora lejupvērsto neto līknes riska pozīciju (CVR_k^-), kā precizēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.g pantā. Paziņoto skaitli izsaka kā decimāldaļu ar precizitāti vismaz divas zīmes aiz komata. Nulles vērtības uzrāda tikai tad, ja aprēķina rezultāts ir faktiski nulle.
0070	Pārskata sniegšanas valūta		Uzrāda iestādes pārskata sniegšanas valūtas nosaukumu (uzrādāmā vērtība atbilst ISO 4217 valūtas apzīmējumam, piemēram, "EUR").
0080	Riska jutīgums (EBI portfeļa valūtas rezultāti)	Šīs regulas V pielikuma 3. un 4. iedaļa un Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.d panta 2. punkts un 325.g, 325.r, 325.s, 325.t un 325.ax pants	Vērtības uzrāda saskaņā ar 0060. slejā sniegtajiem norādījumiem, bet pārrēķina pēc ECB tagadnes kursa, kas saistīts ar portfeļa valūtu, kā noteikts šīs regulas V pielikuma 3. un 4. iedaļā.

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0090	Riska pakāpe	Regulas (ES) Nr. 575/2013 Trešās daļas IV sadaļas 1.a nodaļas 6. iedaļa	Uzrāda riska pakāpi, kas atbilst 0020.–0040. slejā precizētajiem riska faktoriem. Ja 0020. slejā izvēlētais riska faktora identifikators atbilst līknes riska komponentam, uzrāda riska pakāpi, kuru izmanto piemērojamo relatīvo nobīžu noteikšanai. Paziņoto skaitli izsaka kā decimāldaļu ar precizitāti vismaz četras zīmes aiz komata.
0110	Papildu identifikators2	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.ppanta2.punkts.	Ja 0010. slejā izvēlētais riska faktora identifikators atbilst riska klasei "Preču risks" un uz jutīgumu balstītās metodes delta riska komponentam, atbilde ir juridisko noteikumu kopa attiecībā uz piegādes vietu vai cits atbilstošs unikālais identifikators. Ja neviens no minētajiem gadījumiem nav piemērojams, iestādes uzrāda skaidri izteiktu vērtību (*NULL*) kā nepiemērojamu.
0120	Kredītkvalitātes kategorija	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.mpanta1.punkts un 325.ahpanta1.punkts	Ja 0010. slejā izvēlētais riska faktora identifikators atbilst riska klasei "Nevērtspapīrošanas kredītriska starpības risks" un uz jutīgumu balstītās metodes delta riska komponentam, atbilde ir viena no turpmāk minētajām: a) "1. KKP"; b) "2. KKP"; c) "3. KKP"; d) "4. KKP"; e) "5. KKP"; f) "6. KKP"; g) "KKP nav piešķirta (bez reitinga)". Ja neviens no minētajiem gadījumiem nav piemērojams, iestādes uzrāda skaidri izteiktu vērtību (*NULL*) kā nepiemērojamu.

C 120.02 – AR JUTĪGUMU SAISTĪTĀ METODE (*SBM*). PAŠU KAPITĀLA PRASĪBU (*OFR*) SASTĀVS PA PORTFEĻIEM

Norādījumi par lapām (z-ass)

Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
Portfelis	V pielikuma 3., 4. un 5. iedaļa	Uzrāda portfeļa numuru, kas minēts V pielikumā.

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0010	Riska klase	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.dpanta 1.punkts.	Uzrāda riska klasi. Atbilde ir viena no turpmāk minētajām: a) "Vispārīgais procentu likmju risks (*GIRR*)"; b) "Kredītriska starpības risks. Nevērtspapīrošanas kredītriska starpības risks (*CSR*)" (nevērtspapīrošanas kredītriska starpības risks (*CSR*); c) "Kredītriska starpības risks. Alternatīvā korelācijas tirdzniecības portfelī neiekļautas vērtspapīrošanas kredītriska starpības risks (*non-ACTP CSR*)"(alternatīvā korelācijas tirdzniecības portfelī neiekļautas vērtspapīrošanas kredītriska starpības risks (*non-ACTP CSR*)); d) "Kredītriska starpības risks. *ACTP CSR*." (alternatīvā korelācijas tirdzniecības portfelī iekļautas vērtspapīrošanas kredītriska starpības risks (*ACTP CSR*))"; e) "Kapitāla vērtspapīru risks"; f) "Preču risks"; g) "Ārvalstu valūtas risks".
0020	Sastāvdaļa [komponents]	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.epanta 1.punkts.	Uzrāda ar jutīgumu saistītās metodes sastāvdaļu [komponentu]. Atbilde ir viena no turpmāk minētajām: a) "Delta risks"; b) "Vega risks"; c) "Līknes risks"
0030	Korelācijas scenārijs	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.h pants	Uzrāda korelācijas scenāriju. Atbilde ir viena no turpmāk minētajām: a) "Vidējas korelācijas scenārijs"; b) "Augstas korelācijas scenārijs"; c) "Zemas korelācijas scenārijs".
0040	Pašu kapitāla prasības (pārskata sniegšanas valūtas rezultāti)	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.h pants	Par katru portfeli un par visām attiecīgajām riska klasēm, komponentiem un korelācijas scenārija kombinācijām uzrāda pašu kapitāla prasību vērtības "RM (un pēdējās *ASA*) pēdējā atsauces datumā" (kā precizēts šīs regulas V pielikuma 1. iedaļas b) apakšpunktā). Vērtības uzrāda iestādes pārskata sniegšanas valūtā, un tās izsaka ar precizitāti vismaz divas zīmes aiz komata.
0050	Pārskata sniegšanas valūta		Uzrāda iestādes pārskata sniegšanas valūtu (uzrādītā vērtība atbilst ISO 4217 valūtas noteikšanai).
0060	Pašu kapitāla prasības (EBI portfeļa valūtas rezultāti)	Šīs regulas V pielikuma 3. un 4. iedaļa un Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.h pants	Vērtības uzrāda saskaņā ar 0040. slejā sniegtajiem norādījumiem, bet pārrēķina pēc ECB tagadnes kursa, kas saistīts ar portfeļa valūtu, kā noteikts šīs regulas V pielikuma 3. un 4. iedaļā.
0070	Pozīcijas bez izvēles iespējas, kurām piemēro līknes riska pašu kapitāla prasības	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.epanta 3.punkts.	Ja 0020. slejā komponents atbilst līknes riskam: a) Ja iestāde piemēro Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.e panta 3. punktā noteikto pieeju, lai aprēķinātu 0040. un 0060. slejā norādīto rezultātu, uzrāda "JĀ". b) Pretējā gadījumā uzrāda "NĒ". "NĒ" uzrāda arī tad, ja nav piemērojams neviens no minētajiem gadījumiem.

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0080	Bāzes valūtas pieeja, ko piemēro ārvalstu valūtas riska delta un līknes faktoram	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.qpanta7.punkts.	Ja 0010. slejā riska klase atbilst ārvalstu valūtas riskam un 0020. slejā komponents atbilst delta riskam vai līknes riskam: a) ja iestāde piemēro Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.q panta 7. punktā noteikto pieeju, lai aprēķinātu 0040. un 0060. slejā norādīto rezultātu, uzrāda "JĀ". b) Pretējā gadījumā uzrāda "NĒ". "NĒ" uzrāda arī tad, ja nav piemērojams neviens no minētajiem gadījumiem.
0090	Līknes riska komponentu sadalījums pa skalāriem ārvalstu valūtas riskam	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.qpanta6.punkts.	Gadījumos, kad 0010. slejā riska klase atbilst ārvalstu valūtas riskam un 0020. slejā komponents atbilst līknes riskam: a) ja iestāde piemēro Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.q panta 6. punktā noteikto pieeju, lai aprēķinātu 0040. un 0060. slejā norādīto rezultātu, uzrāda "JĀ". b) Pretējā gadījumā uzrāda "NĒ". "NĒ" uzrāda arī tad, ja nav piemērojams neviens no minētajiem gadījumiem.
0095	*SBM* validācijas portfeļa rezultātu iesniegšana	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.epanta1.punkts.	Ja portfelis, par kuru uzrāda informāciju, ir *SBM* validācijas portfelis, kas minēts V pielikuma 7. iedaļā: a) uzrāda "iesniegts", ja iestāde iesniedz rezultātus, kas atbilst šim portfelim; b) uzrāda "nav iesniegts – nav pakļautības riska faktoram", ja iestāde izvēlas neiesniegt rezultātus par attiecīgo *SBM* validācijas portfeli, jo minētās iestādes vadība nav sniegusi iekšēju apstiprinājumu darboties ar instrumentiem, kas radītu pakļautību attiecīgajam riska faktoram; uzrāda "nepiemēro", ja portfelis, par kuru norāda informāciju, ir V pielikuma 3., 4. vai 5. iedaļā minētais portfelis.
0100	Atbilde brīvā tekstā		Iestāde šajā slejā var sniegt papildu informāciju.

C 120.04 – SAISTĪBU NEIZPILDES RISKA PRASĪBA (*DRC*). TIRGUS VĒRTĪBAS UN PĒKŠŅAS SAISTĪBU NEIZPILDES (*JTD*) BRUTO SUMMAS PA INSTRUMENTIEM/PORTFEĻIEM

Iestādes – instrumentu pēc instrumenta – uzrāda riska darījumus, kuri atbilst katram instrumentam. Par katru riska darījumu uzrāda vienu rindu. Visas vērtības attiecas uz "RM (un pēdējās *ASA*) pēdējo atsauces datumu" (kā definēts šīs regulas V pielikuma 1. iedaļas b) punkta v) apakšpunktā). Riska darījumus uzrāda pirms jebkādas savstarpējā ieskaita veikšanas, bet attiecīgā gadījumā pēc atkārtošanas vai sadalīšanas soļu veikšanas (kā definēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.z un 325.ac pantā).

Norādījumi par lapām (z-ass)

Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
Portfelis	V pielikuma 3., 4. un 5. iedaļa	Uzrāda portfeļa numuru, kas minēts V pielikumā.

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0010	Instrumenta numurs	V pielikuma 2. iedaļa	Uzrāda instrumenta numuru, kas minēts V pielikumā.
0020	Riska klase	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.vpanta 2.punkts.	Uzrāda riska klasi, par kuru saistību neizpildes riska prasība (*DRC*) norādīta 0030. un 0040. slejā. Atbilde ir viens no turpmāk minētajiem instrumentu veidiem: a) "Instrumenti, kas nav vērtspapīrošanas pozīcijas"; b) "Vērtspapīrošanas pozīcijas, kas nav ietvertas alternatīvas korelācijas tirdzniecības portfelī"; c) "Vērtspapīrošanas pozīcijas, kas ietvertas alternatīvas korelācijas tirdzniecības portfelī".
0030	1. kopa	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.ypanta 3.punkts, 325.aapanta 4.punkts un 325.adpanta 2.punkts	Uzrāda kopu. Ja 0020. slejā uzrādītā riska klase atbilst "nevērtspapīrošanai", atbilde ir viena no turpmāk minētajām: a) "uzņēmumi [komercsabiedrības]"; b) "valstis"; c) "pašvaldības/municipalitātes". Ja tā vietā 0020. slejā uzrādītā riska klase atbilst "vērtspapīrošanai, kas nav ietverta alternatīvas korelācijas tirdzniecības portfelī", atbilde ir iepriekš minētais a) punkts vai viena no turpmāk minētajām: d) "ABKV – Āzija"; e) "ABKV – Eiropa"; f) "ABKV – Ziemeļamerika"; g) "ABKV – pārējā pasaule"; h) "autokredīti/līzings – Āzija"; i) "autokredīti/līzings – Eiropa"; j) "autokredīti/līzings – Ziemeļamerika"; k) "autokredīti/līzings – pārējā pasaule"; l) "nodrošinātas parādsaistības kvadrātā (*CDO* kvadrātā) – Āzija"; m) "nodrošinātas parādsaistības kvadrātā (*CDO* kvadrātā) – Eiropa"; n) "nodrošinātas parādsaistības kvadrātā (*CDO* kvadrātā) – Ziemeļamerika"; o) "nodrošinātas parādsaistības kvadrātā (*CDO* kvadrātā) – pārējā pasaule"; p) "nodrošinātas kredītsaistības – Āzija"; q) "nodrošinātas kredītsaistības – Eiropa"; r) "nodrošinātas kredītsaistības – Ziemeļamerika"; s) "nodrošinātas kredītsaistības – pārējā pasaule"; t) "ar komerciālām hipotēkām nodrošināti vērtspapīri (*CMBS*) – Āzija"; u) "ar komerciālām hipotēkām nodrošināti vērtspapīri (*CMBS*) – Eiropa"; v) "ar komerciālām hipotēkām nodrošināti vērtspapīri (*CMBS*) – Ziemeļamerika"; w) "ar komerciālām hipotēkām nodrošināti vērtspapīri (*CMBS*) – pārējā pasaule"; x) "kredītkartes – Āzija"; y) "kredītkartes – Eiropa"; z) "kredītkartes – Ziemeļamerika"; aa) "kredītkartes – pārējā pasaule"; bb) "pārējā mazumtirdzniecība – Āzija"; cc) "pārējā mazumtirdzniecība – Eiropa"; dd) "pārējā mazumtirdzniecība – Ziemeļamerika";

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
			ee) "pārējā mazumtirdzniecība – pārējā pasaule"; ff) "pārējā vairumtirdzniecība – Āzija"; gg) "pārējā vairumtirdzniecība – Eiropa"; hh) "pārējā vairumtirdzniecība – Ziemeļamerika"; ii) "pārējā vairumtirdzniecība – pārējā pasaule"; jj) "ar mājokļu hipotēkām nodrošināti vērtspapīri (*RMBS*) – Āzija"; kk) "ar mājokļu hipotēkām nodrošināti vērtspapīri (*RMBS*) – Eiropa"; ll) "ar mājokļu hipotēkām nodrošināti vērtspapīri (*RMBS*) – Ziemeļamerika"; mm) "ar mājokļu hipotēkām nodrošināti vērtspapīri (*RMBS*) – pārējā pasaule"; nn) "mazie un vidējie uzņēmumi (MVU) – Āzija"; oo) "mazie un vidējie uzņēmumi (MVU) – Eiropa"; pp) "mazie un vidējie uzņēmumi (MVU) – Ziemeļamerika"; qq) "mazie un vidējie uzņēmumi (MVU) – pārējā pasaule"; rr) "studiju kreditēšana – Āzija"; ss) "studiju kreditēšana – Eiropa"; tt) "studiju kreditēšana – Ziemeļamerika"; uu) "studiju kreditēšana – pārējā pasaule". Ja tā vietā 0020. slejā uzrādītā riska klase atbilst "vērtspapīrošanai, kas ietverta alternatīvas korelācijas tirdzniecības portfelī", atbilde ir "vērtspapīrošana, kas ietverta alternatīvas korelācijas tirdzniecības portfelī".
0040	2. kopa	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.ad panta 2. punkts	Ja 0020. slejā uzrādītā riska klase atbilst "vērtspapīrošanai, kas ietverta alternatīvas korelācijas tirdzniecības portfelī", atbilde ir indeksa nosaukums; pretējā gadījumā uzrāda (NUL).
0050	Parādnieks	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.v panta 2. punkts, 325.x panta 1. punkts, 325.z un 325.ac pants	Iestādes uzrāda ar parādnieku saistīto informāciju. Ja 0020. slejā norādītā riska klases atbilst: — "instrumenti, kas nav vērtspapīrošanas pozīcijas", atbilde ir parādnieka nosaukums, — "vērtspapīrošanas pozīcijas, kas nav ietvertas alternatīvas korelācijas tirdzniecības portfelī", atbilde ir parādnieka nosaukums vai unikāls identifikators, ar kuru apzīmē pamatā esošo aktīvu portfeli vai laidienu, — "vērtspapīrošanas pozīcijas, kas ietvertas alternatīvas korelācijas tirdzniecības portfelī", atbilde ir unikāls identifikators, ar kuru apzīmē indeksu saimi, sēriju un laidienu.
0060	Kredītkvalitātes kategorija	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.y panta 1. un 2. punkts, 325.aa panta 1. punkts un 325.ad panta 1. punkts	Iestādes uzrāda kredītkvalitāti. Atbilde ir viena no turpmāk minētajām: a) "1. KKP"; b) "2. KKP"; c) "3. KKP"; d) "4. KKP"; e) "5. KKP"; f) "6. KKP"; g) "KKP nav piešķirta (bez reitinga)";

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
			h) "KKP nav piešķirta (ar saistību neizpildi)"; i) "KKP nav piešķirta (0 % riska pakāpe)". Ja 0020. slejā uzrādītā riska klase atbilst "vērtspapīrošanai, kas ietverta alternatīvas korelācijas tirdzniecības portfelī" vai "vērtspapīrošanai, kas nav ietverta alternatīvas korelācijas tirdzniecības portfelī", atbilde ir viena no turpmāk norādītajām: j) "7. KKP"; k) "8. KKP"; l) "9. KKP"; m) "10. KKP"; n) "11. KKP"; o) "12. KKP"; p) "13. KKP"; q) "14. KKP"; r) "15. KKP"; s) "16. KKP"; t) "17. KKP"; u) "Visas pārējās KKP".
0070	Saistību neizpildes riska pakāpe	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.v panta 1. punkta f) apakšpunkts, 325.y panta 1. un 2. punkts, 325.aa panta 1. punkts un 325.ad panta 1. punkts	Iestādes uzrāda attiecīgo riska pakāpi. Vērtspapīrošanas riska darījumiem piemērotās riska pakāpes uzrāda pēc tam, kad tās saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.aa panta 1. punktu reizinātas ar 8 %.
0080	Prioritāte	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.w panta 3. un 6. punkts.	Uzrāda riska darījuma prioritāti. Ja 0020. slejā uzrādītā riska klase atbilst "instrumenti, kas nav vērtspapīrošanas pozīcijas" vai "vērtspapīrošanas pozīcijas, kas nav ietvertas alternatīvas korelācijas tirdzniecības portfelī", atbilde ir viena no turpmāk norādītajām: a) "kapitāla vērtspapīru instrumenti"; b) "parāda instrumenti, kam nav augstākās prioritātes"; c) "prioritāri parāda instrumenti"; d) "segtās obligācijas". Šo šūnu neaizpilda, ja nav piemērojams neviens no minētajiem gadījumiem.
0090	Termiņš	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.x, 325.z un 325.ac pants	Uzrāda riska darījuma termiņu. Datuma paziņošanai pieņem formātu "dd/mm/gggg".

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0100	Atgūšanas likme	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.v panta 1. punkta e) apakšpunkts	Iestādes uzrāda atgūšanas likmi. Atgūšanas likmi aprēķina, izmantojot piemērojamos saistību nepildīšanas zaudējumus (*LGD*); atgūšanas likme = 1 - *LGD*. Paziņoto atgūšanas likmi izsaka kā decimāldaļu (amplitūdā no 0 līdz 1) ar precizitāti vismaz četras zīmes aiz komata.
0110	Virziens	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.v panta 1. punkta a) un b) apakšpunkts	Iestādes norāda riska darījuma virzienu saskaņā ar definīcijām Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.v panta 1. punkta a) un b) apakšpunktā Atbilde ir viena no turpmāk minētajām: a) "īsais riska darījums"; b) "garais riska darījums".
0120	Piesaistes punkts (%)	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.aa un 325.ad pants	Ja uzrādītais riska darījums attiecas uz laidienu, iestādes norāda laidiena piesaistes punktu. Paziņoto skaitli izsaka kā decimāldaļu ar precizitāti vismaz četras zīmes aiz komata.
0130	Atsaistes punkts (%)	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.aa un 325.ad pants	Ja uzrādītais riska darījums attiecas uz laidienu, iestādes norāda laidiena atsaistes punktu. Paziņoto skaitli izsaka kā decimāldaļu ar precizitāti vismaz četras zīmes aiz komata.
0140-0170	Pārskata sniegšanas valūtas rezultāti		Vērtības uzrāda, atsaucoties uz iestādes pārskata sniegšanas valūtu, un attiecīgā gadījumā tās izsaka ar precizitāti vismaz divas zīmes aiz komata.
0140	Nosacītā summa	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.w panta 1., 2. un 5. punkts.	Ja 0020. slejā uzrādītā riska klase atbilst "instrumenti, kas nav vērtspapīrošanas pozīcijas", iestādes uzrāda instrumenta nosacīto vērtību. Atkarībā no riska darījuma veida, vērtība atbilst $V_{notional}$ Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.w panta 1. un 2. punktā vai *V* minētās regulas 325.w panta 5. punktā. Šo šūnu neaizpilda, ja nav piemērojams neviens no minētajiem gadījumiem vai ja iestāde konkrēti neaprēķina vai neizmanto šajā šūnā uzrādāmo summu pēkšņas saistību neizpildes (*JTD*) bruto summas aprēķināšanai.
0150	Peļņa un zaudējumi + korekcija (*P&L + Adjustment*)	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.w panta 1., 2. un 5. punkts.	Iestādes par katru riska darījumu uzrāda peļņas un zaudējumu un korekcijas summu: — ja 0020. slejā uzrādītā riska klase atbilst "instrumenti, kas nav vērtspapīrošanas pozīcijas" un uzrādītais riska darījums ir garās pozīcijas riska darījums, iestādes saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.w panta 1. punktu norāda $P\&L_{long}$ un $Adjustment_{long}$ summu, — ja 0020. slejā uzrādītā riska klase atbilst "Instrumenti, kas nav vērtspapīrošanas pozīcijas" un uzrādītais riska darījums ir īsās pozīcijas riska darījums, iestādes saskaņā ar minētās regulas 325.w panta 2. punktu norāda $P\&L_{short}$ un $Adjustment_{short}$ summu;

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
			Šo šūnu neaizpilda, ja nav piemērojams neviens no minētajiem gadījumiem vai ja iestāde konkrēti neaprēķina vai neizmanto šajā šūnā uzrādāmo summu pēkšņas saistību neizpildes (*JTD*) bruto summas aprēķināšanai.
0160	Pēkšņas saistību neizpildes (*JTD*) bruto summa	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.v panta 1. punkta c) apakšpunkts, 325.w panta 1., 2. un 5. punkts, 325.z panta 1. punkts un 325.ac panta 2. punkts	Iestādes par katru konkrēto riska darījumu uzrāda pēkšņas saistību neizpildes (*JTD*) bruto summu.
0170	Valūta		Uzrāda iestādes pārskata sniegšanas valūtu (uzrādītā vērtība atbilst ISO 4217 valūtas noteikšanai).
0180-0200	EBI portfeļa valūtas rezultāti	Šīs regulas V pielikuma 3. un 4. iedaļa un Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.y, 325.aa un 325.ad pants	Vērtības uzrāda saskaņā ar 0030. slejā sniegtajiem norādījumiem, bet pārrēķina pēc ECB tagadnes kursa, kas saistīts ar portfeļa valūtu, kā noteikts šīs regulas V pielikuma 3. un 4. iedaļā.
0180	Nosacītā summa	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.w panta 1., 2. un 5. punkts.	Ja 0020. slejā uzrādītā riska klase atbilst "instrumenti, kas nav vērtspapīrošanas pozīcijas", iestādes uzrāda instrumenta nosacīto vērtību. Atkarībā no riska darījuma veida, vērtība atbilst $V_{notional}$ Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.w panta 1. un 2. punktā vai *V* minētās regulas 325.w panta 5. punktā. Šo šūnu neaizpilda, ja nav piemērojams neviens no minētajiem gadījumiem vai ja iestāde konkrēti neaprēķina vai neizmanto šajā šūnā uzrādāmo summu pēkšņas saistību neizpildes (*JTD*) bruto summas aprēķināšanai.
0190	Peļņa un zaudējumi + korekcija (*P&L + Adjustment*)	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.w panta 1., 2. un 5. punkts.	Iestādes par katru riska darījumu uzrāda peļņas un zaudējumu un korekcijas summu: — ja 0020. slejā uzrādītā riska klase atbilst "instrumenti, kas nav vērtspapīrošanas pozīcijas" un uzrādītais riska darījums ir garās pozīcijas riska darījums, iestādes saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.w panta 1. punktu norāda $P\&L_{long}$ un $Adjustment_{long}$ summu, — ja 0020. slejā uzrādītā riska klase atbilst "Instrumenti, kas nav vērtspapīrošanas pozīcijas" un uzrādītais riska darījums ir īsās pozīcijas riska darījums, iestādes saskaņā ar minētās regulas 325.w panta 2. punktu norāda $P\&L_{short}$ un $Adjustment_{short}$ summu;

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
			Šo šūnu neaizpilda, ja nav piemērojams neviens no minētajiem gadījumiem vai ja iestāde konkrēti neaprēķina vai neizmanto šajā šūnā uzrādāmo summu pēkšņas saistību neizpildes (*JTD*) bruto summas aprēķināšanai.
0200	Pēkšņas saistību neizpildes (*JTD*) bruto summa	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.v panta 1. punkta c) apakšpunkts, 325.w panta 1., 2. un 5. punkts, 325.z panta 1. punkts un 325.ac panta 2. punkts	Iestādes par katru konkrēto riska darījumu uzrāda pēkšņas saistību neizpildes (*JTD*) bruto summu.

C 120.05 – SAISTĪBU NEIZPILDES RISKA PRASĪBA (*DRC*). PAŠU KAPITĀLA PRASĪBU (*OFR*) SASTĀVS PA PORTFEĻIEM

Norādījumi par lapām (z-ass)

Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
Portfelis	V pielikuma 3., 4. un 5. iedaļa	Uzrāda portfeļa numuru, kas minēts V pielikumā.

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0010	Riska klase	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.v panta 2. punkts.	Uzrāda riska klasi, par kuru saistību neizpildes riska prasība norādīta 0030. un 0040. slejā. Atbilde ir viens no turpmāk minētajiem instrumentu veidiem: a) “instrumenti, kas nav vērtspapīrošanas pozīcijas”; b) “vērtspapīrošanas pozīcijas, kas nav ietvertas alternatīvas korelācijas tirdzniecības portfelī”; c) “vērtspapīrošanas pozīcijas, kas ietvertas alternatīvas korelācijas tirdzniecības portfelī”.
0020	1. kopa	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.y panta 3. punkts, 325.aa panta 4. punkts un 325.ad panta 2. punkts	Uzrāda kopu. Ja 0010. slejā uzrādītā riska klase atbilst “Instrumenti, kas nav vērtspapīrošanas pozīcijas”, atbilde ir viena no turpmāk minētajām: a) “uzņēmumi [komercsabiedrības]”; b) “valstis”; c) “pašvaldības/municipalitātes”.

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
			Ja tā vietā 0010. slejā uzrādītā riska klase atbilst "vērtspapīrošanas pozīcijas, kas nav ietvertas alternatīvas korelācijas tirdzniecības portfelī", atbilde ir viena no turpmāk minētajām: d) "ABKV – Āzija"; e) "ABKV – Eiropa"; f) "ABKV – Ziemeļamerika"; g) "ABKV – pārējā pasaule"; h) "autokredīti/līzings – Āzija"; i) "autokredīti/līzings – Eiropa"; j) "autokredīti/līzings – Ziemeļamerika"; k) "autokredīti/līzings – pārējā pasaule"; l) "nodrošinātas parādsaistības kvadrātā (*CDO* kvadrātā) – Āzija"; m) "nodrošinātas parādsaistības kvadrātā (*CDO* kvadrātā) – Eiropa"; n) "nodrošinātas parādsaistības kvadrātā (*CDO* kvadrātā) – Ziemeļamerika"; o) "nodrošinātas parādsaistības kvadrātā (*CDO* kvadrātā) – pārējā pasaule"; p) "nodrošinātas kredītsaistības – Āzija"; q) "nodrošinātas kredītsaistības – Eiropa"; r) "nodrošinātas kredītsaistības – Ziemeļamerika"; s) "nodrošinātas kredītsaistības – pārējā pasaule"; t) "ar komerciālām hipotēkām nodrošināti vērtspapīri (*CMBS*) – Āzija"; u) "ar komerciālām hipotēkām nodrošināti vērtspapīri (*CMBS*) – Eiropa"; v) "ar komerciālām hipotēkām nodrošināti vērtspapīri (*CMBS*) – Ziemeļamerika"; w) "ar komerciālām hipotēkām nodrošināti vērtspapīri (*CMBS*) – pārējā pasaule"; x) "kredītkartes – Āzija"; y) "kredītkartes – Eiropa"; z) "kredītkartes – Ziemeļamerika"; aa) "kredītkartes – pārējā pasaule"; bb) "pārējā mazumtirdzniecība – Āzija"; cc) "pārējā mazumtirdzniecība – Eiropa"; dd) "pārējā mazumtirdzniecība – Ziemeļamerika"; ee) "pārējā mazumtirdzniecība – pārējā pasaule"; ff) "pārējā vairumtirdzniecība – Āzija"; gg) "pārējā vairumtirdzniecība – Eiropa"; hh) "pārējā vairumtirdzniecība – Ziemeļamerika"; ii) "pārējā vairumtirdzniecība – pārējā pasaule"; jj) "ar mājokļu hipotēkām nodrošināti vērtspapīri (*RMBS*) – Āzija"; kk) "ar mājokļu hipotēkām nodrošināti vērtspapīri (*RMBS*) – Eiropa"; ll) "ar mājokļu hipotēkām nodrošināti vērtspapīri (*RMBS*) – Ziemeļamerika"; mm) "ar mājokļu hipotēkām nodrošināti vērtspapīri (*RMBS*) – pārējā pasaule"; nn) "mazie un vidējie uzņēmumi (MVU) – Āzija"; oo) "mazie un vidējie uzņēmumi (MVU) – Eiropa"; pp) "mazie un vidējie uzņēmumi (MVU) – Ziemeļamerika"; qq) "mazie un vidējie uzņēmumi (MVU) – pārējā pasaule"; rr) "studiju kreditēšana – Āzija";

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
			ss) "studiju kreditēšana – Eiropa"; tt) "studiju kreditēšana – Ziemeļamerika"; uu) "studiju kreditēšana – pārējā pasaule". Ja tā vietā 0010. slejā uzrādītā riska klase atbilst "vērtspapīrošanas pozīcijas, kas ietvertas alternatīvas korelācijas tirdzniecības portfelī", atbilde ir "vērtspapīrošana, kas ietverta alternatīvas korelācijas tirdzniecības portfelī".
0030	2. kopa	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.ad panta 2. punkts	Ja 0010. slejā uzrādītā riska klase atbilst "vērtspapīrošanas pozīcijas, kas ietvertas alternatīvas korelācijas tirdzniecības portfelī", atbilde ir indeksa nosaukums; pretējā gadījumā uzrāda (*NULL*).
0040	Pašu kapitāla prasības (pārskata sniegšanas valūtas rezultāti)	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.y, 325.aa un 325.ad pants	Pašu kapitāla prasības saistību neizpildes riskam uzrāda attiecībā uz "RM (un pēdējās *ASA*) pēdējo atsauces datumu" (kā precizēts šīs regulas V pielikuma 1. iedaļas b) punktā). Vērtības uzrāda iestādes pārskata sniegšanas valūtā, un tās izsaka ar precizitāti vismaz divas zīmes aiz komata.
0050	Pārskata sniegšanas valūta		Uzrāda iestādes pārskata sniegšanas valūtu (uzrādītā vērtība atbilst ISO 4217 valūtas noteikšanai).
0060	Pašu kapitāla prasības (EBI portfeļa valūtas rezultāti)	Šīs regulas V pielikuma 3. un 4. iedaļa un Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.y, 325.aa un 325.ad pants	Vērtības uzrāda saskaņā ar 0030. slejā sniegtajiem norādījumiem, bet pārrēķina pēc ECB tagadnes kursa, kas saistīts ar portfeļa valūtu, kā noteikts šīs regulas V pielikuma 3. un 4. iedaļā.

C 120.06 – *ASA. OFR*

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0010	Portfeļa numurs	V pielikuma 3., 4. un 5. iedaļa	Uzrāda portfeļa numuru, kas minēts V pielikumā.
0020-0040	Pārskata sniegšanas valūtas rezultāti	V pielikuma 3. un 4. iedaļa	

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

Sleja	Apzīmējums	Juridiskā atsauce	Norādījumi
0020	*SBM OFR*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.h pants	Par katru portfeli uzrāda pašu kapitāla prasības alternatīvās standartizētās pieejas ar jutīgumu saistītajai metodei "RM (un pēdējās *ASA*) pēdējā atsauces datumā" (kā precizēts šīs regulas V pielikuma 1. iedaļas b) punktā).
0030	*DRC OFR*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.v pants	Par katru portfeli uzrāda pašu kapitāla prasības alternatīvās standartizētās pieejas saistību neizpildes riska prasībai "RM (un pēdējās *ASA*) pēdējā atsauces datumā" (kā precizēts šīs regulas V pielikuma 1. iedaļas b) punktā).
0040	*RRAO OFR*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.u pants	Par katru portfeli uzrāda pašu kapitāla prasības alternatīvās standartizētās pieejas atlikušā riska papildinājumam "RM (un pēdējās *ASA*) pēdējā atsauces datumā" (kā precizēts šīs regulas V pielikuma 1. iedaļas b) punktā).
0050-0070	EBI portfeļa valūtas rezultāti	V pielikuma 3. un 4. iedaļa	Ja iestādes pārskata sniegšanas valūta atšķiras no EBI portfeļa valūtām, kas norādītas V pielikuma 3. un 4. iedaļā, iestādes pārskata sniegšanas valūtu konvertē ar piemērojamo EBI tagadnes kursu.
0050	*SBM OFR*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.h pants	Par katru portfeli uzrāda pašu kapitāla prasības alternatīvās standartizētās pieejas ar jutīgumu saistītajai metodei "RM (un pēdējās *ASA*) pēdējā atsauces datumā" (kā precizēts šīs regulas V pielikuma 1. iedaļas b) punktā).
0060	*DRC OFR*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.v pants	Par katru portfeli uzrāda pašu kapitāla prasības alternatīvās standartizētās pieejas saistību neizpildes riska prasībai "RM (un pēdējās *ASA*) pēdējā atsauces datumā" (kā precizēts šīs regulas V pielikuma 1. iedaļas b) punktā).
0070	*RRAO OFR*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.u pants	Par katru portfeli uzrāda pašu kapitāla prasības alternatīvās standartizētās pieejas atlikušā riska papildinājumam "RM (un pēdējās *ASA*) pēdējā atsauces datumā" (kā precizēts šīs regulas V pielikuma 1. iedaļas b) punktā).

Tabula. Norādes par 106.01. (0010. sleja) un 120.01. (0020. sleja) veidnes uzrādīšanu

— Sleja "riska klase" attiecas uz Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.d panta 1. punktu. Riska klases apzīmē šādi saīsinājumi:

a) "*GIRR*"(vispārīgais procentu likmju risks);

b) "*CSR_NON_SEC*" (nevērtspapīrošanas kredītriska starpības risks(*CSR*));

c) "*CSR_SEC_NON_ACTP*" (vērtspapīrošanas, kas nav ietverta alternatīvas korelācijas tirdzniecības portfelī, kredītriska starpības risks (*non-ACTP CSR*));

d) "*CSR_SEC_ACTP*" (vērtspapīrošanas, kas ietverta alternatīvas korelācijas tirdzniecības portfelī, kredītriska starpības risks (*ACTP CSR*));

e) "*EQ*" (kapitāla vērtspapīru risks);

f) "*CM*" (preču risks);

g) "*FX*" (ārvalstu valūtas risks).

— Sleja "sastāvdaļa" [komponents] attiecas uz Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.e panta 1. punktu. Ar risku saistītās metodes sastāvdaļas [komponentus] apzīmē šādi saīsinājumi:

a) "*DELTA*" (delta risks);

b) "*VEGA*" (vega risks);

c) "*CURVATURE*" (līknes risks).

— Sleja "termiņš" attiecas uz riska faktora termiņu, ja riska faktori ir definēti atbilstīgi virsotnēm, kas noteiktas saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l, 325.m, 325.n, 325.o, 325.p un 325.q pantu. Vega vispārīgo procentu likmju riska faktoriem, kas noteikti minētās regulas 325.l panta 7. punktā, norāda divus termiņus, kurus atdala ar domuzīmi (piem., "0,5 gadi – 0,5 gadi"); pirmais attiecas uz iespējas līguma termiņu un otrais – uz iespējas līguma pamatā esošā aktīva atlikušo termiņu iespējas līguma beigu datumā.

— Sleja "papildu specifikācijas" sīkāk precizē attiecīgos riska faktorus, izšķirot starp inflācijas risku un starpvalūtu bāzes riska faktoriem saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pantu, starp riska faktoriem, kas saistīti ar parāda instrumentiem, un riska faktoriem, kas saistīti ar kredītriska mijmaiņas darījumiem, saskaņā ar minētās regulas 325.m un 325.n pantu, starp kapitāla vērtspapīru tūlītējās cenas un kapitāla vērtspapīru repo likmes riska faktoriem saskaņā ar minētās regulas 325.o pantu un starp minētā riska faktora augšupvērsto neto līknes riska pozīciju (*CVRk+*) un lejupvērsto neto līknes riska pozīciju (*CVRk-*), kā precizēts minētās regulas 325.g pantā.

Riska klase	Sastāvdaļa [komponents]	Termiņš	Papildu specifikācija	Riska faktora identifikators	Juridiskā atsauce
CM	*DELTA*	0 gadi		CM_D_00.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.p pants
CM	*DELTA*	0,25 gadi		CM_D_00.25	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.p pants
CM	*DELTA*	0,5 gadi		CM_D_00.50	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.p pants
CM	*DELTA*	1 gads		CM_D_01.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.p pants
CM	*DELTA*	2 gadi		CM_D_02.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.p pants
CM	*DELTA*	3 gadi		CM_D_03.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.p pants
CM	*DELTA*	5 gadi		CM_D_05.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.p pants
CM	*DELTA*	10 gadi		CM_D_10.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.p pants
CM	*DELTA*	15 gadi		CM_D_15.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.p pants
CM	*DELTA*	20 gadi		CM_D_20.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.p pants
CM	*DELTA*	30 gadi		CM_D_30.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.p pants
CM	*VEGA*	0,5 gadi		CM_V_00.50	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.p pants
CM	*VEGA*	1 gads		CM_V_01.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.p pants
CM	*VEGA*	3 gadi		CM_V_03.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.p pants
CM	*VEGA*	5 gadi		CM_V_05.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.p pants
CM	*VEGA*	10 gadi		CM_V_10.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.p pants
CM	*CURVATURE*		Augšupejoša pārbīde	CM_CU	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.p un 325.g pants

Riska klase	Sastāvdaļa [komponents]	Termiņš	Papildu specifikācija	Riska faktora identifikators	Juridiskā atsauce
CM	*CURVATURE*		Lejupvērsta pārbīde	CM_CD	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.p un 325.g pants
CSR_NON_SEC	*DELTA*	0,5 gadi	Parāda instruments	CSR_NON_SEC_D_00.50_DEBT	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.m pants
CSR_NON_SEC	*DELTA*	1 gads	Parāda instruments	CSR_NON_SEC_D_01.00_DEBT	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.m pants
CSR_NON_SEC	*DELTA*	3 gadi	Parāda instruments	CSR_NON_SEC_D_03.00_DEBT	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.m pants
CSR_NON_SEC	*DELTA*	5 gadi	Parāda instruments	CSR_NON_SEC_D_05.00_DEBT	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.m pants
CSR_NON_SEC	*DELTA*	10 gadi	Parāda instruments	CSR_NON_SEC_D_10.00_DEBT	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.m pants
CSR_NON_SEC	*DELTA*	0,5 gadi	Kredītriska mijmaiņas darījums	CSR_NON_SEC_D_00.50_CDS	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.m pants
CSR_NON_SEC	*DELTA*	1 gads	Kredītriska mijmaiņas darījums	CSR_NON_SEC_D_01.00_CDS	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.m pants
CSR_NON_SEC	*DELTA*	3 gadi	Kredītriska mijmaiņas darījums	CSR_NON_SEC_D_03.00_CDS	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.m pants
CSR_NON_SEC	*DELTA*	5 gadi	Kredītriska mijmaiņas darījums	CSR_NON_SEC_D_05.00_CDS	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.m pants
CSR_NON_SEC	*DELTA*	10 gadi	Kredītriska mijmaiņas darījums	CSR_NON_SEC_D_10.00_CDS	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.m pants
CSR_NON_SEC	*VEGA*	0,5 gadi		CSR_NON_SEC_V_00.50	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.m pants
CSR_NON_SEC	*VEGA*	1 gads		CSR_NON_SEC_V_01.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.m pants
CSR_NON_SEC	*VEGA*	3 gadi		CSR_NON_SEC_V_03.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.m pants
CSR_NON_SEC	*VEGA*	5 gadi		CSR_NON_SEC_V_05.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.m pants
CSR_NON_SEC	*VEGA*	10 gadi		CSR_NON_SEC_V_10.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.m pants
CSR_NON_SEC	*CURVATURE*		Augšupejoša pārbīde	CSR_NON_SEC_CU	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.m un 325.g pants

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

Riska klase	Sastāvdaļa [komponents]	Termiņš	Papildu specifikācija	Riska faktora identifikators	Juridiskā atsauce
CSR_NON_SEC	*CURVATURE*		Lejupvērsta pārbīde	CSR_NON_SEC_CD	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.m un 325.g pants
CSR_SEC_ACTP	*DELTA*	0,5 gadi	Parāda instruments	CSR_SEC_ACTP_D_00.50_DEBT	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_ACTP	*DELTA*	1 gads	Parāda instruments	CSR_SEC_ACTP_D_01.00_DEBT	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_ACTP	*DELTA*	3 gadi	Parāda instruments	CSR_SEC_ACTP_D_03.00_DEBT	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_ACTP	*DELTA*	5 gadi	Parāda instruments	CSR_SEC_ACTP_D_05.00_DEBT	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_ACTP	*DELTA*	10 gadi	Parāda instruments	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_DEBT	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_ACTP	*DELTA*	0,5 gadi	Kredītriska mijmaiņas darījums	CSR_SEC_ACTP_D_00.50_CDS	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_ACTP	*DELTA*	1 gads	Kredītriska mijmaiņas darījums	CSR_SEC_ACTP_D_01.00_CDS	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_ACTP	*DELTA*	3 gadi	Kredītriska mijmaiņas darījums	CSR_SEC_ACTP_D_03.00_CDS	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_ACTP	*DELTA*	5 gadi	Kredītriska mijmaiņas darījums	CSR_SEC_ACTP_D_05.00_CDS	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_ACTP	*DELTA*	10 gadi	Kredītriska mijmaiņas darījums	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_CDS	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_ACTP	*VEGA*	0,5 gadi		CSR_SEC_ACTP_V_00.50	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_ACTP	*VEGA*	1 gads		CSR_SEC_ACTP_V_01.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_ACTP	*VEGA*	3 gadi		CSR_SEC_ACTP_V_03.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_ACTP	*VEGA*	5 gadi		CSR_SEC_ACTP_V_05.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_ACTP	*VEGA*	10 gadi		CSR_SEC_ACTP_V_10.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_ACTP	*CURVATURE*		Augšupejoša pārbīde	CSR_SEC_ACTP_CU	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n un 325.g pants

Riska klase	Sastāvdaļa [komponents]	Termiņš	Papildu specifikācija	Riska faktora identifikators	Juridiskā atsauce
CSR_SEC_ACTP	*CURVATURE*		Lejupvērsta pārbīde	CSR_SEC_ACTP_CD	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n un 325.g pants
CSR_SEC_NO-N_ACTP	*DELTA*	0,5 gadi	Parāda instruments	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_00.50_DEBT	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_NO-N_ACTP	*DELTA*	1 gads	Parāda instruments	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_01.00_DEBT	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_NO-N_ACTP	*DELTA*	3 gadi	Parāda instruments	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_03.00_DEBT	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_NO-N_ACTP	*DELTA*	5 gadi	Parāda instruments	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_05.00_DEBT	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_NO-N_ACTP	*DELTA*	10 gadi	Parāda instruments	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_10.00_DEBT	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_NO-N_ACTP	*DELTA*	0,5 gadi	Kredītriska mijmaiņas darījums	CSR_SEC_NON_ACTP_D_00.50_CDS	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_NO-N_ACTP	*DELTA*	1 gads	Kredītriska mijmaiņas darījums	CSR_SEC_NON_ACTP_D_01.00_CDS	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_NO-N_ACTP	*DELTA*	3 gadi	Kredītriska mijmaiņas darījums	CSR_SEC_NON_ACTP_D_03.00_CDS	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_NO-N_ACTP	*DELTA*	5 gadi	Kredītriska mijmaiņas darījums	CSR_SEC_NON_ACTP_D_05.00_CDS	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_NO-N_ACTP	*DELTA*	10 gadi	Kredītriska mijmaiņas darījums	CSR_SEC_NON_ACTP_D_10.00_CDS	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_NO-N_ACTP	*VEGA*	0,5 gadi		CSR_SEC_NON_ACTP_V_00.50	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_NO-N_ACTP	*VEGA*	1 gads		CSR_SEC_NON_ACTP_V_01.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_NO-N_ACTP	*VEGA*	3 gadi		CSR_SEC_NON_ACTP_V_03.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_NO-N_ACTP	*VEGA*	5 gadi		CSR_SEC_NON_ACTP_V_05.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_NO-N_ACTP	*VEGA*	10 gadi		CSR_SEC_NON_ACTP_V_10.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n pants
CSR_SEC_NO-N_ACTP	*CURVATURE*		Augšupejoša pārbīde	CSR_SEC_NON_ACTP_CU	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n un 325.g pants

Riska klase	Sastāvdaļa [komponents]	Termiņš	Papildu specifikācija	Riska faktora identifikators	Juridiskā atsauce
CSR_SEC_NO-N_ACTP	*CURVATURE*		Lejupvērsta pārbīde	CSR_SEC_NON_ACTP_CD	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.n un 325.g pants
EQ	*DELTA*		Tūlītējā cena	EQ_D_SPOT	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.o pants
EQ	*DELTA*		Repo likme	EQ_D_REPO	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.o pants
EQ	*VEGA*	0,5 gadi		EQ_V_00.50	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.o pants
EQ	*VEGA*	1 gads		EQ_V_01.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.o pants
EQ	*VEGA*	3 gadi		EQ_V_03.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.o pants
EQ	*VEGA*	5 gadi		EQ_V_05.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.o pants
EQ	*VEGA*	10 gadi		EQ_V_10.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.o pants
EQ	*CURVATURE*		Augšupejoša pārbīde	EQ_CU	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.o un 325.g pants
EQ	*CURVATURE*		Lejupvērsta pārbīde	EQ_CD	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.o un 325.g pants
FX	*DELTA*			FX_D	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.q pants
FX	*VEGA*	0,5 gadi		FX_V_00.50	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.q pants
FX	*VEGA*	1 gads		FX_V_01.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.q pants
FX	*VEGA*	3 gadi		FX_V_03.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.q pants
FX	*VEGA*	5 gadi		FX_V_05.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.q pants
FX	*VEGA*	10 gadi		FX_V_10.00	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.q pants
FX	*CURVATURE*		Augšupejoša pārbīde	FX_CU	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.q un 325.g pants

Riska klase	Sastāvdaļa [komponents]	Termiņš	Papildu specifikācija	Riska faktora identifikators	Juridiskā atsauce
FX	*CURVATURE*		Lejupvērsta pārbīde	FX_CD	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.q un 325.g pants
GIRR	*DELTA*	0,25 gadi		*GIRR_D_00.25*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*DELTA*	0,5 gadi		*GIRR_D_00.50*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*DELTA*	1 gads		*GIRR_D_01.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*DELTA*	2 gadi		*GIRR_D_02.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*DELTA*	3 gadi		*GIRR_D_03.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*DELTA*	5 gadi		*GIRR_D_05.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*DELTA*	10 gadi		*GIRR_D_10.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*DELTA*	15 gadi		*GIRR_D_15.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*DELTA*	20 gadi		*GIRR_D_20.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*DELTA*	30 gadi		*GIRR_D_30.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*DELTA*		Inflācija	*GIRR_D_INF*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*DELTA*		Starpvalūtu bāze (attiecībā uz EUR)	*GIRR_D_CRO_EUR*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*DELTA*		Starpvalūtu bāze (attiecībā uz USD)	*GIRR_D_CRO_USD*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	0,5 gadi – 0,5 gadi		*GIRR_V_00.50_00.50*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	1 gads – 0,5 gadi		*GIRR_V_01.00_00.50*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	3 gadi – 0,5 gadi		*GIRR_V_03.00_00.50*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants

Riska klase	Sastāvdaļa [komponents]	Termiņš	Papildu specifikācija	Riska faktora identifikators	Juridiskā atsauce
GIRR	*VEGA*	5 gadi – 0,5 gadi		*GIRR_V_05.00_00.50*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	10 gadi – 0,5 gadi		*GIRR_V_10.00_00.50*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	0,5 gadi – 1 gads		*GIRR_V_00.50_01.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	1 gads – 1 gads		*GIRR_V_01.00_01.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	3 gadi – 1 gads		*GIRR_V_03.00_01.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	5 gadi – 1 gads		*GIRR_V_05.00_01.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	10 gadi – 1 gads		*GIRR_V_10.00_01.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	0,5 gadi – 3 gadi		*GIRR_V_00.50_03.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	1 gads – 3 gadi		*GIRR_V_01.00_03.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	3 gadi – 3 gadi		*GIRR_V_03.00_03.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	5 gadi – 3 gadi		*GIRR_V_05.00_3.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	10 gadi – 3 gadi		*GIRR_V_10.00_03.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	0,5 gadi – 5 gadi		*GIRR_V_00.50_05.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	1 gads – 5 gadi		*GIRR_V_01.00_05.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	3 gadi – 5 gadi		*GIRR_V_03.00_05.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	5 gadi – 5 gadi		*GIRR_V_05.00_05.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	10 gadi – 5 gadi		*GIRR_V_10.00_05.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants

Riska klase	Sastāvdaļa [komponents]	Termiņš	Papildu specifikācija	Riska faktora identifikators	Juridiskā atsauce
GIRR	*VEGA*	0,5 gadi – 10 gadi		*GIRR_V_00.50_10.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	1 gads – 10 gadi		*GIRR_V_01.00_10.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	3 gadi – 10 gadi		*GIRR_V_03.00_10.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	5 gadi – 10 gadi		*GIRR_V_05.00_10.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	10 gadi – 10 gadi		*GIRR_V_10.00_10.00*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	0,5 gadi	Inflācija	*GIRR_V_00.50_INF*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	1 gads	Inflācija	*GIRR_V_01.00_INF*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	3 gadi	Inflācija	*GIRR_V_03.00_INF*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	5 gadi	Inflācija	*GIRR_V_05.00_INF*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	10 gadi	Inflācija	*GIRR_V_10.00_INF*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	0,5 gadi	Starpvalūtu bāze (attiecībā uz EUR)	*GIRR_V_00.50_CRO_EUR*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	1 gads	Starpvalūtu bāze (attiecībā uz EUR)	*GIRR_V_01.00_CRO_EUR*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	3 gadi	Starpvalūtu bāze (attiecībā uz EUR)	*GIRR_V_03.00_CRO_EUR*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	5 gadi	Starpvalūtu bāze (attiecībā uz EUR)	*GIRR_V_05.00_CRO_EUR*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	10 gadi	Starpvalūtu bāze (attiecībā uz EUR)	*GIRR_V_10.00_CRO_EUR*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	0,5 gadi	Starpvalūtu bāze (attiecībā uz USD)	*GIRR_V_00.50_CRO_USD*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	1 gads	Starpvalūtu bāze (attiecībā uz USD)	*GIRR_V_01.00_CRO_USD*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants

Riska klase	Sastāvdaļa [komponents]	Termiņš	Papildu specifikācija	Riska faktora identifikators	Juridiskā atsauce
GIRR	*VEGA*	3 gadi	Starpvalūtu bāze (attiecībā uz USD)	*GIRR_V_03.00_CRO_USD*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	5 gadi	Starpvalūtu bāze (attiecībā uz USD)	*GIRR_V_05.00_CRO_USD*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*VEGA*	10 gadi	Starpvalūtu bāze (attiecībā uz USD)	*GIRR_V_10.00_CRO_USD*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l pants
GIRR	*CURVATURE*		Augšupejoša pārbīde	*GIRR_CU*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l un 325.g pants
GIRR	*CURVATURE*		Lejupvērsta pārbīde	*GIRR_CD*	Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.l un 325.g pants".

IV PIELIKUMS

"VII PIELIKUMS

Rezultātu uzraudzības salīdzinošās vērtēšanas portfeļi. TIRGUS RISKS

REZULTĀTU SALĪDZINOŠĀS VĒRTĒŠANAS PORTFEĻI. TIRGUS RISKS			
Veidnes numurs	**Veidnes kods**	**Veidnes / veidņu grupas nosaukums**	**Saīsinātais nosaukums**
		SĀKOTNĒJAIS TIRGUS NOVĒRTĒJUMS	
106,1	C 106.00	SĀKOTNĒJAIS TIRGUS NOVĒRTĒJUMS (*IMV*) UN IZSLĒGŠANAS PAMATOJUMS	*IMV*
106,2	C 106.01	RISKA JUTĪGUMS PA INSTRUMENTIEM	JUTĪGUMS
		VaR, sVaR* un *PV	
107,1	C 107.01	SĪKĀKA INFORMĀCIJA	*VaR* un *SVaR* 1
107,2	C 107.02	**EBI PORTFEĻA** VALŪTAS REZULTĀTI	*VaR* un *SVaR* 2
		PEĻŅAS UN ZAUDĒJUMU LAIKRINDAS	
108	C 108.00	PEĻŅAS UN ZAUDĒJUMU LAIKRINDAS	*P&L*
		INKREMENTĀLĀ RISKA PRASĪBA (*IRC*)	
109,1	C 109.01	INKREMENTĀLĀ RISKA PRASĪBA (*IRC*). SĪKĀKA INFORMĀCIJA PAR MODELI.	*IRC* 1
109,2	C 109.02	INKREMENTĀLĀ RISKA PRASĪBA (*IRC*). SĪKĀKA INFORMĀCIJA PA PORTFEĻIEM	*IRC* 2
109,3	C 109.03	INKREMENTĀLĀ RISKA PRASĪBA (*IRC*). SUMMA PA PORTFEĻIEM/DATUMIEM	*IRC* 3
		KORELĀCIJAS TIRDZNIECĪBA (*CT*)	
110,1	C 110.01	KORELĀCIJAS TIRDZNIECĪBA (*CT*). SĪKĀKA INFORMĀCIJA PAR MODELI	*CT* 1
110,2	C 110.02	KORELĀCIJAS TIRDZNIECĪBA (*CT*). SĪKĀKA INFORMĀCIJA PA PORTFEĻIEM	*CT* 2
110,3	C 110.03	KORELĀCIJAS TIRDZNIECĪBA (*CT*). SUMMA PA PORTFEĻIEM/DATUMIEM	*CT* 3
		ALTERNATĪVĀ STANDARTIZĒTĀ PIEEJA (*SBM* un *DRC*)	
120,1	C 120.01	AR JUTĪGUMU SAISTĪTĀ METODE (*SBM*). RISKA JUTĪGUMS PA INSTRUMENTIEM/PORTFEĻIEM	*SBM* 1
120,2	C 120.02	AR JUTĪGUMU SAISTĪTĀ METODE (*SBM*). PAŠU KAPITĀLA PRASĪBU (*OFR*) SASTĀVS PA PORTFEĻIEM	*SBM* 2
120,4	C 120.04	SAISTĪBU NEIZPILDES RISKA PRASĪBA (*DRC*). TIRGUS VĒRTĪBAS UN PĒKŠŅAS SAISTĪBU NEIZPILDES (*JTD*) BRUTO SUMMAS PA INSTRUMENTIEM/PORTFEĻIEM	*DRC* 1
120,5	C 120.05	SAISTĪBU NEIZPILDES RISKA PRASĪBA (*DRC*). PAŠU KAPITĀLA PRASĪBU (*OFR*) SASTĀVS PA PORTFEĻIEM	*DRC* 2
120,6	C 120.06	ALTERNATĪVĀ STANDARTIZĒTĀ PIEEJA (*ASA*). PAŠU KAPITĀLA PRASĪBAS (*OFR*) PA PORTFEĻIEM	*ASA OFR*

C 106.00 – SĀKOTNĒJAIS TIRGUS NOVĒRTĒJUMS UN IZSLĒGŠANAS PAMATOJUMS

Instrumenta numurs	Instruments modelēts attiecībā uz *VaR* + *SVaR* (Jā/Nē)	Instruments modelēts attiecībā uz *IRC* (Jā/Nē)	Instruments modelēts attiecībā uz korelācijas tirdzniecību (Jā/Nē)	Izslēgšanas pamatojums	Atbilde brīvā tekstā	Sākotnējais tirgus novērtējums
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070

C 106.01 – RISKA JUTĪGUMS PA INSTRUMENTIEM

Instrumenta numurs

Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Riska jutīgums (pārskata sniegšanas valūtas rezultāti)	Pārskata sniegšanas valūta	Riska jutīgums (EBI instrumentu valūtas rezultāti)	Cenu noteikšanas modelis	Jutīguma definīcija	Atbilde brīvā tekstā	Papildu identifikators2	Kredītkvalitātes kategorija
0010	0020	0030	0050	0060	0070	0080	0090	0100	110	120

C 107.01 – *VaR, sVaR* un *PV*. SĪKĀKA INFORMĀCIJA

		Iespēja	Atbilde brīvā tekstā
		0010	0020
VaR			
0010	**Metodika**		
0020	**10 dienu laikposma aprēķināšana**		

		Iespēja	Atbilde brīvā tekstā
		0010	0020
0030	**Novērošanas laikposma ilgums**		
0040	**Datu svēršana**		
0050	**Atpakaļejošas pārbaudes palielinājums**		
0060	**VaR regulatīvs palielinājums**		
SVaR			
0070	**Metodika**		
0080	**10 dienu laikposma aprēķināšana**		
0090	**sVaR regulatīvs palielinājums**		
0100	**sVaR periods**		

C 107.02 – *VaR* un *sVaR*, kas nav *CTP*. EBI PORTFEĻA VALŪTAS REZULTĀTI

Portfelis

Datums	VaR	sVaR	PV
0010	0020	0030	0040

C 108.00 – PEĻŅAS UN ZAUDĒJUMU LAIKRINDAS

Portfelis

Datums	**Dienas P&L**
0010	0020

C 109.01 – INKREMENTĀLĀ RISKA PRASĪBA (*IRC*). SĪKĀKA INFORMĀCIJA PAR MODELI

		Iespēja	**Atbilde brīvā tekstā**
Rinda	**Postenis**	0010	0020
0010	**Modelēšanas faktoru skaits**		
0020	**LGD avots**		

C 109.02 – INKREMENTĀLĀ RISKA PRASĪBA (*IRC*). SĪKĀKA INFORMĀCIJA PA PORTFEĻIEM

Portfelis

		Iespēja	**Atbilde brīvā tekstā**
Rinda	**Postenis**	0010	0020
0010	**Likviditātes periods**		
0020	**PD avots**		
0030	**Pārejas matriču avots**		

C 109.03 – INKREMENTĀLĀ RISKA PRASĪBA (*IRC*). SUMMA PA PORTFEĻIEM/DATUMIEM

Portfelis

Datums	**IRC**
0010	0020

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

C 110.01 – KORELĀCIJAS TIRDZNIECĪBA (*CT*). SĪKĀKA INFORMĀCIJA PAR MODELI.

		Iespēja	Atbilde brīvā tekstā
Rinda	**Postenis**	0010	0020
0010	**Modelēšanas faktoru skaits**		
0020	**LGD avots**		

C 110.02 – KORELĀCIJAS TIRDZNIECĪBA (*CT*). SĪKĀKA INFORMĀCIJA PA PORTFEĻIEM

Portfelis

		Iespēja	Atbilde brīvā tekstā
Rinda	**Postenis**	0010	0020
0010	**Likviditātes periods**		
0020	**PD avots**		
0030	**Pārejas matriču avots**		

C 110.03 – KORELĀCIJAS TIRDZNIECĪBA (*CT*). VISS CENAS RISKS (*APR*) PA PORTFEĻIEM/DATUMIEM

Portfelis

Datums	**APR**
0010	0060

C 120.01 - SBM. RISK SENSITIVITIES BY INSTRUMENT/PORTFOLIO

Portfolio

Instrument number	**Risk factor identifier**	**Bucket**	**Additional identifier**	**Risk sensitivity (Reporting currency results)**	**Reporting currency**	**Risk sensitivity (EBA portfolio currency results)**	**Risk weight**	**Additional identifier2**	**Credit quality category**
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 COMPOSITION BY PORTFOLIO

Portfolio

Risk class	Risk Component	Correlations scenario	Own funds requirements (Reporting currency results)	Reporting currency	Own funds requirements (EBA portfolio currency results)	Positions without optionality subjected to curvature risk own funds requirements	Base currency approach applied for foreign-exchange risk delta and curvature	Division of curvature risk components for foreign-exchange risk by scalar	Submission of SBM validation portfolio results	Free text box
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0950	0100

C 120.04 - DRC. Market values and gross JTD amounts by Instrument/Portfolio

Portfolio

Integer

Instrument number	Risk class	Bucket1	Bucket2	Obligor	Credit quality category	Default risk weight	Seniority	Maturity	Recovery Rate	Direction	Attachment point (%)	Detachment point (%)	Reporting currency results				EBA portfolio currency results		
													Notional	P&L + Adjustment	Gross JTD amount	Currency	Notional	P&L + Adjustment	Gross JTD amount
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120	0130	0140	0150	0160	0170	0180	0190	0200

C 120.05 - DRC. OFR COMPOSITION BY PORTFOLIO

Portfolio

Integer

Risk class	Bucket1	Bucket2	Own funds requirements (Reporting currency results)	Reporting currency	Own funds requirements (EBA portfolio currency results)
0010	0020	0030	0040	0050	0060

C 120.06 – ALTERNATĪVĀ STANDARTIZĒTĀ PIEEJA (*ASA*). OFR

Portfeļa numurs	Pārskata sniegšanas valūtas rezultāti			EBI portfeļa valūtas rezultāti		
	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 PIELIKUMS

"X PIELIKUMS

Ar jutīgumu saistītās metodes (SBM) validācijas portfeļi

Lapas nosaukums	Apraksts
Instrumenti	Instrumenti (jutīgums un līknes riska pozīcijas) *SBM* validācijas vajadzībām
Portfeļi	*SBM* validācijas portfeļi, kas definēti kā šajā pielikumā definēto instrumentu kombinācijas

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
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

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
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

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
S_IRV_c1#	*GIRR_V*_00.50_00.50	CLP				300,00
S_IRV_d1#	*GIRR_V*_00.50_00.50	EUR				– 4 750,00
S_IRV_e1#	*GIRR_V*_00.50_00.50	BRL				– 500,00
S_IRD_b11#	*GIRR_D_INF*	USD				– 50 000,00
S_IRD_d11#	*GIRR_D_INF*	CLP				95 000,00
S_IRD_e11#	*GIRR_D_INF*	EUR	DE			– 65 000,00
S_IRD_e13#	*GIRR_D_INF*	EUR	FR			– 100 000,00
S_IRD_d12#	*GIRR_D_CRO*_USD	CLP				10 500,00
S_IRD_e12#	*GIRR_D_CRO*_USD	EUR				– 85 000,00
S_IRD_b12#	GIRR_D_CRO_EUR	USD				– 65 000,00
S_IRD_b10#	*GIRR_D*_30.00	USD	OIS			– 50 000,00
S_IRD_c10#	*GIRR_D*_30.00	USD	Libor3m			10 000,00
S_IRD_d10#	*GIRR_D*_30.00	CLP	OIS			15 000,00
S_IRD_e10#	*GIRR_D*_30.00	EUR	OIS			– 120 000,00
S_IRD_b9#	*GIRR_D*_20.00	USD	OIS			200 000,00
S_IRD_c9#	*GIRR_D*_20.00	USD	Libor3m			– 30 000,00
S_IRD_d9#	*GIRR_D*_20.00	CLP	OIS			90 000,00
S_IRD_e9#	*GIRR_D*_20.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b8#	*GIRR_D*_15.00	USD	OIS			30 000,00
S_IRD_c8#	*GIRR_D*_15.00	USD	Libor3m			10 000,00
S_IRD_d8#	*GIRR_D*_15.00	CLP	OIS			70 000,00

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
S_IRD_e8#	*GIRR_D_15.00*	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b7#	*GIRR_D_10.00*	USD	OIS			2 000,00
S_IRD_c7#	*GIRR_D_10.00*	USD	Libor3m			– 100 000,00
S_IRD_d7#	*GIRR_D_10.00*	CLP	OIS			– 25 000,00
S_IRD_e7#	*GIRR_D_10.00*	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b6#	*GIRR_D_05.00*	USD	OIS			– 90 000,00
S_IRD_c6#	*GIRR_D_05.00*	USD	Libor3m			– 35 000,00
S_IRD_d6#	*GIRR_D_05.00*	CLP	OIS			– 5 000,00
S_IRD_e6#	*GIRR_D_05.00*	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b5#	*GIRR_D_03.00*	USD	OIS			85 000,00
S_IRD_c5#	*GIRR_D_03.00*	USD	Libor3m			55 000,00
S_IRD_d5#	*GIRR_D_03.00*	CLP	OIS			– 100 000,00
S_IRD_e5#	*GIRR_D_03.00*	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b4#	*GIRR_D_02.00*	USD	OIS			– 10 000,00
S_IRD_c4#	*GIRR_D_02.00*	USD	Libor3m			10 000,00
S_IRD_d4#	*GIRR_D_02.00*	CLP	OIS			5 000,00
S_IRD_e4#	*GIRR_D_02.00*	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b3#	*GIRR_D_01.00*	USD	OIS			– 65 000,00
S_IRD_c3#	*GIRR_D_01.00*	USD	Libor3m			70 000,00
S_IRD_d3#	*GIRR_D_01.00*	CLP	OIS			10 000,00
S_IRD_e3#	*GIRR_D_01.00*	EUR	OIS			– 50 000,00
S_IRD_b2#	*GIRR_D_00.50*	USD	OIS			15 000,00
S_IRD_c2#	*GIRR_D_00.50*	USD	Libor3m			– 40 000,00
S_IRD_d2#	*GIRR_D_00.50*	CLP	OIS			45 000,00
S_IRD_e2#	*GIRR_D_00.50*	EUR	OIS			100,00
S_IRD_a1#	*GIRR_D_00.25*	USD	OIS			30 000,00
S_IRD_b1#	*GIRR_D_00.25*	USD	OIS			20 000,00

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
S_IRD_c1#	*GIRR_D_00.25*	USD	Libor3m			– 30 000,00
S_IRD_d1#	*GIRR_D_00.25*	CLP	OIS			– 30 000,00
S_IRD_e1#	*GIRR_D_00.25*	EUR	OIS			100,00
S_IRD_f1#	*GIRR_D_00.25*	DKK	OIS			100,00
S_IRC_a1#	*GIRR_CU*	USD				– 18 466,83
S_IRC_b1#	*GIRR_CU*	USD				92 233,09
S_IRC_c1#	*GIRR_CU*	CLP				– 1 270,00
S_IRC_d1#	*GIRR_CU*	EUR				– 253,12
S_IRC_e1#	*GIRR_CU*	VND				– 11 950,00
S_IRC_a1#	*GIRR_CD*	USD				18 647,66
S_IRC_b1#	*GIRR_CD*	USD				– 93 178,71
S_IRC_c1#	*GIRR_CD*	CLP				450,00
S_IRC_d1#	*GIRR_CD*	EUR				– 3 237,08
S_IRC_e1#	*GIRR_CD*	VND				– 4 030,00
S_FXV_b4#	*FX_V_5.00*	EUR_CLP				200,00
S_FXV_d4#	*FX_V_5.00*	CHF_VND				1 500,00
S_FXV_b3#	*FX_V_3.00*	EUR_CLP				– 400,00
S_FXV_d3#	*FX_V_3.00*	CHF_VND				1 000,00
S_FXV_b5#	*FX_V_10.00*	EUR_CLP				150,00
S_FXV_d5#	*FX_V_10.00*	CHF_VND				– 2 000,00
S_FXV_b2#	*FX_V_1.00*	EUR_CLP				300,00
S_FXV_d2#	*FX_V_1.00*	CHF_VND				3 750,00

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
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	EMITENTS A			100,00

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
S_EQV_aa4#	*EQ_V_5.00*	5	EMITENTS AA			1 200,00
S_EQV_ac1#	*EQ_V_5.00*	7	EMITENTS AC			– 50,00
S_EQV_ae4#	*EQ_V_5.00*	9	EMITENTS AE			600,00
S_EQV_af4#	*EQ_V_5.00*	10	EMITENTS AF			375,00
S_EQV_b4#	*EQ_V_5.00*	1	EMITENTS B			50,00
S_EQV_f4#	*EQ_V_5.00*	5	EMITENTS F			450,00
S_EQV_j4#	*EQ_V_5.00*	9	EMITENTS J			– 200,00
S_EQV_k4#	*EQ_V_5.00*	10	EMITENTS K			– 825,00
S_EQV_m1#	*EQ_V_5.00*	11	EMITENTS M			– 700,00
S_EQV_n4#	*EQ_V_5.00*	12	INDEKSS N			850,00
S_EQV_o4#	*EQ_V_5.00*	12	INDEKSS O			150,00
S_EQV_y1#	*EQ_V_5.00*	3	EMITENTS Y			700,00
S_EQV_a4#	*EQ_V_3.00*	1	EMITENTS A			– 500,00
S_EQV_aa3#	*EQ_V_3.00*	5	EMITENTS AA			– 850,00
S_EQV_ad1#	*EQ_V_3.00*	8	EMITENTS AD			300,00
S_EQV_ae3#	*EQ_V_3.00*	9	EMITENTS AE			– 450,00
S_EQV_af3#	*EQ_V_3.00*	10	EMITENTS AF			– 725,00
S_EQV_b3#	*EQ_V_3.00*	1	EMITENTS B			– 500,00

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
S_EQV_f3#	*EQ_V_3.00*	5	EMITENTS F			250,00
S_EQV_j3#	*EQ_V_3.00*	9	EMITENTS J			– 900,00
S_EQV_k3#	*EQ_V_3.00*	10	EMITENTS K			– 975,00
S_EQV_n3#	*EQ_V_3.00*	12	INDEKSS N			– 1 250,00
S_EQV_o3#	*EQ_V_3.00*	12	INDEKSS O			100,00
S_EQV_x1#	*EQ_V_3.00*	2	EMITENTS X			– 200,00
S_EQV_z1#	*EQ_V_3.00*	4	EMITENTS Z			– 800,00
S_EQV_a6#	*EQ_V_10.00*	1	EMITENTS A			100,00
S_EQV_aa5#	*EQ_V_10.00*	5	EMITENTS AA			– 300,00
S_EQV_ab1#	*EQ_V_10.00*	6	EMITENTS AB			– 400,00
S_EQV_ae5#	*EQ_V_10.00*	9	EMITENTS AE			– 850,00
S_EQV_af5#	*EQ_V_10.00*	10	EMITENTS AF			525,00
S_EQV_b5#	*EQ_V_10.00*	1	EMITENTS B			500,00
S_EQV_f5#	*EQ_V_10.00*	5	EMITENTS F			600,00
S_EQV_j5#	*EQ_V_10.00*	9	EMITENTS J			150,00
S_EQV_k5#	*EQ_V_10.00*	10	EMITENTS K			300,00
S_EQV_n5#	*EQ_V_10.00*	12	INDEKSS N			225,00
S_EQV_o5#	*EQ_V_10.00*	12	INDEKSS O			– 200,00

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

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
S_EQV_q1#	*EQ_V_10.00*	13	INDEKSS Q			– 800,00
S_EQV_a3#	*EQ_V_1.00*	1	EMITENTS A			400,00
S_EQV_aa2#	*EQ_V_1.00*	5	EMITENTS AA			– 400,00
S_EQV_ae2#	*EQ_V_1.00*	9	EMITENTS AE			– 250,00
S_EQV_af2#	*EQ_V_1.00*	10	EMITENTS AF			– 1 150,00
S_EQV_b2#	*EQ_V_1.00*	1	EMITENTS B			200,00
S_EQV_f2#	*EQ_V_1.00*	5	EMITENTS F			– 750,00
S_EQV_j2#	*EQ_V_1.00*	9	EMITENTS J			350,00
S_EQV_k2#	*EQ_V_1.00*	10	EMITENTS K			1 050,00
S_EQV_n2#	*EQ_V_1.00*	12	INDEKSS N			– 800,00
S_EQV_o2#	*EQ_V_1.00*	12	INDEKSS O			400,00
S_EQV_a1#	*EQ_V_0.50*	1	EMITENTS A			– 100,00
S_EQV_a2#	*EQ_V_0.50*	1	EMITENTS A			700,00
S_EQV_aa1#	*EQ_V_0.50*	5	EMITENTS AA			950,00
S_EQV_ae1#	*EQ_V_0.50*	9	EMITENTS AE			50,00
S_EQV_af1#	*EQ_V_0.50*	10	EMITENTS AF			– 300,00
S_EQV_b1#	*EQ_V_0.50*	1	EMITENTS B			900,00
S_EQV_c1#	*EQ_V_0.50*	2	EMITENTS C			– 500,00

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
S_EQV_d1#	*EQ_V_0.50*	3	EMITENTS D			600,00
S_EQV_e1#	*EQ_V_0.50*	4	EMITENTS E			– 800,00
S_EQV_f1#	*EQ_V_0.50*	5	EMITENTS F			1 000,00
S_EQV_g1#	*EQ_V_0.50*	6	EMITENTS G			– 400,00
S_EQV_h1#	*EQ_V_0.50*	7	EMITENTS H			– 50,00
S_EQV_i1#	*EQ_V_0.50*	8	EMITENTS I			300,00
S_EQV_j1#	*EQ_V_0.50*	9	EMITENTS J			50,00
S_EQV_k1#	*EQ_V_0.50*	10	EMITENTS K			– 300,00
S_EQV_l1#	*EQ_V_0.50*	11	EMITENTS L			1 000,00
S_EQV_n1#	*EQ_V_0.50*	12	INDEKSS N			750,00
S_EQV_o1#	*EQ_V_0.50*	12	INDEKSS O			– 500,00
S_EQV_p1#	*EQ_V_0.50*	13	INDEKSS P			40,00
S_EQD_a1#	*EQ_D_SPOT*	1	EMITENTS A			16 500,00
S_EQD_a2#	*EQ_D_SPOT*	1	EMITENTS A			– 35 000,00
S_EQD_b1#	*EQ_D_SPOT*	1	EMITENTS B			20 000,00
S_EQD_c1#	*EQ_D_SPOT*	2	EMITENTS C			66 000,00
S_EQD_d1#	*EQ_D_SPOT*	3	EMITENTS D			1 700,00
S_EQD_e1#	*EQ_D_SPOT*	4	EMITENTS E			1 100,00

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

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
S_EQD_f1#	*EQ_D_SPOT*	5	EMITENTS F			25 000,00
S_EQD_g1#	*EQ_D_SPOT*	5	EMITENTS G			8 400,00
S_EQD_h1#	*EQ_D_SPOT*	6	EMITENTS H			22 500,00
S_EQD_i1#	*EQ_D_SPOT*	7	EMITENTS I			– 12 300,00
S_EQD_j1#	*EQ_D_SPOT*	8	EMITENTS J			– 450,00
S_EQD_k1#	*EQ_D_SPOT*	9	EMITENTS K			– 143,00
S_EQD_l1#	*EQ_D_SPOT*	9	EMITENTS L			– 143,00
S_EQD_m1#	*EQ_D_SPOT*	10	EMITENTS M			– 100,00
S_EQD_n1#	*EQ_D_SPOT*	10	EMITENTS N			– 100,00
S_EQD_o1#	*EQ_D_SPOT*	11	EMITENTS O			– 19 600,00
S_EQD_q1#	*EQ_D_SPOT*	12	INDEKSS Q			1 100,00
S_EQD_r1#	*EQ_D_SPOT*	12	INDEKSS R			– 40 000,00
S_EQD_s1#	*EQ_D_SPOT*	13	INDEKSS S			– 1 950,00
S_EQD_s2#	*EQ_D_SPOT*	13	INDEKSS S			280,00
S_EQD_t2#	*EQ_D_SPOT*	13	INDEKSS T			3 150,00
S_EQD_u1#	*EQ_D_SPOT*	9	EMITENTS U			– 57,00
S_EQD_v1#	*EQ_D_SPOT*	10	EMITENTS V			– 100,00

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
S_EQD_a3#	*EQ_D_REPO*	1	EMITENTS A			50 000,00
S_EQD_aa1#	*EQ_D_REPO*	6	EMITENTS AA			79 000,00
S_EQD_ab1#	*EQ_D_REPO*	7	EMITENTS AB			31 000,00
S_EQD_ac1#	*EQ_D_REPO*	8	EMITENTS AC			– 10 000,00
S_EQD_b2#	*EQ_D_REPO*	1	EMITENTS B			– 39 000,00
S_EQD_f2#	*EQ_D_REPO*	5	EMITENTS F			90 000,00
S_EQD_g2#	*EQ_D_REPO*	5	EMITENTS G			60 000,00
S_EQD_k2#	*EQ_D_REPO*	9	EMITENTS K			– 14 250,00
S_EQD_l2#	*EQ_D_REPO*	9	EMITENTS L			– 150 000,00
S_EQD_m2#	*EQ_D_REPO*	10	EMITENTS M			– 85 000,00
S_EQD_n2#	*EQ_D_REPO*	10	EMITENTS N			– 72 000,00
S_EQD_p1#	*EQ_D_REPO*	11	EMITENTS P			48 000,00
S_EQD_q2#	*EQ_D_REPO*	12	INDEKSS Q			85 000,00
S_EQD_r2#	*EQ_D_REPO*	12	INDEKSS R			– 40 000,00
S_EQD_t1#	*EQ_D_REPO*	13	INDEKSS T			– 125 000,00
S_EQD_x1#	*EQ_D_REPO*	2	EMITENTS X			75 000,00
S_EQD_y1#	*EQ_D_REPO*	3	EMITENTS Y			4 800,00

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

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
S_EQD_z1#	*EQ_D_REPO*	4	EMITENTS Z			– 15 000,00
S_EQC_a1#	*EQ_CU*	1	EMITENTS A			– 37 820,00
S_EQC_a2#	*EQ_CU*	1	EMITENTS A			77 655,00
S_EQC_aa1#	*EQ_CU*	2	EMITENTS AA			39 300,00
S_EQC_ab1#	*EQ_CU*	4	EMITENTS AB			17 262,00
S_EQC_ac1#	*EQ_CU*	5	EMITENTS AC			7 139,60
S_EQC_ad1#	*EQ_CU*	6	EMITENTS AD			– 3 642,50
S_EQC_ae1#	*EQ_CU*	7	EMITENTS AE			3 900,00
S_EQC_af1#	*EQ_CU*	8	EMITENTS AF			41 550,00
S_EQC_ag1#	*EQ_CU*	9	EMITENTS AG			36 860,00
S_EQC_ah1#	*EQ_CU*	10	EMITENTS AH			22 150,00
S_EQC_b1#	*EQ_CU*	1	EMITENTS B			20 677,50
S_EQC_c1#	*EQ_CU*	2	EMITENTS C			– 31 440,00
S_EQC_d1#	*EQ_CU*	3	EMITENTS D			6 238,00
S_EQC_e1#	*EQ_CU*	4	EMITENTS E			– 21 605,00
S_EQC_f1#	*EQ_CU*	5	EMITENTS F			– 2 850,00
S_EQC_g1#	*EQ_CU*	6	EMITENTS G			– 3 642,50

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

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

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
S_EQC_ad1#	*EQ_CD*	6	EMITENTS AD			2 617,50
S_EQC_ae1#	*EQ_CD*	7	EMITENTS AE			– 2 720,00
S_EQC_af1#	*EQ_CD*	8	EMITENTS AF			– 28 250,00
S_EQC_ag1#	*EQ_CD*	9	EMITENTS AG			– 30 935,00
S_EQC_ah1#	*EQ_CD*	10	EMITENTS AH			– 15 025,00
S_EQC_b1#	*EQ_CD*	1	EMITENTS B			– 238 910,00
S_EQC_c1#	*EQ_CD*	2	EMITENTS C			24 480,00
S_EQC_d1#	*EQ_CD*	3	EMITENTS D			– 6 068,00
S_EQC_e1#	*EQ_CD*	4	EMITENTS E			12 310,00
S_EQC_f1#	*EQ_CD*	5	EMITENTS F			2 160,00
S_EQC_g1#	*EQ_CD*	6	EMITENTS G			2 617,50
S_EQC_h1#	*EQ_CD*	7	EMITENTS H			5 440,00
S_EQC_i1#	*EQ_CD*	8	EMITENTS I			20 050,00
S_EQC_j1#	*EQ_CD*	9	EMITENTS J			181 560,00
S_EQC_k1#	*EQ_CD*	10	EMITENTS K			– 2 900,00
S_EQC_q1#	*EQ_CD*	11	EMITENTS Q			20 052,00
S_EQC_r1#	*EQ_CD*	11	EMITENTS R			– 30 078,00
S_EQC_s1#	*EQ_CD*	3	EMITENTS S			– 9 435,00

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
S_EQC_t1#	*EQ_CD*	12	EMITENTS T			– 7 400,00
S_EQC_u1#	*EQ_CD*	13	EMITENTS U			– 11 040,00
S_EQC_v1#	*EQ_CD*	12	EMITENTS V			38 850,00
S_EQC_w1#	*EQ_CD*	13	EMITENTS W			57 960,00
S_EQC_y1#	*EQ_CD*	1	EMITENTS Y			13 590,00
S_EQC_z1#	*EQ_CD*	1	EMITENTS Z			27 180,00
S_CNV_a5#	*CSR_NON_SEC_V_5.00*	1	EMITENTS A			100,00
S_CNV_b4#	*CSR_NON_SEC_V_5.00*	1	EMITENTS B			50,00
S_CNV_c4#	*CSR_NON_SEC_V_5.00*	3	EMITENTS C			150,00
S_CNV_hb1#	*CSR_NON_SEC_V_5.00*	9	EMITENTS HA			– 750,00
S_CNV_a4#	*CSR_NON_SEC_V_3.00*	1	EMITENTS A			– 500,00
S_CNV_ab1#	*CSR_NON_SEC_V_3.00*	2	EMITENTS AB			325,00
S_CNV_b3#	*CSR_NON_SEC_V_3.00*	1	EMITENTS B			– 500,00
S_CNV_c3#	*CSR_NON_SEC_V_3.00*	3	EMITENTS C			100,00
S_CNV_v1#	*CSR_NON_SEC_V_3.00*	20	INDEKSS V			500,00
S_CNV_a6#	*CSR_NON_SEC_V_10.00*	1	EMITENTS A			100,00
S_CNV_b5#	*CSR_NON_SEC_V_10.00*	1	EMITENTS B			500,00

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
S_CNV_c5#	*CSR_NON_SEC_V_10.00*	3	EMITENTS C			– 200,00
S_CNV_a3#	*CSR_NON_SEC_V_1.00*	1	EMITENTS A			400,00
S_CNV_b2#	*CSR_NON_SEC_V_1.00*	1	EMITENTS B			200,00
S_CNV_c2#	*CSR_NON_SEC_V_1.00*	3	EMITENTS C			400,00
S_CNV_a1#	*CSR_NON_SEC_V_0.50*	1	EMITENTS A			– 100,00
S_CNV_a2#	*CSR_NON_SEC_V_0.50*	1	EMITENTS A			700,00
S_CNV_b1#	*CSR_NON_SEC_V_0.50*	1	EMITENTS B			900,00
S_CNV_c1#	*CSR_NON_SEC_V_0.50*	3	EMITENTS C			– 500,00
S_CNV_d1#	*CSR_NON_SEC_V_0.50*	4	EMITENTS D			700,00
S_CNV_e1#	*CSR_NON_SEC_V_0.50*	5	EMITENTS E			– 800,00
S_CNV_f1#	*CSR_NON_SEC_V_0.50*	6	EMITENTS F			700,00
S_CNV_g1#	*CSR_NON_SEC_V_0.50*	7	EMITENTS G			– 400,00
S_CNV_h1#	*CSR_NON_SEC_V_0.50*	8	EMITENTS H			– 50,00
S_CNV_i1#	*CSR_NON_SEC_V_0.50*	10	EMITENTS I			300,00
S_CNV_j1#	*CSR_NON_SEC_V_0.50*	11	EMITENTS J			50,00
S_CNV_k1#	*CSR_NON_SEC_V_0.50*	12	EMITENTS K			– 300,00
S_CNV_l1#	*CSR_NON_SEC_V_0.50*	13	EMITENTS L			1 000,00

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
S_CNV_m1#	*CSR_NON_SEC_V_0.50*	14	EMITENTS M			– 350,00
S_CNV_n1#	*CSR_NON_SEC_V_0.50*	15	EMITENTS N			950,00
S_CNV_o1#	*CSR_NON_SEC_V_0.50*	16	EMITENTS O			– 900,00
S_CNV_p1#	*CSR_NON_SEC_V_0.50*	17	EMITENTS P			200,00
S_CNV_q1#	*CSR_NON_SEC_V_0.50*	18	EMITENTS Q			400,00
S_CNV_r1#	*CSR_NON_SEC_V_0.50*	18	EMITENTS R			– 300,00
S_CNV_s1#	*CSR_NON_SEC_V_0.50*	19	INDEKSS S			850,00
S_CNV_t1#	*CSR_NON_SEC_V_0.50*	20	INDEKSS T			– 650,00
S_CNV_u1#	*CSR_NON_SEC_V_0.50*	19	INDEKSS U			– 350,00
S_CND_hb2#	*CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT*	9	EMITENTS HB			– 17 000,00
S_CND_t1#	*CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT*	3	EMITENTS T			– 6 000,00
S_CND_y1#	*CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT*	20	INDEKSS Y			9 000,00
S_CND_ab2#	*CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS*	2	EMITENTS AC			14 000,00
S_CND_b2#	*CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS*	1	EMITENTS B			– 17 000,00
S_CND_w1#	*CSR_NON_-SEC_D_10.00_DEBT*	10	EMITENTS W		CQS 1	9 000,00
S_CND_a4#	*CSR_NON_-SEC_D_1.00_DEBT*	1	EMITENTS A			– 10 000,00
S_CND_s1#	*CSR_NON_-SEC_D_1.00_DEBT*	3	EMITENTS S			– 6 000,00

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
S_CND_x1#	*CSR_NON_SEC_D_1.00_CDS*	19	INDEKSS X			– 18 500,00
S_CND_a1#	*CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT*	1	EMITENTS A			20 000,00
S_CND_a2#	*CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT*	1	EMITENTS A			– 30 000,00
S_CND_b1#	*CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT*	1	EMITENTS B			12 000,00
S_CND_c1#	*CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT*	3	EMITENTS C			– 6 000,00
S_CND_d1#	*CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT*	4	EMITENTS D			25 000,00
S_CND_e1#	*CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT*	5	EMITENTS E			– 4 000,00
S_CND_f1#	*CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT*	6	EMITENTS F			– 8 000,00
S_CND_g1#	*CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT*	7	EMITENTS G			8 000,00
S_CND_h1#	*CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT*	8	EMITENTS H			3 000,00
S_CND_hb1#	*CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT*	9	EMITENTS HA			– 23 000,00
S_CND_i1#	*CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT*	10	EMITENTS I		CQS 2	– 5 000,00
S_CND_j1#	*CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT*	11	EMITENTS J			2 000,00
S_CND_k1#	*CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT*	12	EMITENTS K			7 000,00
S_CND_l1#	*CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT*	13	EMITENTS L			– 9 000,00
S_CND_m1#	*CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT*	14	EMITENTS M			10 000,00
S_CND_n1#	*CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT*	15	EMITENTS N			– 20 000,00

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
S_CND_o1#	*CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT*	16	EMITENTS O			5 000,00
S_CND_p1#	*CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT*	17	EMITENTS P			– 3 000,00
S_CND_q1#	*CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT*	18	EMITENTS Q			10 000,00
S_CND_r1#	*CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT*	18	EMITENTS R			– 5 000,00
S_CND_a3#	*CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS*	1	EMITENTS A			15 000,00
S_CND_ab1#	*CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS*	2	EMITENTS AB			21 000,00
S_CND_u1#	*CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS*	19	INDEKSS U			– 32 000,00
S_CND_v1#	*CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS*	20	INDEKSS V			– 13 000,00
S_CND_x2#	*CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS*	19	INDEKSS X			52 500,00
S_CNC_a1#	*CSR_NON_SEC_CU*	1	EMITENTS A			– 2 338,64
S_CNC_a2#	*CSR_NON_SEC_CU*	1	EMITENTS A			35 116,67
S_CNC_aa1#	*CSR_NON_SEC_CU*	10	EMITENTS AA		CQS 1	– 1 212,50
S_CNC_ab1#	*CSR_NON_SEC_CU*	2	EMITENTS AB1			– 247,47
S_CNC_b1#	*CSR_NON_SEC_CU*	1	EMITENTS B			890,91
S_CNC_c1#	*CSR_NON_SEC_CU*	3	EMITENTS C			– 500,00
S_CNC_d1#	*CSR_NON_SEC_CU*	4	EMITENTS D			415,00
S_CNC_e1#	*CSR_NON_SEC_CU*	5	EMITENTS E			– 1 050,00

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
S_CNC_f1#	*CSR_NON_SEC_CU*	6	EMITENTS F			– 150,00
S_CNC_g1#	*CSR_NON_SEC_CU*	7	EMITENTS G			– 318,75
S_CNC_h1#	*CSR_NON_SEC_CU*	8	EMITENTS H			– 425,00
S_CNC_hb1#	*CSR_NON_SEC_CU*	9	EMITENTS HB1			– 500,00
S_CNC_i1#	*CSR_NON_SEC_CU*	10	EMITENTS I		CQS 2	– 937,50
S_CNC_j1#	*CSR_NON_SEC_CU*	11	EMITENTS J			– 4 650,00
S_CNC_k1#	*CSR_NON_SEC_CU*	12	EMITENTS K			– 425,00
S_CNC_l1#	*CSR_NON_SEC_CU*	13	EMITENTS L			– 27 660,00
S_CNC_m1#	*CSR_NON_SEC_CU*	14	EMITENTS M			– 488,00
S_CNC_n1#	*CSR_NON_SEC_CU*	15	EMITENTS N			13 237,50
S_CNC_o1#	*CSR_NON_SEC_CU*	16	EMITENTS O			– 1 127,50
S_CNC_p1#	*CSR_NON_SEC_CU*	17	EMITENTS P			– 5 775,00
S_CNC_q1#	*CSR_NON_SEC_CU*	18	EMITENTS Q			– 7 842,00
S_CNC_r1#	*CSR_NON_SEC_CU*	18	EMITENTS R			15 684,00
S_CNC_s1#	*CSR_NON_SEC_CU*	4	EMITENTS S			– 750,00
S_CNC_t1#	*CSR_NON_SEC_CU*	19	EMITENTS T			3 550,00
S_CNC_u1#	*CSR_NON_SEC_CU*	20	EMITENTS U			1 660,00
S_CNC_v1#	*CSR_NON_SEC_CU*	19	EMITENTS V			– 18 637,50

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
S_CNC_w1#	*CSR_NON_SEC_CU*	20	EMITENTS W			– 8 715,00
S_CNC_x1#	*CSR_NON_SEC_CU*	3	EMITENTS X			– 500,00
S_CNC_y1#	*CSR_NON_SEC_CU*	1	EMITENTS Y			– 249,95
S_CNC_z1#	*CSR_NON_SEC_CU*	1	EMITENTS Z			– 249,95
S_CNC_a1#	*CSR_NON_SEC_CD*	1	EMITENTS A			2 363,38
S_CNC_a2#	*CSR_NON_SEC_CD*	1	EMITENTS A			– 35 314,65
S_CNC_aa1#	*CSR_NON_SEC_CD*	10	EMITENTS AA		CQS 1	1 150,00
S_CNC_ab1#	*CSR_NON_SEC_CD*	2	EMITENTS AB1			247,47
S_CNC_b1#	*CSR_NON_SEC_CD*	1	EMITENTS B			– 5 543,43
S_CNC_c1#	*CSR_NON_SEC_CD*	3	EMITENTS C			500,00
S_CNC_d1#	*CSR_NON_SEC_CD*	4	EMITENTS D			– 385,00
S_CNC_e1#	*CSR_NON_SEC_CD*	5	EMITENTS E			575,00
S_CNC_f1#	*CSR_NON_SEC_CD*	6	EMITENTS F			75,00
S_CNC_g1#	*CSR_NON_SEC_CD*	7	EMITENTS G			287,50
S_CNC_h1#	*CSR_NON_SEC_CD*	8	EMITENTS H			400,00
S_CNC_hb1#	*CSR_NON_SEC_CD*	9	EMITENTS HB1			500,00
S_CNC_i1#	*CSR_NON_SEC_CD*	10	EMITENTS I		CQS 2	750,00
S_CNC_j1#	*CSR_NON_SEC_CD*	11	EMITENTS J			4 100,00

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

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
S_CNC_k1#	*CSR_NON_SEC_CD*	12	EMITENTS K			387,50
S_CNC_l1#	*CSR_NON_SEC_CD*	13	EMITENTS L			22 130,00
S_CNC_m1#	*CSR_NON_SEC_CD*	14	EMITENTS M			160,00
S_CNC_n1#	*CSR_NON_SEC_CD*	15	EMITENTS N			– 23 437,50
S_CNC_o1#	*CSR_NON_SEC_CD*	16	EMITENTS O			1 246,25
S_CNC_p1#	*CSR_NON_SEC_CD*	17	EMITENTS P			6 225,00
S_CNC_q1#	*CSR_NON_SEC_CD*	18	EMITENTS Q			8 752,00
S_CNC_r1#	*CSR_NON_SEC_CD*	18	EMITENTS R			– 17 504,00
S_CNC_s1#	*CSR_NON_SEC_CD*	4	EMITENTS S			– 250,00
S_CNC_t1#	*CSR_NON_SEC_CD*	19	EMITENTS T			– 3 500,00
S_CNC_u1#	*CSR_NON_SEC_CD*	20	EMITENTS U			– 1 540,00
S_CNC_v1#	*CSR_NON_SEC_CD*	19	EMITENTS V			18 375,00
S_CNC_w1#	*CSR_NON_SEC_CD*	20	EMITENTS W			8 085,00
S_CNC_x1#	*CSR_NON_SEC_CD*	3	EMITENTS X			500,00
S_CNC_y1#	*CSR_NON_SEC_CD*	1	EMITENTS Y			– 226,77
S_CNC_z1#	*CSR_NON_SEC_CD*	1	EMITENTS Z			– 226,77
S_CMV_a5#	*CM_V_5.00*	1	OGLES			– 300,00

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
S_CMV_b4#	*CM_V_5.00*	1	URĀNS			450,00
S_CMV_a4#	*CM_V_3.00*	1	OGLES			800,00
S_CMV_b3#	*CM_V_3.00*	1	URĀNS			800,00
S_CMV_a6#	*CM_V_10.00*	1	OGLES			100,00
S_CMV_b5#	*CM_V_10.00*	1	URĀNS			– 250,00
S_CMV_a3#	*CM_V_1.00*	1	OGLES			– 200,00
S_CMV_b2#	*CM_V_1.00*	1	URĀNS			– 750,00
S_CMV_d1#	*CM_V_1.00*	2	*WTI*			– 175,00
S_CMV_f1#	*CM_V_1.00*	3	*FWD ELECTRICITY NE*			– 450,00
S_CMV_h1#	*CM_V_1.00*	4	*PANAMAX*			– 5 500,00
S_CMV_j1#	*CM_V_1.00*	5	VARŠ			– 200,00
S_CMV_l1#	*CM_V_1.00*	6	SAŠĶIDRINĀTA DABASGĀZE			1 000,00
S_CMV_n1#	*CM_V_1.00*	7	SUDRABS			500,00
S_CMV_p1#	*CM_V_1.00*	8	KUKURŪZA			– 1 000,00
S_CMV_r1#	*CM_V_1.00*	9	SŪKALAS			– 125,00
S_CMV_t1#	*CM_V_1.00*	10	KAUČUKS			– 50,00
S_CMV_v1#	*CM_V_1.00*	11	POTAŠA			– 1 800,00

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
S_CMV_a1#	*CM_V_0.50*	1	OGLES			1 000,00
S_CMV_a2#	*CM_V_0.50*	1	OGLES			– 350,00
S_CMV_b1#	*CM_V_0.50*	1	URĀNS			150,00
S_CMV_c1#	*CM_V_0.50*	2	*BRENT*			200,00
S_CMV_e1#	*CM_V_0.50*	3	*SPOT ELECTRICITY SE*			– 300,00
S_CMV_g1#	*CM_V_0.50*	4	*SUPRAMAX*			– 5 000,00
S_CMV_i1#	*CM_V_0.50*	5	TĒRAUDS			550,00
S_CMV_k1#	*CM_V_0.50*	6	DABASGĀZE			400,00
S_CMV_m1#	*CM_V_0.50*	7	ZELTS			– 200,00
S_CMV_o1#	*CM_V_0.50*	8	SOJAS PUPAS			– 750,00
S_CMV_q1#	*CM_V_0.50*	9	ZIVIS			250,00
S_CMV_s1#	*CM_V_0.50*	10	KAKAO			350,00
S_CMV_u1#	*CM_V_0.50*	11	LOKŠŅU STIKLS			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	KUKURŪZA	OKLAHOMA		– 10 000,00
S_CMD_f1#	*CM_D_3.00*	3	*FWD ELECTRICITY NE*	TEKSASA		– 4 500,00

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
S_CMD_h1#	*CM_D_3.00*	4	*PANAMAX*	ĶŪORLEĀNA		– 68 750,00
S_CMD_n1#	*CM_D_20.00*	7	SUDRABS	EU1		5 000,00
S_CMD_r1#	*CM_D_20.00*	9	SŪKALAS	ĶŪKĀSLA		– 1 250,00
S_CMD_d1#	*CM_D_2.00*	2	*WTI*	OKLAHOMA		– 1 750,00
S_CMD_l1#	*CM_D_15.00*	6	SAŠĶIDRINĀTA DABASGĀZE	OKLAHOMA		10 000,00
S_CMD_t1#	*CM_D_15.00*	10	KAUČUKS	ĶŪKĀSLA		– 500,00
S_CMD_j1#	*CM_D_10.00*	5	VARŠ	OKLAHOMA		– 2 000,00
S_CMD_v1#	*CM_D_10.00*	11	POTAŠA	ĶŪKĀSLA		– 18 000,00
S_CMD_b1#	*CM_D_1.00*	1	URĀNS	OKLAHOMA		1 500,00
S_CMD_g1#	*CM_D_1.00*	4	*SUPRAMAX*	SANTUSA		– 62 500,00
S_CMD_w1#	*CM_D_1.00*	4	*SUPRAMAX*	SANTUSA		– 62 500,00
S_CMD_x1#	*CM_D_1.00*	4	*PANAMAX*	ĶŪORLEĀNA		187 500,00
S_CMD_a4#	*CM_D_0.50*	1	OGLES	ĶŪKĀSLA		8 000,00
S_CMD_a1#	*CM_D_0.00*	1	OGLES	ĶŪKĀSLA		10 000,00
S_CMD_a2#	*CM_D_0.00*	1	OGLES	ĶŪKĀSLA		– 3 500,00
S_CMD_a3#	*CM_D_0.00*	1	OGLES	LONDONA		– 2 000,00
S_CMD_c1#	*CM_D_0.00*	2	*BRENT*	HAVRA		2 000,00

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

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
S_CMD_e1#	*CM_D_0.00*	3	*SPOT ELECTRICITY SE*	LONDONA		– 3 000,00
S_CMD_i1#	*CM_D_0.00*	5	TĒRAUDS	HAVRA		5 500,00
S_CMD_k1#	*CM_D_0.00*	6	DABASGĀZE	HAVRA		4 000,00
S_CMD_m1#	*CM_D_0.00*	7	ZELTS	UK1		– 2 000,00
S_CMD_o1#	*CM_D_0.00*	8	SOJAS PUPAS	HAVRA		– 7 500,00
S_CMD_q1#	*CM_D_0.00*	9	ZIVIS	LONDONA		2 500,00
S_CMD_s1#	*CM_D_0.00*	10	KAKAO	LONDONA		3 500,00
S_CMD_u1#	*CM_D_0.00*	11	LOKŠŅU STIKLS	LONDONA		30 000,00
S_CMC_a1#	*CM_CU*	1	OGLES			17 335,00
S_CMC_a2#	*CM_CU*	1	OGLES			36 936,00
S_CMC_b1#	*CM_CU*	1	URĀNS			6 635,00
S_CMC_c1#	*CM_CU*	2	*BRENT*			– 11 600,00
S_CMC_d1#	*CM_CU*	2	*WTI*			– 36 900,00
S_CMC_e1#	*CM_CU*	3	*SPOT ELECTRICITY SE*			8 563,00
S_CMC_f1#	*CM_CU*	3	*FWD ELECTRICITY NE*			– 27 250,00
S_CMC_g1#	*CM_CU*	4	*SUPRAMAX*			– 36 880,00
S_CMC_h1#	*CM_CU*	4	*PANAMAX*			29 472,00

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
S_CMC_i1#	*CM_CU*	5	TĒRAUDS			– 5 850,00
S_CMC_j1#	*CM_CU*	5	VARŠ			14 644,80
S_CMC_k1#	*CM_CU*	6	DABASGĀZE			– 6 147,50
S_CMC_l1#	*CM_CU*	6	SAŠĶIDRINĀTA DABASGĀZE			– 6 147,50
S_CMC_m1#	*CM_CU*	7	ZELTS			– 1 486,67
S_CMC_n1#	*CM_CU*	7	SUDRABS			743,33
S_CMC_o1#	*CM_CU*	8	SOJAS PUPAS			– 14 535,00
S_CMC_p1#	*CM_CU*	8	KUKURŪZA			20 475,00
S_CMC_q1#	*CM_CU*	9	ZIVIS			– 19 900,00
S_CMC_r1#	*CM_CU*	9	SŪKALAS			3 387,00
S_CMC_s1#	*CM_CU*	10	KAKAO			1 005,00
S_CMC_t1#	*CM_CU*	10	KAUČUKS			10 892,20
S_CMC_u1#	*CM_CU*	11	LOKŠŅU STIKLS			– 13 790,00
S_CMC_v1#	*CM_CU*	11	POTAŠA			20 685,00
S_CMC_x1#	*CM_CU*	9	PIENS			– 6 300,00
S_CMC_y1#	*CM_CU*	1	URĀNS			– 65 864,00
S_CMC_z1#	*CM_CU*	4	*PANAMAX*			29 472,00

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
S_CMC_a1#	*CM_CD*	1	OGLES			– 18 260,00
S_CMC_a2#	*CM_CD*	1	OGLES			– 37 630,00
S_CMC_b1#	*CM_CD*	1	URĀNS			– 70 460,00
S_CMC_c1#	*CM_CD*	2	*BRENT*			8 320,00
S_CMC_d1#	*CM_CD*	2	*WTI*			3 550,00
S_CMC_e1#	*CM_CD*	3	*SPOT ELECTRICITY SE*			– 8 233,00
S_CMC_f1#	*CM_CD*	3	*FWD ELECTRICITY NE*			16 370,00
S_CMC_g1#	*CM_CD*	4	*SUPRAMAX*			29 110,00
S_CMC_h1#	*CM_CD*	4	*PANAMAX*			– 15 256,00
S_CMC_i1#	*CM_CD*	5	TĒRAUDS			4 080,00
S_CMC_j1#	*CM_CD*	5	VARŠ			– 10 219,80
S_CMC_k1#	*CM_CD*	6	DABASGĀZE			4 222,50
S_CMC_l1#	*CM_CD*	6	SAŠĶIDRINĀTA DABASGĀZE			4 222,50
S_CMC_m1#	*CM_CD*	7	ZELTS			1 353,33
S_CMC_n1#	*CM_CD*	7	SUDRABS			– 676,67
S_CMC_o1#	*CM_CD*	8	SOJAS PUPAS			10 435,00
S_CMC_p1#	*CM_CD*	8	KUKURŪZA			– 14 735,00

Instruments	Riska faktora identifikators	Kopa	Papildu identifikators	Papildu identifikators 2	Kredītkvalitātes kategorija	Riska jutīgums
S_CMC_q1#	*CM_CD*	9	ZIVIS			6 700,00
S_CMC_r1#	*CM_CD*	9	SŪKALAS			– 3 012,00
S_CMC_s1#	*CM_CD*	10	KAKAO			– 1 415,00
S_CMC_t1#	*CM_CD*	10	KAUČUKS			– 7 817,20
S_CMC_u1#	*CM_CD*	11	LOKŠŅU STIKLS			14 200,00
S_CMC_v1#	*CM_CD*	11	POTAŠA			– 21 300,00
S_CMC_x1#	*CM_CD*	9	PIENS			– 4 700,00
S_CMC_y1#	*CM_CD*	1	URĀNS			– 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	Riska klase	Sastāvdaļa [komponents]	Instrumenti
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	Riska klase	Sastāvdaļa [komponents]	Instrumenti
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	Riska klase	Sastāvdaļa [komponents]	Instrumenti
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*	LĪKNES	S_IRC_b1#
G047	*GIRR*	LĪKNES	S_IRC_c1#
G048	*GIRR*	LĪKNES	S_IRC_a1# S_IRC_b1#
G049	*GIRR*	LĪKNES	S_IRC_d1#
G050	*GIRR*	LĪKNES	S_IRC_b1# S_IRC_c1#
G051	*GIRR*	LĪKNES	S_IRC_c1# S_IRC_e1#
G052	*GIRR*	LĪKNES	S_IRC_d1# S_IRC_e1#
G053	*GIRR*	LĪKNES	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	Riska klase	Sastāvdaļa [komponents]	Instrumenti
G054	*GIRR*	VISAS	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	Riska klase	Sastāvdaļa [komponents]	Instrumenti
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	Riska klase	Sastāvdaļa [komponents]	Instrumenti
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	Riska klase	Sastāvdaļa [komponents]	Instrumenti
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#
AL;LE072	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	Riska klase	Sastāvdaļa [komponents]	Instrumenti
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	LĪKNES	S_EQC_b1#
E089	EQ	LĪKNES	S_EQC_c1#
E090	EQ	LĪKNES	S_EQC_d1#
E091	EQ	LĪKNES	S_EQC_e1#
E092	EQ	LĪKNES	S_EQC_f1#
E093	EQ	LĪKNES	S_EQC_g1#
E094	EQ	LĪKNES	S_EQC_h1#
E095	EQ	LĪKNES	S_EQC_i1#
E096	EQ	LĪKNES	S_EQC_j1#
E097	EQ	LĪKNES	S_EQC_k1#
E098	EQ	LĪKNES	S_EQC_q1#
E099	EQ	LĪKNES	S_EQC_t1#
E100	EQ	LĪKNES	S_EQC_u1#
E101	EQ	LĪKNES	S_EQC_a1# S_EQC_a2#
E102	EQ	LĪKNES	S_EQC_a1# S_EQC_b1#
E103	EQ	LĪKNES	S_EQC_f1# S_EQC_ac1#
E104	EQ	LĪKNES	S_EQC_j1# S_EQC_ag1#
E105	EQ	LĪKNES	S_EQC_k1# S_EQC_ah1#
E106	EQ	LĪKNES	S_EQC_q1# S_EQC_r1#
E107	EQ	LĪKNES	S_EQC_t1# S_EQC_v1#

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

Portfelis	Riska klase	Sastāvdaļa [komponents]	Instrumenti
			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	Riska klase	Sastāvdaļa [komponents]	Instrumenti
F015	*FX*	LĪKNES	S_FXC_b1#
F016	*FX*	LĪKNES	S_FXC_c1#
F017	*FX*	LĪKNES	S_FXC_a1# S_FXC_b1#
F018	*FX*	LĪKNES	S_FXC_d1#
F019	*FX*	LĪKNES	S_FXC_b1# S_FXC_c1#
F020	*FX*	LĪKNES	S_FXC_c1# S_FXC_e1#
F021	*FX*	LĪKNES	S_FXC_b1# S_FXC_d1# S_FXC_e1#
F022	*FX*	LĪKNES	S_FXC_a1# S_FXC_a1# S_FXC_b1# S_FXC_b1# S_FXC_c1# S_FXC_c1# S_FXC_d1# S_FXC_d1# S_FXC_e1# S_FXC_e1# S_FXC_f1# S_FXC_f1#
F023	*FX*	ALL	S_FXD_a1# S_FXD_b1# S_FXD_c1# S_FXD_d1# S_FXD_e1# S_FXD_f1# S_FXV_a1# S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5# S_FXV_c1# S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5# S_FXC_a1# S_FXC_a1# S_FXC_b1# S_FXC_b1# S_FXC_c1# S_FXC_c1# S_FXC_d1# S_FXC_d1# S_FXC_e1# S_FXC_e1# S_FXC_f1# S_FXC_f1#
F024	*FX*	DELTA	S_FXD_d1#
F026	*FX*	DELTA	S_FXD_f1#
F028	*FX*	LĪKNES	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	Riska klase	Sastāvdaļa [komponents]	Instrumenti
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	Riska klase	Sastāvdaļa [komponents]	Instrumenti
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	Riska klase	Sastāvdaļa [komponents]	Instrumenti
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	LĪKNES	S_CNC_b1#
N066	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_c1#
N067	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_d1#
N068	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_e1#
N069	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_f1#
N070	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_g1#
N071	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_h1#
N072	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_i1#
N073	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_aa1#
N074	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_j1#
N075	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_k1#
N076	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_l1#
N077	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_m1#
N078	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_n1#
N079	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_o1#
N080	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_p1#

Portfelis	Riska klase	Sastāvdaļa [komponents]	Instrumenti
N081	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_q1#
N082	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_t1#
N083	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_u1#
N084	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_a1# S_CNC_a2#
N085	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_a1# S_CNC_b1#
N086	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_q1# S_CNC_r1#
N087	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_t1# S_CNC_v1#
N088	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_u1# S_CNC_w1#
N089	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_y1# S_CNC_z1#
N090	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_s1#
N091	CSR_NON_SEC	LĪKNES	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	LĪKNES	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	LĪKNES	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	LĪKNES	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	LĪKNES	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	LĪKNES	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	LĪKNES	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	LĪKNES	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	LĪKNES	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	LĪKNES	S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N101	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_c1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_z1#
N102	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_a1# S_CNC_b1# S_CNC_d1# S_CNC_s1#

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

Portfelis	Riska klase	Sastāvdaļa [komponents]	Instrumenti
N104(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	LĪKNES	S_CNC_ab1#
N105(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	LĪKNES	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	Riska klase	Sastāvdaļa [komponents]	Instrumenti
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	Riska klase	Sastāvdaļa [komponents]	Instrumenti
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	LĪKNES	S_CMC_b1#
C052	CM	LĪKNES	S_CMC_c1#
C053	CM	LĪKNES	S_CMC_e1#
C054	CM	LĪKNES	S_CMC_g1#
C055	CM	LĪKNES	S_CMC_i1#
C056	CM	LĪKNES	S_CMC_k1#
C057	CM	LĪKNES	S_CMC_m1#
C058	CM	LĪKNES	S_CMC_o1#
C059	CM	LĪKNES	S_CMC_q1#
C060	CM	LĪKNES	S_CMC_s1#
C061	CM	LĪKNES	S_CMC_u1#
C062	CM	LĪKNES	S_CMC_a1# S_CMC_a2#
C063	CM	LĪKNES	S_CMC_a1# S_CMC_b1#
C064	CM	LĪKNES	S_CMC_c1# S_CMC_d1#
C065	CM	LĪKNES	S_CMC_e1# S_CMC_f1#
C066	CM	LĪKNES	S_CMC_g1# S_CMC_h1#
C067	CM	LĪKNES	S_CMC_i1# S_CMC_j1#
C068	CM	LĪKNES	S_CMC_k1# S_CMC_l1#
C069	CM	LĪKNES	S_CMC_m1# S_CMC_n1#
C070	CM	LĪKNES	S_CMC_o1# S_CMC_p1#
C071	CM	LĪKNES	S_CMC_q1# S_CMC_r1#
C072	CM	LĪKNES	S_CMC_s1# S_CMC_t1#
C073	CM	LĪKNES	S_CMC_u1# S_CMC_v1#
C074	CM	LĪKNES	S_CMC_a2# S_CMC_b1#
C075	CM	LĪKNES	S_CMC_g1# S_CMC_z1#

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