1. pielikums
Finanšu un kapitāla tirgus komisijas
03.11.2020. normatīvajiem noteikumiem Nr. 209

*(Pielikums grozīts ar FKTK 08.06.2021. noteikumiem Nr. 65)*

# Kapitāla pietiekamības novērtējuma rezultātu apkopojums

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Kredītiestāde |  | Datums |  |
| Rezultātu apkopojuma līmenis |  |
| Vēlamais kapitāla līmenis (kapitāla pietiekamības mērķi) |  |

**Risku segšanai nepieciešamais kapitāls**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
|  | Pozīcijas kods | Kredītiestādes novērtējums par nepieciešamā kapitāla apmēru, t.sk. kopējo kapitāla rezervju prasības apmēru saskaņā ar Kredītiestāžu likuma prasībām, *euro* | Papildu informācija: nepieciešamā kapitāla apmērs saskaņā ar ES regulu Nr. 575/2013, ievērojot šo noteikumu 23. punktu, *euro* |
| **1. pīlāra riski** | **1.** |  |  |
| Kredītrisks  | 1.1. |  |  |
| Kredīta vērtības korekcijas risks (CVA risks) | 1.2. |  |  |
| Tirgus riski, t.sk.: | 1.3. |  |  |
| *ārvalstu valūtu risks* | 1.3.1. |  |  |
| *norēķinu risks* | 1.3.2. |  |  |
| *preču risks* | 1.3.3. |  |  |
| *pozīcijas risks* | 1.3.4. |  |  |
| Operacionālais risks | 1.4. |  |  |
| **2. pīlāra riski** | **2.** |  |  |
| Procentu likmju risks netirdzniecības portfelī | 2.1. |  |  |
| Koncentrācijas risks, t.sk.: | 2.2. |  |  |
|  *individuālās koncentrācijas risks* | 2.2.1. |  |  |
|  *nozaru koncentrācijas risks* | 2.2.2. |  |  |
|  *valūtu nesakritības koncentrācijas risks* | 2.2.3. |  |  |
|  *nodrošinājuma koncentrācijas risks* | 2.2.4. |  |  |
| Noziedzīgi iegūtu līdzekļu legalizācijas un terorisma un proliferācijas finansēšanas risks | 2.3. |  |  |
| Likviditātes risks | 2.4. |  |  |
| Pārējie riski, t.sk.: | 2.5. |  |  |
|  *reputācijas risks* | 2.5.1. |  |  |
|  *biznesa modeļa risks* | 2.5.2. |  |  |
|  *citi riski*[[1]](#footnote-1)\* | 2.5.3. |  |  |
| Papildu kapitāla prasība, kas saistīta ar individuāli noteikto kapitāla pietiekamības rādītāju | 2.6. |  |  |
| **Diversifikācijas efekti** | **3.** |  |  |
| **Kopējo kapitāla rezervju prasība**, t.sk.: | **4.** |  |  |
| *kapitāla saglabāšanas rezerve* | 4.1. |  |  |
| *pretcikliskā kapitāla rezerve* | 4.2. |  |  |
| *citas sistēmiski nozīmīgas iestādes kapitāla rezerve*  | 4.3. |  |  |
| *sistēmiskā riska kapitāla rezerve* | 4.4. |  |  |
| **Ieteicamā kapitāla rezerve** | **5.** |  |  |

**Papildu informācija**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | Pozīcijas kods | Summa, *euro,* vai rādītājs,% |
| **Kopējā riska darījumu vērtība** (TREA)*(ES regulas Nr. 2021/451[[2]](#footnote-2)\*\* pārskata "C 02.00 — PAŠU KAPITĀLA PRASĪBAS (CA2)" 0010. rinda)* | **6.** |  |
| **Individuālais minimālais kapitāla pietiekamības rādītājs** | **7.** |  |
| **Kopējā kapitāla rādītājs**, t.sk.:*(ES regulas Nr. 2021/451 pārskata "C 03.00 — KAPITĀLA RĀDĪTĀJI UN KAPITĀLA LĪMEŅI (CA3)" 0050. rinda)* | **8.** |  |
| *pirmā līmeņa pamata kapitāla rādītājs(ES regulas Nr. 2021/451 pārskata "C 03.00 — KAPITĀLA RĀDĪTĀJI UN KAPITĀLA LĪMEŅI (CA3)" 0010. rinda)* | 8.1. |  |
| *pirmā līmeņa kapitāla rādītājs(ES regulas Nr. 2021/451 pārskata "C 03.00 — KAPITĀLA RĀDĪTĀJI UN KAPITĀLA LĪMEŅI (CA3)" 0030. rinda)* | 8.2. |  |

**Kredītiestādes rīcībā esošā kapitāla apmērs**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | Pozīcijas kods | Pašu kapitāls saskaņā ar ES regulu Nr. 575/2013, *euro* |
| **Kopā**, t.sk.:*(ES regulas Nr. 2021/451 pārskata "C 01.00 — PAŠU KAPITĀLS (CA1)" 0010. rinda)* | **9.** |  |
| *pirmā līmeņa pamata kapitāls(ES regulas Nr. 2021/451 pārskata "C 01.00 — PAŠU KAPITĀLS (CA1)" 0020. rinda)* | 9.1. |  |
| *pirmā līmeņa papildu kapitāls(ES regulas Nr. 2021/451 pārskata "C 01.00 — PAŠU KAPITĀLS (CA1)" 0530. rinda)* | 9.2. |  |
| *otrā līmeņa kapitāls(ES regulas Nr. 2021/451 pārskata "C 01.00 — PAŠU KAPITĀLS (CA1)" 0750. rinda)* | 9.3. |  |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **TSCR apmēra aprēķins un tā faktiskā izpilde** |  | **TSCR rādītāja aprēķins un tā faktiskā izpilde** |
|  | Pozīcijas kods | Summa, *euro* |  |  | Pozīcijas kods | Rādītājs, % |
| **TSCR apmērs**, t.sk.:  | **10.** |  |  | **TSCR rādītājs**, t.sk.: | **12.** |  |
| *minimālā prasība pirmā līmeņa pamata kapitālam* | 10.1. |  |  | *minimālā prasība pirmā līmeņa pamata kapitālam* | 12.1. |  |
| **Kapitāla pārpalikums vai iztrūkums**, t.sk.: | **11.** |  |  | **Kapitāla pārpalikums vai iztrūkums**, t.sk.: | **13.** |  |
| *pirmā līmeņa pamata kapitāls*  | 11.1. |  |  | *pirmā līmeņa pamata kapitāls* | 13.1. |  |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **OCR apmēra aprēķins un tā faktiskā izpilde** |  | **OCR rādītāja aprēķins un tā faktiskā izpilde** |
|  | Pozīcijas kods | Summa,*euro* |  |  | Pozīcijas kods | Rādītājs, % |
| **OCR apmērs**, t.sk.: | **14.** |  |  | **OCR rādītājs**, t.sk.: | **16.** |  |
| *minimālā prasība pirmā līmeņa pamata kapitālam*  | 14.1. |  |  | *minimālā prasība pirmā līmeņa pamata kapitālam* | 16.1. |  |
| **Kapitāla pārpalikums vai iztrūkums**, t.sk.: | **15.** |  |  | **Kapitāla pārpalikums vai iztrūkums**, t.sk.: | **17.** |  |
| *pirmā līmeņa pamata kapitāls*  | 15.1. |  |  | *pirmā līmeņa pamata kapitāls* | 17.1. |  |

**Papildu informācija:
plānotie pasākumi kapitāla pietiekamības nodrošināšanai kapitāla nepietiekamības gadījumā**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
|  | **Summa,** ***euro*** | **Rādītājs, %** | **Plānotais pasākums** |
| **Kapitāla iztrūkums TSCR apmēra segšanai**, t.sk.:  |  |  |  |
| *pirmā līmeņa pamata kapitāls* |  |  |  |
| **Pirmā līmeņa pamata kapitāla iztrūkums kopējo kapitāla rezervju prasības un ieteicamās kapitāla rezerves segšanai**, t.sk.: |  |  |  |
| *kopējo kapitāla rezervju prasības segšanai*  |  |  |  |
| *ieteicamās kapitāla rezerves segšanai*  |  |  |  |

1. *\* Kredītiestāde iekļauj risku uzskaitījumu atbilstoši kredītiestādes lietotajai risku klasifikācijai.* [↑](#footnote-ref-1)
2. \*\* 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. [↑](#footnote-ref-2)