



Finantsinspeksioon

Krediidiasutused
Investeeringisühingud

18.08.2020 nr 4.11-3.1/4325

Konsultatsiooni algatamine tururiskimõõtmise mudelis andmesisendite kasutamise kriteeriumite suuniste kohta

Euroopa Pangandusjärelevalve (EBA) algatas 12. augustil 2020 konsultatsiooni suuniste kohta, milles täpsustatakse kriteeriumid andmesisendite kasutamiseks määruse 2019/876 (EL) artiklis 325bc osutatud riskimõõtmise mudelis.

Krediidiasutused ja investeeringisühingud, kes kasutavad tururiski omavahendite nõuete arvutamiseks sisemist riskimõõtmise mudelit (IMA-d), peavad arvutama eeldatava puudujäägi riskinäitaja (ES) nende riskitegurite jaoks, mille jaoks on saadaval piisav arv kontrollitavaid hindu (modelleeritavad riskifaktorid). Suunised selgitavad tingimusi, millele peavad vastama modelleeritavate riskifaktoritega seotud andmed, mida krediitiasutused ja investeeringisühingud peaksid oma ES-i arvutustes kasutama.

Konsultatsiooni puudutav dokumentatsioon on kättesaadav EBA kodulehel ¹. Kommentaare saab esitada läbi EBA kodulehe kuni **12. novembrini 2020**. Lisaks juhime tähelepanu, et 5. oktoobril 2020 toimub avalik arutelu, millele on võimalik samal lehel oleva lingi kaudu registreerida.

Lugupidamisega

/allkirjastatud digitaalselt/

Andre Nõmm
juhatuse liige

Teadmiseks: Eesti Pangaliit

Grete Jürjental 668 0577
grete.jyrjental@fi.ee

¹ <https://eba.europa.eu/eba-consults-guidelines-criteria-use-data-inputs-expected-shortfall-risk-measure-under-internal>