



Briselē, 2025. gada 11. jūlijā
(OR. en)

11518/25

EF 239
ECOFIN 987
DELECT 98

PAVADVĒSTULE

Sūtītājs:	Eiropas Komisijas ģenerālsekretāre, parakstījusi direktore <i>Martine DEPREZ</i>
Saņemšanas datums:	2025. gada 3. jūlijs
Saņēmējs:	Eiropas Savienības Padomes ģenerālsekretāre <i>Thérèse BLANCHET</i>
K-jas dok. Nr.:	C(2025) 4338 final
Temats:	KOMISIJAS DELEĢĒTĀ REGULA (ES) .../.. (3.7.2025), ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 575/2013 papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem, kuros precizēti nosacījumi alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanas paplašinājumu un izmaiņu un modelējamo riska faktoru apakšgrupas izmaiņu būtiskuma novērtēšanai

Pielikumā ir pievienots dokuments C(2025) 4338 final.

Pielikumā: C(2025) 4338 final

Briselē, 3.7.2025.
C(2025) 4338 final

KOMISIJAS DELEĢĒTĀ REGULA (ES) .../..

(3.7.2025),

ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 575/2013 papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem, kuros precizēti nosacījumi alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanas paplašinājumu un izmaiņu un modelējamo riska faktoru apakšgrupas izmaiņu būtiskuma novērtēšanai

(Dokuments attiecas uz EEZ)

PASKAIDROJUMA RAKSTS

1. DELEĢĒTĀ AKTA KONTEKSTS

Ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 ("regula") 325.az panta 8. punktu Komisija tiek pilnvarota pēc tam, kad Eiropas Banku iestāde (EBI) ir iesniegusi standartu projektu, un saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 1093/2010 10.–14. pantu pieņemt deleģētos aktus, kuros precizē nosacījumus alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanas paplašinājumu un izmaiņu, kā arī regulas 325.bc pantā minēto modelējamo riska faktoru apakšgrupas izmaiņu būtiskuma novērtēšanai.

Saskaņā ar 10. panta 1. punktu Regulā (ES) Nr. 1093/2010, ar ko izveido EBI, Komisija trīs mēnešu laikā pēc standartu projekta saņemšanas pieņem lēmumu par to, vai tā apstiprina iesniegtos projektus. Ja tas ir Savienības interesēs, Komisija, ievērojot īpašo procedūru, kas noteikta minētajos pantos, var apstiprināt standartu projektu tikai daļēji vai ar grozījumiem.

2. PIRMS AKTA PIEŅEMŠANAS NOTIKUSĪ APSPIEŠANĀS

Saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 1093/2010 10. panta 1. punkta trešo daļu EBI ir rīkojusi sabiedrisku apspriešanu par tehnisko standartu projektu, kas iesniegts Komisijai saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 ("regula") 325.az panta 8. punktu. EBI 2023. gada 29. novembrī sāka sabiedrisko apspriešanu, kas noslēdzās 2024. gada 29. februārī. Turklāt EBI lūdza saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 1093/2010 37. pantu izveidoto Banku nozares ieinteresēto personu grupu sniegt atzinumu par minēto projektu. EBI kopā ar tehnisko standartu projektu iesniedza arī skaidrojumu par šo apspriešanu iznākuma iekļaušanu Komisijai iesniegtā tehnisko standartu projekta galīgās redakcijas izstrādē.

Saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 1093/2010 10. panta 1. punkta trešo daļu EBI kopā ar tehnisko standartu projektu iesniedza arī savu ietekmes novērtējumu, tostarp izmaksu un ieguvumu izvērtējumu saistībā ar Komisijai iesniegto tehnisko standartu projektu. Šis izvērtējums ir pieejams tīmekļa vietnē <https://www.eba.europa.eu/legacy/regulation-and-policy/regulatory-activities/market-counterparty-and-cva-risk/regulatory-5>, tehnisko standartu projekta nobeiguma ziņojuma 38.–45. lpp.

3. DELEĢĒTĀ AKTA JURIDISKIE ASPEKTI

Tehnisko standartu projekta galīgajā redakcijā ir precizēti nosacījumi alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanas paplašinājumu un izmaiņu un modelējamo riska faktoru apakšgrupas izmaiņu būtiskuma novērtēšanai. Saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.az panta 8. punktu tehnisko standartu galīgajā projektā ir nošķirti būtiski paplašinājumi un izmaiņas, kas jāapstiprina kompetentajām iestādēm, un nebūtiski paplašinājumi un izmaiņas, par kuriem jāpaziņo kompetentajām iestādēm četras nedēļas iepriekš. Pēdējā minētā kategorija ir iedalīta divās apakškategorijs: paplašinājumi un izmaiņas, par kuriem paziņots, sniedzot papildu informāciju, un paplašinājumi un izmaiņas, par kuriem paziņots, sniedzot pamatinformāciju.

Attiecībā uz modeļu paplašinājumu un izmaiņu iedalīšanu relevantajās kategorijās/apakškategorijs tehnisko standartu projekta galīgajā redakcijā ir noteikta kvalitatīvo un kvantitatīvo nosacījumu kombinācija. Proti, kvantitatīvo nosacījumu mērķis ir novērtēt paplašinājuma vai izmaiņas ietekmi uz alternatīvo iekšējo modeļu vispārējām pašu kapitāla prasībām un to komponentiem (sagaidāmā iztrūkuma riska mēru, spriedzes scenārija riska mēru, saistību nepildīšanas riska kapitāla prasību) pirms un pēc plānotās paplašināšanas vai izmaiņām. Turklāt attiecībā uz izmaiņām iestādes modelējamo riska faktoru apakšgrupas izvēlē tiek novērtēta arī izmaiņas ietekme uz PES_t^{RC} / PES_t^{FC} attiecību.

Tehnisko standartu projekta galīgajā redakcijā ir iekļauti arī pamatprincipi, kas iestādēm jāievēro kategorizācijas procesā, noteikumi par paplašinājumu un izmaiņu īstenošanu un dokumentācijas prasības.

KOMISIJAS DELEĢĒTĀ REGULA (ES) .../..

(3.7.2025),

ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 575/2013 papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem, kuros precizēti nosacījumi alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanas paplašinājumu un izmaiņu un modelējamo riska faktoru apakšgrupas izmaiņu būtiskuma novērtēšanai

(Dokuments attiecas uz EEZ)

EIROPAS KOMISIJA,

ņemot vērā Līgumu par Eiropas Savienības darbību,

ņemot vērā Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 575/2013 (2013. gada 26. jūnijs) par prudenārajām prasībām attiecībā uz kredītiestādēm, un ar ko groza Regulu (ES) Nr. 648/2012¹, un jo īpaši ņemot vērā tās 325.az panta 8. punkta pirmās daļas b) apakšpunktu un trešo daļu,

tā kā:

- (1) Tas, vai iestādes no savām kompetentajām iestādēm saņem atļauju izmantot alternatīvo iekšējā modeļa pieeju, kas noteikta Regulas (ES) Nr. 575/2013 IV sadaļas 1.b nodaļā, ir atkarīgs no tā, vai tās atbilst minētās regulas Trešās daļas IV sadaļas 1.b nodaļā noteiktajām prasībām, tostarp prasībām saistībā ar metodēm, procesiem, kontrolēm, datu vākšanu, riska kontroles struktūrvienības un iekšējās validācijas funkcijas organizēšanu un IT sistēmām. Iestādēm ir atļauts modificēt to kompetentās iestādes apstiprinātās metodes, procesus, kontroles, datu vākšanu, riska kontroles struktūrvienības un iekšējās validācijas funkcijas organizāciju, kā arī IT sistēmas, ar nosacījumu, ka atkarībā no modifikāciju veida par šādām modifikācijām ir paziņots to kompetentajai iestādei vai to kompetentā iestāde tās ir apstiprinājusi saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.az panta 7. punktu. Tas attiecas arī uz modifikācijām, kuru iemesls ir regulatīvo prasību piemērošana, ja šīs izmaiņas ietver tādu metožu vai pieeju izmantošanu, kas nav daļa no esošās kompetentās iestādes atļaujas.
- (2) Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.bc panta 2. punktā minēto modelējamo riska faktoru apakšgrupas izvēle ir daļa no iestādes apstiprinātā un dokumentētā iekšējās politikas un procedūru kopuma. Ja iestāde modificē savu ar modelējamo riska faktoru izvēli saistīto politiku un procedūras, kompetentajai iestādei minētās modifikācijas būtu jāapstiprina vai par tām būtu jāpaziņo kompetentajai iestādei, jo tās ir izmaiņas modelējamo riska faktoru apakšgrupas izvēlē. Turpretī minētās regulas 325.bc panta 2. punktā minētajā modelējamo riska faktoru apakšgrupā iekļautā riska faktoru saraksta sastāva izmaiņas, kas notiek apstiprinātās politikas un procedūru ietvaros, tostarp datu pieejamības samazināšanās gadījumā, nebūtu jāuzskata par izmaiņām iestādes modelējamo riska faktoru apakšgrupas izvēlē.

¹ OV L 176, 27.6.2013., 1. lpp., ELI: <http://data.europa.eu/eli/reg/2013/575/oj>.

- (3) Kompetentās iestādes atļauja attiecas uz alternatīvās iekšējā modeļa pieejas metodēm, procesiem, kontrolēm, datu vākšanu un IT sistēmām. Tādēļ iestādēm nevajadzētu būt pienākumam paziņot savai kompetentajai iestādei par to izmantoto alternatīvo iekšējo modeļu pastāvīgo saskaņošanu ar izmantotajiem datu avotiem, par kļūdu labošanu vai par nelielām korekcijām, kas vajadzīgas modeļu uzturēšanai ikdienā un kas notiek jau iepriekš apstiprinātās metodēs, procesos, kontrolēs, datu vākšanā un IT sistēmās un tiek attiecīgi reģistrētas.
- (4) Alternatīvu iekšējo modeļu izmantošanas paplašinājumi un izmaiņas vai modelējamo riska faktoru apakšgrupas izmaiņas, pamatojoties gan uz kvalitatīviem, gan kvantitatīviem kritērijiem, būtu jāklasificē kā “būtiski” un līdz ar to tādi, kuriem nepieciešama kompetento iestāžu iepriekšēja atļauja, vai kā “nebūtiski” un līdz ar to tādi, par kuriem jāpaziņo kompetentajām iestādēm. Dažiem paplašinājumiem un izmaiņām, tostarp organizatoriskām izmaiņām, iekšējā procesa izmaiņām vai riska pārvaldības procesa izmaiņām, var nebūt tiešas kvantitatīvas ietekmes uz alternatīvajiem iekšējiem modeļiem, bet tie var ietekmēt minētā alternatīvā iekšējā modeļa precizitāti, pamatotību un izmantošanu. Šādos gadījumos, ņemot vērā grūtības noteikt kvantitatīvo ietekmi, iestādēm un kompetentajām iestādēm minēto izmaiņu būtiskuma novērtēšanai būtu jāizmanto tikai kvalitatīvie kritēriji.
- (5) Lai nodrošinātu piesardzīgu pieeju un ļautu kompetentajām iestādēm pārskatīt alternatīvu iekšējo modeļu izmantošanas paplašinājumus un izmaiņas vai modelējamo riska faktoru apakšgrupas izmaiņas pirms to īstenošanas, iestādēm par šādiem nebūtiskiem paplašinājumiem un izmaiņām būtu jāpaziņo savai kompetentajai iestādei vismaz četras nedēļas pirms īstenošanas. Tomēr minētais paziņošanas termiņš nebūtu jāpiemēro gadījumos, kad iestādes neatbilst Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.bc panta 2. punkta a) apakšpunkta nosacījumam. Šādos gadījumos iestādēm vajadzētu būt iespējai nekavējoties rīkoties, lai atjaunotu atbilstību regulatīvajām prasībām, bet tām būtu arī pienācīgi un nekavējoties jāpaziņo kompetentajām iestādēm pirms šādas izmaiņas īstenošanas.
- (6) Kompetentās iestādes alternatīvu iekšējo modeļu izmantošanas paplašinājumus un izmaiņas, kā arī izmaiņas modelējamo riska faktoru apakšgrupā var pārskatīt tikai tad, ja tās no attiecīgajām iestādēm saņem visu šādi pārskatīšanai nepieciešamo informāciju. Tādēļ ir jāprecizē tās informācijas saturs, kas iestādēm jāsniedz šajā nolūkā.
- (7) Kvantitatīvie rādītāji un saistītās robežvērtības, ko izmanto, lai identificētu būtiskas izmaiņas un paplašinājumus, būtu jāizstrādā tā, lai tajos būtu ņemta vērā ietekme uz dažām relevantajām riska skaitliskajām vērtībām un kombinētajām tirgus riska kapitāla prasībām. Lai atvieglotu minēto kvantitatīvo rādītāju aprēķināšanu un nodrošinātu visinformatīvākos rezultātus, būtu jāņem vērā tikai jaunākās riska skaitliskās vērtības.
- (8) Lai ņemtu vērā ietekmi, ko rada iespējamās lielas izmaiņas tirdzniecības portfeļa pozīcijās, kas parasti notiek katru dienu, iestādēm vajadzīgās riska skaitliskās vērtības būtu jāaprēķina, pamatojoties uz 15 secīgu darba dienu novērošanas periodu, nevis uz vienu konkrētu brīdi. Tomēr, lai novērtējumā par to, vai izmaiņas alternatīvu iekšējo modeļu izmantošanā un modelējamo riska faktoru apakšgrupā ir būtiskas, iekļautu zināmu proporcionalitātes pakāpi, minētajam 15 secīgu darbdienu novērošanas periodam būtu jāpiemēro atbrīvojumi, ja novērtētā kvantitatīvā ietekme pirmajā testēšanas dienā ir ļoti neliela un ja pastāv pieņēmums, ka minētajā 15 secīgo darbdienu periodā kvantitatīvās robežvērtības netiks pārsniegtas.

- (9) Kompetentajām iestādēm nebūtu jāpieprasa, lai iestādes aprēķina vajadzīgās riska skaitliskās vērtības, kad tās piešķir iestādēm sākotnējo atļauju aprēķināt savas pašu kapitāla prasības, izmantojot alternatīvus iekšējos modeļus. Tomēr, lai pamatotu un argumentētu minēto izmaiņu un paplašinājumu būtiskuma novērtējumu, iestādēm vajadzīgās riska skaitliskās vērtības būtu jāaprēķina tad, kad tās paplašina vai maina savus alternatīvos iekšējos modeļus un maina modelējamo riska faktoru apakšgrupu.
- (10) Lai nodrošinātu, ka kompetentās iestādes jebkurā laikā veic atbilstīgus uzraudzības pasākumus attiecībā uz alternatīvo iekšējo modeļu paplašinājumiem un izmaiņām un iestādes modelējamo riska faktoru apakšgrupas izvēles izmaiņām, kompetentajām iestādēm grupa ar alternatīva iekšējā modeļa saistītiem paplašinājumiem vai izmaiņām, par kurām iestāde paziņojusi atsevišķi, būtu jāuzskata par vienu paplašinājumu vai izmaiņu. Šādā gadījumā kompetentajām iestādēm būtu jānovērtē, vai alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanas paplašinājumi un izmaiņas ir būtiski minētā atsevišķā paplašinājuma vai izmaiņu līmenī.
- (11) Šīs regulas pamatā ir regulatīvo tehnisko standartu projekts, ko Komisijai iesniegusi Eiropas Banku iestāde.
- (12) Eiropas Banku iestāde ir veikusi atklātu sabiedrisko apspriešanu par regulatīvo tehnisko standartu projektu, kas ir šīs regulas pamatā, izvērtējusi potenciālās saistītās izmaksas un ieguvumus un pieprasījusi saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 1093/2010² 37. pantu izveidotās Banku nozares ieinteresēto personu grupas atzinumu,

IR PIENĒMUSI ŠO REGULU.

1. NODAĻA

NOSACĪJUMI ALTERNATĪVU IEKŠĒJO MODEĻU IZMANTOŠANAS PAPLAŠINĀJUMU UN IZMAIŅU BŪTISKUMA NOVĒRTĒŠANAI

1. pants

Alternatīvu iekšējo modeļu izmantošanas paplašinājumu un izmaiņu kategorijas

1. Iestādes savu alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanas paplašinājumus un izmaiņas iedala vienā no šādām kategorijām:
 - (a) saskaņā ar 2. panta 1. un 2. punktu identificēti alternatīvu iekšējo modeļu izmantošanas būtiski paplašinājumi un izmaiņas, kam vajadzīga kompetento iestāžu atļauja;
 - (b) alternatīvu iekšējo modeļu izmantošanas nebūtiski paplašinājumi un izmaiņas, par kuriem jāpaziņo kompetentajām iestādēm.
2. Iestādes savu alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanas nebūtiskos paplašinājumus un izmaiņas, kas minēti 1. punkta b) apakšpunktā, iedala vienā no šādām apakškategorijām:

² 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>).

- (a) saskaņā ar 3. panta 1. un 2. punktu identificēti paplašinājumi un izmaiņas, par kuriem jāpaziņo, sniedzot papildu informāciju;
- (b) paplašinājumi un izmaiņas, par kuriem jāpaziņo, sniedzot pamatinformāciju.

2. pants

Būtiskas izmaiņas un būtiski paplašinājumi alternatīvu iekšējo modeļu izmantošanā

1. Iestādes izmaiņas savu alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanā kategorizē kā būtiskas, kā minēts 1. panta 1. punkta a) apakšpunktā, ja minētās izmaiņas atbilst jebkuram no šādiem nosacījumiem:

- (a) tās atbilst kādam no pielikuma I daļā izklāstītajiem kvalitatīvajiem kritērijiem;
- (b) to rezultātā izmaiņa jebkurā no 4. punktā noteiktajām riska skaitliskajām vērtībām Rn_i , kuras uzskata par relevantām saskaņā ar 5. punktu, absolūtā izteiksmē ir vienāda ar vai lielāka par 1 %, aprēķinot par izmaiņas ietekmes testēšanas pirmo darbdienu, un to rezultāts ir jebkurš no turpmāk minētajiem raksturlielumiem:
 - i) palielinājums, kas absolūtā izteiksmē vienāds ar vai lielāks par 15 % no šādas summas:

$$S_{IMA} = Rn_1 \cdot m_c + Rn_2 + Rn_3$$

kur Rn_1 , Rn_2 un Rn_3 ir riska skaitliskās vērtības, kas minētas attiecīgi šā panta 4. punktā, un m_c ir Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.ba panta 1. punkta b) apakšpunkta i) punktā minētais reizināšanas koeficients;

- ii) šā punkta b) apakšpunkta i) punktā minētās summas S_{IMA} samazinājums absolūtā izteiksmē par 10 % vai vairāk;
 - iii) jebkuras 4. punktā minētās riska skaitliskās vērtības Rn_i , ko uzskata par relevantu saskaņā ar 5. punktu, palielinājums absolūtā izteiksmē par 20 % vai vairāk;
 - iv) jebkuras šā punkta b) apakšpunkta iii) punktā minētās riska skaitliskās vērtības Rn_i samazinājums absolūtā izteiksmē par 15 % vai vairāk.
2. Iestādes savu alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanas paplašinājumus kategorizē kā būtiskus, kā minēts 1. panta 1. punkta a) apakšpunktā, ja minētie paplašinājumi atbilst jebkuram no šādiem nosacījumiem:
 - (a) tie atbilst kādam no pielikuma I daļā izklāstītajiem kvalitatīvajiem kritērijiem;
 - (b) to rezultātā izmaiņa jebkurā no 4. punktā noteiktajām riska skaitliskajām vērtībām Rn_i , kuras uzskata par relevantām saskaņā ar 5. punktu, absolūtā izteiksmē ir vienāda ar vai lielāka par 1 %, aprēķinot par paplašinājuma ietekmes testēšanas pirmo darbdienu, un to rezultāts ir jebkurš no turpmāk minētajiem raksturlielumiem:
 - i) izmaiņas, kas absolūtā izteiksmē vienādas ar vai lielākas par 10 % no 1. punkta b) apakšpunkta i) punktā minētās summas S_{IMA} ;
 - ii) jebkuras 4. punktā minētās riska skaitliskās vērtības Rn_i , ko uzskata par relevantu saskaņā ar 5. punktu, izmaiņa absolūtā izteiksmē par 15 % vai vairāk.

3. Atkāpjoties no 1. un 2. punkta, iestādes savu alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanas paplašinājumus un izmaiņas nekategorizē kā būtiskus, ja tos pieprasījušas veikt to kompetentās iestādes.
4. Lai novērtētu, vai ir izpildīti 1. punkta b) apakšpunkta un 2. punkta b) apakšpunkta nosacījumi, iestādes ņem vērā šādas riska skaitliskās vērtības Rn_i :
 - (a) Rn_1 , iestādes iepriekšējās dienas sagaidāmā iztrūkuma riska mērs (ES_{t-1}), kas minēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.ba panta 1. punkta a) apakšpunkta i) punktā, visu šā panta 10. punktā minēto pozīciju portfelim;
 - (a) Rn_2 , iestādes iepriekšējās dienas spriedzes scenārija riska mērs (SS_{t-1}), kas minēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.ba panta 1. punkta a) apakšpunkta ii) punktā, visu šā panta 10. punktā minēto pozīciju portfelim;
 - (b) Rn_3 , pēdējā pašu kapitāla prasība saistību nepildīšanas riskam, kas minēta Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.ba panta 2. punkta a) apakšpunktā, visu šā panta 10. punktā minēto pozīciju portfelim.
5. Iestādes uzskata, ka 4. punktā noteiktā riska skaitliskā vērtība Rn_i ir relevanta, ja šī riska skaitliskā vērtība atbilst visiem šādiem nosacījumiem:

- (a) vismaz vienu dienu 9. punktā minētajā laikposmā:

$$\frac{Rn_i}{S_{IMA}} > 5\%$$

- (b) paplašinājuma vai izmaiņas ietekmes testēšanas pirmajā darbdienā:

$$\frac{Rn_i}{S_{IMA}} > 1\%$$

kur S_{IMA} ir 1. punkta b) apakšpunkta i) punktā minētā summa.

Iestādes pārbauda pirmajā daļā minētos nosacījumus gan ar savu alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanas paplašinājumu vai izmaiņu, gan bez tiem.

6. Lai novērtētu, vai ir izpildīti 1. punkta b) apakšpunkta i) vai iii) punkta nosacījumi, iestādes to alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanas izmaiņas ietekmi nosaka, izmantojot attiecīgi 7. vai 8. punktā noteikto attiecību lielāko pieaugumu absolūtā izteiksmē 9. punktā minētajā periodā.

Lai novērtētu, vai ir izpildīti 1. punkta b) apakšpunkta ii) punkta vai iv) punkta nosacījumi, iestādes to alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanas izmaiņas ietekmi nosaka, izmantojot attiecīgi 7. vai 8. punktā noteikto attiecību lielāko samazinājumu absolūtā izteiksmē 9. punktā minētajā periodā.

Lai novērtētu, vai ir izpildīti 2. punkta b) apakšpunkta i) punkta vai b) apakšpunkta ii) punkta nosacījumi, iestādes paplašinājuma ietekmi uz to alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanu nosaka, izmantojot attiecīgi 7. vai 8. punktā noteikto attiecību lielāko izmaiņu absolūtā izteiksmē 9. punktā minētajā periodā.

7. Iestādes attiecību, kas jāizmanto, lai novērtētu, vai ir izpildīti 1. punkta b) apakšpunkta i) un ii) punktā vai 2. punkta b) apakšpunkta i) punktā izklāstītie nosacījumi, aprēķina šādi:

- (a) skaitliskajā atšķirībā starp summu S_{IMA} , kas minēta 1. punkta b) apakšpunkta i) punktā, ar savu alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanas paplašinājumu vai izmaiņu un bez tiem;

- (b) saucējā atšķirība starp summu S_{IMA} , kas minēta 1. punkta b) apakšpunkta i) punktā, ar savu alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanas paplašinājumu vai izmaiņu un bez tiem.
8. Iestādes attiecību, kas jāizmanto, lai novērtētu, vai ir izpildīti 1. punkta b) apakšpunkta iii) un iv) punktā un 2. punkta b) apakšpunkta ii) punktā izklāstītie nosacījumi, aprēķina šādi:
- (a) skaitītājā atšķirība starp relevanto riska skaitlisko vērtību Rn_i , kas minēta 4. punktā, ar savu alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanas paplašinājumu vai izmaiņu un bez tiem;
 - (b) saucējā relevantā riska skaitliskā vērtība Rn_i , kas minēta 4. punktā, bez savu alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanas paplašinājuma vai izmaiņām.
9. Iestādes aprēķina 7. un 8. punktā minētās attiecības par 15 secīgām darba dienām, sākot no pirmās darba dienas, kad tiek testēta to alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanas paplašinājuma vai izmaiņas ietekme.
- 15 secīgu darba dienu laikposma izvēle reprezentē tirdzniecības un riska ierobežošanas darbību parastos tirgus apstākļos to pozīciju portfelim, kuras ietekmē iestāžu alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanas paplašinājums vai izmaiņa. Minētais laikposms ir daļa no 9 mēnešiem pirms paziņojuma vai atļaujas pieprasījuma to kompetentajai iestādei, kā minēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.az panta 7. punktā.
10. Iestādes aprēķina 4. punktā noteiktās riska skaitliskās vērtības Rn_i visu to pozīciju portfelim, kas piesaistītas tirdzniecības nodaļām, kuras atbilst visām Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.az panta 2. punktā izklāstītajām prasībām brīdī, kad to kompetentajai iestādei tiek iesniegts paziņojums vai pieprasīta atļauja, kā minēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.az panta 7. punktā.

3. pants

Alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanas nebūtiskas izmaiņas un nebūtiski paplašinājumi, par kuriem jāpaziņo, sniedzot papildu informāciju

1. Iestādes nebūtiskas izmaiņas savu alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanā kategorizē kā tādas, par kurām jāziņo, sniedzot papildu informāciju, kā minēts 1. panta 2. punkta a) apakšpunktā, ja minētās izmaiņas atbilst jebkuram no šādiem nosacījumiem:
- (a) tās atbilst kādam no pielikuma II daļā izklāstītajiem kvalitatīvajiem kritērijiem;
 - (b) to rezultātā izmaiņa jebkurā no 2. panta 4. punktā noteiktajām riska skaitliskajām vērtībām Rn_i , kuras uzskata par relevantām saskaņā ar 2. panta 5. punktu, absolūtā izteiksmē ir vienāda ar vai lielāka par 1 %, aprēķinot par izmaiņas ietekmes testēšanas pirmo darbdienu, un to rezultāts ir jebkurš no turpmāk minētajiem raksturlielumiem:
 - i) palielinājums, kas absolūtā izteiksmē vienāds ar vai lielāks par 10 % un mazāks par 15 % no 2. panta 1. punkta b) apakšpunkta i) punktā minētās summas S_{IMA} ;
 - ii) samazinājums, kas absolūtā izteiksmē vienāds ar vai lielāks par 5 % un mazāks par 10 % no 2. panta 1. punkta b) apakšpunkta i) punktā minētās summas S_{IMA} ;

- iii) jebkuras 2. panta 4. punktā minētās riska skaitliskās vērtības Rn_i , ko uzskata par relevantu saskaņā ar 2. panta 5. punktu, palielinājums, kas absolūtā izteiksmē vienāds ar vai lielāks par 15 % un mazāks par 20 %;
 - iv) jebkuras 2. panta 4. punktā minētās riska skaitliskās vērtības Rn_i , ko uzskata par relevantu saskaņā ar 2. panta 5. punktu, samazinājums, kas absolūtā izteiksmē vienāds ar vai lielāks par 10 % un mazāks par 15 %;
- 2. Iestādes nebūtiskus paplašinājumus savu alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanā kategorizē kā tādas, par kuriem jāziņo, sniedzot papildu informāciju, kā minēts 1. panta 2. punkta a) apakšpunktā, ja minētie paplašinājumi atbilst jebkuram no šādiem nosacījumiem:
 - (a) tie atbilst kādam no pielikuma II daļā izklāstītajiem kvalitatīvajiem kritērijiem;
 - (b) to rezultātā izmaiņa jebkurā no 2. panta 4. punktā minētajām riska skaitliskajām vērtībām Rn_i , kurus uzskata par relevantām saskaņā ar 2. panta 5. punktu, absolūtā izteiksmē ir vienāda ar vai lielāka par 1 %, aprēķinot par paplašinājuma ietekmes testēšanas pirmo darbdienu, un to rezultāts ir jebkurš no turpmāk minētajiem raksturlielumiem:
 - i) izmaiņa, kas absolūtā izteiksmē vienāda ar vai lielāka par 5 % un mazāka par 10 % no 2. panta 2. punkta b) apakšpunkta i) punktā minētās summas S_{IMA} ;
 - ii) jebkuras 2. panta 4. punktā minētās riska skaitliskās vērtības Rn_i , ko uzskata par relevantu saskaņā ar 2. panta 5. punktu, izmaiņa, kas absolūtā izteiksmē vienāda ar vai lielāka par 10 % un mazāka par 15 %.
- 3. Iestādes saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.az panta 7. punkta otro daļu paziņo savām kompetentajām iestādēm par nebūtiskiem paplašinājumiem vai izmaiņām savu alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanā četras nedēļas pirms to īstenošanas.
- 4. Lai novērtētu, vai ir izpildīti 1. punkta b) apakšpunkta i) punktā vai iii) punktā minētie nosacījumi, iestādes to alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanas izmaiņas ietekmi nosaka, izmantojot attiecīgi 2. panta 7. vai 8. punktā minēto attiecību lielāko pieaugumu absolūtā izteiksmē 2. panta 9. punktā minētajā periodā.
 Lai novērtētu, vai ir izpildīti 1. punkta b) apakšpunkta ii) punktā vai iv) punktā minētie nosacījumi, iestādes to alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanas izmaiņas ietekmi nosaka, izmantojot attiecīgi 2. panta 7. vai 8. punktā minēto attiecību lielāko samazinājumu absolūtā izteiksmē 2. panta 9. punktā minētajā periodā.
 Lai novērtētu, vai ir izpildīti 2. punkta b) apakšpunkta i) punktā vai b) apakšpunkta ii) punktā minētie nosacījumi, to alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanas paplašinājuma ietekmi nosaka, izmantojot attiecīgi 2. panta 7. vai 8. punktā minēto attiecību lielāko izmaiņu absolūtā izteiksmē 2. panta 9. punktā minētajā periodā.

2. NODAĻA

NOSACĪJUMI IESTĀDES MODELĒJAMO RISKA FAKTORU APAKŠGRUPAS IZVĒLES IZMAIŅU BŪTISKUMA NOVĒRTĒŠANAI

4. pants

Iestādes modelējamo riska faktoru apakšgrupas izvēles izmaiņu kategorijas

1. Iestādes Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.bc panta 2. punktā minētās modelējamo riska faktoru apakšgrupas izvēles izmaiņas iedala vienā no šādām kategorijām:
 - (a) tādas būtiskas izmaiņas iestādes izvēlē attiecībā uz modelējamo riska faktoru apakšgrupu, kuras identificētas saskaņā ar šīs regulas 5. panta 1. punktu un kam vajadzīga kompetento iestāžu atļauja;
 - (b) nebūtiskas izmaiņas iestādes izvēlē attiecībā uz modelējamo riska faktoru apakšgrupu, par kurām jāpaziņo kompetentajām iestādēm.
2. Iestādes 1. punkta b) apakšpunktā minētās modelējamo riska faktoru apakšgrupas izvēles izmaiņas iedala vienā no šādām kategorijām:
 - (a) tādas izmaiņas iestādes izvēlē attiecībā uz modelējamo riska faktoru apakšgrupu, kuras identificētas saskaņā ar 6. panta 1. punktu un kuras jāpaziņo, sniedzot papildu informāciju;
 - (b) tādas izmaiņas iestādes izvēlē attiecībā uz modelējamo riska faktoru apakšgrupu, kuras jāpaziņo, sniedzot pamatinformāciju.

5. pants

Būtiskas izmaiņas iestādes modelējamo riska faktoru apakšgrupas izvēlē

1. Izmaiņas iestādes Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.bc pantā minēto modelējamo riska faktoru apakšgrupas izvēlē iestādes saskaņā ar šīs regulas 4. panta 1. punkta a) apakšpunktu kategorizē kā būtiskas, ja minētās izmaiņas rezultāts ir abi no turpmāk minētajiem raksturlielumiem:
 - (a) izmaiņa, kas absolūtā izteiksmē vienāda ar vai lielāka par 1 % no 2. panta 4. punkta a) apakšpunktā minētās riska skaitliskās vērtības Rn_1 , aprēķinot par iestādes izvēlēto modelējamo riska faktoru apakšgrupas izmaiņas ietekmes testēšanas pirmo darbadienu;
 - (b) un jebkurš no turpmāk minētajiem raksturlielumiem:
 - i) palielinājums, kas absolūtā izteiksmē vienāds ar vai lielāks par 15 % no 2. panta 1. punkta b) apakšpunkta i) punktā minētās summas S_{IMA} ;
 - ii) samazinājums, kas absolūtā izteiksmē vienāds ar vai lielāks par 10 % no 2. panta 1. punkta b) apakšpunkta i) punktā minētās summas S_{IMA} ;
 - iii) palielinājums, kas absolūtā izteiksmē vienāds ar vai lielāks par 20 % no 2. panta 4. punkta a) apakšpunktā minētās riska skaitliskās vērtības Rn_1 ;
 - iv) samazinājums, kas absolūtā izteiksmē vienāds ar vai lielāks par 15 % no 2. panta 4. punkta a) apakšpunktā minētās riska skaitliskās vērtības Rn_1 ;
 - v) šā panta 4. punktā noteiktās attiecības samazinājums, kā rezultātā ir izpildīts šāds nosacījums:

$$R_{change} \leq 80\%$$

kur R_{change} ir 4. punktā noteiktā attiecība ar modelējamo riska faktoru apakšgrupas izvēles izmaiņas ieviešanu.

2. Atkāpjoties no 1. punkta, iestādes savu modelējamo riska faktoru apakšgrupas izvēles izmaiņas nekategorizē kā būtiskas, ja to pieprasījušas veikt to kompetentās iestādes.
3. Atkāpjoties no 1. punkta, iestādes uzskata, ka to modelējamo riska faktoru apakšgrupas izvēles izmaiņas, kas izriet no Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.bc panta 2. punkta a) apakšpunktā noteiktās prasības neizpildes, ir nebūtiskas izmaiņas, par kurām jāpaziņo, sniedzot pamatinformāciju.
4. Šā panta 1. punkta b) apakšpunkta v) punkta nolūkā iestādes R_{change} attiecību aprēķina saskaņā ar šādu formulu:

$$R_{change} = \frac{1}{15} \cdot \sum_{k=0}^{14} \frac{PES_{t+k}^{RC}}{PES_{t+k}^{FC}}$$

kur iestādes aprēķina PES_{t+k}^{RC} un PES_{t+k}^{FC} saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.bc panta 3. un 4. punktu un kur t ir iestādes modelējamo riska faktoru apakšgrupas izvēles izmaiņas ietekmes testēšanas pirmā darbdienu, un kur summu rēķina par 15 secīgu darbdienu periodu, kas minēts šīs regulas 2. panta 9. punktā.

5. Lai novērtētu, vai ir izpildīti 1. punkta b) apakšpunkta i) punktā vai iii) punktā minētie nosacījumi, iestādes to modelējamo riska faktoru apakšgrupas izvēles izmaiņas ietekmi nosaka, izmantojot attiecīgi 2. panta 7. vai 8. punktā minēto attiecību lielāko pieaugumu absolūtā izteiksmē 2. panta 9. punktā minētajā periodā.

Lai novērtētu, vai ir izpildīti 1. punkta b) apakšpunkta i) un iv) punktā minētie nosacījumi, iestādes to modelējamo riska faktoru apakšgrupas izvēles izmaiņas ietekmi nosaka, izmantojot attiecīgi 2. panta 7. vai 8. punktā minēto attiecību lielāko samazinājumu absolūtā izteiksmē 2. panta 9. punktā minētajā periodā.

6. pants

Iestādes modelējamo riska faktoru apakšgrupas izvēles nebūtiskas izmaiņas

1. Iestādes modelējamo riska faktoru apakšgrupas izvēles nebūtiskās izmaiņas kategorizē kā tādas, par kurām ir jāpaziņo, sniedzot papildu informāciju saskaņā ar 4. panta 2. punkta a) apakšpunktu, ja to rezultāts ir visi turpmāk minētie raksturlielumi:
 - (a) izmaiņa, kas absolūtā izteiksmē vienāda ar vai lielāka par 1 % no 2. panta 4. punkta a) apakšpunktā noteiktās riska skaitliskās vērtības Rn_1 , kā aprēķināts par iestādes izvēlēto modelējamo riska faktoru apakšgrupas izmaiņas ietekmes testēšanas pirmo darbadienu;
 - (b) jebkurš no turpmāk minētajiem raksturlielumiem:
 - i) palielinājums, kas absolūtā izteiksmē vienāds ar vai lielāks par 10 % un mazāks par 15 % no 2. panta 2. punkta b) apakšpunkta i) punktā minētās summas S_{IMA} ;
 - ii) samazinājums, kas absolūtā izteiksmē vienāds ar vai lielāks par 5 % un mazāks par 10 % no 2. panta 2. punkta b) apakšpunkta i) punktā minētās summas S_{IMA} ;

- iii) palielinājums, kas absolūtā izteiksmē vienāds ar vai lielāks par 15 % un mazāks par 20 % no 2. panta 4. punkta a) apakšpunktā minētās riska skaitliskās vērtības Rn_1 ;
 - iv) samazinājums, kas absolūtā izteiksmē vienāds ar vai lielāks par 10 % un mazāks par 15 % no 2. panta 4. punkta a) apakšpunktā minētās riska skaitliskās vērtības Rn_1 ;
- (a) R_{change} neatbilst 5. panta 1. punkta b) apakšpunkta v) punktā noteiktajam kritērijam.
2. Iestādes saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.az panta 7. punkta otro daļu paziņo savām kompetentajām iestādēm par nebūtiskām izmaiņām savā modelējamā riska faktoru apakšgrupas izvēlē četras nedēļas pirms to īstenošanas.
- Tomēr iestādes pirms izmaiņu īstenošanas paziņo par visām izmaiņām modelējamā riska faktoru apakšgrupas izvēlē, kas izriet no minētās regulas 325.bc panta 2. punkta a) apakšpunktā noteiktās prasības neizpildes.
3. Lai novērtētu, vai ir izpildīti 1. punkta b) apakšpunkta i) punktā vai iii) punktā minētie nosacījumi, iestādes to modelējamā riska faktoru apakšgrupas izvēles izmaiņas ietekmi nosaka, izmantojot attiecīgi 2. panta 7. vai 8. punktā minēto attiecību lielāko pieaugumu absolūtā izteiksmē 2. panta 9. punktā minētajā periodā.
- Lai novērtētu, vai ir izpildīti 1. punkta b) apakšpunkta i) un iv) punktā minētie nosacījumi, iestādes to modelējamā riska faktoru apakšgrupas izvēles izmaiņas ietekmi nosaka, izmantojot attiecīgi 2. panta 7. vai 8. punktā minēto attiecību lielāko samazinājumu absolūtā izteiksmē 2. panta 9. punktā minētajā periodā.

3. NODAĻA

VISPĀRĪGI NOTEIKUMI ALTERNATĪVO IEKŠĒJO MODEĻU IZMANTOŠANAS IZMAIŅU UN PAPLAŠINĀJUMU UN IESTĀDES MODELĒJAMO RISKĀ FAKTORU APAKŠGRUPAS IZMAIŅU BŪTISKUMA NOVĒRTĒŠANAI

7. pants

Alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanas izmaiņu un paplašinājumu un modelējamo risku faktoru apakšgrupas izmaiņu klasifikācijas principi

1. Aprēķinot kvantitatīvo ietekmi saskaņā ar 2. panta 1. un 2. punktu, 3. panta 1. un 2. punktu, 5. panta 1. punktu un 6. panta 1. punktu, iestādes izmanto modeļa jaunāko konfigurāciju un kalibrēšanas parametrus un ievaddatus, kas atbilst 2. panta 9. punktā minētajam periodam.

Aprēķināšanas prasības nepiemēro paplašinājumiem un izmaiņām, kam nav tiešas kvantitatīvas ietekmes.

2. Kompetentās iestādes vairākas alternatīvajā iekšējā modelī veiktas modifikācijas, ko iestāde iesniegusi atsevišķi, uzskata par viena modeļa paplašinājumu vai izmaiņu, ja šādas modifikācijas pēc būtības ir līdzīgas vai saistītas darbības jomas ziņā. Kompetentās iestādes alternatīvajā iekšējā modelī veiktu modifikāciju grupas, ko iestāde iesniegusi kā vienu modeļa paplašinājumu vai izmaiņu, uzskata par atsevišķiem modeļa paplašinājumiem vai izmaiņām, ja šādas modeļa modifikācijas pēc būtības nav līdzīgas vai nav saistītas darbības jomas ziņā.

3. Ja rodas šaubas par 1. vai 4. pantā minēto kategorizāciju, iestādes kompetentajai iestādei sniedz paskaidrojumu, kurā pamato savu izvēli attiecībā uz kategoriju vai apakškategoriju un izklāsta iespējamās alternatīvas. Kompetentā iestāde var mainīt kategoriju vai apakškategoriju, kas norādīta Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.az panta 7. punkta pirmajā daļā minētajā atļaujas pieprasījumā vai minētās regulas 325.az panta 7. punkta otrajā daļā minētajā paziņojumā.

8. pants

Alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanas izmaiņu un paplašinājumu un modelējamo riska faktoru apakšgrupas izmaiņu īstenošana

1. Iestādes, kurām ir piešķirta atļauja veikt alternatīvu iekšējo modeļu izmantošanas būtiskus paplašinājumus vai izmaiņas vai veikt modelējamo riska faktoru apakšgrupas būtiskas izmaiņas, kā minēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.az panta 7. punkta pirmajā daļā, savas pašu kapitāla prasības aprēķina, pamatojoties uz apstiprināto paplašinājumu vai izmaiņu, sākot no atļaujā norādītā datuma.
2. Ja tiek kavēta alternatīvu iekšējo modeļu izmantošanas paplašinājuma vai izmaiņas vai modelējamo riska faktoru apakšgrupas izmaiņas īstenošana, attiecībā uz kuru kompetentā iestāde ir piešķīrusi atļauju, kā minēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.az panta 7. punkta pirmajā daļā, iestādes bez liekas kavēšanās:
 - (a) paziņo savai kompetentajai iestādei par šādu kavēšanos;
 - (b) iesniedz savai kompetentajai iestādei plānu par apstiprinātā paplašinājuma vai izmaiņas savlaicīgu īstenošanu, kas jāapstiprina kompetentajai iestādei.
3. Iestādes, kas savai kompetentajai iestādei ir paziņojušas par paplašinājumu vai izmaiņu un pēc tam ir nolēmušas neīstenot šādu paplašinājumu vai izmaiņu, par to bez liekas kavēšanās paziņo savai kompetentajai iestādei.

9. pants

Alternatīvu iekšējo modeļu izmantošanas paplašinājumu un izmaiņu un iestādes modelējamo riska faktoru apakšgrupas izvēles izmaiņu dokumentācija

1. Iestādes, kad tās lūdz savai kompetentajai iestādei piešķirt tām Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.az panta 7. punkta pirmajā daļā minēto atļauju, iesniedz savai kompetentajai iestādei visu turpmāk minēto dokumentāciju:
 - (a) apraksts par alternatīvo iekšējo modeļu izmantošanas paplašinājumu vai izmaiņu vai par modelējamo riska faktoru apakšgrupas izvēles izmaiņu un apraksts par šāda paplašinājuma vai izmaiņas loģisko pamatojumu un mērķi;
 - (b) šāda paplašinājuma vai izmaiņas īstenošanas datums;
 - (c) to tirdzniecības nodaļu darbības tvērums, kuras ietekmē alternatīvā iekšējā modeļa izmantošanas paplašinājums vai izmaiņa vai iestādes modelējamo riska faktoru apakšgrupas izvēles izmaiņa, tostarp informācija par minēto nodaļu tirdzniecības apjomu;
 - (d) tehniskie un procesuālie dokumenti;
 - (e) ziņojumi par iestādes neatkarīgu pārskatu vai validāciju;
 - (f) apstiprinājums, ka iestādes kompetentā struktūra, izmantojot iestādes apstiprināšanas procesus, ir apstiprinājusi alternatīvā iekšējā modeļa

izmantošanas paplašinājumu vai izmaiņu vai iestādes modelējamo riska faktoru apakšgrupas izvēles izmaiņu, un minētā apstiprinājuma datums;

- (g) attiecīgā gadījumā jebkurš no turpmāk minētajiem relevantajiem raksturlielumiem, kā arī pamatojums par to, ka kvantitatīvās ietekmes noteikšanai atlasītais 15 secīgu darbdienu periods ir reprezentatīvs:
 - i) alternatīvā iekšējā modeļa izmantošanas paplašinājuma vai izmaiņas kvantitatīvā ietekme uz 2. panta 1. punkta b) apakšpunkta i) punktā minēto summu;
 - ii) alternatīvā iekšējā modeļa izmantošanas paplašinājuma vai izmaiņas kvantitatīvā ietekme uz 2. panta 4. punktā minētajām relevantajām riska skaitliskajām vērtībām Rn_i ;
 - iii) iestādes modelējamo riska faktoru apakšgrupas izvēles izmaiņas kvantitatīvā ietekme uz 2. panta 1. punkta b) apakšpunkta i) punktā minēto summu;
 - iv) iestādes modelējamo riska faktoru apakšgrupas izvēles izmaiņas kvantitatīvā ietekme uz 2. panta 4. punkta a) apakšpunktā minēto riska skaitlisko vērtību Rn_1 ;
 - v) 5. panta 4. punktā minētā attiecība R_{change} ;
 - (h) informācija par iespējamo ietekmi uz tirdzniecības nodaļām, kas neatbilst visām Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.az panta 2. punkta prasībām, ja iestāde lūdz tās kompetentajai iestādei tai piešķirt atļauju, kā minēts Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.az panta 7. punkta pirmajā daļā, vai iesniedz paziņojumu savai kompetentajai iestādei saskaņā ar minētās regulas 325.az panta 7. punkta otro daļu, tostarp aplēse par kvantitatīvo ietekmi uz relevantajām riska skaitliskajām vērtībām Rn_i , kas minētas šīs regulas 2. panta 4. punktā.
 - (i) ieraksti par attiecīgo iestādes alternatīvo iekšējo modeļu pašreizējo un iepriekšējo versiju numuru.
2. Attiecībā uz nebūtiskiem paplašinājumiem vai izmaiņām, kas jāpaziņo, sniedzot papildu informāciju, kā minēts 1. panta 2. punkta a) apakšpunktā un 4. panta 2. punkta a) apakšpunktā, iestādes kopā ar paziņojumu iesniedz visu šā panta 1. punkta a)–i) apakšpunktā minēto dokumentāciju.
3. Attiecībā uz nebūtiskiem paplašinājumiem vai izmaiņām, kas jāpaziņo, sniedzot pamatinformāciju, kā minēts 1. panta 2. punkta b) apakšpunktā un 4. panta 2. punkta b) apakšpunktā, iestādes kopā ar paziņojumu iesniedz šā panta 1. punkta a), b), c) un f)–i) apakšpunktā minēto dokumentāciju.
4. Šā panta 1. punkta e) apakšpunktā minētie iestāžu neatkarīgās pārskatīšanas vai validācijas ziņojumi ietver visu turpmāk minēto:
- (a) būtiskuma novērtējuma un izmantotā 15 secīgu darbdienu laikposma reprezentativitātes pārbaude;
 - (b) alternatīvā iekšējā modeļa izmantošanas paplašinājuma vai izmaiņas vai iestādes modelējamo riska faktoru apakšgrupas izvēles izmaiņas iezīmju kritiska pārskatīšana, kas veikta saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 575/2013 325.bi panta 2. punktu un 325.bj pantu;

- (c) plāns to nepieciešamo korektīvo pasākumu savlaicīgai īstenošanai, kas ierosināti kā daļa no neatkarīgās pārskatīšanas vai validācijas procesa.

10. pants

Stāšanās spēkā

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, 3.7.2025

*Komisijas vārdā –
priekšsēdētāja
Ursula VON DER LEYEN*