

**РЕГЛАМЕНТ ЗА ИЗПЪЛНЕНИЕ (ЕС) 2015/2197 НА КОМИСИЯТА****от 27 ноември 2015 година****за определяне на техническите стандарти за изпълнение за валути с висока взаимосвързаност в съответствие с Регламент (ЕС) № 575/2013 на Европейския парламент и на Съвета****(текст от значение за ЕИП)**

ЕВРОПЕЙСКАТА КОМИСИЯ,

като взе предвид Договора за функционирането на Европейския съюз,

като взе предвид Регламент (ЕС) № 575/2013 на Европейския парламент и на Съвета от 26 юни 2013 г. относно пруденциалните изисквания за кредитните институции и инвестиционните посредници и за изменение на Регламент (ЕС) № 648/2012 <sup>(1)</sup>, и по-специално член 354, параграф 3 от него,

като има предвид, че:

- (1) При стандартизирания подход за оценяване на пазарния риск институциите могат да предвидят по-ниски капиталови изисквания за валутен риск по отношение на съчетани позиции в две валути, ако според методиката в член 354, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 575/2013 валутите се приемат за валути „с висока взаимосвързаност“.
- (2) При посочване на валутите с висока взаимосвързаност следва да се приложи стандартната пазарна практика обхватът на максималната загуба да бъде намален от десет дни на един ден, като максималното валутно движение от 4 % се раздели на корен квадратен от 10. Следователно прагът на максималната дневна промяна на стойността при двойка валути следва да бъде установен на 1,265 %.
- (3) Процентът на дневните валутни движения следва да се определя като разликата между натуралните логаритми от стойността на двойките валути в рамките на два последователни дни.
- (4) Абсолютната стойност на получения процент следва да се сравни с прага от 1,265 % на максималната дневна промяна на стойността при двойка валути. Всички стойности, превишаващи този праг, следва да се приемат за нарушения на прага от 4 % на максималната десетдневна загуба.
- (5) Необходимо е да се определи максимален брой допустими загуби, така че тези двойки валути, които надхвърлят това ограничение, да не бъдат квалифицирани като взаимосвързани по смисъла на член 354 от Регламент (ЕС) № 575/2013. Освен това, при изчисляването на максималния брой допустими загуби следва да се отчитат както дългите, така и късите позиции в чуждестранната валута. Броят на позволените нарушения следва да се понижи, като максималният брой на нарушенията следва да се определи на 7 нарушения на максималната загуба през предходните 3 години и 65 — през предходните 5 години.
- (6) Предвидените в член 354, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 575/2013 по-ниски капиталови изисквания са само за покриване на позициите в „приложими валути с висока взаимосвързаност“. В резултат на това критериите за установяване на валути с висока взаимосвързаност следва да бъдат прилагани само към двойките обменни курсове, образувани като всяка отделна валута на държава членка се комбинира с валута от списък с валути на трети държави, които са от значение за финансовите институции в Съюза.
- (7) Оценката следва да обхваща и някои други двойки обменни курсове, в които са включени само валути от трети държави, с оглед на значението им за портфейлите на институциите в Съюза. Освен това, предвид изискванията в член 354, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 575/2013 за съответните периоди на наблюдение, когато се решава кои валути да бъдат включени в оценката следва да бъдат взимани предвид само валутите, за които са налични ежедневни данни от надежден източник за период от пет години.
- (8) Член 354, параграф 4 от Регламент (ЕС) № 575/2013 обаче постановява специално третиране за двойките валути, формирани от валутите на държавите членки, участващи във втория етап на икономическия и паричен съюз („ИПС II“), и еврото, както и помежду им. Следователно двойките, включващи тези валути, не следва да се разглеждат като „приложими“. Въпреки това за „приложими“ следва да се приемат двойките валути, формирани, от една страна, от валута на ИПС II, а от друга — от валута, различна от евро или друга валута на ИПС II.

<sup>(1)</sup> OBL 176, 27.6.2013 г., стр. 1.

- (9) Следователно следва да бъде оценявана корелацията на всяка отделна двойка валути, формирана като комбинация между валутите, посочени в приложението към настоящия регламент.
- (10) С оглед на правната сигурност при използването на списъка с валути с висока взаимосвързаност, в съответствие с член 29, параграф 1, буква г) от Регламент (ЕС) № 1093/2010 на Европейския парламент и на Съвета <sup>(1)</sup> този списък следва да се преразглежда. Поради същите причини такова преразглеждане следва да се извършва на редовни интервали, както и от — или около — същата дата всяка година, освен ако пазарната конюнктура не наложи извършването му по изключение в различен момент.
- (11) Настоящият регламент се основава на проектите за технически стандарти за изпълнение, представени от Европейския банков орган на Европейската комисия.
- (12) Европейският банков орган проведе обществени консултации по проектите на техническите стандарти за изпълнение, въз основа на които е изготвен настоящият регламент, анализира потенциалните разходи и ползи и поиска становище от създадената с член 37 от Регламент (ЕС) № 1093/2010 Група на участниците от банковия сектор,

ПРИЕ НАСТОЯЩИЯ РЕГЛАМЕНТ:

#### Член 1

Двойките валути, които отговарят на изискванията по член 354, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 575/2013, са посочени в приложението към настоящия регламент.

#### Член 2

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

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

Съставено в Брюксел на 27 ноември 2015 година.

За Комисията  
Председател  
Jean-Claude JUNCKER

---

<sup>(1)</sup> Регламент (ЕС) № 1093/2010 на Европейския парламент и на Съвета от 24 ноември 2010 г. за създаване на Европейски надзорен орган (Европейски банков орган), за изменение на Решение № 716/2009/ЕО и за отмяна на Решение 2009/78/ЕО на Комисията (ОВ L 331, 15.12.2010 г., стр. 12).

## ПРИЛОЖЕНИЕ

**Списък на валутите с висока взаимосвързаност***Част 1 — Списък на валутите с висока взаимосвързаност спрямо еврото (EUR)*

Албански лек (ALL), босненска конвертируема марка (BAM), български лев (BGN), чешка крона (CZK), британска лира (GBP), хърватска куна (HRK), марокански дирхам (MAD), румънска лея (RON).

*Част 2 — Списък на валутите с висока взаимосвързаност спрямо дирхам на ОАЕ (AED)*

Анголска кванза (AOA), канадски долар (CAD), китайски юан (CNY), британска лира (GBP), хонконгски долар (HKD), ливанска лира (LBP), патака на Макао (MOP), нов перуански сол (PEN), филипинско песо (PHP), сингапурски долар (SGD), тайландски бат (THB), тайвански долар (TWD), щатски долар (USD).

*Част 3 — Списък на валутите с висока взаимосвързаност спрямо албанския лек (ALL)*

Босненска конвертируема марка (BAM), български лев (BGN), чешка крона (CZK), датска крона (DKK), хърватска куна (HRK), марокански дирхам (MAD), румънска лея (RON), евро (EUR).

*Част 4 — Списък на валутите с висока взаимосвързаност спрямо анголската кванза (AOA)*

Дирхам на ОАЕ (AED), китайски юан (CNY), хонконгски долар (HKD), ливанска лира (LBP), патака на Макао (MOP), нов перуански сол (PEN), филипинско песо (PHP), сингапурски долар (SGD), тайландски бат (THB), тайвански долар (TWD), щатски долар (USD).

*Част 5 — Списък на валутите с висока взаимосвързаност спрямо босненската конвертируема марка (BAM)*

Албански лек (ALL), български лев (BGN), чешка крона (CZK), датска крона (DKK), британска лира (GBP), хърватска куна (HRK), марокански дирхам (MAD), румънска лея (RON), евро (EUR).

*Част 6 — Списък на валутите с висока взаимосвързаност спрямо българския лев (BGN)*

Албански лек (ALL), босненска конвертируема марка (BAM), чешка крона (CZK), датска крона (DKK), британска лира (GBP), хърватска куна (HRK), марокански дирхам (MAD), румънска лея (RON), евро (EUR).

*Част 7 — Списък на валутите с висока взаимосвързаност спрямо канадския долар (CAD)*

Дирхам на ОАЕ (AED), хонконгски долар (HKD), патака на Макао (MOP), сингапурски долар (SGD), тайвански долар (TWD), щатски долар (USD).

*Част 8 — Списък на валутите с висока взаимосвързаност спрямо китайския юан (CNY)*

Дирхам на ОАЕ (AED), анголска кванза (AOA), британска лира (GBP), хонконгски долар (HKD), ливанска лира (LBP), патака на Макао (MOP), нов перуански сол (PEN), филипинско песо (PHP), сингапурски долар (SGD), тайландски бат (THB), тайвански долар (TWD), щатски долар (USD).

*Част 9 — Списък на валутите с висока взаимосвързаност спрямо чешката крона (CZK)*

Албански лек (ALL), босненска конвертируема марка (BAM), български лев (BGN), датска крона (DKK), хърватска куна (HRK), марокански дирхам (MAD), румънска лея (RON), евро (EUR).

*Част 10 — Списък на валутите с висока взаимосвързаност спрямо датската крона (DKK)*

Албански лек (ALL), босненска конвертируема марка (BAM), български лев (BGN), чешка крона (CZK), британска лира (GBP), хърватска куна (HRK), марокански дирхам (MAD), румънска лея (RON), сингапурски долар (SGD).

*Част 11 — Списък на валутите с висока взаимосвързаност спрямо британската лира (GBP)*

Дирхам на ОАЕ (AED), босненска конвертируема марка (BAM), български лев (BGL), китайски юан (CNY), датска крона (DKK), хонконгски долар (HKD), хърватска куна (HRK), ливанска лира (LBP), марокански дирхам (MAD), патака на Макао (MOP), сингапурски долар (SGD), тайвански долар (TWD), щатски долар (USD), евро (EUR).

*Част 12 — Списък на валутите с висока взаимосвързаност спрямо хонконгския долар (HKD)*

Дирхам на ОАЕ (AED), анголска кванза (AOA), канадски долар (CAD), китайски юан (CNY), британска лира (GBP), ливанска лира (LBP), патака на Макао (MOP), нов перуански сол (PEN), филипинско песо (PHP), сингапурски долар (SGD), тайландски бат (THB), тайвански долар (TWD), щатски долар (USD).

*Част 13 — Списък на валутите с висока взаимосвързаност спрямо хърватската куна (HRK)*

Албански лек (ALL), босненска конвертируема марка (BAM), български лев (BGN), чешка крона (CZK), датска крона (DKK), британска лира (GBP), марокански дирхам (MAD), румънска лея (RON), сингапурски долар (SGD), евро (EUR).

*Част 14 — Списък на валутите с висока взаимосвързаност южнокорейския вон (KRW)*

Нов перуански сол (PEN), филипинско песо (PHP), сингапурски долар (SGD), тайвански долар (TWD).

*Част 15 — Списък на валутите с висока взаимосвързаност спрямо ливанската лира (LBP)*

Дирхам на ОАЕ (AED), анголска кванза (AOA), китайски юан (CNY), британска лира (GBP), хонконгски долар (HKD), патака на Макао (MOP), нов перуански сол (PEN), филипинско песо (PHP), сингапурски долар (SGD), тайландски бат (THB), тайвански долар (TWD), щатски долар (USD).

*Част 16 — Списък на валутите с висока взаимосвързаност спрямо мароканския дирхам (MAD)*

Албански лек (ALL), босненска конвертируема марка (BAM), български лев (BGN), чешка крона (CZK), датска крона (DKK), британска лира (GBP), хърватска куна (HRK), румънска лея (RON), сингапурски долар (SGD), тайландски бат (THB), тайвански долар (TWD), евро (EUR).

*Част 17 — Списък на валутите с висока взаимосвързаност спрямо патаката на Макао (MOP)*

Дирхам на ОАЕ (AED), анголска кванза (AOA), канадски долар (CAD), китайски юан (CNY), британска лира (GBP), хонконгски долар (HKD), ливанска лира (LBP), нов перуански сол (PEN), филипинско песо (PHP), сингапурски долар (SGD), тайландски бат (THB), тайвански долар (TWD), щатски долар (USD).

*Част 18 — Списък на валутите с висока взаимосвързаност спрямо новия перуански сол (PEN)*

Дирхам на ОАЕ (AED), анголска кванза (AOA), китайски юан (CNY), хонконгски долар (HKD), южнокорейски вон (KRW), ливанска лира (LBP), патака на Макао (MOP), филипинско песо (PHP), сингапурски долар (SGD), тайландски бат (THB), тайвански долар (TWD), щатски долар (USD).

*Част 19 — Списък на валутите с висока взаимосвързаност спрямо филипинското песо (PHP)*

Дирхам на ОАЕ (AED), анголска кванза (AOA), китайски юан (CNY), хонконгски долар (HKD), южнокорейски вон (KRW), ливанска лира (LBP), патака на Макао (MOP), малайзийски рингит (MYR), нов перуански сол (PEN), сингапурски долар (SGD), тайландски бат (THB), тайвански долар (TWD), щатски долар (USD).

*Част 20 — Списък на валутите с висока взаимосвързаност спрямо румънската лея (RON)*

Албански лек (ALL), босненска конвертируема марка (BAM), български лев (BGN), чешка крона (CZK), датска крона (DKK), хърватска куна (HRK), марокански дирхам (MAD), евро (EUR).

*Част 21 — Списък на валутите с висока взаимосвързаност спрямо сингапурския долар (SGD)*

Дирхам на ОАЕ (AED), анголска кванза (AOA), канадски долар (CAD), китайски юан (CNY), датска крона (DKK), британска лира (GBP), хонконгски долар (HKD), хърватска куна (HRK), южнокорейски вон (KRW), ливанска лира (LBP), марокански дирхам (MAD), патака на Макао (MOP), малайзийски рингит (MYR), нов перуански сол (PEN), филипинско песо (PHP), тайландски бат (THB), тайвански долар (TWD), щатски долар (USD).

*Част 22 — Списък на валутите с висока взаимосвързаност спрямо тайландския бат (THB)*

Дирхам на ОАЕ (AED), анголска кванза (AOA), китайски юан (CNY), хонконгски долар (HKD), ливанска лира (LBP), марокански дирхам (MAD), патака на Макао (MOP), нов перуански сол (PEN), филипинско песо (PHP), сингапурски долар (SGD), тайвански долар (TWD), щатски долар (USD).

*Част 23 — Списък на валутите с висока взаимосвързаност спрямо тайванския долар (TWD)*

Дирхам на ОАЕ (AED), анголска кванза (AOA), канадски долар (CAD), китайски юан (CNY), британска лира (GBP), хонконгски долар (HKD), южнокорейски вон (KRW), ливанска лира (LBP), марокански дирхам (MAD), патака на Макао (MOP), малайзийски рингит (MYR), нов перуански сол (PEN), филипинско песо (PHP), сингапурски долар (SGD), тайландски бат (THB), щатски долар (USD).

*Част 24 — Списък на валутите с висока взаимосвързаност спрямо щатския долар (USD)*

Дирхам на ОАЕ (AED), анголска кванза (AOA), канадски долар (CAD), китайски юан (CNY), британска лира (GBP), хонконгски долар (HKD), ливанска лира (LBP), патака на Макао (MOP), нов перуански сол (PEN), филипинско песо (PHP), сингапурски долар (SGD), тайландски бат (THB), тайвански долар (TWD).

---