



LIETUVOS BANKO VALDYBA NUTARIMAS

DĖL LIETUVOS BANKO VALDYBOS 2014 M. GRUODŽIO 9 D. NUTARIMO NR. 03-324 „DĖL LIETUVOS BANKO VYKDOMŲ EUROSISTEMOS PINIGŲ POLITIKOS OPERACIJŲ TAISYKLIŲ PATVIRTINIMO“ PAKEITIMO

2020 m. rugpjūčio 13 d. Nr. 03-114
Vilnius

Lietuvos banko valdyba n u t a r i a:

Pakeisti Lietuvos banko valdybos 2014 m. gruodžio 9 d. nutarimu Nr. 03-324 „Dėl Lietuvos banko vykdomų Eurosistemos pinigų politikos operacijų taisyklių patvirtinimo“ patvirtintas Lietuvos banko vykdomų Eurosistemos pinigų politikos operacijų taisykles:

1. pakeisti 4.10.10 papunktį ir jį išdėstyti taip:

„4.10.10. Atsiskaitymo pagal terminuotąjį indėlį dieną Lietuvos bankas nusirašo lėšas nuo sandorio šalies MM sąskaitos arba, jei Lietuvos bankas nurodo, sandorio šalis perveda lėšas į Lietuvos banko MM sąskaitą. Terminuotojo indėlio sandorio pabaigos dieną Lietuvos bankas grąžina sandorio šaliai terminuotąjį indėlį ir priskaičiuotą palūkanų sumą į sandorio šalies MM sąskaitą. Jei terminuotojo indėlio palūkanos yra neigiamos, terminuotojo indėlio sandorio pabaigos dieną Lietuvos bankas grąžina sandorio šaliai terminuotąjį indėlį ir kartu nusirašo priskaičiuotų palūkanų sumą nuo sandorio šalies MM sąskaitos.“;

2. papildyti 6.39.3.1¹ papunkčiu:

„6.39.3.1¹ Papildomi kredito reikalavimai, kurie neatitinka Taisyklių 11 priedo 6.6 papunktyje nustatyto reikalavimo, gali būti naudojami kredito operacijoms užtikrinti, jeigu jie yra įsigalioję iki 2020 m. rugpjūčio 17 d. Šiems papildomiems kredito reikalavimams taikomas papildomas 8 proc. įvertinimo mažesne nei rinkos verte dydis prie Taisyklėse nurodytų arba pagal Taisykles apskaičiuotų įvertinimo mažesne nei rinkos verte dydžių. Jeigu bent vienas papildomų kredito reikalavimų portfelį sudarantis papildomas kredito reikalavimas neatitinka Taisyklių 11 priedo 6.6 papunktyje nustatyto reikalavimo, papildomas 8 proc. įvertinimo mažesne nei rinkos verte dydis taikomas visam papildomų kredito reikalavimų portfeliui.“;

3. pakeisti 6.39.5.2 papunktį ir jį išdėstyti taip:

„6.39.5.2. Individualiems papildomiems kredito reikalavimams taikomi įvertinimo mažesne nei rinkos verte dydžiai nurodyti Taisyklių 23 priede.“;

4. pakeisti 6.39.5.3 papunktį ir jį išdėstyti taip:

„6.39.5.3. Lietuvos bankas turi teisę taikyti papildomus įvertinimo mažesne nei rinkos verte dydžius prie Taisyklių 23 priede nustatytų dydžių ir (arba) kitas rizikos kontrolės priemones.“;

5. pakeisti 6.39.6.3 papunktį ir jį išdėstyti taip:

„6.39.6.3. Įsipareigojimų neįvykdymo tikimybė iki kredito reikalavimo termino pabaigos ($PD(\tau)$) apskaičiuojama pagal kredito reikalavimo įsipareigojimų neįvykdymo tikimybę per vienus metus (PD) pagal Taisyklių 24 priedą.“;

6. pakeisti 6.39.6.5 papunktį ir jį išdėstyti taip:

„6.39.6.5. Pakoreguotas nuostolis skolininkui neįvykdžius įsipareigojimų ($LGD^{adjusted}$) apskaičiuojamas pagal Taisyklių 25 priedą.“;

7. pakeisti 6.39.8.2 papunktį ir jį išdėstyti taip:

„6.39.8.2. Portfeliui taikomas įvertinimo mažesne nei rinkos verte dydis apskaičiuojamas pagal formulę, gautą dydį suapvalinus iki sveikojo skaičiaus:

$$Vertės sumažinimas_{portfelio} = 0,8 \left(\sum_{i=1}^n \frac{likutinis\ nominalas_i}{\sum_{i=1}^n likutinis\ nominalas_i} PD_i^{stressed} LGD_i^{adjusted} \right),$$

kur:

$PD_i^{stressed}$ – papildomo kredito reikalavimo i portfelyje, sudarytame iš n papildomų kredito reikalavimų, pakoreguota įsipareigojimų neįvykdymo tikimybė, apskaičiuota pagal Taisyklių 26 priedą,

$LGD_i^{adjusted}$ – papildomo kredito reikalavimo i portfelyje, sudarytame iš n papildomų kredito reikalavimų, pakoreguotas nuostolis skolininkui neįvykdžius įsipareigojimų, apskaičiuotas pagal Taisyklių 25 priedą,

$likutinis\ nominalas_i$ – kredito reikalavimo i likutinė nominalioji vertė.“;

8. buvusių 26, 27, 28 ir 29 priedus laikyti atitinkamai 23, 24, 25 ir 26 priedais.

Valdybos pirmininkas

Vitas Vasiliauskas