



BANCA NAȚIONALĂ A ROMÂNIEI

### **Instrucțiuni din 28.12.2021**

*privind criteriile de utilizare a datelor de intrare în modelul de măsurare a valorilor la risc menționate la articolul 325bc din Regulamentul (UE) nr. 575/2013*

Având în vedere:

- *Ghidul Autorității Bancare Europene privind criteriile de utilizare a datelor de intrare în modelul de măsurare a valorilor la risc menționate la articolul 325bc din Regulamentul (UE) nr. 575/2013 - EBA/GL/2021/07 din 13 iulie 2021,*
- *prevederile părții a treia, titlul IV, capitolul 1 – ”Cerințe de fonduri proprii pentru riscul de piață – Dispoziții generale” și ale art. 325bc și art. 325bh din Regulamentul (UE) nr. 575/2013 al Parlamentului European și al Consiliului din 26 iunie 2013 privind cerințele prudențiale pentru instituțiile de credit și de modificare a Regulamentului (UE) nr. 648/2012,*
- *prevederile art. 173<sup>4</sup> lit. c) din Ordonanța de urgență a Guvernului nr.99/2006 privind instituțiile de credit și adecvarea capitalului, aprobată cu modificări și completări prin Legea nr.227/2007, cu modificările și completările ulterioare,*

În temeiul dispozițiilor art. 420 alin. (2) – (4) din *Ordonanța de urgență a Guvernului nr.99/2006 privind instituțiile de credit și adecvarea capitalului*, aprobată cu modificări și completări prin *Legea nr.227/2007*, cu modificările și completările ulterioare,

Banca Națională a României emite următoarele instrucțiuni:

**1.** Prezentele instrucțiuni precizează criteriile pentru utilizarea datelor de intrare în modelul de măsurare a valorilor la risc menționate la art. 325bc din Regulamentul (UE) nr. 575/2013 privind cerințele prudențiale pentru instituțiile de credit și de modificare a Regulamentului (UE) nr. 648/2012, cu modificările și completările ulterioare, în conformitate cu art. 325bh alin. (3) din regulamentul menționat.

2. Prezentele instrucțiuni se aplică instituțiilor de credit pentru care Banca Națională a României este autoritate competentă și care au primit aprobarea de a utiliza modele interne alternative, în conformitate cu partea a treia titlul IV capitolul 1 din Regulamentul (UE) nr. 575/2013.

3. În scopul aplicării prevederilor părții a treia titlul IV capitolul 1 din Regulamentul (UE) nr. 575/2013, și, în special, în ceea ce privește respectarea cerințelor prevăzute la art. 325bc și 325bh din regulamentul respectiv, instituțiile de credit prevăzute la pct.2 au în vedere includerea în procedurile interne și în sistemele informatice a cerințelor Ghidului Autorității Bancare Europene privind criteriile de utilizare a datelor de intrare în modelul de măsurare a valorilor la risc menționate la articolul 325bc din Regulamentul (UE) nr. 575/2013 (EBA/GL/2021/07), denumit în continuare Ghidul EBA/GL/2021/07, anexat la prezentele instrucțiuni.

4. În vederea respectării criteriilor pentru utilizarea datelor de intrare în modelul de măsurare a valorilor la risc menționate la art. 325bc din Regulamentul (UE) nr. 575/2013, în conformitate cu art. 325bh din regulamentul menționat, instituțiile de credit prevăzute la pct. 2 au în vedere Ghidul EBA/GL/2021/07.

\*

5. Prezentele instrucțiuni se publică pe pagina oficială de internet a Băncii Naționale a României și se aplică de la data de 1 ianuarie 2022.

Guvernator

MUGUR CONSTANTIN ISĂRESCU