ANNESS XXV

**STRUZZJONIJIET GĦALL-MILI TAL-FORMOLI TAL-LIKWIDITÀ TAL-ANNESS XXIV**

**PARTI 1: ASSI LIKWIDI**

1. Assi likwidi

1.1. Rimarki ġenerali

1. Din hija formula ta’ sommarju li tinkludi informazzjoni dwar l-assi għall-finijiet ta’ rapportar dwar ir-rekwiżit ta’ kopertura tal-likwidità kif speċifikat fir-Regolament Delegat tal-Kummissjoni (UE) 2015/61[[1]](#footnote-2). L-entrati li ma għandhomx għalfejn jimtlew mill-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom lewn griż.
2. Assi rapportati għandhom jikkonformaw mar-rekwiżiti stabbiliti fit-Titolu II tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.
3. Permezz ta’ deroga mill-punt 2, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu ma għandhomx japplikaw restrizzjonijiet fuq il-munita skont l-Artikolu 8(6), il-punt (d) tal-Artikolu 10(1) u l-punt (c) tal-Artikolu 12(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 meta jimlew il-Formula f’munita separata skont l-Artikolu 415(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. L-istituzzjonijiet ta’ kreditu xorta għandhom japplikaw ir-restrizzjonijiet ta’ ġurisdizzjoni.
4. L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-formula fil-muniti korrispondenti skont l-Artikolu 415(2) tar-Regolament (UE) 575/2013.
5. Skont l-Artikolu 9 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw, fejn rilevanti, l-ammont/il-valur tas-suq tal-assi likwidi waqt li jieħdu inkunsiderazzjoni l-flussi ta’ ħruġ netti u l-influssi netti tal-likwidità li jirriżultaw minn għeluq bikri tal-ħeġġijiet imsemmi fil-punt (b) tal-Artikolu 8(5) u skont il-haircuts xierqa speċifikati fil-Kapitolu 2 tar-Regolament Delegat.
6. Ir-Regolament Delegat (UE) 2015/61 jirreferi biss għal rati u haircuts. F’dawn l-istruzzjonijiet il-kelma “ponderati” tintuża bħala terminu ġenerali li jindika l-ammont miksub wara l-applikazzjoni tal-haircuts u r-rati rispettivi u kwalunkwe struzzjoni addizzjonali rilevanti oħra (pereżempju fil-każ ta’ għoti ta’ self u finanzjament garantit). Il-kelma “ponderazzjoni” fil-kuntest ta’ dawn l-istruzzjonijijiet tirreferi għal numru bejn 0 u 1, li mmultiplikat bl-ammont jagħti l-ammont ponderat jew il-valur imsemmi fl-Artikolu 9 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, rispettivament.
7. L-istituzzjonijiet ta’ kreditu ma għandhomx jirrappurtaw darbtejn l-entrati f’xi waħda jew f’aktar minn waħda mit-taqsimiet 1.1.1., 1.1.2., 1.2.1., u 1.2.2. tal-formula.

1.2. Kummenti speċifiċi

1.2.1. Rekwiżiti speċifiċi rigward is-CIUs

1. Għall-entrati 1.1.1.10., 1.1.1.11., 1.2.1.6., 1.1.2.2., 1.2.2.10., 1.2.2.11., 1.2.2.12., 1.2.2.13. tal-formula, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-proporzjon xieraq tal-valur tas-suq tas-CIUs li jikkorrispondi mal-assi likwidi sottostanti għall-impriża, skont l-Artikolu 15(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.

1.2.2. Rekwiżiti speċifiċi rigward l-anterjorità u l-provvedimenti tranżizzjonali

1. L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw entrati kif imsemmi fl-Artikoli 35 sa 37 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 fir-ringieli xierqa tal-assi. Total tal-ammonti tal-assi kollha rrapportati bbażat fuq dawn l-Artikoli għandu jiġi rrapportat ukoll fit-taqsima “Memorandum” għal referenza.

1.2.3. Rekwiżiti speċifiċi għar-rapportar mill-Istituzzjonijiet Ċentrali

1. L-istituzzjonijiet ċentrali, meta jirrapportaw assi likwidi korrispondenti għal depożiti minn istituzzjonijiet ta’ kreditu pjazzati fl-istituzzjoni ċentrali li huma kkunsidrati bħala assi likwidi għall-istituzzjonijiet ta’ kreditu depożitanti, għandhom jiżguraw li l-ammont irrapportat ta’ dawn l-assi likwidi wara l-haircut ma jaqbiżx il-fluss ta’ ħruġ mid-depożiti korrispondenti skont l-Artikolu 27(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.

1.2.4. Rekwiżiti speċifiċi rigward is-saldu u tranżazzjonijiet forward start

1. L-assi kollha li jikkonformaw mal-Artikoli 7, 8 u 9 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 u li jkunu fl-istokk tal-istituzzjoni ta’ kreditu fid-data ta’ referenza, għandhom jiġu rrapportati fir-ringiela rilevanti fil-formula C72, anki jekk jinbiegħu jew jintużaw fi tranżazzjonijiet forward garantiti. B’mod konsistenti, assi likwidi minn tranżazzjonijiet forward start li jirreferu għal xirjiet miftiehma b’kuntratt iżda li għadhom mhux saldati ta’ assi likwidi u xiri forward ta’ assi likwidi għandhom jiġu rrapportati f’din il-formula.

1.2.5. Subformula tal-assi likwidi

1.2.5.1 Struzzjonijiet dwar kolonni speċifiċi

|  |  |
| --- | --- |
| Kolonna | Referenzi legali u struzzjonijiet |
| 0010 | **Ammont/Valur tas-suq**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-kolonna 0010 il-valur tas-suq jew l-ammont fejn applikabbli, tal-assi likwidi skont it-Titolu II tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  L-ammont/valur tas-suq irrapportat fil-kolonna 0010:  — għandu jqis il-flussi ta’ ħruġ netti u l-influssi netti li jirriżultaw mill-għeluq bikri tal-ħeġġijiet definiti fl-Artikolu 8(5) tal-istess Regolament;  — ma għandux iqis il-haircuts speċifikati fit-Titolu II tal-istess Regolament;  — għandu jinkludi l-proporzjon ta’ depożiti msemmija fil-punt (a) tal-Artikolu 16(1) tal-istess Regolament li qegħdin iżommu assi speċifiċi differenti fir-ringieli tal-assi korrispondenti;  — għandu jitnaqqas, meta applikabbli, mill-ammont ta’ depożiti kif definit fl-Artikolu 16 pjazzati fl-istituzzjoni ċentrali ta’ kreditu kif imsemmi fl-Artikolu 27(3) tal-istess Regolament.  Meta jirreferu għall-Artikolu 8(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jieħdu inkunsiderazzjoni l-fluss ta’ flus nett, kemm jekk fluss ta’ ħruġ jew l-influss, li jinħoloq kieku l-ħeġġ kellu jingħalaq fid-data ta’ referenza tar-rapportar. L-istituzzjonijiet ta’ kreditu ma għandhomx jieħdu inkunsiderazzjoni bidliet potenzjali futuri fil-valur fl-assi. |
| 0020 | **Ponderazzjoni standard**  Il-kolonna 0020 tinkludi ponderazzjonijiet li jirriflettu l-ammont miksub wara l-applikazzjoni tal-haircuts rispettivi speċifikati fit-Titolu II tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. Il-ponderazzjoniijiet huma intenzjonati li jirriflettu t-tnaqqis fil-valur tal-assi likwidi wara l-applikazzjoni tal-haircuts xierqa. |
| 0030 | **Ponderazzjoni applikabbli**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-kolonna 0030 il-ponderazzjoni applikabbli applikata għall-assi likwidi stabbiliti fit-Titolu II tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. Il-ponderazzjonijiet applikabbli jistgħu jirriżultaw f’valuri medji ponderati u għandhom ikunu rrapportati f’termini deċimali (jiġifieri 1,00 għal ponderazzjoni applikabbli ta’ 100 fil-mija, jew 0,50 għal ponderazzjoni applikabbli ta’ 50 fil-mija). Il-ponderazzjonijiet applikabbli jistgħu jirriflettu, iżda mhumiex limitati għal, diskrezzjonijiet speċifiċi għall-kumpanija u diskrezzjonijiet nazzjonali. Iċ-ċifra rrapportata fil-kolonna 0030 ma taqbiżx iċ-ċifra fil-kolonna 0020. |
| 0040 | **Valur skont l-Artikolu 9**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-kolonna 0040 il-valur tal-assi likwidu ddeterminat skont l-Artikolu 9 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, li jkun l-ammont/il-valur tas-suq, filwaqt li jitqiesu l-flussi ta’ ħruġ u influssi netti tal-likwidità dovuti għall-għeluq bikri tal-ħeġġijiet, multiplikati bil-ponderazzjoni applikabbli. |

1.2.5.2 Struzzjonijiet dwar ringieli speċifiċi

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Ringiela | Referenzi legali u struzzjonijiet | |
| 0010 | | **1. TOTAL MHUX AĠĠUSTAT TAL-ASSI LIKWIDI**  It-Titolu II tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont totali/il-valur tas-suq tal-Assi likwidi tagħhom fil-kolonna 0010.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-valur totali kkalkulat skont l-Artikolu 9 tal-Assi likwidi tagħhom fil-kolonna 0040. |
| 0020 | | **1.1. Total mhux aġġustat ta’ assi tal-livell 1**  L-Artikoli 10, 15, 16 u 19 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Assi rapportati f’din it-taqsima ġew identifikati b’mod espliċitu jew ittrattati bħala assi tal-Livell 1 skont ir-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont totali/il-valur tas-suq tal-Assi Likwidi tal-Livell 1 fil-kolonna 0010.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-valur totali kkalkulat skont l-Artikolu 9 tal-Assi likwidi tagħhom tal-Livell 1 fil-kolonna 0040. |
| 0030 | | 1.1.1. Total mhux aġġustat ta’ assi tal-LIVELL 1 esklużi bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna  L-Artikoli 10, 15, 16 u 19 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Assi rapportati f’din is-subtaqsima ġew identifikati b’mod espliċitu jew ittrattati bħala assi tal-Livell 1 skont ir-Regolament Delegat (UE) 2015/61. Assi u assi sottostanti li jikkwalifikaw bħala bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna kif imsemmi fil-punt (f) tal-Artikolu 10(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 ma għandhomx ikunu rrapportati f’din is-subtaqsima.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-kolonna 0010 is-somma tal-valur tas-suq/l-ammont totali tal-assi tal-Livell 1, bl-esklużjoni ta’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna, mingħajr ma jitqiesu r-rekwiżiti tal-Artikolu 17 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-kolonna 0040 is-somma tal-ammont ponderat totali ta’ assi tal-Livell 1, bl-esklużjoni ta’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna, mingħajr ma jitqiesu r-rekwiżiti tal-Artikolu 17 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0040 | 1.1.1.1. Muniti u karti tal-flus  Il-punt (a) tal-Artikolu 10(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-ammont totali ta’ flus inklużi muniti u karti ta’ flus. | |
| 0050 | 1.1.1.2. Riżervi tal-bank ċentrali prelevabbli  Il-punt (b)(iii) tal-Artikolu 10(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-ammont totali ta’ riżervi, prelevabbli fi kwalunkwe ħin f’perjodi ta’ stress, miżmuma mill-istituzzjoni ta’ kreditu fil-BĊE, f’bank ċentrali ta’ Stat Membru jew f’bank ċentrali ta’ pajjiż terz, dment li l-iskoperturi għall-bank ċentrali tal-pajjiż terz jew għall-gvern ċentrali tiegħu jkunu assenjati valutazzjoni tal-kreditu minn ECAI nominata (istituzzjoni esterna tal-valutazzjoni tal-kreditu) li tkun tal-anqas tal-kwalità tal-kreditu tal-iskala 1 skont l-Artikolu 114(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.  L-ammont eliġibbli prelevabbli għandu jiġi speċifikat permezz ta’ ftehim bejn l-awtorità kompetenti tal-istituzzjoni ta’ kreditu u l-bank ċentrali li fih jinżammu r-riżervi jew fir-regoli applikabbli tal-pajjiż terz kif imsemmi fil-punt (b)(iii) tal-Artikolu 10(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 0060 | 1.1.1.3. Assi ta’ bank ċentrali  Il-punti (b) (i) u (b) (ii) tal-Artikolu 10(1) tar- Regolament Delegat (UE) Nru 2015/61  Assi li jirrappreżentaw pretensjonijiet fuq jew iggarantiti mill-BĊE, bank ċentrali ta’ Stat Membru jew bank ċentrali ta’ pajjiż terz, dment li l-iskoperturi għall-bank ċentrali jew għall-gvern ċentrali tal-pajjiż terz ikunu assenjati valutazzjoni tal-kreditu minn ECAI nominata li tal-anqas ikollha kwalità tal-kreditu tal-iskala 1 skont l-Artikolu 114(2) tar-Regolament (UE) 575/2013. | |
| 0070 | 1.1.1.4. Assi ta’ gvern ċentrali  Il-punti (c)(i) u (c)(ii) tal-Artikolu 10(1) tar- Regolament Delegat (UE) 2015/61  Assi li jirrappreżentaw pretensjonijiet fuq jew iggarantiti mill-gvern ċentrali ta’ Stat Membru jew il-gvern ċentrali ta’ pajjiż terz, dment li dawk l-assi jiġu assenjati valutazzjoni tal-kreditu minn ECAI nominata li tal-inqas ikollha kwalità tal-kreditu tal-iskala 1 skont l-Artikolu 114(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.  Assi maħruġin mill-istituzzjonijiet ta’ kreditu li jibbenefikaw minn garanzija tal-gvern ċentrali ta’ Stat Membru skont l-Artikolu 35 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 jiġu rapportati f’din ir-ringiela.  Assi maħruġin minn aġenziji tal-immaniġġjar ta’ assi indeboliti sponsorjati minn Stat Membru kif imsemmi fl-Artikolu 36 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 għandhom jiġu rrapportati f’din ir-ringiela. | |
| 0080 | 1.1.1.5. Assi ta’ gvern reġjonali/awtoritajiet lokali  Il-punti (c) (iii) u (c) (iv) tal-Artikolu 10(1) tar- Regolament Delegat (UE) 2015/61  Assi li jirrappreżentaw pretensjonijiet fuq jew iggarantiti minn gvernijiet reġjonali jew awtoritajiet lokali fi Stat Membru, dment li jiġu ttrattati bħala skoperturi għall-gvern ċentrali tal-Istat Membru f’konformità mal-Artikolu 115(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.  Assi li jirrappreżentaw pretensjonijiet fuq jew iggarantiti minn gvernijiet reġjonali jew awtoritajiet lokali f’pajjiż terz, dment li jiġu assenjati valutazzjoni tal-kreditu minn ECAI nominata li tal-inqas ikollha kwalità tal-kreditu tal-iskala 1 skont l-Artikolu 114(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, u dment li jkunu trattati bħala skoperturi għall-gvern ċentrali tal-pajjiż terz f’konformità mal-Artikolu 115(4) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.  Assi maħruġin minn istituzzjonijiet ta’ kreditu li jibbenefikaw minn garanzija minn gvern ċentrali jew minn awtorità lokali fi Stat Membru skont l-Artikolu 35 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 għandhom jiġu rapportati f’din ir-ringiela. | |
| 0090 | 1.1.1.6. Assi ta’ Entità mis-Settur Pubbliku  Il-punti (c)(v) u (c)(vi) tal-Artikolu 10(1)Regolament Delegat (UE) 2015/61  Assi li jirrappreżentaw pretensjonijiet fuq jew iggarantiti minn entitajiet mis-settur pubbliku fi Stat Membru jew f’pajjiż terz, dment li dawk l-assi jkunu trattati bħala skoperturi għall-gvern ċentrali, gvern reġjonali jew awtoritajiet lokali ta’ dan l-Istat Membru jew il-pajjiż terz skont l-Artikolu 116(4) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.  Kwalunkwe skopertura għal gvern ċentrali ta’ pajjiż terz imsemmija fil-paragrafu ta’ qabel għandha tkun assenjata valutazzjoni tal-kreditu minn ECAI nominata li tal-inqas ikollha kwalità tal-kreditu tal-iskala 1 skont l-Artikolu 114(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.  Kwalunkwe skopertura għal gvern reġjonali jew awtorità lokali ta’ pajjiż terz imsemmija f’din is-subtaqsima għandha tiġi ttrattata bħala skoperturi għall-gvern ċentrali tal-pajjiż terz f’konformità mal-Artikolu 115(4) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. | |
| 0100 | 1.1.1.7. Assi rikonoxxibbli fil-munita domestika jew barranija ta’ gvern ċentrali u ta’ bank ċentrali  Il-punt (d) tal-Artikolu 10(1) tar- Regolament Delegat (UE) 2015/61  Assi li jirrappreżentaw pretensjonijiet fuq jew iggarantiti mill-gvern ċentrali, jew il-bank ċentrali u riżervi miżmuma f’bank ċentrali skont il-kundizzjonijiet tal-punt (d) (ii) tal-Artikolu 10(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, ta’ pajjiż terz li mhuwiex assenjat valutazzjoni tal-kreditu minn ECAI nominata ta’ mill-inqas skala 1 tal-kwalità tal-kreditu, dment li l-istituzzjoni ta’ kreditu tirrikonoxxi tali assi b’mod aggregat bħala Livell 1 sal-ammont tal-flussi ta’ ħruġ netti tal-likwidità tagħha mġarrba fl-istess munita.  Assi li jirrappreżentaw pretensjonijiet fuq jew iggarantiti mill-gvern ċentrali, jew il-bank ċentrali u riżervi miżmuma f’bank ċentrali skont il-kundizzjonijiet tal-punt (d)(ii) tal-Artikolu 10(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, ta’ pajjiż terz li mhuwiex assenjat valutazzjoni tal-kreditu minn ECAI nominata tal-inqas tal-iskala 1 tal-kwalità tal-kreditu, u dawk l-assi mhumiex denominati fil-munita domestika ta’ dak il-pajjiż terz, dment li l-istituzzjoni ta’ kreditu tirrikonoxxi l-assi bħala Livell 1 sal-ammont tal-flussi ta’ ħruġ tal-likwidità netta taħt stress tagħha f’dik il-munita barranija li tikkorrispondi għall-operazzjonijiet tagħha fil-ġurisdizzjoni tar-riskju. | |
| 0110 | 1.1.1.8. Assi ta’ istituzzjoni ta’ kreditu (protetta minn gvern ta’ Stat Membru, mutwanti promozzjonali)  Il-punti (e) (i) u (e) (ii) tal-Artikolu 10(1) tar- Regolament Delegat (UE) 2015/61  Assi maħruġin mill-istituzzjonijiet ta’ kreditu inkorporati jew stabbiliti mill-gvern ċentrali, gvern reġjonali jew awtorità lokali ta’ Stat Membru li jkollhom l-obbligu legali li jipproteġu l-bażi ekonomika tal-istituzzjoni ta’ kreditu u li żżomm il-vijabbiltà finanzjarja tagħha.  Assi maħruġa minn mutwanti promozzjonali skont il-punt (e) (ii) tal-Artikolu 10(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Kwalunkwe skopertura għal gvern reġjonali jew awtorità lokali msemmija hawn fuq għandha tiġi trattata bħala skopertura għall-gvern ċentrali tal-Istat Membru skont l-Artikolu 115(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. | |
| 0120 | 1.1.1.9. Assi ta’ banek multilaterali tal-iżvilupp u organizzazzjonijiet internazzjonali  Il-punt (g) tal-Artikolu 10(1) tar- Regolament Delegat (UE) 2015/61  Assi li jirrappreżentaw pretensjonijiet fuq jew iggarantiti mill-banek ta’ żvilupp multilaterali u l-organizzazzjonijiet internazzjonali kif imsemmija fl-Artikolu 117(2) u l-Artikolu 118 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. | |
| 0130 | 1.1.1.10. Azzjonijiet/unitajiet ta’ CIU kwalifikanti: sottostanti huwa muniti/karti ta’ flus u/jew skopertura għall-bank ċentrali  Il-punt (a) tal-Artikolu 15(2)tar- Regolament Delegat (UE) 2015/61  Azzjonijiet jew unitajiet f’CIUs li l-assi sottostanti tagħhom jikkorrispondu għal muniti, karti ta’ flus u skoperturi għall-BĊE, għall-bank ċentrali ta’ Stat Membru jew ta’ pajjiż terz, dment li l-iskoperturi għall-bank ċentrali ta’ pajjiż terz jew għall-gvern ċentrali tiegħu jkunu assenjati valutazzjoni ta’ kreditu minn ECAI nominata li tal-inqas ikollha kwalità tal-kreditu tal-iskala 1 skont l-Artikolu 114(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. | |
| 0140 | 1.1.1.11. Azzjonijiet/unitajiet ta’ CIU kwalifikanti: sottostanti huwa assi ta’ Livell 1 għajr bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna  Il-punt (b) tal-Artikolu 15(2) tar- Regolament Delegat (UE) 2015/61  Azzjonijiet jew unitajiet f’CIUs li l-assi sottostanti tagħhom jikkorrispondu għal assi li jikkwalifikaw bħala assi tal-Livell 1, għajr muniti, karti ta’ flus, skoperturi għall-BĊE, għall-bank ċentrali ta’ Stat Membru jew ta’ pajjiż terz, u bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna kif speċifikat fil-punt (f) tal-Artikolu 10(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 0150 | 1.1.1.12. Approċċi Alternattivi għal-Likwidità: Faċilità ta’ kreditu mill-bank ċentrali  Il-punt (b) tal-Artikolu 19(1) tar- Regolament Delegat (UE) 2015/61  Ammont mhux prelevat ta’ faċilitajiet ta’ kreditu mill-BĊE, il-bank ċentrali ta’ Stat Membru jew pajjiż terz dment li l-faċilità tikkonforma mar-rekwiżiti stabbiliti fil-punti (b) (i) sa (b) (iii) tal-Artikolu 19(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 0160 | **1.1.1.13. Istituzzjonijiet ta’ kreditu ċentrali: Assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna li jitqiesu bħala assi likwidi għall-istituzzjoni ta’ kreditu depożitanti**  L-Artikolu 27(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Skont l-Artikolu 27(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, għandhom jiġu identifikati assi likwidi li jikkorrispondu għal depożiti minn istituzzjonijiet ta’ kreditu mqiegħda fl-istituzzjoni ċentrali li jitqiesu bħala assi likwidi għall-istituzzjoni ta’ kreditu depożitanti. Dawk l-assi likwidi ma għandhomx jingħaddu biex ikoperu l-flussi ta’ ħruġ ħlief mid-depożiti korrispondenti u ma għandhomx jitqiesu fil-kalkoli tal-kompożizzjoni tal-bafer tal-likwidità li tibqa’, skont l-Artikolu 17, għall-istituzzjoni ċentrali f’livell individwali.  Meta jirrapportaw dawk l-assi, l-istituzzjonijiet ċentrali għandhom jiżguraw li l-ammont irrapportat ta’ dawk l-assi likwidi wara l-haircut ma jaqbiżx il-fluss ta’ ħruġ mid-depożiti korrispondenti.  Assi msemmija f’din ir-ringiela għandhom ikunu assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna. | |
| 0170 | 1.1.1.14. Approċċi Alternattivi għal-Likwidità: Assi tal-Livell 2A rikonoxxuti bħala Livell 1  Il-punt (c) tal-Artikolu 19(1) tar- Regolament Delegat (UE) 2015/61  Meta jkun hemm defiċit ta’ assi tal-Livell 1, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont ta’ assi tal-Livell 2A li qegħdin jirrikonoxxu bħala tal-Livell 1 u mhux irrapportati bħala tal-Livell 2A skont il-punt (c) tal-Artikolu 19(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. Dawk l-assi ma għandhomx ikunu rrapportati fit-taqsima tal-assi tal-Livell 2A. | |
| 0180 | 1.1.2. Total mhux aġġustati ta’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna ta’ Livell 1  L-Artikoli 10, 15 u 16 tar Regolament Delegat (UE) 2015/61  Assi rrapportati f’din is-subtaqsima ġew identifikati b’mod espliċitu bħala assi tal-Livell 1 skont ir-Regolament Delegat (UE) 2015/61 u huma bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna, jew l-assi sottostanti tagħhom jikkwalifikaw bħala tali, kif imsemmi fil-punt (f) tal-Artikolu 10(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-kolonna 0010 is-somma tal-valur tas-suq totali / tal-ammont ta’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1, mingħajr kunsiderazzjoni tar-rekwiżiti tal-Artikolu 17 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-kolonna 0040 is-somma tat-total tal-ammont ponderat ta’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1, mingħajr kunsiderazzjoni tar-rekwiżiti tal-Artikolu 17 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 0190 | 1.1.2.1. Bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna  Il-punt (f) tal-Artikolu 10(1) tar- Regolament Delegat (UE) 2015/61  Assi li jirrappreżentaw skoperturi fil-forma ta’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna li huma konformi mal-punt (f) tal-Artikolu 10(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 0200 | 1.1.2.2. Azzjonijiet/unitajiet ta’ CIU kwalifikanti: sottostanti huma bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna  Il-punt (c) tal-Artikolu 15(2) tar- Regolament Delegat (UE) 2015/61  Azzjonijiet jew unitajiet f’CIUs li l-assi sottostanti tagħhom jikkorrispondu għal assi li jikkwalifikaw bħala bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna kif speċifikat fil-punt (f) tal-Artikolu 10(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 0210 | **1.1.2.3. Istituzzjonijiet ta’ kreditu ċentrali: Bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 li jitqiesu bħala assi likwidi għall-istituzzjoni ta’ kreditu depożitanti**  L-Artikolu 27(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Skont l-Artikolu 27(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, għandhom jiġu identifikati assi likwidi li jikkorrispondu għal depożiti minn istituzzjonijiet ta’ kreditu mqiegħda fl-istituzzjoni ċentrali li jitqiesu bħala assi likwidi għall-istituzzjoni ta’ kreditu depożitanti. Dawk l-assi likwidi ma għandhomx jingħaddu biex ikopru l-flussi ta’ ħruġ għajr mid-depożiti korrispondenti u għandhom jiġu injorati għall-kalkoli tal-kompożizzjoni tal-bafer tal-likwidità li jifdal skont l-Artikolu 17 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 għall-istituzzjoni ċentrali f’livell individwali.  Meta jirrapportaw dawk l-assi, l-istituzzjonijiet ċentrali għandhom jiżguraw li l-ammont irrapportat ta’ dawk l-assi likwidi wara l-haircut ma jaqbiżx il-fluss ta’ ħruġ mid-depożiti korrispondenti.  Assi msemmija f’din ir-ringiela huma bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1. | |
| 0220 | **1.2. Total mhux aġġustat ta’ assi tal-livell 2**  L-Artikoli 11 sa 16 u l-Artikolu 19 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Assi rapportati f’din it-taqsima ġew identifikati b’mod espliċitu, jew huma tratati l-istess bħall-assi tal-Livell 2A jew tal-Livell 2B skont ir-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont totali/il-valur tas-suq tal-Assi Likwidi tal-Livell 2 fil-kolonna 0010.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-valur totali kkalkulat skont l-Artikolu 9 tal-Assi likwidi tagħhom tal-Livell 2 fil-kolonna 0040. | |
| 0230 | **1.2.1. Total mhux aġġustat ta’ assi tal-LIVELL 2A**  L-Artikoli 11, 15 u 19 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Assi rapportati f’din is-subtaqsima ġew identifikati b’mod espliċitu jew ittrattati bħala assi tal-Livell 2A skont ir-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-kolonna 0010 is-somma tal-ammont totali tas-suq/valur tal-assi tal-Livell 2A, mingħajr ma jqisu r-rekwiżiti tal-Artikolu 17 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-kolonna 0040 is-somma tal-ammont ponderat totali ta’ assi tal-Livell 2A, mingħajr ma jqisu r-rekwiżiti tal-Artikolu 17 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 0240 | **1.2.1.1. Assi ta’ gvern reġjonali/awtoritajiet lokali jew Entitajiet tas-Settur Pubbliku (Stat Membru, RW20 %)**  Il-punt (a) tal-Artikolu 11(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Assi li jirrappreżentaw pretensjonijiet fuq jew huma ggarantiti minn gvernijiet reġjonali, awtoritajiet lokali jew entitajiet tas-settur pubbliku fi Stat Membru, meta l-iskoperturi jkunu assenjati ponderazzjoni tar-riskju ta’ 20 %. | |
| 0250 | **1.2.1.2. Assi ta’ bank ċentrali jew gvern ċentrali/reġjonali jew awtoritajiet lokali jew Entitajiet tas-Settur Pubbliku (Pajjiż Terz, RW20 %)**  Il-punt (b) tal-Artikolu 11(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Assi li jirrappreżentaw pretensjonijiet fuq jew huma ggarantiti mill-gvern ċentrali jew mill-bank ċentrali ta’ pajjiż terz jew minn gvern reġjonali, awtorità lokali jew entità tas-settur pubbliku f’pajjiż terz, dment li dawk l-assi jkunu assenjati ponderazzjoni tar-riskju ta’ 20 %. | |
| 0260 | **1.2.1.3. Bonds koperti ta’ kwalità għolja (CQS2)**  Il-punt (c) tal-Artikolu 11(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Assi li jirrappreżentaw skoperturi fil-forma ta’ bonds koperti ta’ kwalità għolja li jikkonformaw mal-punt (c) tal-Artikolu 11(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 dment li dawk l-assi jiġu assenjati valutazzjoni tal-kreditu minn ECAI nominata li tal-inqas ikollha kwalità tal-kreditu skala 2 skont l-Artikolu 129(4) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. | |
| 0270 | **1.2.1.4. Bonds koperti ta’ kwalità għolja (Pajjiż Terz, CQS1)**  Il-punt (d) tal-Artikolu 11(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Assi li jirrappreżentaw skoperturi fil-forma ta’ bonds koperti maħruġin minn istituzzjonijiet ta’ kreditu f’pajjiżi terzi li huma konformi mal-punt (d) tal-Artikolu 11(1) tar-Regolament Delegat tal-Kummissjoni (UE) 2015/61 dment li dawk l-assi jkunu assenjati valutazzjoni tal-kreditu minn ECAI nominata li tal-inqas ikollha l-iskala 1 tal-kwalità tal-kreditu f’konformità mal-Artikolu 129(4) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. | |
| 0280 | **1.2.1.5. Titoli ta’ dejn korporattiv (CQS1)**  Il-punt (e) tal-Artikolu 11(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Titoli ta’ dejn korporattiv li huma konformi mal-punt (e) tal-Artikolu 11(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 0290 | **1.2.1.6. Azzjonijiet/unitajiet ta’ CIU kwalifikanti: sottostanti huma assi tal-Livell 2A**  Il-punt (d) tal-Artikolu 15(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Azzjonijiet jew unitajiet f’CIUs li l-assi sottostanti tagħhom jikkorrispondu għal assi li jikkwalifikaw bħala assi tal-Livell 2 A kif speċifikat fl-Artikolu 11 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 0300 | **1.2.1.7. Istituzzjonijiet ta’ kreditu ċentrali: Assi tal-Livell 2A li jitqiesu bħala assi likwidi għall-istituzzjoni ta’ kreditu depożitanti**  L-Artikolu 27(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Skont l-Artikolu 27(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, għandhom jiġu identifikati assi likwidi li jikkorrispondu għal depożiti minn istituzzjonijiet ta’ kreditu mqiegħda fl-istituzzjoni ċentrali li jitqiesu bħala assi likwidi għall-istituzzjoni ta’ kreditu depożitanti. Dawn l-assi likwidi ma għandhomx jingħaddu biex ikoperu l-flussi ta’ ħruġ ħlief mid-depożiti korrispondenti u ma għandhomx jitqiesu fil-kalkoli tal-kompożizzjoni tal-bafer tal-likwidità li tibqa’, skont l-Artikolu 17 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 għall-istituzzjoni ċentrali f’livell individwali.  Meta jirrapportaw dawk l-assi, l-istituzzjonijiet ċentrali għandhom jiżguraw li l-ammont irrapportat ta’ dawk l-assi likwidi wara l-haircut ma jaqbiżx il-fluss ta’ ħruġ mid-depożiti korrispondenti.  Assi msemmija f’din ir-ringiela huma assi tal-Livell 2A. | |
| 0310 | **1.2.2. Total mhux aġġustat ta’ assi tal-Livell 2B**  L-Artikoli 12 sa 16 u l-Artikolu 19 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Assi rapportati f’din is-subtaqsima ġew identifikati b’mod espliċitu bħala assi tal-Livell 2B skont ir-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-kolonna 0010 is-somma tal-valur tas-suq/l-ammont totali tal-assi tal-Livell 2B, mingħajr ma jqisu r-rekwiżiti tal-Artikolu 17 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-kolonna 0040 is-somma tal-ammont ponderat totali ta’ assi tal-Livell 2B, mingħajr ma jqisu r-rekwiżiti tal-Artikolu 17 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 0320 | **1.2.2.1. Titoli garantiti b’assi (residenzjali, CQS1)**  Il-punt (a) tal-Artikolu 12(1) u l-punti (g)(i) u (g)(ii) tal-Artikolu 13(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Skoperturi fil-forma ta’ titoli garantiti b’assi li jikkonformaw mar-rekwiżiti tal-Artikolu 13 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, dment li jkunu ggarantiti b’self residenzjali garantit b’ipoteka tal-ewwel grad jew self residenzjali garantit bis-sħiħ skont il-punti (g)(i) u (g)(ii) tal-Artikolu 13(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Assi li huma soġġetti għall-provvediment tranżizzjonali speċifikat fl-Artikolu 37 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 għandhom jiġu rrapportati f’din ir-ringiela. | |
| 0330 | **1.2.2.2. Titoli garantiti b’assi (vetturi, CQS1)**  Il-punt (a) tal-Artikolu 12(1) u l-punt (g)(iv) tal-Artikolu 13(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Skoperturi fil-forma ta’ titoli garantiti b’assi li jikkonformaw mal-Artikolu 13 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, dment li jkunu garantiti b’self u kirjiet fuq karozzi skont il-punt (g)(iv) tal-Artikolu 13(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 0340 | **1.2.2.3. Bonds koperti ta’ kwalità għolja (RW35 %)**  Il-punt (e) tal-Artikolu 12(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Assi li jirrappreżentaw skoperturi fil-forma ta’ bonds koperti maħruġin minn istituzzjonijiet ta’ kreditu li huma konformi mal-punt (e) tal-Artikolu 12(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 dment li l-pool ta’ assi sottostanti tikkonsisti esklussivament minn skoperturi li jikkwalifikaw għal ponderazzjoni tar-riskju ta’ 35 % jew inqas, skont l-Artikolu 125 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. | |
| 0350 | **1.2.2.4. Titoli garantiti b’assi (kummerċjali jew individwi, Stat Membru, CQS1)**  Il-punt (a) tal-Artikolu 12(1) u l-punti (g)(iii) u (g)(v) tal-Artikolu 13(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Skoperturi fil-forma ta’ titoli garantiti b’assi li jikkonformaw mar-rekwiżiti tal-Artikolu 13 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, dment li jkunu garantiti b’assi kif imsemmi fil-punti (g)(iii) u (g)(v) tal-Artikolu 13(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. Kun af li għall-fini tal-punt (g) (iii) tal-Artikolu 13(2), mill-inqas 80 % tal-mutwatarji fil-pula għandhom ikunu SMEs fil-ħin tal-ħruġ tat-titolizzazzjoni. | |
| 0360 | **1.2.2.5. Titoli ta’ dejn korporattiv (CQS2/3)**  Il-punt (b) tal-Artikolu 12(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Titoli ta’ dejn korporattiv li huma konformi mal-punt (b) tal-Artikolu 12(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 | |
| 0370 | **1.2.2.6. Titoli ta’ dejn korporattiv — assi li ma jrendux imgħax (miżmuma minn istituzzjonijiet ta’ kreditu għal raġunijiet reliġjużi) (CQS1/2/3)**  L-Artikolu 12(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Awtorità kompetenti tista’ tippermetti lill-istituzzjonijiet ta’ kreditu li, skont l-istatuti ta’ inkorporazzjoni tagħhom, ma jkunux jistgħu jżommu assi li jrendu l-imgħax għal raġunijiet ta’ osservanza reliġjuża, li jidderogaw mill-punti (b)(ii) u (b)(iii) tal-Artikolu 12(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, dment li jkun hemm evidenza ta’ disponibbiltà insuffiċjenti ta’ assi li ma jrendux imgħax li jissodisfaw ir-rekwiżiti stabbiliti f’dawk il-punti u li l-assi li ma jrendux imgħax inkwistjoni jkunu likwidi b’mod adegwat fis-swieq privati.  Dawk l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw titoli ta’ dejn korporattiv li fihom assi li ma jrendux imgħax sakemm dawn jissodisfaw ir-rekwiżiti tal-punt (b)(i) tal-Artikolu 12(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 u jkunu rċevew deroga xierqa mill-awtorità kompetenti tagħhom. | |
| 0380 | **1.2.2.7. Azzjonijiet (indiċi tal-borża ewlieni)**  Il-punt (c) tal-Artikolu 12(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Azzjonijiet, li huma konformi mal-punt (c) tal-Artikolu 12(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 u huma denominati fil-munita tal-Istat Membru tad-domiċilju tal-istituzzjoni ta’ kreditu.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw ukoll azzjonijiet li huma konformi mal-punt (c) tal-Artikolu 12(1) u denominati f’munita differenti, dment li jingħaddu bħala assi tal-Livell 2B biss sal-ammont li jkopri l-flussi ta’ ħruġ tal-likwidità f’dik il-munita jew fil-ġurisdizzjoni fejn jittieħed ir-riskju tal-likwidità. | |
| 0390 | **1.2.2.8. Assi li ma jrendux imgħax (miżmuma minn istituzzjonijiet ta’ kreditu għal raġunijiet reliġjużi) (CQS3-5)**  Il-punt (f) tal-Artikolu 12(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għall-istituzzjonijiet ta’ kreditu li, skont l-istatuti ta’ inkorporazzjoni tagħhom, ma jkunux jistgħu jżommu assi li jrendu l-imgħax għal raġunijiet ta’ osservanza reliġjuża, assi li ma jrendux imgħax li jikkostitwixxu pretensjoni fuq jew iggarantiti minn banek ċentrali jew mill-gvern ċentrali jew mill-bank ċentrali ta’ pajjiż terz jew minn gvern reġjonali, awtorità lokali jew entità tas-settur pubbliku f’pajjiż terz, dment li dawk l-assi jkollhom valutazzjoni tal-kreditu minn ECAI nominata tal-inqas tal-iskala 5 tal-kwalità tal-kreditu skont l-Artikolu 114 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, jew l-iskala ta’ kreditu ekwivalenti għal terminu qasir fil-każ ta’ valutazzjoni tal-kwalità tal-kreditu fuq terminu qasir. | |
| 0400 | **1.2.2.9. Faċilitajiet ta’ likwidità impenjati ta’ użu ristrett ta’ bank ċentrali**  Il-punt (d) tal-Artikolu 12(1) u l-Artikolu 14 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Ammont mhux prelevat ta’ faċilitajiet ta’ likwidità impenjati ta’ użu ristrett ipprovduti minn banek ċentrali li huma konformi mal-Artikolu 14 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 0410 | **1.2.2.10. Azzjonijiet/unitajiet ta’ CIU kwalifikanti: sottostanti huma titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1)**  Il-punt (e) tal-Artikolu 15(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Azzjonijiet jew unitajiet f’CIUs li l-assi sottostanti tagħhom jikkorrispondu għal assi li jikkwalifikaw bħala assi tal-Livell 2B kif speċifikat fil-punti (g)(i), (g)(ii) u (g)(iv) tal-Artikolu 13(2) tar-Regolament Delegat (KE) Nru 2015/61. | |
| 0420 | **1.2.2.11. Azzjonijiet/unitajiet ta’ CIU kwalifikanti: sottostanti huma Bonds koperti ta’ kwalità għolja (RW35 %)**  Il-punt (f) tal-Artikolu 15(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Azzjonijiet jew unitajiet f’CIUs li l-assi sottostanti tagħhom jikkorrispondu għal assi li jikkwalifikaw bħala assi tal-Livell 2B kif speċifikat fil-punt (e) tal-Artikolu 12(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 0430 | **1.2.2.12. Azzjonijiet/unitajiet ta’ CIU kwalifikanti: sottostanti huma titoli garantiti b’assi (kummerċjali jew individwi, Stat Membru, CQS1)**  Il-punt (g) tal-Artikolu 15(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Azzjonijiet jew unitajiet f’CIUs li l-assi sottostanti tagħhom jikkorrispondu għal assi li jikkwalifikaw bħala assi tal-Livell 2B kif speċifikat fil-punti (g) (iii) u (g) (v) tal-Artikolu 13(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. Kun af li għall-fini tal-punt (g) (iii) tal-Artikolu 13(2), mill-inqas 80 % tal-mutwatarji fil-pula għandhom ikunu SMEs fil-ħin tal-ħruġ tat-titolizzazzjoni. | |
| 0440 | **1.2.2.13. Azzjonijiet/unitajiet ta’ CIU kwalifikanti: sottostanti huma titoli ta’ dejn korporattiv (CQS2/3), azzjonijiet (indiċi ta’ borża ewlieni) jew assi li ma jrendux imgħax (miżmuma mill-istituzzjonijiet ta’ kreditu għal raġunijiet reliġjużi) (CQS3-5)**  Il-punt (h) tal-Artikolu 15(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Azzjonijiet jew unitajiet f’CIUs li l-assi sottostanti tagħhom jikkorrispondu għal titoli ta’ dejn korporattiv konformi mal-punt (b) tal-Artikolu 12(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, azzjonijiet konformi mal-punt (c) tal-Artikolu 12(1) tal-istess Regolament jew assi li ma jrendux imgħax li huma konformi mal-punt (f) tal-Artikolu 12(1) tal-istess Regolament. | |
| 0450 | **1.2.2.14. Depożiti minn membru ta’ netwerk ma’ istituzzjoni ċentrali (investiment mhux obbligat)**  Il-punt (b) tal-Artikolu 16(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Depożitu minimu li l-istituzzjoni ta’ kreditu żżomm mal-istituzzjoni ta’ kreditu ċentrali, dment li tkun parti minn skema ta’ protezzjoni istituzzjonali msemmija fl-Artikolu 113(7) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, għal netwerk eliġibbli għall-eżenzjoni prevista fl-Artikolu 10 tal-istess Regolament jew għal netwerk kooperattiv fi Stat Membru rregolat b’liġi jew b’kuntratt.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jiżguraw li l-istituzzjoni ċentrali ma tkunx taħt xi obbligu legali jew kuntrattwali li żżomm jew tinvesti d-depożiti f’assi likwidi ta’ livell jew kategorija speċifikati. | |
| 0460 | **1.2.2.15. Finanzjament tal-likwidità disponibbli għal membru ta’ netwerk minn istituzzjoni ċentrali (kollateralizzazzjoni mhux speċifikata)**  L-Artikolu 16(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Ammont mhux prelevat ta’ finanzjament ta’ likwidità limitat li jikkonforma mal-Artikolu 16(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 0470 | **1.2.2.16. Istituzzjonijiet ta’ kreditu ċentrali: Assi tal-Livell 2B li jitqiesu bħala assi likwidi għall-istituzzjoni ta’ kreditu depożitanti**  L-Artikolu 27(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Skont l-Artikolu 27(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, jeħtieġ li jiġu identifikati assi likwidi li jikkorrispondu għal depożiti mill-istituzzjonijiet ta’ kreditu pjazzati fl-istituzzjoni ċentrali li jitqiesu bħala assi likwidi għall-istituzzjoni ta’ kreditu depożitanti. Dawn l-assi likwidi ma għandhomx jingħaddu biex ikopru l-flussi ta’ ħruġ ħlief mid-depożiti korrispondenti u ma għandhomx jitqiesu fil-kalkoli tal-kompożizzjoni tal-bafer tal-likwidità li tibqa’, skont l-Artikolu 17, għall-istituzzjoni ċentrali f’livell individwali.  Meta jirrapportaw dawk l-assi, l-istituzzjonijiet ċentrali għandhom jiżguraw li l-ammont irrapportat ta’ dawn l-assi likwidi wara l-haircut ma jaqbiżx il-fluss ta’ ħruġ mid-depożiti korrispondenti.  Assi msemmija f’din ir-ringiela huma assi tal-Livell 2B. | |
| **ENTRATI TA’ MEMORANDUM** | | |
| 0485 | **2. Depożiti minn membru ta’ netwerk ma’ istituzzjoni ċentrali (investiment obbligat)**  Il-punt (a) tal-Artikolu 16(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont totali ta’ assi rrapportati fit-taqsimiet ta’ hawn fuq skont ir-rekwiżiti fil-punt (a) tal-Artikolu 16(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 0580 | **3. Assi tal-livell 1/2 A/2B esklużi minħabba raġunijiet ta’ munita**  L-Artikoli 8(6), il-punt (d) tal-Artikolu 10(1) u l-punt (c) tal-Artikolu 12(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjoni għandha tirrapporta l-porzjon tal-assi tal-Livell 1, tal-Livell 2A u tal-Livell 2B imsemmija fl-Artikoli 10 sa 16 li mhumiex rikonoxxibbli mill-istituzzjoni skont l-Artikolu 8(6), il-punt (d) tal-Artikolu 10(1) u l-punt (c) tal-Artikolu 12(1). | |
| 0590 | **4. Assi tal-Livell 1/2 A/2B esklużi minħabba raġunijiet operazzjonali ħlief għal raġunijiet ta’ munita**  L-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-assi f’konformità mal-Artikolu 7 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 iżda li ma jissodisfawx ir-rekwiżiti speċifikati fl-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, dment li ma jkunux ġew irrapportati fir-ringiela 0580 għal raġunijiet ta’ munita. | |

**PARTI 2. FLUSSI TA’ ĦRUĠ**

1. Flussi ta’ Ħruġ

1.1. Rimarki ġenerali

1. Din hija l-formula ta’ sommarju li fiha informazzjoni dwar il-flussi ta’ ħruġ tal-likwidità mkejla matul it-30 jum ta’ wara, għall-finijiet ta’ rapportar tar-rekwiżit tal-kopertura tal-likwidità kif speċifikat fir-Regolament Delegat (UE) 2015/61. L-entrati li ma għandhomx għalfejn jimtlew mill-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom lewn griż.

2. L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-formula fil-muniti korrispondenti skont l-Artikolu 415(2) tar-Regolament (UE) 575/2013.

3. Ċerti entrati ta’ memorandum huma inklużi fil-formula assoċjata ma’ dawn l-istruzzjonijiet. Għalkemm mhux strettament neċessarji għall-kalkolu tal-proporzjon innifsu, huwa meħtieġ li jimtlew. Dawk l-entrati jipprovdu informazzjoni meħtieġa biex l-awtoritajiet kompetenti jkunu jistgħu jagħmlu valutazzjoni adegwata tal-konformità tal-istituzzjonijiet ta’ kreditu mar-rekwiżiti ta’ likwidità. F’ċerti każijiet jirrappreżentaw tqassim iktar granulari tal-entrati inklużi fit-taqsimiet ewlenin tal-formuli filwaqt li f’każijiet oħrajn jirriflettu riżorsi ta’ likwidità addizzjonali li l-istituzzjonijiet ta’ kreditu jistgħu jkollhom aċċess għalihom.

4. Skont l-Artikolu 22(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, il-flussi ta’ ħruġ tal-likwidità għandhom:

i. jinkludu l-kategoriji msemmija fl-Artikolu 22(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61

ii. jiġu kkalkolati billi l-bilanċi pendenti ta’ diversi kategoriji ta’ obbligazzjonijiet u impenji barra l-karta bilanċjali jiġu mmultiplikati bir-rati li bihom huma mistennija jiġu likwidati jew prelevati kif indikat fir-Regolament Delegat (UE) 2015/61.

5. Ir-Regolament Delegat (UE) 2015/61 jirreferi biss għar-rati u l-haircuts, u l-kelma “ponderazzjoni” tirreferi biss għal dawn. F’dawn l-istruzzjonijiet il-kelma “ponderati” tintuża bħala terminu ġenerali li jindika l-ammont miksub wara l-applikazzjoni tal-haircuts u r-rati rispettivi u kwalunkwe struzzjoni addizzjonali rilevanti oħra (pereżempju fil-każ ta’ għoti ta’ self u finanzjament garantit).

6. Il-flussi ta’ ħruġ fi grupp jew skema ta’ protezzjoni istituzzjonali (minbarra l-flussi ta’ ħruġ minn kreditu mhux prelevat jew faċilitajiet ta’ likwidità pprovduti minn membri ta’ grupp jew skema ta’ protezzjoni istituzzjonali fejn l-awtorità kompetenti tat permess li tiġi applikata rata ta’ fluss ’ il barra preferenzjali u flussi ta’ ħruġ minn depożiti operazzjonali miżmuma fil-kuntest ta’ Skema ta’ Protezzjoni istituzzjonali jew netwerk kooperattiv) għandhom ikunu rrapportati fil-kategoriji rilevanti. Dawk il-flussi ta’ ħruġ għandhom jiġu rrapportati wkoll b’mod separat bħala entrati ta’ memorandum.

7. Il-flussi ta’ ħruġ tal-likwidità għandhom jiġu rrapportati darba biss fil-formula dment li ma jkunux applikabbli flussi ta’ ħruġ addizzjonali skont l-Artikolu 30 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 jew meta l-entrata tkun entrata “li minnhom” jew entrata ta’ memorandum.

8. Fil-każ ta’ rapportar separat kif imsemmi fl-Artikolu 415(2) tar-Regolament (UE) 575/2013, għandu dejjem japplika dan li ġej:

 entrati u flussi denominati f’dik il-munita biss għandhom jiġu rrapportati;

 f’każ ta’ diskrepanza fil-muniti bejn il-komponenti ta’ tranżazzjoni, jiġi rrapportat biss il-komponent f’dik il-munita;

 meta r-Regolament Delegat (UE) 2015/61 jippermetti netting, dan jista’ jiġi applikat biss għal flussi f’dik il-munita;

 meta fluss ikollu opzjonalità għal diversi muniti, l-istituzzjoni ta’ kreditu għandha tagħmel valutazzjoni tal-munita li l-fluss x’aktarx li jseħħ fiha u għandha tirrapporta l-entrata f’dik il-munita separata biss.

9. Il-ponderazzjonijiet standard fil-kolonna 0040 tal-formula C 73.00 tal-Anness XXIV huma dawk speċifikati fir-Regolament Delegat (UE) 2015/61 b’mod prestabbilit u huma pprovduti hawnhekk għall-informazzjoni.

10. Il-formula fiha l-informazzjoni dwar il-flussi tal-likwidità kollateralizzati, imsejħa “għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali” fir-Regolament Delegat (UE) 2015/61, u għall-finijiet tal-kalkolu tal-LCR kif definit f’dak ir-Regolament. Meta dawk it-tranżazzjonijiet isiru kontra pula ta’ kollateral, l-identifikazzjoni tal-assi speċifiċi mirhuna għall-finijiet ta’ rapportar f’din il-Formula se ssir, skont il-kategoriji tal-assi likwidi speċifikati fit-Titolu II, il-Kapitolu 2 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, li jibdew mill-assi l-inqas likwidi. Fl-istess ħin, fil-każ ta’ tranżazzjonijiet b’maturitajiet residwi differenti magħmula kontra pula ta’ kollateral, l-ewwel jiġu assenjati assi inqas likwidi għat-tranżazzjonijiet bl-aktar maturitajiet residwi.

11. Formula separata hija pprovdut għal swaps kollaterali, C 75.01 tal-ANNESS XXIV. Swaps kollaterali, li huma tranżazzjonijiet kollateral-versus-kollateral ma għandhomx ikunu rrapportati fil-formula tal-flussi ta’ ħruġ C 73.00 tal-Anness XXIV, li tkopri biss tranżazzjonijiet fi flus-versus-kollaterali.

1.2. Kummenti speċifiċi rigward is-saldu u t-tranżazzjonijiet forward start

12. L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw flussi ta’ ħruġ li jirriżultaw minn repos forward start, retroriakkwist u swaps kollaterali li jibdew fi żmien perjodu ta’ 30 jum u jimmaturaw wara l-perjodu ta’ 30 jum fejn il-komponent inizjali jipproduċi fluss ta’ ħruġ. Fil-każ ta’ retroriakkwist, l-ammont li se jingħata b’self lill-kontroparti għandu jitqies bħala fluss ta’ ħruġ u rapportat fl-entrata 1.1.8.6. nett mill-valur tas-suq tal-assi li se jiġi riċevut bħala kollateral u wara l-applikazzjoni tal-haircut tal-LCR relatat jekk l-assi jikkwalifika bħala assi likwidu. Jekk l-ammont li se jingħata b’self ikun anqas mill-valur tas-suq tal-assi (wara l-haircut tal-LCR) li se jiġi riċevut bħala kollateral, id-differenza għandha tkun irrapportata bħala influss. Jekk il-kollateral li se jiġi riċevut ma jikkwalifikax bħala assi likwidu, il-fluss ta’ ħruġ għandu jkun irrapportat kollu. Fil-każ ta’ repo, fejn il-valur tas-suq tal-assi li se jingħata b’self bħala kollateral wara l-applikazzjoni tal-haircut tal-LCR relatat (jekk l-assi jikkwalifika bħala assi likwidu) ikun ikbar mill-ammont fi flus li se jiġi riċevut, id-differenza għandha tkun irrapportata bħala fluss ta’ ħruġ fir-ringiela msemmija hawn fuq. Jekk l-ammont li se riċevut ikun akbar mill-valur tas-suq tal-assi (wara l-haircut tal-LCR) li se jingħata b’self bħala kollateral, id-differenza għandha tkun irrapportata bħala influss. Għal swaps kollaterali, fejn l-effett nett tal-iswap inizjali ta’ assi likwidi (b’kunsiderazzjoni tal-haircuts tal-LCR) joħloq fluss ta’ ħruġ dan il-fluss ta’ ħruġ għandu jkun irrapportat fir-ringiela msemmija hawn fuq.

Repos forward, retroriakkwisti forward u swaps kollaterali forward li jibdew u jimmaturaw fil-perjodu ta’ 30 jum tal-LCR ma għandhom l-ebda impatt fuq l-LCR ta’ bank u jistgħu jiġu injorati.

13. L-iskema tad-deċiżjonijiet għat-taqsima 1 ta’ C 73.00 tal-Anness XXIV, l-iskema tad-deċiżjonijiet hija mingħajr preġudizzju għar-rapportar tal-entrati ta’ memorandum. L-iskema tad-deċiżjonijiet hija parti mill-istruzzjonijiet biex jiġu speċifikati l-kriterji tal-valutazzjoni tal-prijoritizzazzjoni għall-allokazzjoni ta’ kull entrata rapportata sabiex jiġi żgurat rapportar omoġenju u komparabbli. L-implimentazzjoni tal-iskema tad-deċiżjonijiet weħidha mhijex biżżejjed, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom dejjem jikkonformaw mal-bqija tal-istruzzjonijiet. Għall-fini ta’ sempliċità, l-iskema tad-deċiżjonijiet tinjora t-totali u s-subtotali; madankollu dan ma jfissirx li ma għandhomx ikunu rrapportati wkoll. DA tirreferi għar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **#** | **Fattur** | **Deċiżjoni** | **Rappurtar** |
| 1 | Tranżazzjoni forward start | Iva | # 2 |
| Le | # 4 |
| 2 | Tranżazzjoni forward aċċettata wara d-data ta’ rapportar; | Iva | **Tirrapportax** |
| Le | # 3 |
| 3 | Tranżazzjoni forward li tibda fi ħdan il-perjodu ta’ 30 jum u timmatura wara l-perjodu ta’ 30 jum fejn il-komponent inizjali jipproduċi fluss ta’ ħruġ nett | Iva | ID 1.1.8.6 |
| Le | **Tirrapportax** |
| 4 | Entrata li teħtieġ flussi ta’ ħruġ addizzjonali skont l-Artikolu 30 tad-DA? | Iva | # 5 u sussegwentement # 51 |
| Le | # 5 |
| 5 | Depożitu fil-livell tal-konsumatur skont l-Artikolu 411(2) tar-Regolament (UE) 575/2013? | Iva | # 6 |
| Le | # 12 |
| 6 | Depożitu kkanċellat b’maturità residwa ta’ inqas minn 30 jum tal-kalendarju u fejn sar ftehim li l-ħlas isir lil istituzzjoni ta’ kreditu oħra? | Iva | ID 1.1.1.2 |
| Le | # 7 |
| 7 | Depożitu skont l-Artikolu 25(4) tad-DA? | Iva | ID 1.1.1.1 |
| Le | # 8 |
| 8 | Depożitu skont l-Artikolu 25(5) tad-DA? | Iva | ID 1.1.1.6 |
| Le | # 9 |
| 9 | Depożitu skont l-Artikolu 25(2) tad-DA? | Iva | Alloka f’entrata rilevanti waħda tal-ID 1.1.1.3. |
| Le | # 10 |
| 10 | Depożitu skont l-Artikolu 24(4) tad-DA? | Iva | ID 1.1.1.5 |
| Le | # 11 |
| 11 | Depożitu skont l-Artikolu 24(1) tad-DA? | Iva | ID 1.1.1.4 |
| Le | ID 1.1.1.7 |
| 12 | L-obbligazzjoni saret dovuta, tista’ tissejjaħ għall-ħlas mill-emittent jew mill-fornitur tal-finanzjament jew tinvolvi aspettattiva mill-fornitur tal-finanzjament li l-istituzzjoni ta’ kreditu tkun trid tħallas lura l-obbligazzjoni matul it-30 jum tal-kalendarju li jmiss? | Iva | # 13 |
| Le | # 30 |
| 13 | Obbligazzjoni li tirriżulta mill-ispejjeż operazzjonali tal-istituzzjoni stess? | Iva | ID 1.1.8.1 |
| Le | # 14 |
| 14 | Obbligazzjoni fil-forma ta’ bond mibjugħa esklussivament fis-suq tal-konsumaturi u miżmuma f’kont fil-livell ta’ konsumatur f’konformità mal-Artikolu 28(6) tad-DA? | Iva | Segwi l-perkors tad-depożiti fil-livell tal-konsumatur (jiġifieri wieġeb iva għal # 5 u ttratta skont dan) |
| Le | # 15 |
| 15 | Responsabbiltà fil-forma ta’ titolu ta’ dejn? | Iva | ID 1.1.8.2 |
| Le | # 16 |
| 16 | Depożitu riċevut bħala kollateral? | Iva | Alloka fl-entrati rilevanti tal-ID 1.1.5 |
| Le | # 17 |
| 17 | Depożitu li jirriżulta minn relazzjoni bankarja korrispondenti jew minn senserija primarja? | Iva | ID1.1.4.1. |
| Le | # 18 |
| 18 | Depożitu operattiv skont l-Artikolu 27 tad-DA? | Iva | # 19 |
| Le | # 24 |
| 19 | Miżmumin fil-kuntest ta’ IPS jew netwerk kooperattiv? | Iva | # 20 |
| Le | # 22 |
| 20 | Trattati bħala assi likwidi għall-istituzzjoni ta’ kreditu depożitanti? | Iva | ID 1.1.2.2.2 |
| Le | # 21 |
| 21 | Miżmumin biex jinkiseb l-ikklerjar ta’ flus u s-servizzi ta’ istituzzjonijiet ta’ kreditu ċentrali fi ħdan netwerk? | Iva | ID 1.1.2.4 |
| Le | ID 1.1.2.2.1 |
| 22 | Miżmumin għall-ikklerjar, il-kustodja, l-immaniġġjar ta’ flus jew servizzi oħrajn komparabbli fil-kuntest ta’ relazzjoni operazzjonali stabbilita? | Iva | Alloka f’entrata rilevanti waħda tal-ID 1.1.2.1. |
| Le | # 23 |
| 23 | Miżmumin fil-kuntest ta’ relazzjoni operazzjonali stabbilita (oħra) ma’ konsumaturi mhux finanzjarji? | Iva | ID 1.1.2.3 |
| Le | # 24 |
| 24 | Depożiti operazzjonali eċċessi? | Iva | Alloka f’entrata rilevanti waħda tal-ID 1.1.3. |
| Le | # 25 |
| 25 | Depożitu ieħor? | Iva | # 26 |
| Le | # 27 |
| 26 | Depożiti minn klijenti finanzjarji? | Iva | ID 1.1.4.2 |
| Le | Alloka f’entrata rilevanti waħda tal-ID 1.1.4.3. |
| 27 | Obbligazzjoni minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali minbarra derivattivi u swaps kollaterali? | Iva | Alloka f’entrata rilevanti waħda tal-ID 1.2. |
| Le | # 28 |
| 28 | Obbligazzjoni minn swaps kollaterali? | Iva | Alloka f’entrata rilevanti waħda ta’ C75.01 u ID 1.3. fejn applikabbli. |
| Le | # 29 |
| 29 | Obbligazzjoni li tirriżulta fi fluss ta’ ħruġ minn derivattivi skont l-Artikolu 30(4) tad-DA? | Iva | ID 1.1.5.5 |
| Le | # 30 |
| 30 | Xi obbligazzjoni oħra li se ssir dovuta fit-30 jum li jmiss? | Iva | ID 1.1.8.3 |
| Le | # 31 |
| 31 | Impenji kuntrattwali biex jiġi estiż il-finanzjament lil klijenti mhux finanzjarji li huma dovuti fit-30 jum li ġejjin li jaqbżu l-influssi minn dawk il-klijenti? | Iva | Wieħed mill-IDs li ġejjin: 1.1.8.4.1 sa 1.1.8.4.4 |
|  |  | Le | # 32 |
| 32 | Flussi ta’ ħruġ oħra li huma dovuti fit-30 jum li jmiss mhux imsemmija hawn fuq? | Iva | ID 1.1.8.6 |
| Le | # 33 |
| 33 | Ammont mhux prelevat li jista’ jiġi prelevat minn kreditu impenjat u faċilità ta’ likwidità skont l-Artikolu 31 tal-AD? | Iva | # 34 |
| Le | # 42 |
| 34 | Faċilità ta’ kreditu impenjata? | Iva | # 35 |
| Le | # 37 |
| 35 | F’IPS jew netwerk kooperattiv ittrattat bħala assi likwidu mill-istituzzjoni depożitanti? | Iva | ID 1.1.6.1.6 |
| Le | # 36 |
| 36 | Fi grupp jew IPS soġġetta għal trattament preferenzjali? | Iva | ID 1.1.6.1.5 |
| Le | Alloka f’entrata waħda rilevanti li jifdal tal-ID 1.1.6.1 |
| 37 | Faċilità ta’ likwidità impenjata? | Iva | # 38 |
| mhux applikabbli | mhux applikabbli |
| 38 | F’IPS jew netwerk kooperattiv ittrattat bħala assi likwidu mill-istituzzjoni depożitanti? | Iva | ID 1.1.6.2.7 |
| Le | # 39 |
| 39 | Fi grupp jew IPS soġġetta għal trattament preferenzjali? | Iva | ID 1.1.6.2.6 |
| Le | # 40 |
| 40 | Lil SSPEs? | Iva | Alloka f’entrata rilevanti waħda tal-ID 1.1.6.2.4. |
| Le | # 41 |
| 41 | Lil kumpaniji ta’ investiment personali? | Iva | ID 1.1.6.2.3 |
| Le | Alloka f’entrata waħda rilevanti li jifdal tal-ID 1.1.6.2 |
| 42 | Prodott jew servizz ieħor f’konformità mal-Artikolu 23 tad-DA? | Iva | # 43 |
| Le | **Tirrapportax** |
| 43 | Prodott relatat mal-finanzjament tal-kummerċ barra l-karta bilanċjali? | Iva | ID1.1.7.8. |
| Le | # 44 |
| 44 | Avvanzi u self mhux prelevati lil kontropartijiet fil-livell ta’ operatur? | Iva | ID 1.1.7.2 |
| Le | # 45 |
| 45 | Ipoteki li ġew miftiehma iżda li għadhom ma ġewx prelevati | Iva | ID 1.1.7.3 |
| Le | # 46 |
| 46 | Flussi ta’ ħruġ ippjanati relatati mat-tiġdid jew l-estensjoni ta’ self ġdid lill-konsumaturi jew lill-operaturi? | Iva | ID 1.1.7.6 |
| Le | **#** 47 |
| 47 | Karti tal-kreditu? | Iva | ID 1.1.7.4 |
| Le | # 48 |
| 48 | Self kurrenti? | Iva | ID 1.1.7.5 |
| Le | # 49 |
| 49 | Derivattivi pagabbli? | Iva | ID1.1.7.7. |
| Le | # 50 |
| 50 | Obbligi oħrajn li ma jidhrux fil-karta tal-bilanċ jew ta’ finanzjament kontinġenti? | Iva | ID1.1.7.1. |
| Le | ID 1.1.7.9 |
| 51 | Titolu ta’ dejn diġà rapportat fl-entrata 1.1.8.2 ta’ C 73.00? | Iva | **Tirrapportax** |
| Le | # 52 |
| 52 | Rekwiżit tal-likwidità għal derivattivi skont l-Artikolu 30.4 tad-DA diġà kkunsidrat fil-mistoqsija #29? | Iva | **Tirrapportax** |
| Le | Alloka fl-entrati rilevanti tal-ID 1.1.5 |

1.3. Struzzjonijiet dwar kolonni speċifiċi

|  |  |
| --- | --- |
| Kolonna | Referenzi legali u struzzjonijiet |
| 0010 | **L-Ammont**  1.1. Struzzjonijiet speċifiċi dwar tranżazzjonijiet/depożiti mhux garantiti:  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-bilanċ pendenti ta’ diversi kategoriji ta’ obbligazzjonijiet u impenji barra l-karta bilanċjali kif speċifikat fl-Artikoli 22 sa 31 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Soġġett għall-approvazzjoni minn qabel tal-awtorità kompetenti f’kull kategorija ta’ flussi ta’ ħruġ, l-ammont ta’ kull entrata rapportata fil-kolonna 0010 tal-Formula C 73.00 tal-Anness XXIV għandu jiġi nnettjat billi jitnaqqas l-ammont rilevanti ta’ fluss ta’ dħul interdipendenti skont l-Artikolu 26.  1.2. Struzzjonijiet dwar għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali:  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-bilanċ pendenti tal-obbligazzjonijiet li jirrappreżentaw l-komponent ta’ flus tat-tranżazzjoni garantita skont l-Artikolu 22(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0020 | **Valur tas-suq tal-kollateral estiż**  Struzzjonijiet dwar għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali:  Hawnhekk l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-valur tas-suq ta’ kollateral estiż li huwa kkalkolat bħala l-valur tas-suq attwali gross bil-haircut u nett mill-flussi li jirriżultaw mill-istralċ tal-ħeġġijiet assoċjati (skont l-Artikolu 8(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 u soġġett għall-kundizzjonijiet li ġejjin:  — Meta istituzzjoni ta’ kreditu tista’ tirrikonoxxi biss parti mill-azzjonijiet tagħha f’munita barranija, jew assi f’munita barranija tal-gvern ċentrali jew tal-bank, jew assi fil-munita domestika tal-gvern ċentrali jew tal-bank ċentrali fl-HQLA tagħhom, il-parti rikonoxxibbli biss għandha tiġi rrapportata fir-ringieli tal-assi tal-Livell 1, tal-Livell 2A u tal-Livell 2B skont il-punt (c)(ii) tal-Artikolu 12(1) u l-punt (d) tal-Artikolu 10(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. Fejn l-assi partikolari jintuża bħala kollateral iżda f’ammont li huwa ikbar mill-porzjon li jista’ jiġi rikonoxxut f’assi likwidi, l-ammont b’surplus għandu jkun irrapportat fit-taqsima tal-mhux likwidi;  — Assi tal-Livell 2A għandhom ikunu rrapportati fir-ringiela tal-assi L2A korrispondenti, anki jekk ikun qed jiġi segwit l-Approċċ Alternattiv ta’ Likwidità (jiġifieri ċċaqlaqx L2A lejn L1 fir-rapportar tat-tranżazzjoni garantita). |
| 0030 | **Valur tal-kollateral estiż skont l-Artikolu 9**  Struzzjonijiet dwar għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali:  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-valur tal-kollateral estiż skont l-Artikolu 9 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. Dan jiġi kalkulat billi tiġi mmultiplikata l-kolonna 0020 tal-Formula C 73.00 tal-Anness XXIV bil-ponderazzjoni/haircut applikabbli mill-Formula C 72.00 tal-Anness XXIV li tikkorrispondi għat-tip ta’ assi. Il-kolonna 0030 tal-Formula C 73.00 tal-Anness XXIV tintuża fil-kalkolu tal-ammont aġġustat ta’ assi likwidi fil-formula C 76.00 tal-Anness XXIV. |
| 0040 | **Ponderazzjoni Standard**  L-Artikoli 24 sa 31a tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Il-ponderazzjoniijiet standard fil-kolonna 0040 huma dawk speċifikati b’mod prestabbilit fir-Regolament Delegat (UE) 2015/61 u huma pprovduti għall-informazzjoni biss. |
| 0050 | **Ponderazzjoni Applikabbli**  Kemm garantiti kif ukoll mhux garantiti:  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-ponderazzjoniijiet applikabbli. Dawn il-ponderazzjoniijiet huma dawk speċifikati fl-Artikoli 22 sa 31a tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. Il-ponderazzjonijiet applikabbli jistgħu jirriżultaw f’valuri medji ponderati u għandhom ikunu rrapportati f’termini deċimali (jiġifieri 1,00 għal ponderazzjoni applikabbli ta’ 100 fil-mija, jew 0,50 għal ponderazzjoni applikabbli ta’ 50 fil-mija). Il-ponderazzjonijiet applikabbli jistgħu jirriflettu, iżda mhumiex limitati għal, diskrezzjonijiet speċifiċi għall-kumpanija u diskrezzjonijiet nazzjonali. |
| 0060 | **Fluss ta’ ħruġ**  Kemm garantiti kif ukoll mhux garantiti:  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ta’ ħruġ. Dawk il-flussi ta’ ħruġ huma kkalkolati billi l-kolonna 0010 C 73.00 tal-Anness XXIV tiġi mmultiplikata bil-kolonna 0050 C 73.00 tal-Anness XXIV. |

1.4. Struzzjonijiet dwar ringieli speċifiċi

|  |  |
| --- | --- |
| Ringiela | Referenzi legali u struzzjonijiet |
| 0010 | **1. FLUSSI TA’ ĦRUĠ**  Il-Kapitolu 2 tat-Titolu III tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk dwar il-flussi ta’ ħruġ skont il-Kapitolu 2 tat-Titolu III tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0020 | **1.1. Flussi ta’ ħruġ minn tranżazzjonijiet/depożiti mhux garantiti**  L-Artikoli 20 sa 31a tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk dwar il-flussi ta’ ħruġ skont l-Artikoli 21 sa 31a tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, bl-eċċezzjoni tal-flussi ta’ ħruġ irrapportati skont l-Artikolu 28(3) u (4) ta’ dak ir-Regolament Delegat. |
| 0030 | **1.1.1. Depożiti fil-livell tal-konsumatur**  L-Artikoli 24 u 25 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk dwar id-depożiti fil-livell ta’ konsumatur kif definit fl-Artikolu 411(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom ukoll jirrapportaw fil-kategorija xierqa tad-depożiti fil-livell tal-konsumatur l-ammont tan-noti, bonds u titoli oħrajn maħruġin li jinbiegħu b’mod esklussiv fis-suq tal-konsumatur u miżmuma f’kont fil-livell tal-konsumatur, kif imsemmi fl-Artikolu 28(6) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. Għal din il-kategorija ta’ obbligazzjonijiet l-istituzzjonijiet ta’ kreditu se jikkunsidraw ir-rati ta’ flussi ta’ ħruġ applikabbli previsti fir-Regolament Delegat (UE) 2015/61 għall-kategoriji differenti ta’ depożiti fil-livell tal-konsumatur. Għaldaqstant, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw bħala ponderazzjoni applikabbli l-medja tal-ponderazzjoniijiet applikabbli rilevanti għal dawn id-depożiti. |
| 0035 | **1.1.1.1. depożiti eżentati mill-kalkolu tal-flussi ta’ ħruġ**  L-Artikolu 25(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Hawnhekk l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw dawk il-kategoriji ta’ depożiti fil-livell tal-konsumatur eżentati mill-kalkolu tal-flussi ta’ ħruġ jekk il-kundizzjonijiet tal-punti (a) u (b) tal-Artikolu 25(4) ikunu ġew issodisfati. |
| 0040 | **1.1.1.2. depożiti fejn il-ħlas ikun ġie miftiehem fit-30 jum ta’ wara**  L-Artikolu 25(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Meta jkun ġie miftiehem il-ħlas l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk id-depożiti b’maturità residwali ta’ inqas minn 30 jum. |
| 0050 | **1.1.1.3. depożiti soġġetti għal flussi ta’ ħruġ ogħla**  L-Artikoli 25(2) u (3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-bilanċ sħiħ tad-depożiti soġġetti għal rati ta’ fluss ta’ ħruġ ogħla skont l-Artikolu 25(2) u (3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. Dawk id-depożiti fil-livell tal-konsumatur fejn il-valutazzjoni taħt l-Artikolu 25(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 għall-kategorizzazzjoni tagħhom ma tkunx saret jew ma tkunx tlestiet ukoll għandhom ikunu rrapportati hawnhekk. |
| 0060 | **1.1.1.3.1. Kategorija 1**  L-Artikolu 25(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont tal-bilanċ pendenti kollu ta’ kull depożitu fil-livell tal-konsumatur li jissodisfa l-kriterji fil-punt (a) jew tnejn mill-kriterji fil-punti (b) sa (e) tal-Artikolu 25(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, sakemm dawn id-depożiti ma jkunux ittieħdu f’pajjiżi terzi fejn jiġi applikat fluss ta’ ħruġ ogħla skont l-Artikolu 25(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, f’liema każ għandhom jiġu rrapportati f’din il-kategorija tal-aħħar.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw bħala ponderazzjoni applikabbli l-medja tar-rati, kemm dawk ir-rati standard previsti b’mod prestabbilit fil-punt (a) tal-Artikolu 25(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 jew oħrajn ogħla jekk applikati minn awtorità kompetenti, li ġew applikati b’mod effettiv fuq l-ammont sħiħ ta’ kull depożitu msemmi fil-paragrafu preċedenti u ponderat bl-ammonti korrispondenti ċċitati. |
| 0070 | **1.1.1.3.2. Kategorija 2**  L-Artikolu 25(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont tal-bilanċ pendenti kollu ta’ kull depożitu fil-livell tal-konsumatur li jissodisfa l-kriterji fil-punt (a) tal-Artikolu 25(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 u mill-inqas kriterju ieħor imsemmi fl-Artikolu 25(2) jew tliet kriterji jew aktar tal-Artikolu 25(2) sakemm dawn id-depożiti ma jkunux ittieħdu f’pajjiżi terzi fejn jiġi applikat fluss ta’ ħruġ ogħla skont l-Artikolu 25(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, f’liema każ għandhom jiġu rrapportati f’din il-kategorija tal-aħħar.  Dawk id-depożiti fil-livell tal-konsumatur fejn il-valutazzjoni taħt l-Artikolu 25(2) għall-kategorizzazzjoni tagħhom ma tkunx saret jew ma tkunx tlestiet ukoll għandhom ikunu rrapportati hawnhekk.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw bħala ponderazzjoni applikabbli l-medja tar-rati, jew dawk ir-rati standard previsti b’inadempjenza fil-punt (b) tal-Artikolu 25(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, jew oħrajn ogħla jekk applikati minn awtorità kompetenti, li jkunu ġew applikati fuq l-ammont sħiħ ta’ kull depożitu msemmi fil-paragrafi preċedenti u ppeżati bl-ammonti korrispondenti ċċitati. |
| 0080 | **1.1.1.4. depożiti stabbli**  L-Artikolu 24 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-parti tal-ammonti tad-depożiti fil-livell tal-konsumatur koperti minn Skema ta’ Garanzija tad-Depożiti skont id-Direttiva 94/19/KE jew id-Direttiva 2014/49/UE jew skema ekwivalenti ta’ garanzija tad-depożiti f’pajjiż terz u jew hija parti minn relazzjoni stabbilita li tagħmel il-prelevament ferm improbabbli jew jinżamm f’kont tranżazzjonali skont l-Artikolu 24(2) u (3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 rispettivament u fejn:  — Dawk id-depożiti ma jissodisfawx il-kriterji għal rata ta’ fluss ta’ ħruġ ogħla stabbiliti fl-Artikolu 25(2), (3) u (5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 f’liema każ dawn għandhom ikunu rrapportati bħala depożiti soġġetti għal flussi ta’ ħruġ ogħla; jew  — Dawk id-depożiti ma ttiħdux f’pajjiżi terzi fejn huwa applikat fluss ’il barra ogħla skont l-Artikolu 25(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, f’liema każ għandhom ikunu rrapportati f’din il-kategorija;  — Id-deroga speċifikata fl-Artikolu 24(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 mhijiex applikabbli. |
| 0090 | **1.1.1.5. Depożiti stabbli derogati**  L-Artikolu 24(4) u (6) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-parti tal-ammonti tad-depożiti fil-livell tal-konsumatur li hija koperta minn Skema ta’ Garanzija tad-Depożiti skont id-Direttiva 2014/49/UE sa livell massimu ta’ EUR 100,000 u jew hija parti minn relazzjoni stabbilita li tagħmel il-prelevament ferm improbabbli jew jinżamm f’kont tranżazzjonali skont l-Artikolu 24(2) u (3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 rispettivament u fejn:  Dawk id-depożiti ma jissodisfawx il-kriterji għal rata ta’ fluss ta’ ħruġ ogħla stabbiliti fl-Artikolu 25(2), (3) u (5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 f’liema każ dawn għandhom ikunu rrapportati bħala depożiti soġġetti għal flussi ta’ ħruġ ogħla; jew  — Dawk id-depożiti ma ttiħdux f’pajjiżi terzi fejn huwa applikat fluss ’il barra ogħla skont l-Artikolu 25(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 f’liema każ għandhom ikunu rrapportati f’din il-kategorija;  — Tapplika d-deroga prevista fl-Artikolu 24(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0100 | **1.1.1.6. depożiti f’pajjiżi terzi fejn jiġi applikat fluss ta’ ħruġ ogħla**  L-Artikolu 25(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont ta’ depożiti fil-livell tal-konsumatur meħudin f’pajjiż terz fejn fluss ta’ ħruġ ogħla huwa applikat skont il-liġi nazzjonali li tistabbilixxi rekwiżiti ta’ likwidità f’dak il-pajjiż terz. |
| 0110 | **1.1.1.7. depożiti fil-livell ta’ konsumatur oħrajn**  L-Artikolu 25(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont ta’ depożiti oħrajn fil-livell tal-konsumatur minn dawk koperti fl-entrati preċedenti. |
| 0120 | **1.1.2. Depożiti operazzjonali**  L-Artikolu 27 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Hawnhekk l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-parti tad-depożiti operazzjonali ddeterminati skont l-Artikolu 27 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, li huma meħtieġa għall-provvista ta’ servizzi operazzjonali. Depożiti li jirriżultaw minn relazzjoni bankarja korrispondenti jew mill-provvista ta’ servizzi ta’ senserija primarja għandhom jitqiesu bħala depożiti mhux operazzjonali kif stabbilit fl-Artikolu 27(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Il-parti tad-depożiti operazzjonali li taqbeż l-ammont meħtieġ għall-provvista ta’ servizzi operazzjonali ma għandhiex tiġi rrapportata hawnhekk iżda għandha tiġi rrapportata skont l-id 1.1.3. |
| 0130 | **1.1.2.1. miżmuma għall-ikklerjar, kustodja, immaniġġjar tal-flus jew servizzi komparabbli oħra fil-kuntest ta’ relazzjoni operattiva stabbilita**  Il-punt (a) tal-Artikolu 27(1), l-Artikolu 27(2) u (4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw dwar id-depożiti miżmumin mid-depożitant sabiex jinkisbu servizzi ta’ kklerjar, kustodja jew ta’ mmaniġġjar tal-flus jew servizzi komparabbli oħrajn fil-kuntest ta’ relazzjoni stabbilita, kif imsemmi fil-punt (a) tal-Artikolu 27(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, li huma ta’ importanza kritika għad-depożitant kif imsemmi fl-Artikolu 27(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61; fondi li jaqbżu dawk meħtieġa għall-forniment ta’ servizzi operazzjonali għandhom jiġu ttrattati bħala depożiti mhux operazzjonali kif imsemmi fl-aħħar sentenza tal-Artikolu 27(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Għandhom jiġu rrapportati biss id-depożiti li jkollhom limitazzjonijiet legali jew operazzjonali sinifikanti li minħabba fihom ikun mhux probabbli li jsiru prelevamenti sinifikanti fi żmien 30 jum tal-kalendarju, kif imsemmi fit-tieni sentenza tal-Artikolu 27(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw b’mod separat, l-ammont ta’ dawk id-depożiti koperti u mhux koperti minn Skema ta’ Garanzija tad-Depożiti jew skema ta’ garanzija tad-depożiti ekwivalenti ta’ pajjiż terz li jissemmew fl-Artikolu 27(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, kif speċifikat fl-entrati tal-istruzzjonijiet li ġejjin. |
| 0140 | **1.1.2.1.1. koperti minn SGD (Skema ta’ Garanzija tad-Depożiti)**  Il-punt (a) tal-Artikolu 27(1), l-Artikolu 27(2) u (4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-porzjon tal-bilanċ pendenti tad-depożiti operazzjonali miżmuma fil-kuntest ta’ relazzjoni operazzjonali stabbilita li tissodisfa l-kriterji stabbiliti fil-punt (a) tal-Artikolu 27(1) u l-Artikolu 27(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 u li hija koperta minn Skema ta’ Garanzija tad-Depożiti skont id-Direttiva 94/19/KE, jew id-Direttiva 2014/49/UE jew skema ekwivalenti ta’ garanzija tad-depożiti f’pajjiż terz. |
| 0150 | **1.1.2.1.2. mhux koperti minn SGD**  Il-punt (a) tal-Artikolu 27(1), l-Artikolu 27(2) u (4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-porzjon tal-bilanċ pendenti tad-depożiti operazzjonali fil-kuntest ta’ relazzjoni operazzjonali stabbilita li tissodisfa l-kriterji stabbiliti fil-punt (a) tal-Artikolu 27(1) u l-Artikolu 27(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 u li mhijiex koperta minn Skema ta’ Garanzija tad-Depożiti skont id-Direttiva 94/19/KE, jew id-Direttiva 2014/49/UE jew skema ekwivalenti ta’ garanzija tad-depożiti f’pajjiż terz. |
| 0160 | **1.1.2.2. miżmuma fil-kuntest tal-IPS (Skema ta’ Protezzjoni Istituzzjonali) jew netwerk kooperattiv**  Il-punt (b) tal-Artikolu 27(1) u l-Artikolu 27(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk dwar depożiti miżmumin fil-kuntest ta’ kondiviżjoni komuni tal-kompiti fi skema ta’ protezzjoni istituzzjonali li tissodisfa r-rekwiżiti tal-Artikolu 113(7) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 jew fi ħdan grupp ta’ istituzzjonijiet ta’ kreditu kooperattivi affiljati b’mod permanenti ma’ korp ċentrali li jissodisfa r-rekwiżiti tal-Artikolu 113(6) tal-istess Regolament, jew bħala depożitu minimu legali jew kuntrattwalment stabbilit minn istituzzjoni ta’ kreditu oħra li hija Membru tal-istess skema ta’ protezzjoni istituzzjonali jew netwerk kooperattiv, kif stabbilit fil-punt (b) tal-Artikolu 27(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw dawk id-depożiti f’ringieli differenti skont jekk humiex ittrattati bħala assi likwidi mill-istituzzjoni ta’ kreditu depożitanti jew le, skont l-Artikolu 27(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0170 | **1.1.2.2.1. mhux ittrattati bħala assi likwidi għall-istituzzjoni depożitanti**  Il-punt (b) tal-Artikolu 27(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont tal-bilanċ pendenti ta’ depożiti miżmumin fil-kuntest ta’ netwerk kooperattiv jew skema ta’ protezzjoni istituzzjonali skont il-kriterji stabbiliti fil-punt (b) tal-Artikolu 27(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, dment li dawk id-depożiti ma jkunux rikonoxxuti bħala assi likwidi għall-istituzzjoni ta’ kreditu depożitanti. |
| 0180 | **1.1.2.2.2. trattati bħala assi likwidi għall-istituzzjoni ta’ kreditu depożitanti**  Il-punt (b) tal-Artikolu 27(1) u l-Artikolu 27(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw depożiti mill-istituzzjonijiet ta’ kreditu pjazzati fl-istituzzjoni ta’ kreditu ċentrali li huma kkunsidrati bħala assi likwidi għall-istituzzjoni ta’ kreditu depożitanti skont l-Artikolu 16 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont ta’ dawn id-depożiti sal-ammont tal-assi likwidi korrispondenti wara l-haircut, kif stabbilit fl-Artikolu 27(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0190 | **1.1.2.3. miżmuma fil-kuntest ta’ relazzjoni operattiva stabbilita (oħra) ma’ klijenti mhux finanzjarji**  Il-punt (c) tal-Artikolu 27(1), l-Artikolu 27(4) u (6) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont tal-bilanċ pendenti ta’ depożiti miżmumin minn konsumatur mhux finanzjarju fil-kuntest ta’ relazzjoni operazzjonali stabbilita għajr dik imsemmija fil-punt (a) tal-Artikolu 27(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, u soġġetta għar-rekwiżiti stabbiliti fl-Artikolu 27(6) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Għandhom jiġu rrapportati biss dawk id-depożiti li jkollhom limitazzjonijiet legali jew operazzjonali sinifikanti li minħabba fihom ikun mhux probabbli li jsiru prelevamenti sinifikanti fi żmien 30 jum tal-kalendarju kif imsemmija fl-Artikolu 27(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0200 | **1.1.2.4. miżmuma biex jinkisbu servizzi ta’ kklerjar ta’ flus kontanti u istituzzjonijiet ċentrali ta’ kreditu f’netwerk**  Il-punt (d) tal-Artikolu 27(1) u l-Artikolu 27(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont tal-bilanċ pendenti ta’ depożiti miżmumin mid-depożitant sabiex jinkisbu servizzi ta’ kklerjar tal-flus u ta’ istituzzjoni ċentrali, u meta l-istituzzjoni ta’ kreditu tkun tappartjeni għal wieħed min-netwerks jew waħda mill-iskemi msemmi fl-Artikolu 16 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, kif stabbilit fil-punt (d) tal-Artikolu 27(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. Dawk is-servizzi ta’ kklerjar ta’ flus u ta’ istituzzjoni ta’ kreditu ċentrali jkopru biss dawk is-servizzi sakemm jingħataw fil-kuntest ta’ relazzjoni stabbilita li hija ta’ importanza kritika għad-depożitant kif imsemmi fl-ewwel sentenza tal-Artikolu 27(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61; fondi li jaqbżu dawk meħtieġa għall-forniment ta’ servizzi operazzjonali għandhom jiġu ttrattati bħala depożiti mhux operazzjonali kif imsemmi fl-aħħar sentenza tal-Artikolu 27(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61).  Għandhom jiġu rrapportati biss dawk id-depożiti li jkollhom limitazzjonijiet legali jew operazzjonali sinifikanti li minħabba fihom ikun mhux probabbli li jsiru prelevamenti sinifikanti fi żmien 30 jum tal-kalendarju kif imsemmija fl-Artikolu 27(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0203 | **1.1.3 Depożiti operazzjonali eċċessivi**  L-Artikolu 27(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Hawnhekk l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-parti tad-depożiti operazzjonali li tkun ogħla minn dawk meħtieġa għall-provvista ta’ servizzi operazzjonali. |
| 0204 | **1.1.3.1 depożiti minn klijenti finanzjarji**  L-Artikolu 27(4) u 31a(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-parti tad-depożiti operazzjonali minn klijenti finanzjarji li jaqbżu dawk meħtieġa għall-forniment ta’ servizzi operazzjonali skont l-Artikolu 27(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0205 | **1.1.3.2 depożiti minn klijenti oħra**  L-Artikoli 27(4) u 28(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-parti tad-depożiti operazzjonali minn klijenti li mhumiex klijenti finanzjarji, u esklużi depożiti fil-livell tal-konsumatur, li jaqbżu dawk meħtieġa għall-forniment ta’ servizzi operazzjonali kif imsemmi fl-aħħar sentenza tal-Artikolu 27(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Dawn id-depożiti operazzjonali eċċessi għandhom ikunu rrapportati f’żewġ ringieli differenti skont jekk l-ammont sħiħ tad-depożitu operazzjonali eċċess huwiex kopert (minn Skema ta’ Garanzija tad-Depożiti jew Skema ta’ Garanzija tad-Depożiti ekwivalenti ta’ pajjiż terz). |
| 0206 | **1.1.3.2.1 koperti minn SGD**  L-Artikoli 27(4) u 28(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk l-ammont sħiħ tal-bilanċ pendenti ta’ dawn id-depożiti operazzjonali eċċessi miżmumin minn konsumaturi oħrajn jekk dak l-ammont sħiħ ikun kopert minn Skema ta’ Garanzija tad-Depożiti skont id-Direttiva 94/19/KE jew id-Direttiva 2014/48/KE jew Skema ta’ Garanzija tad-Depożiti ekwivalenti f’pajjiż terz kif imsemmi fl-Artikolu 28(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0207 | **1.1.3.2.2 mhux kopert minn SGD**  L-Artikoli 27(4) u 28(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk l-ammont sħiħ tal-bilanċ pendenti ta’ dawn id-depożiti operazzjonali eċċessi miżmumin minn konsumaturi oħrajn jekk dak l-ammont sħiħ ma jkunx kopert minn Skema ta’ Garanzija tad-Depożiti skont id-Direttiva 94/19/KE jew id-Direttiva 2014/48/KE jew Skema ta’ Garanzija tad-Depożiti ekwivalenti f’pajjiż terz kif imsemmi fl-Artikolu 28(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0210 | **1.1.4. Depożiti mhux operazzjonali**  L-Artikoli 27(5), 28(1) u 31(9) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk dwar depożiti mhux garantiti msemmija fl-Artikolu 28(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 u dawk li jirriżultaw minn relazzjoni bankarja korrispondenti jew mill-forniment ta’ servizzi ta’ senserija primarja kif imsemmi fl-Artikolu 27(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw b’mod separat, bl-eċċezzjoni tal-obbligazzjonijiet li jirriżultaw minn relazzjoni bankarja korrispondenti jew mill-forniment ta’ servizzi ta’ senserija primarja kif imsemmi fl-Artikolu 27(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, id-depożiti mhux operazzjonali koperti u mhux koperti minn Skema ta’ Garanzija tad-Depożiti jew skema ta’ garanzija tad-depożiti ekwivalenti ta’ pajjiż terz, kif speċifikat fl-entrati li ġejjin tal-istruzzjonijiet.  Il-parti tad-depożiti operazzjonali li taqbeż dawk meħtieġa għall-provvista ta’ servizzi operazzjonali ma għandhiex tiġi rrapportata hawnhekk iżda għandha tiġi rrapportata skont l-id 1.1.3. |
| 0220 | **1.1.4.1. ibbankjar korrispondenti u provvedimenti ta’ depożiti ta’ senserija primarja**  L-Artikolu 27(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont tal-bilanċ pendenti ta’ depożiti li jirriżultaw minn relazzjoni bankarja korrispondenti jew mill-forniment ta’ servizzi ta’ senserija primarja kif imsemmija fl-Artikolu 27(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0230 | **1.1.4.2. depożiti minn klijenti finanzjarji**  L-Artikolu 31a(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont tal-bilanċ pendenti ta’ depożiti miżmumin minn klijenti finanzjarji diment li ma jkunux ikkunsidrati bħala depożiti operazzjonali skont l-Artikolu 27 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0240 | **1.1.4.3. depożiti minn klijenti oħra**  L-Artikolu 28(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw dwar id-depożiti miżmumin minn konsumaturi oħrajn (minbarra klijenti finanzjarji u konsumaturi kkunsidrati għad-depożiti fil-livell tal-konsumatur) kif imsemmi fl-Artikolu 28(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, sa fejn dawk id-depożiti ma jkunux ikkunsidrati bħala depożiti operazzjonali skont l-Artikolu 27 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Dawk id-depożiti għandhom ikunu rrapportati f’żewġ ringieli differenti skont jekk l-ammont sħiħ tad-depożitu huwiex kopert (minn Skema ta’ Garanzija tad-Depożiti jew Skema ta’ Garanzija tad-Depożiti ekwivalenti ta’ pajjiż terz). |
| 0250 | **1.1.4.3.1. koperti minn SGD**  L-Artikolu 28(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk l-ammont sħiħ tal-bilanċ pendenti ta’ dawn id-depożiti miżmumin minn konsumaturi oħrajn jekk dak l-ammont sħiħ ikun kopert minn Skema ta’ Garanzija tad-Depożiti skont id-Direttiva 94/19/KE jew id-Direttiva 2014/48/KE jew Skema ta’ Garanzija tad-Depożiti ekwivalenti f’pajjiż terz kif imsemmi fl-Artikolu 28(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0260 | **1.1.4.3.2. mhux koperti minn SGD**  L-Artikolu 28(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk l-ammont sħiħ tal-bilanċ pendenti ta’ dawn id-depożiti miżmumin minn konsumaturi oħrajn jekk dak l-ammont sħiħ ma jkunx kopert minn Skema ta’ Garanzija tad-Depożiti skont id-Direttiva 94/19/KE jew id-Direttiva 2014/48/KE jew Skema ta’ Garanzija tad-Depożiti ekwivalenti f’pajjiż terz kif imsemmi fl-Artikolu 28(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0270 | **1.1.5. Flussi ta’ ħruġ addizzjonali**  L-Artikolu 30 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Hawnhekk l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-flussi ta’ ħruġ addizzjonali kif imsemmija fl-Artikolu 30 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Depożiti riċevuti bħala kollateral, kif imsemmi fl-Artikolu 30(7) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, ma għandhomx jitqiesu bħala obbligazzjonijiet għall-finijiet tal-Artikolu 24, 25, 27 jew 31a tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, iżda għandhom ikunu soġġetti għall-Artikolu 30(1) sa (6) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, fejn applikabbli. |
| 0280 | **1.1.5.1. kollateral għajr assi tal-Livell 1 depożitati għal derivattivi**  L-Artikolu 30(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-valur tas-suq ta’ kollateral ieħor għajr tal-Livell 1 li huwa depożitat għall-kuntratti elenkati fl-Anness II tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 u derivattivi ta’ kreditu. |
| 0290 | **1.1.5.2. kollateral ta’ assi ta’ Bonds Koperti EHQ tal-Livell 1 depożitati għal derivattivi**  L-Artikolu 30(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-valur tas-suq ta’ kollateral ta’ Bonds Koperti EHQ tal-Livell 1 li huwa depożitati għall-kuntratti elenkati fl-Anness II tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 u derivattivi ta’ kreditu. |
| 0300 | **1.1.5.3. flussi ta’ ħruġ materjali minħabba deterjorament tal-kwalità tal-kreditu proprja**  L-Artikolu 30(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont totali ta’ flussi ta’ ħruġ addizzjonali li kkalkolaw u nnotifikaw lill-awtoritajiet kompetenti skont l-Artikolu 30(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Jekk ammont soġġett għal fluss ta’ ħruġ minħabba deterjorament tal-kwalità tal-kreditu proprja jkun ġie rrapportat xi mkien ieħor f’ringiela b’ponderazzjoni ta’ inqas minn 100 %, f’dak il-każ għandu jiġi rrapportat ukoll ammont fir-ringiela 0300 b’tali mod li s-somma tal-flussi ta’ ħruġ tkun fluss ta’ ħruġ ta’ 100 % fit-total għat-tranżazzjoni. |
| 0310 | **1.1.5.4. impatt ta’ xenarju negattiv tas-suq fuq tranżazzjonijiet derivattivi**  L-Artikolu 30(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont ta’ flussi ta’ ħruġ kkalkulat skont ir-Regolament Delegat tal-Kummissjoni (UE) 2017/208. |
| 0340 | **1.1.5.5. flussi ta’ ħruġ minn derivattivi**  L-Artikolu 30(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont ta’ flussi ta’ ħruġ mistennija fuq perjodu ta’ 30 jum tal-kalendarju mill-kuntratti elenkati fl-Anness II tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 u minn derivattivi ta’ kreditu kkalkolat skont l-Artikolu 21 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Għall-każijiet ta’ rapportar f’munita separata, skont l-Artikolu 415(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, huma biss l-istituzzjonijiet ta’ kreditu li għandhom jirrapportaw flussi ta’ ħruġ li jseħħu biss fil-munita sinifikanti rispettiva. In-netting skont il-kontroparti jista’ jiġi applikat biss għall-flussi f’dik il-munita, pereżempju Kontroparti A: EUR+10 u Kontroparti A: EUR-20 għandhom ikunu rrapportati bħala fluss ta’ ħruġ ta’ EUR10. Ma jistax isir netting bejn il-kontropartijiet, pereżempju Kontroparti A: EUR- 10, Kontroparti B: EUR+40 għandu jiġi rrapportat bħala fluss ta’ ħruġ ta’ EUR10 f’C73.00 (u influss ta’ EUR40 f’C74.00). |
| 0350 | **1.1.5.6. pożizzjonijiet qosra**  L-Artikolu 30(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Jekk l-istituzzjoni ta’ kreditu jkollha pożizzjoni bin-nieqes li tkun koperta minn teħid b’self ta’ titolu mhux garantit, l-istituzzjoni ta’ kreditu għandha żżid fluss ta’ ħruġ addizzjonali li jkun jikkorrispondi għal 100 % tal-valur tas-suq tat-titoli jew ta’ assi oħrajn mibjugħa bin-nieqes, sakemm it-termini li fuqhom ikunu meħuda b’self mill-istituzzjoni ta’ kreditu ma jkunux jirrikjedu r-ritorn tagħhom biss wara 30 jum kalendarju. Jekk il-pożizzjoni qasira tkun koperta minn tranżazzjoni ta’ finanzjament ta’ titoli kollateralizzati, l-istituzzjoni ta’ kreditu għandha tassumi li l-pożizzjoni qasira se tinżamm matul il-perjodu ta’ 30 jum kalendarju u tirċievi fluss ta’ ħruġ ta’ 0 %. |
| 0360 | **1.1.5.6.1. kopert minn SFT kollateralizzat (tranżazzjonijiet ta’ finanzjament tat-titoli)**  L-Artikolu 30(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-valur tas-suq ta’ titoli jew assi oħrajn mibjugħin bin-nieqes li huma koperti minn tranżazzjonijiet ta’ finanzjament tat-titoli kollateralizzati u li għandhom jiġu kkonsenjati fi żmien 30 jum tal-kalendarju sakemm l-istituzzjoni ta’ kreditu ma tkunx isselfithom b’termini li jeħtieġu r-ritorn tagħhom biss wara perjodu ta’ 30 jum tal-kalendarju. |
| 0370 | **1.1.5.6.2. oħrajn**  L-Artikolu 30(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-valur tas-suq ta’ titoli jew assi oħrajn mibjugħin bin-nieqes minbarra dawk li huma koperti minn tranżazzjonijiet ta’ finanzjament tat-titoli kollateralizzati u li għandhom jiġu kkonsenjati fi żmien 30 jum tal-kalendarju sakemm l-istituzzjoni ta’ kreditu ma tkunx isselfithom b’termini li jeħtieġu r-ritorn tagħhom biss wara perjodu ta’ 30 jum tal-kalendarju. |
| 0380 | **1.1.5.7. kollateral f’eċċess eżerċitabbli**  Il-punt (a) tal-Artikolu 30(6) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-valur tas-suq tal-kollateral eċċessiv li l-istituzzjoni ta’ kreditu jkollha, li huwa kuntrattwalment eżerċitabbli fi kwalunkwe ħin mill-kontroparti. |
| 0390 | **1.1.5.8. kollateral dovut**  Il-punt (b) tal-Artikolu 30(6) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-valur tas-suq tal-kollateral li huwa dovut li jrid jingħata lil kontroparti fi żmien 30 jum tal-kalendarju. |
| 0400 | **1.1.5.9. kollateral ta’ assi likwidi skambjabbli għal assi mhux likwidi**  Il-punt (c) tal-Artikolu 30(6) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-valur tas-suq tal-kollateral li jikkwalifika bħala assi likwidi għall-finijiet tat-Titolu II li jistgħu jiġu sostitwiti għall-assi li jikkorrispondu għal assi li ma jkunux jikkwalifikaw bħala assi likwidi għall-finijiet tat-Titolu II mingħajr il-kunsens tal-istituzzjoni. |
| 0410 | **1.1.5.10. telf ta’ finanzjament fuq attivitajiet ta’ finanzjament strutturat**  L-Artikolu 30(8) sa 30(10) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jassumu fluss ta’ ħruġ ta’ 100 % għal telf ta’ finanzjament minn titoli garantiti b’assi, bonds koperti u strumenti oħrajn ta’ finanzjament strutturati li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju maħruġin mill-istituzzjoni ta’ kreditu jew minn veikoli jew SPVs sponsorjati.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu li huma fornituri ta’ faċilitajiet ta’ likwidità assoċjati ma għandhomx bżonn li jgħoddu darbtejn l-istrument ta’ finanzjament maturat u l-faċilità ta’ likwidità għall-programmi konsolidati. |
| 0420 | **1.1.5.10.1. strumenti ta’ finanzjament strutturati**  L-Artikolu 30(8) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont pendenti attwali ta’ obbligazzjonijiet proprji jew obbligazzjonijiet ta’ veikoli sponsorjati jew SPVs minn titoli garantiti b’assi, bonds koperti u strumenti oħrajn ta’ finanzjament strutturati li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju. |
| 0430 | **1.1.5.10.2. faċilitajiet ta’ finanzjament**  L-Artikolu 30(9) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont li jimmatura ta’ obbligazzjonijiet minn karti kummerċjali garantiti b’assi, veikoli, veikoli ta’ investiment tat-titoli u faċilitajiet oħra ta’ finanzjament bħal dawn, sakemm dawn ma jidħlux fl-ambitu tad-definizzjoni tal-istrumenti definiti fl-entrata 1.1.5.10.1., jew l-ammont ta’ assi li potenzjalment jistgħu jiġu rritornati jew il-likwidità meħtieġa fl-ambitu ta’ dawk l-istrumenti.  Il-finanzjament kollu fuq karti kummerċjali garantiti b’assi, veikoli, veikoli ta’ investiment tat-titoli u faċilitajiet oħrajn ta’ finanzjament bħal dawn li jimmaturaw jew li jistgħu jiġu rritornati fi żmien 30 jum. L-istituzzjonijiet ta’ kreditu li għandhom faċilitajiet ta’ finanzjament strutturati li jinkludu l-ħruġ ta’ strumenti ta' dejn fuq żmien qasir, bħal karti kummerċjali garantiti b’assi, għandhom jirrapportaw il-flussi ta’ ħruġ potenzjali tal-likwidità minn dawn l-istrutturi. Dawn jinkludu, iżda mhumiex limitati għal (i) l-inabbiltà li dejn li jimmatura jiġi rifinanzjat, u (ii) l-eżistenza ta’ derivattivi jew komponenti simili għal derivattivi miktubin b’kuntratt fid-dokumentazzjoni assoċjata mal-istruttura li tippermetti r- “ritorn” ta’ assi f’arranġament ta’ finanzjament, jew li jeħtieġu lil min jittrasferixxi l-assi oriġinali jipprovdi likwidità, u b’hekk itemm b’mod effettiv l-arranġament ta’ finanzjament (“puts ta’ likwidità”) fi żmien il-perjodu ta’ 30 jum. Meta l-attivitajiet ta’ finanzjament strutturat isiru permezz ta’ entità bi skop speċjali (bħal veikolu bi skop speċjali, veikolu jew SIV), meta tiddetermina r-rekwiżiti tal-HQLA, l-istituzzjoni ta’ kreditu għandha tirreferi għall-maturità tal-istrumenti tad-dejn maħruġin mill-entità u għal kwalunkwe opzjoni inkorporata f’arranġamenti ta’ finanzjament li jistgħu potenzjalment jiskattaw ir-“ritorn” ta’ assi jew il-ħtieġa għal-likwidità, irrispettivament minn jekk l-SPV huwiex konsolidat jew le. |
| 0450 | **1.1.5.11. netting intern tal-pożizzjonijiet tal-klijent**  L-Artikolu 30(12) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-valur tas-suq tal-assi mhux likwidi ta’ klijent li, f'rabta mas-servizzi ta’ senserija primarja, l-istituzzjoni ta’ kreditu tkun użat biex tkopri l-bejgħ bin-nieqes ta’ klijent ieħor billi qabbluhom internament. |
| 0460 | **1.1.6. Faċilitajiet impenjati**  L-Artikolu 31 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk dwar il-flussi ta’ ħruġ kif definit fl-Artikolu 31 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk ukoll dwar il-faċilitajiet impenjati skont l-Artikolu 29 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  L-ammont massimu li jista’ jiġi prelevat għandu jkun ivvalutat skont l-Artikolu 31(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0470 | **1.1.6.1. faċilitajiet ta’ kreditu**  Hawnhekk l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw dwar faċilitajiet ta’ kreditu impenjati kif definit fl-Artikolu 31(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0480 | **1.1.6.1.1. lill-klijenti bl-imnut**  L-Artikolu 31(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont massimu li jista’ jiġi prelevat minn faċilitajiet ta’ kreditu impenjati mhux prelevati lill-klijenti fil-livell tal-konsumaturi kif definit fl-Artikolu 411(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 0490 | **1.1.6.1.2. lil klijenti mhux finanzjarji minbarra klijenti fil-livell ta’ konsumatur**  L-Artikolu 31(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont massimu li jista’ jiġi prelevat minn faċilitajiet ta’ kreditu impenjati mhux prelevati lil klijenti li la huma klijenti finanzjarji skont l-Artikolu 411(1) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 u lanqas klijenti fil-livell tal-konsumatur skont l-Artikolu 411(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 u li ma ġewx ipprovduti għall-fini tas-sostituzzjoni tal-finanzjament tal-klijent f’sitwazzjonijiet fejn il-klijent ma jkunx jista’ jikseb rekwiżiti ta’ finanzjament fis-swieq finanzjarji. |
| 0500 | **1.1.6.1.3. għall-istituzzjonijiet ta’ kreditu**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk dwar il-faċilitajiet ta’ kreditu impenjati pprovduti lill-istituzzjonijiet ta’ kreditu. |
| 0510 | **1.1.6.1.3.1. għall-finanzjament ta’ self promozzjonali ta’ klijenti fil-livell tal-konsumatur**  L-Artikolu 31(9) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont massimu li jista’ jiġi prelevat minn faċilitajiet ta’ kreditu impenjati mhux prelevati pprovduti lill-istituzzjonijiet ta’ kreditu għall-iskop uniku ta’ finanzjament dirett jew indirett ta’ self promozzjonali li jikkwalifika bħala skoperturi għal konsumaturi skont l-Artikolu 411(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.  Huma biss l-istituzzjonijiet ta’ kreditu li ġew stabbiliti u li huma sponsorjati minn gvern ċentrali jew reġjonali ta’ mill-inqas Stat Membru wieħed li jistgħu jirrapportaw din l-entrata. |
| 0520 | **1.1.6.1.3.2. għall-finanzjament ta’ self promozzjonali ta’ klijenti mhux finanzjarji**  L-Artikolu 31(9) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont massimu li jista’ jiġi prelevat minn faċilitajiet ta’ kreditu impenjati mhux prelevati pprovduti lill-istituzzjonijiet ta’ kreditu għall-iskop uniku ta’ finanzjament dirett jew indirett ta’ self promozzjonali li jikkwalifika bħala skoperturi għal klijenti li la huma klijenti finanzjarji skont l-Artikolu 411(1) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 u lanqas klijenti fil-livell tal-konsumaturi skont l-Artikolu 411(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.  Huma biss l-istituzzjonijiet ta’ kreditu li ġew stabbiliti u li huma sponsorjati minn gvern ċentrali jew reġjonali ta’ mill-inqas Stat Membru wieħed li jistgħu jirrapportaw din l-entrata. |
| 0530 | **1.1.6.1.3.3. oħrajn**  Il-punt (a) tal-Artikolu 31(8) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont massimu li jista’ jiġi prelevat minn faċilitajiet ta’ kreditu impenjati mhux prelevati pprovduti lill-istituzzjonijiet ta’ kreditu għajr dawk rapportati hawn fuq. |
| 0540 | **1.1.6.1.4. għall-istituzzjonijiet finanzjarji regolati għajr l-istituzzjonijiet ta’ kreditu**  Il-punt (a) tal-Artikolu 31(8) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont massimu li jista’ jiġi prelevat minn faċilitajiet ta’ kreditu impenjati mhux prelevati pprovduti lil istituzzjonijiet finanzjarji regolati għajr istituzzjonijiet ta’ kreditu. |
| 0550 | **1.1.6.1.5. fi grupp jew IPS jekk soġġetta għal trattament preferenzjali**  L-Artikolu 29 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont massimu li jista’ jiġi prelevat minn faċilitajiet ta’ kreditu impenjati mhux prelevati u li għalihom għandhom permess japplikaw rata ta’ fluss ta’ ħruġ iktar baxxa skont l-Artikolu 29 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0560 | **1.1.6.1.6. fi ħdan IPS jew netwerk kooperattiv jekk trattat bħala assi likwidu mill-istituzzjoni depożitanti**  L-Artikolu 31(7) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ċentrali ta’ skema jew netwerk imsemmija fl-Artikolu 16 għandhom jirrapportaw l-ammont massimu li jista’ jiġi prelevat minn faċilitajiet ta’ kreditu impenjati mhux prelevati lil istituzzjoni ta’ kreditu membru fejn tali istituzzjoni ta’ kreditu membru tittratta l-faċilità bħala assi likwidu f’konformità mal-Artikolu 16(2) tal-istess Regolament Delegat. |
| 0570 | **1.1.6.1.7. lil klijenti finanzjarji oħra**  Il-punt (c) tal-Artikolu 31(8) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont massimu li jista’ jiġi prelevat minn faċilitajiet ta’ kreditu impenjati mhux prelevati minbarra dawk rapportati hawn fuq lil konsumaturi finanzjarji oħrajn. |
| 0580 | **1.1.6.2. faċilitajiet ta’ likwidità**  L-Artikolu 31(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Hawnhekk l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw dwar faċilitajiet ta’ likwidità impenjati kif definit fl-Artikolu 31(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0590 | **1.1.6.2.1. lill-klijenti bl-imnut**  L-Artikolu 31(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont massimu li jista’ jiġi prelevat minn faċilitajiet ta’ likwidità impenjati mhux prelevati lill-klijenti fil-livell tal-konsumaturi kif definit fl-Artikolu 411(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 0600 | **1.1.6.2.2. lil klijenti mhux finanzjarji minbarra klijenti fil-livell ta’ konsumatur**  L-Artikolu 31(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont massimu li jista’ jiġi prelevat minn faċilitajiet ta’ likwidità impenjati mhux prelevati lil klijenti li la huma klijenti finanzjarji skont l-Artikolu 411(1) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 u lanqas klijenti fil-livell tal-konsumaturi skont l-Artikolu 411(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 0610 | **1.1.6.2.3. lil kumpaniji ta’ investiment personali**  L-Artikolu 31(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammonti massimi li jistgħu jiġu prelevati minn faċilitajiet ta’ likwidità impenjati mhux prelevati pprovduti lil kumpaniji tal-investiment privat. |
| 0620 | **1.1.6.2.4. għal SSPEs (veikolu bi skop speċjali tat-titolizzazzjoni)**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk dwar faċilitajiet ta’ likwidità impenjati pprovduti lil SSPEs. |
| 630 | **1.1.6.2.4.1. għax-xiri ta’ assi għajr titoli mingħand klijenti mhux finanzjarji**  L-Artikolu 31(6) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont massimu li jista’ jiġi prelevat minn faċilitajiet ta’ likwidità impenjati mhux prelevati pprovduti lil SSPE bil-għan li jippermetti lit-tali SSPE tixtri assi, għajr titoli mingħand klijenti li mhumiex klijenti finanzjarji, sal-punt li jaqbeż l-ammont ta’ assi attwalment mixtrija mingħand il-klijenti u meta l-ammont massimu li jista’ jiġi prelevat ikun kuntrattwalment limitat għall-ammont ta’ assi attwalment mixtrija. |
| 0640 | **1.1.6.2.4.2. oħrajn**  Il-punt (b) tal-Artikolu 31(8) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont massimu li jista’ jiġi prelevat minn faċilitajiet ta’ likwidità impenjati mhux prelevati pprovduti lil SSPEs għal raġunijiet differenti minn dawk imsemmija hawn fuq. Dan jinkludi arranġamenti li taħthom l-istituzzjoni hija meħtieġa tixtri jew tiswappja assi minn SSPE. |
| 0650 | **1.1.6.2.5. għall-istituzzjonijiet ta’ kreditu**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk dwar faċilitajiet ta’ likwidità impenjati pprovduti lill-istituzzjonijiet ta’ kreditu. |
| 0660 | **1.1.5.2.5.1. għall-finanzjament ta’ self promozzjonali ta’ klijenti fil-livell tal-konsumatur**  L-Artikolu 31(9) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont massimu li jista’ jiġi prelevat minn faċilitajiet ta’ likwidità impenjati mhux prelevati pprovduti lill-istituzzjonijiet ta’ kreditu għall-iskop uniku ta’ finanzjament dirett jew indirett ta’ self promozzjonali li jikkwalifika bħala skoperturi għal konsumaturi skont l-Artikolu 411(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.  Huma biss l-istituzzjonijiet ta’ kreditu li ġew stabbiliti u li huma sponsorjati minn gvern ċentrali jew reġjonali ta’ mill-inqas Stat Membru wieħed li jistgħu jirrapportaw din l-entrata. |
| 0670 | **1.1.6.2.5.2. għall-finanzjament ta’ self promozzjonali ta’ klijenti mhux finanzjarji**  L-Artikolu 31(9) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont massimu li jista’ jiġi prelevat minn faċilitajiet ta’ likwidità impenjati mhux prelevati pprovduti lill-istituzzjonijiet ta’ kreditu għall-iskop uniku ta’ finanzjament dirett jew indirett ta’ self promozzjonali li jikkwalifika bħala skoperturi għal klijenti li la huma klijenti finanzjarji skont l-Artikolu 411(1) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 u lanqas klijenti fil-livell tal-konsumaturi skont l-Artikolu 411(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.  Huma biss l-istituzzjonijiet ta’ kreditu li ġew stabbiliti u li huma sponsorjati minn gvern ċentrali jew reġjonali ta’ mill-inqas Stat Membru wieħed li jistgħu jirrapportaw din l-entrata. |
| 0680 | **1.1.6.2.5.3. oħrajn**  Il-punt (a) tal-Artikolu 31(8) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont massimu li jista’ jiġi prelevat minn faċilitajiet ta’ likwidità impenjati mhux prelevati pprovdut lill-istituzzjonijiet ta’ kreditu mhux imsemmija hawn fuq. |
| 0690 | **1.1.6.2.6. fi grupp jew IPS jekk soġġetta għal trattament preferenzjali**  L-Artikolu 29 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont massimu li jista’ jiġi prelevat minn faċilitajiet ta’ likwidità impenjati mhux prelevati u li għalihom għandhom permess japplikaw rata ta’ fluss ta’ ħruġ iktar baxxa skont l-Artikolu 29 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0700 | **1.1.6.2.7. fi ħdan IPS jew netwerk kooperattiv jekk trattat bħala assi likwidu mill-istituzzjoni depożitanti**  L-Artikolu 31(7) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ċentrali ta’ skema jew netwerk imsemmija fl-Artikolu 16 għandhom jirrapportaw l-ammont massimu li jista’ jiġi prelevat minn faċilitajiet ta’ likwidità impenjati mhux prelevati lil istituzzjoni ta’ kreditu membru fejn tali istituzzjoni ta’ kreditu membru tittratta l-faċilità bħala assi likwidu f’konformità mal-Artikolu 16(2) tal-istess Regolament Delegat. |
| 0710 | **1.1.6.2.8. lil klijenti finanzjarji oħra**  Il-punt (c) tal-Artikolu 31(8) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont massimu li jista’ jiġi prelevat minn faċilitajiet ta’ likwidità impenjati mhux prelevati minbarra dawk irrapportati hawn fuq lil konsumaturi finanzjarji oħrajn. |
| 0720 | **1.1.7. Prodotti u servizzi oħra**  L-Artikolu 23(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk dwar dawk il-prodotti jew servizzi msemmija fl-Artikolu 23(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  L-ammont li għandu jiġi rrapportat għandu jkun l-ammont massimu li jista’ jiġi prelevat minn dawk il-prodotti jew servizzi msemmija fl-Artikolu 23(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Il-ponderazzjoni applikabbli li għandha tiġi rrapportata għandha tkun il-ponderazzjoni kif iddeterminata mill-awtoritajiet kompetenti skont il-proċedura stabbilita fl-Artikolu 23(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0731 | **1.1.7.1. Faċilitajiet ta’ finanzjament mhux impenjati**  L-Artikolu 23(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont ta’ faċilitajiet ta’ finanzjament mhux impenjati msemmija fl-Artikolu 23(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Il-garanziji ma għandhomx jiġu rrapportati f’din ir-ringiela. |
| 0740 | **1.1.7.2. self mhux prelevat u avvanzi lil kontropartijiet bl-ingrossa**  L-Artikolu 23(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont ta’ self u avvanzi mhux prelevati lil kontropartijiet fil-livell ta’ operatur msemmija fl-Artikolu 23(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0750 | **1.1.7.3. ipoteki li ġew miftiehma iżda li għadhom ma ġewx prelevati**  L-Artikolu 23(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont ta’ self ipotekarju li ġie miftiehem iżda li għadu mhux prelevat imsemmi fl-Artikolu 23(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0760 | **1.1.7.4. karti ta’ kreditu**  L-Artikolu 23(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont ta’ karti ta’ kreditu msemmija fl-Artikolu 23(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0770 | **1.1.7.5. overdrafts**  L-Artikolu 23(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont ta’ overdrafts msemmi fl-Artikolu 23(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0780 | **1.1.7.6. flussi ta’ ħruġ ippjanati relatati mat-tiġdid jew mal-estensjoni ta’ self ġdid għall-konsumaturi jew għall-operaturi**  L-Artikolu 23(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont ta' flussi ta’ ħruġ ippjanati relatati mat-tiġdid jew mal-estensjoni ta’ self ġdid għall-konsumaturi jew għall-operaturi msemmi fl-Artikolu 23(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0850 | **1.1.7.7. Derivattivi pagabbli**  L-Artikolu 23 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont ta’ pagabbli derivattivi, għajr il-kuntratti elenkati fl-Anness II tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 u derivattivi ta’ kreditu, imsemmija fl-Artikolu 23(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0860 | **1.1.7.8. prodotti relatati mal-finanzjament tal-kummerċ barra l-karta bilanċjali**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont tal-prodotti jew is-servizzi relatati mal-prodotti relatati mal-finanzjament tal-kummerċ barra l-karta bilanċjali msemmija fl-Artikolu 23(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0870 | **1.1.7.9. oħrajn**  L-Artikolu 23(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont ta’ prodotti jew servizzi oħrajn minbarra dawk imsemmija hawn fuq fl-Artikolu 23(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Garanziji, fost entrati oħra, għandhom jiġu rrapportati f’din ir-ringiela.  Il-flussi ta’ ħruġ kontinġenti dovuti għal skattaturi ta’ deklassifikazzjoni msemmija fl-Artikolu 30(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 għandhom jiġu rrapportati f’din ir-ringiela. |
| 0885 | **1.1.8. Obbligazzjonijiet oħra u impenji dovuti**  L-Artikolu 28(2) u (6) u l-Artikolu 31a tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-flussi ta’ ħruġ minn obbligazzjonijiet u impenji dovuti oħra kif previst fl-Artikolu 28(2) u (6) u l-Artikolu 31a tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Din l-entrata għandha tinkludi wkoll, fejn meħtieġ, bilanċi addizzjonali meħtieġa li jinżammu f’riżervi tal-bank ċentrali fejn ikun hemm qbil bejn l-awtorità kompetenti rilevanti u l-BĊE jew il-bank ċentrali skont il-punt (b) (iii) tal-Artikolu 10(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0890 | **1.1.8.1. obbligazzjonijiet li jirriżultaw minn spejjeż operatorji**  L-Artikolu 28(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont tal-bilanċi pendenti ta’ obbligazzjonijiet li jirriżultaw mill-ispejjeż operatorji proprji tal-istituzzjoni ta’ kreditu kif imsemmija fl-Artikolu 28(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0900 | **1.1.8.2. fil-forma ta’ titoli ta’ dejn jekk mhux ittrattati bħala depożiti fil-livell ta’ konsumatur**  L-Artikolu 28(6) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont tal-bilanċ pendenti ta’ noti, bonds u titoli oħrajn ta’ dejn maħruġa mill-istituzzjoni ta’ kreditu minbarra dawk irrapportati bħala depożiti fil-livell tal-konsumatur kif imsemmi fl-Artikolu 28(6) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. Dan l-ammont jinkludi wkoll kupuni li jsiru dovuti fit-30 jum tal-kalendarju li jmiss li jirrigwardaw lil dawn it-titoli kollha. |
| 0912 | **1.1.8.4 Eċċess ta’ finanzjament lil klijenti mhux finanzjarji**  L-Artikolu 31a(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk id-differenza bejn l-impenji kuntrattwali biex jestendu l-finanzjament lil klijenti mhux finanzjarji u l-ammont ta’ influssi minn tali klijenti msemmija fil-punt (a) tal-Artikolu 32(3) ta’ dak ir-Regolament Delegat meta tal-ewwel jaqbżu lil tal-aħħar. |
| 0913 | **1.1.8.4.1 eċċess ta’ finanzjament lil klijenti fil-livell tal-konsumatur**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk id-differenza bejn l-impenji kuntrattwali biex jestendu l-finanzjament lil klijenti fil-livell tal-konsumatur u l-ammont ta’ influssi minn tali klijenti msemmija fil-punt (a) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 meta tal-ewwel jaqbżu lil tal-aħħar. |
| 0914 | **1.1.8.4.2 eċċess ta’ finanzjament lil korporazzjonijiet mhux finanzjarji**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk id-differenza bejn l-impenji kuntrattwali biex jestendu l-finanzjament lil klijenti korporattivi mhux finanzjarji u l-ammont ta’ influssi minn tali klijenti msemmija fil-punt (a) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 meta tal-ewwel jaqbżu lil tal-aħħar. |
| 0915 | **1.1.8.4.3 eċċess ta’ finanzjament lil sovrani, MLDBs (banek multilaterali tal-iżvilupp) u PSEs (entitajiet tas-settur pubbliku)**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk id-differenza bejn l-impenji kuntrattwali biex jestendu l-finanzjament lil sovrani, banek multilaterali tal-iżvilupp u entitajiet tas-settur pubbliku u l-ammont ta’ influssi minn tali klijenti msemmija fil-punt (a) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 meta tal-ewwel jaqbżu lil tal-aħħar. |
| 0916 | **1.1.8.4.4 eċċess ta’ finanzjament lil entitajiet legali oħra**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk id-differenza bejn l-impenji kuntrattwali biex jestendu l-finanzjament lil entitajiet legali oħra u l-ammont ta’ influssi minn tali klijenti msemmija fil-punt (a) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 meta tal-ewwel jaqbżu lil tal-aħħar. |
| 0917 | **1.1.8.5 Assi mislufa fuq bażi mhux garantita**  L-Artikolu 28(7) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk l-assi meħudin b’self fuq bażi mhux garantita u li jimmaturaw fi żmien 30 jum. Dawn l-assi għandhom jitqiesu li jiġu likwidati bis-sħiħ, u jwasslu għal fluss ta’ ħruġ ta’ 100 %.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-valur tas-suq tal-assi meħuda b’self fuq bażi mhux garantita u li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju meta l-istituzzjoni ta’ kreditu ma tkunx sid it-titoli u dawn ma jiffurmawx parti mill-buffer tal-likwidità tal-istituzzjonijiet. |
| 0918 | **1.1.8.6 Oħrajn**  L-Artikolu 31a(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont tal-bilanċ pendenti ta’ kwalunkwe obbligazzjoni li ssir dovuta fit-30 jum tal-kalendarju li jmiss minbarra dawk imsemmija fl-Artikoli 24 sa 31 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Din ir-ringiela għandha tinkludi biss kwalunkwe ħruġ ieħor minn tranżazzjonijiet mhux garantiti. Tranżazzjonijiet iggarantiti għandhom jiġu rrapportati taħt l-ID 1.2. fuq “Flussi ta’ ħruġ minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali” u taħt l-ID 1.3. fuq “Flussi ta’ ħruġ totali minn swaps kollaterali”. |
| 0920 | **1.2. Flussi ta’ ħruġ minn self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali**  L-Artikolu 28(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ta’ ħruġ minn self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali kif definit fil-punti (2) u (3) tal-Artikolu 192 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. Tranżazzjonijiet ta’ swaps kollaterali (li jkopri tranżazzjonijiet kollateral ma’ kollateral) għandhom ikunu rrapportati fil-formula C 75.01 tal-Anness XXIV. |
| 0930 | **1.2.1. Il-kontroparti hija bank ċentrali**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ta’ ħruġ minn self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali kif definit fil-punti (2) u (3) tal-Artikolu 192 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 fejn il-kontroparti hija bank ċentrali. |
| 0940 | **1.2.1.1. kollateral tal-Livell 1 eskl. Bonds Koperti EHQ**  Il-punt (a) tal-Artikolu 28(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ta’ ħruġ minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali kif definit fil-punti (2) u (3) tal-Artikolu 192 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 fejn il-kontroparti hija bank ċentrali u l-kollateral estiż huwa assi tal-Livell 1 bl-esklużjoni ta’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna u, kieku ma ntużawx bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 10 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidi. |
| 0945 | **1.2.1.1.1 li minnhom kollateral estiż jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.1.1 fejn il-kollateral, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika mal-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 0950 | **1.2.1.2. kollateral ta’ Bonds Koperti EHQ tal-Livell 1**  Il-punt (a) tal-Artikolu 28(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ta’ ħruġ minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali kif definit fil-punti (2) u (3) tal-Artikolu 192 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 fejn il-kontroparti hija bank ċentrali u l-kollateral estiż huwa assi tal-Livell 1 li huwa bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna u, kieku ma ntużax bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikoli 7 u 10 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 0955 | **1.2.1.2.1 li minnhom kollateral estiż jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.1.2 fejn il-kollateral, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 0960 | **1.2.1.3. kollateral tal-Livell 2A**  Il-punt (a) tal-Artikolu 28(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ta’ ħruġ minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali kif definit fil-punti (2) u (3) tal-Artikolu 192 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 fejn il-kontroparti hija bank ċentrali u l-kollateral estiż huwa assi tal-Livell 2A u, kieku ma ntużax bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikoli 7 u 11 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 0965 | **1.2.1.3.1 li minnhom kollateral estiż jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.1.3 fejn il-kollateral, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 0970 | **1.2.1.4. kollateral ta’ titoli garantiti b’assi tal-livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1)**  Il-punt (a) tal-Artikolu 28(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ta’ ħruġ li jirriżultaw minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali kif definit fil-punti (2) u (3) tal-Artikolu 192 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 fejn il-kontroparti hija bank ċentrali u l-kollateral estiż huwa titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B li huma ggarantiti b’assi residenzjali jew b’vetturi u ta’ kwalita ta’ kreditu ta’ skala 1 u li jikkonformaw mal-kundizzjonijiet stabbiliti fil-punti (b)(i), (b)(ii) jew (b)(iv) tal-Artikolu 13(2) u, ħlief biex jintużaw bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 13 tar-Regolament Delegat 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 0975 | **1.2.1.4.1 li minnhom kollateral estiż jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.1.4 fejn il-kollateral, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 0980 | **1.2.1.5. bonds koperti tal-livell 2B**  Il-punt (a) tal-Artikolu 28(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ta’ ħruġ minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali kif definit fil-punti (2) u (3) tal-Artikolu 192 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 fejn il-kontroparti hija bank ċentrali u l-kollateral estiż huwa bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B li jikkonformaw mal-kundizzjonijiet stabbiliti fil-punt (e) tal-Artikolu 12(1)(e) u, li kieku ma ntużawx bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 12 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 0985 | **1.2.1.5.1 li minnhom kollateral estiż jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.1.5 fejn il-kollateral, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 0990 | **1.2.1.6. kollateral ta’ titoli garantiti b’assi tal-livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1)**  Il-punt (a) tal-Artikolu 28(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ta’ ħruġ li jirriżultaw minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali kif definit fil-punti (2) u (3) tal-Artikolu 192 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 fejn il-kontroparti hija bank ċentrali u l-kollateral estiż huwa titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B li huma ggarantiti b’self kummerċjali, kirjiet u faċilitajiet ta’ kreditu lil impriżi jew self u faċilitajiet ta’ kreditu lil individwi ta’ Stat Membru u tal-iskala 1 tal-kwalità tal-kreditu u li jikkonformaw mal-kundizzjonijiet stabbiliti fil-punti (g)(iii) jew (g)(v) tal-Artikolu 13(2)(g) u, ħlief biex jintużaw bħala kollateral għal dawk it-transazzjonijiet, jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 13 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidi. |
| 0995 | **1.2.1.6.1 li minnhom kollateral estiż jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.1.6 fejn il-kollateral, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu |
| 1000 | **1.2.1.7. kollateral ta’ assi oħrajn tal-Livell 2B**  Il-punt (a) tal-Artikolu 28(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ta’ ħruġ minn self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali kif definit fil-punti (2) u (3) tal-Artikolu 192 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 fejn il-kontroparti hija bank ċentrali u l-kollateral estiż huwa assi tal-Livell 2B mhux kopert hawn fuq u, kieku ma ntużax bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikoli 7 u 12 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 1005 | **1.2.1.7.1 li minnhom kollateral estiż jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.1.7 fejn il-kollateral, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 1010 | **1.2.1.8. kollateral ta’ assi mhux likwidi**  Il-punt (a) tal-Artikolu 28(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ta’ ħruġ minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali kif definit fil-punti (2) u (3) tal-Artikolu 192 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 fejn il-kontroparti tkun bank ċentrali u l-kollateral estiż huwa assi mhux likwidi. |
| 1020 | **1.2.2. Il-kontroparti mhijiex bank ċentrali**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ta’ ħruġ minn self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali kif definit fil-punti (2) u (3) tal-Artikolu 192 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 fejn il-kontroparti ma tkunx bank ċentrali. |
| 1030 | **1.2.2.1. kollateral tal-Livell 1 eskl. Bonds Koperti EHQ**  Il-punt (a) tal-Artikolu 28(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ta’ ħruġ minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali kif definit fil-punti (2) u (3) tal-Artikolu 192 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 fejn il-kontroparti mhijiex bank ċentrali u l-kollateral estiż huwa assi tal-Livell 1 bl-esklużjoni ta’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna u, kieku ma ntużawx bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 10 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidi. |
| 1035 | **1.2.2.1.1. li minnu kollateral estiż jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.2.1 fejn il-kollateral, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 1040 | **1.2.2.2. kollateral ta’ Bonds Koperti EHQ tal-Livell 1**  Il-punt (b) tal-Artikolu 28(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ta’ ħruġ minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali kif definit fil-punti (2) u (3) tal-Artikolu 192 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 fejn il-kontroparti mhijiex bank ċentrali u l-kollateral estiż huwa assi tal-Livell 1 li huwa bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna u, kieku ma ntużax bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikoli 7 u 10 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 1045 | **1.2.2.2.1. li minnu kollateral estiż jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.2.2 fejn il-kollateral, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 1050 | **1.2.2.3. kollateral tal-Livell 2A**  Il-punt (c) tal-Artikolu 28(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ta’ ħruġ minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali kif definit fil-punti (2) u (3) tal-Artikolu 192 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 fejn il-kontroparti mhijiex bank ċentrali u l-kollateral estiż huwa kollateral tal-Livell 2A u, kieku ma ntużax bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikoli 7 u 11 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 1055 | **1.2.2.3.1. li minnu kollateral estiż jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.2.3 fejn il-kollateral, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 1060 | **1.2.2.4. kollateral ta’ titoli garantiti b’assi tal-livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1)**  Il-punt (d) tal-Artikolu 28(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ta’ ħruġ li jirriżultaw minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali kif definit fil-punti (2) u (3) tal-Artikolu 192 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 fejn il-kontroparti mhijiex bank ċentrali u l-kollateral estiż huwa titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B li huma residenzjali jew sostnuti minn karozzi u tal-iskala 1 tal-kwalità tal-kreditu u li jikkonformaw mal-kundizzjonijiet stabbiliti fil-punti (g) (i), (g) (ii) jew (g) (iv) tal-Artikolu 13(2) u, ħlief biex jintużaw bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifikaw bħala likwidi skont l-Artikoli 7 u 13 tar-Regolament Delegat 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 1065 | **1.2.2.4.1. li minnu kollateral estiż jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.2.4 fejn il-kollateral, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 1070 | **1.2.2.5. bonds koperti tal-livell 2B**  Il-punt (e) tal-Artikolu 28(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ta’ ħruġ minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali kif definit fil-punti (2) u (3) tal-Artikolu 192 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 fejn il-kontroparti mhijiex bank ċentrali u l-kollateral estiż huwa bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B li jikkonformaw mal-kundizzjonijiet stabbiliti fil-punt (e) tal-Artikolu 12(1) u, li kieku ma ntużawx bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 12 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 1075 | **1.2.2.5.1. li minnu kollateral estiż jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.2.5 fejn il-kollateral, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 1080 | **1.2.2.6. kollateral ta’ titoli garantiti b’assi tal-livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1)**  Il-punt (f) tal-Artikolu 28(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ta’ ħruġ li jirriżultaw minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali kif definit fil-punti (2) u (3) tal-Artikolu 192 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 fejn il-kontroparti mhijiex bank ċentrali u l-kollateral estiż huwa titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B li huma ggarantiti minn self kummerċjali, kirjiet u faċilitajiet ta’ kreditu lil impriżi jew self u faċilitajiet ta’ kreditu lil individwi ta’ Stat Membru u tal-iskala 1 tal-kwalità tal-kreditu u li jikkonformaw mal-kundizzjonijiet stabbiliti fil-punti (f) (iii) jew (f) (v) tal-Artikolu 13(2) u, ħlief biex jintużaw bħala kollateral għal dawk it-transazzjonijiet, jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 13 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidi. |
| 1085 | **1.2.2.6.1. li minnu kollateral estiż jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.2.6 fejn il-kollateral, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 1090 | **1.2.2.7. kollateral ta’ assi oħrajn tal-Livell 2B**  Il-punt (g) tal-Artikolu 28(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ta’ ħruġ minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali kif definit fil-punti (2) u (3) tal-Artikolu 192 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 fejn il-kontroparti mhijiex bank ċentrali u l-kollateral estiż huwa kollateral tal-Livell 2B mhux kopert hawn fuq u, kieku ma ntużax bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikoli 7 u 12 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 1095 | **1.2.2.7.1. li minnu kollateral estiż jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.2.7 fejn il-kollateral, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 1100 | **1.2.2.8. kollateral ta’ assi mhux likwidi**  Il-punt (h) tal-Artikolu 28(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ta’ ħruġ minn self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali kif definit fil-punti (2) u (3) tal-Artikolu 192 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 fejn il-kontroparti ma tkunx bank ċentrali u l-kollateral estiż huwa kollateral ta’ assi mhux likwidi. |
| 1130 | **1.3. Total ta’ flussi ta’ ħruġ minn swaps kollaterali**  Is-somma tal-flussi ta’ ħruġ minn C75.01 tal-Anness XXIV il-kolonna 0070 tiġi rrapportata fil-kolonna 0060. |
| **ENTRATI TA’ MEMORANDUM** | |
| 1170 | **2. Flussi ta’ ħruġ ta’ likwidità li jridu jkunu nnettjati b’influssi interdipendenti**  L-Artikolu 26 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-kolonna 0010 l-ammont tal-bilanċ pendenti tal-obbligazzjonijiet u l-impenji barra l-karta bilanċjali kollha, li l-flussi ta’ ħruġ tal-likwidità tagħhom ġew innettjati mill-influssi interdipendenti skont l-Artikolu 26 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrappurtaw fil-kolonna 0060 il-flussi ta’ ħruġ li ġew innettjati bl-influssi interdipendenti skont l-Artikolu 26 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
|  | **3. Depożiti operazzjonali miżmumin għall-ikklerjar, il-kustodja l-immaniġġjar tal-flus jew servizzi komparabbli oħrajn fil-kuntest ta’ relazzjoni operazzjonali stabbilita**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk dwar id-depożiti operazzjonali msemmija fl-entrata  1.1.2.1. diżaggregati skont il-kontropartijiet li ġejjin:  — L-istituzzjonijiet ta’ kreditu;  — klijenti finanzjarji minbarra istituzzjonijiet ta’ kreditu;  — sovrani, banek ċentrali, banek multilaterali tal-iżvilupp u entitajiet tas-settur pubbliku;  — konsumaturi oħrajn. |
| 1180 | **3.1. ipprovduti minn istituzzjonijiet ta’ kreditu**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont tal-bilanċ pendenti tad-depożiti operazzjonali msemmija fl-entrata 1.1.2.1. ipprovduti minn istituzzjonijiet ta’ kreditu. |
| 1190 | **3.2. ipprovduti minn klijenti finanzjarji għajr istituzzjonijiet ta’ kreditu**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont tal-bilanċ pendenti tad-depożiti operazzjonali msemmija fl-entrata 1.1.2.1. ipprovduti minn konsumaturi finanzjarji minbarra istituzzjonijiet ta’ kreditu. |
| 1200 | **3.3. ipprovduti minn sovrani, banek ċentrali, MDBs u PSEs**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont tal-bilanċ pendenti tad-depożiti operazzjonali msemmija fl-entrata 1.1.2.1. ipprovduti minn sovrani, banek ċentrali, banek multilaterali tal-iżvilupp u entitajiet tas-settur pubbliku. |
| 1210 | **3.4. ipprovduti minn klijenti oħra**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont tal-bilanċ pendenti tad-depożiti operazzjonali msemmija fl-entrata 1.1.2.1. ipprovduti minn klijenti oħrajn (minbarra dawk imsemmija hawn fuq u klijenti kkunsidrati għad-depożiti fil-livell tal-konsumatur). |
|  | **4. Flussi ta’ ħruġ intragrupp jew IPS**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk it-tranżazzjonijiet kollha rrapportati fl-entrata 1 meta l-kontroparti tkun kumpanija prinċipali jew sussidjarja tal-istituzzjoni ta’ kreditu jew sussidjarja oħra tal-istess kumpanija prinċipali jew marbuta mal-istituzzjoni ta’ kreditu permezz ta’ relazzjoni skont it-tifsira tal-Artikolu 12(1) tad-Direttiva 83/349/KEE jew membru tal-istess skema ta’ protezzjoni istituzzjonali msemmija fl-Artikolu 113(7) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 jew l-istituzzjoni ċentrali jew affiljat ta’ netwerk jew grupp kooperattiv kif imsemmi fl-Artikolu 10 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 1290 | **4.1. li minnhom: lil konsumatur finanzjarju**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont totali rapportat fl-entrata 1.1 lill-klijenti finanzjarji fl-ambitu tal-entrata 4. |
| 1300 | **4.2. li minnhom: lil klijenti mhux finanzjarji**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont totali rapportat fl-entrata 1.1. lill-konsumaturi mhux finanzjarji fl-ambitu tal-entrata 4. |
| 1310 | **4.3. li minnhom: garantiti**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont totali ta’ tranżazzjonijiet garantiti rrapportati fl-entrata 1.2. fl-ambitu tal-entrata 4. |
| 1320 | **4.4. li minnhom: faċilitajiet ta’ kreditu mingħajr trattament preferenzjali**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont massimu li jista’ jiġi prelevat minn faċilitajiet ta’ kreditu impenjati u mhux prelevati rapportati fl-entrata 1.1.6.1. lil entitajiet fl-ambitu tal-entrata 4 li għalihom għadhom ma rċevewx il-permess li japplikaw rata ta’ fluss ta’ ħruġ iktar baxxa skont l-Artikolu 29 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1330 | **4.5. li minnhom: faċilitajiet tal-likwidità mingħajr trattament preferenzali**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont massimu li jista’ jiġi prelevat minn faċilitajiet ta’ likwidità impenjati u mhux prelevati rapportati fl-entrata 1.1.6.2. lil entitajiet fl-ambitu tal-entrata 4 li għalihom għadhom ma rċevewx il-permess li japplikaw rata ta’ fluss ta’ ħruġ iktar baxxa skont l-Artikolu 29 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1340 | **4.6. li minnhom: depożiti operazzjonali**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont ta’ depożiti msemmija fl-entrata 1.1.2. lil entitajiet fl-ambitu tal-entrata 4. |
| 1345 | **4.7. li minnhom: depożiti operazzjonali żejda** Istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont ta’ fondi minn depożiti operazzjonali miżmuma f’eċċess imsemmija fl-entrata 1.1.3. lil entitajiet fl-ambitu tal-entrata 4. |
| 1350 | **4.8. li minnhom: depożiti mhux operazzjonali**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont tal-bilanċ pendenti tad-depożiti msemmija fl-entrata 1.1.4. mingħand entitajiet fl-ambitu tal-entrata 4. |
| 1360 | **4.9. li minnhom: obbligazzjonijiet fil-forma ta’ titoli ta’ dejn jekk mhux ittrattati bħala depożiti fil-livell ta’ konsumatur**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont tal-bilanċ pendenti ta’ titoli ta’ dejn irrapportati fl-entrata 1.1.8.2. li huma miżmumin mill-entitajiet fl-ambitu tal-entrata 4. |
| 1370 | **5. Flussi ta’ ħruġ FX**  Din l-entrata għandha tkun rapportata biss fil-każ ta’ rapportar f’muniti soġġetti għar-rapportar separat.  Għall-każijiet ta’ rapportar f’munita separata, skont l-Artikolu 415(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-porzjon ta’ flussi ta’ ħruġ minn derivattivi (irrapportati fl-entrata 1.1.5.5.) relatati mal-flussi FX prinċipali fil-munita sinifikanti rispettiva minn swaps bejn il-muniti, tranżazzjonijiet spot u forward FX li jimmaturaw fi żmien il-perjodu ta’ 30 jum. In-netting skont il-kontroparti jista’ jiġi applikat biss għall-flussi f’dik il-munita, pereżempju Kontroparti A: EUR+10 u Kontroparti A: EUR-20 għandhom ikunu rrapportati bħala fluss ta’ ħruġ ta’ EUR10. Ma jistax isir netting bejn il-kontropartijiet, pereżempju Kontroparti A: EUR-10, Kontroparti B: EUR+40 għandu jiġi rrapportat bħala fluss ta’ ħruġ ta’ EUR10 f’C73.00 (u influss ta’ EUR40 f’C74.00). |
|  | **6. Finanzjament garantit eżentat mill-Artikolu 17(2) u (3)**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk tranżazzjonijiet ta’ finanzjament garantiti b’maturità residwa sa 30 jum meta l-kontroparti tkun bank ċentrali u fejn it-tranżazzjonijiet rilevanti huma eżentati mill-applikazzjoni tal-Artikolu 17(2) u (3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bl-Artikolu 17(4) tiegħu. |
| 1400 | **6.1 li minnhom: garantit b’L1 għajr EHQCB**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk tranżazzjonijiet ta’ finanzjament garantiti li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju meta l-kontroparti tkun bank ċentrali, il-kollateral estiż huwa kollateral tal-Livell 1 li huma bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna u minbarra meta jintuża bħala kollateral, jissodisfa r-rekwiżiti stabbiliti fl-Artikoli 7 u 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, u fejn it-tranżazzjonijiet rilevanti huma eżentati mill-applikazzjoni tal-Artikolu 17(2) u (3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bl-Artikolu 17(4) tiegħu. |
| 1410 | **6.2 li minnhom: garantit b’L1 EHQCB**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk tranżazzjonijiet ta’ finanzjament garantiti li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju meta l-kontroparti tkun bank ċentrali, il-kollateral estiż huwa kollateral tal-Livell 1 li huma bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna u minbarra meta jintuża bħala kollateral, jissodisfa r-rekwiżiti stabbiliti fl-Artikoli 7 u 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, u fejn it-tranżazzjonijiet rilevanti huma eżentati mill-applikazzjoni tal-Artikolu 17(2) u (3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bl-Artikolu 17(4) tiegħu. |
| 1420 | **6.3 li minnhom: garantit bl-L2A**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk tranżazzjonijiet ta’ finanzjament garantiti li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju meta l-kontroparti tkun bank ċentrali, il-kollateral estiż huwa kollateral tal-Livell 2B u minbarra meta jintuża bħala kollateral, jissodisfa r-rekwiżiti stabbiliti fl-Artikoli 7 u 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, u fejn it-tranżazzjonijiet rilevanti huma eżentati mill-applikazzjoni tal-Artikolu 17(2) u (3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bl-Artikolu 17(4) tiegħu. |
| 1430 | **6.4 li minnhom: garantit bl-L2B**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk tranżazzjonijiet ta’ finanzjament garantiti li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju meta l-kontroparti tkun bank ċentrali, il-kollateral estiż huwa kollateral tal-Livell 2A u minbarra meta jintuża bħala kollateral, jissodisfa r-rekwiżiti stabbiliti fl-Artikoli 7 u 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, u fejn it-tranżazzjonijiet rilevanti huma eżentati mill-applikazzjoni tal-Artikolu 17(2) u (3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bl-Artikolu 17(4) tiegħu. |
| 1440 | **6.5 li minnhom: garantiti b’assi mhux likwidi**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk tranżazzjonijiet ta’ finanzjament garantit li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju meta l-kontroparti tkun bank ċentrali, il-kollateral estiż huwa kollateral mhux likwidu u fejn it-tranżazzjonijiet rilevanti huma eżentati mill-applikazzjoni tal-Artikolu 17(2) u (3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bl-Artikolu 17(4) tiegħu. |

**PARTI 3: INFLUSSI**

1. Influssi

1.1. Rimarki ġenerali

1. Din hija l-formula ta’ sommarju li fiha informazzjoni dwar l-influssi tal-likwidità mkejla matul it-30 jum ta’ wara, għall-finijiet ta’ rapportar tar-rekwiżit tal-kopertura tal-likwidità kif speċifikat fir-Regolament Delegat (UE) 2015/61. Entrati li ma għandhomx għalfejn jimtlew mill-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom lewn griż.
2. L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jissottomettu l-formula fil-muniti korrispondenti skont l-Artikolu 415(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.
3. Skont l-Artikolu 32 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, l-influssi tal-likwidità għandhom:

i. jinkludu biss influssi kuntrattwali minn skoperturi li ma jkunux skadew u li għalihom l-istituzzjoni ta’ kreditu ma jkollha l-ebda raġuni għalfejn tistenna nuqqas ta’ prestazzjoni fil-perjodu ta’ żmien ta’ 30 jum;

ii. jiġu kkalkolati billi jiġu mmultiplikati l-bilanċi pendenti ta’ diversi kategoriji ta’ ammonti riċevibbli kuntrattwali bir-rati speċifikati fir-Regolament ta’ Delega (UE) 2015/61.

1. L-influssi fi grupp jew skema ta’ protezzjoni istituzzjonali (minbarra l-influssi minn faċilitajiet ta’ kreditu jew ta’ likwidità mhux prelevati pprovduti minn membri ta’ grupp jew skema ta’ protezzjoni istituzzjonali fejn l-awtorità kompetenti tat il-permess li tiġi applikata rata ta’ influss preferenzjali) għandhom jiddaħħlu fil-kategoriji rilevanti. L-ammonti mhux ponderati għandhom ikunu wkoll irrapportati bħala entrati ta’ memorandum taħt it-taqsima 3 tal-Formula (ringieli 0460-0510).
2. Skont l-Artikolu 32(6) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu ma għandhomx jirrapportaw influssi minn kwalunkwe assi likwidi rrapportati skont it-Titolu II ta’ dak ir-Regolament għajr il-pagamenti dovuti fuq l-assi li mhumiex riflessi fil-valur tas-suq tal-assi.
3. L-influssi li għandhom jiġu rċevuti f’pajjiżi terzi fejn hemm restrizzjonijiet fuq trasferimenti jew li jkunu denominati f’muniti mhux konvertibbli għandhom ikunu rapportati fir-ringieli rilevanti tat-taqsimiet 1.1, 1.2 jew 1.3. L-influssi għandhom ikunu irrapportati kollha, irrispettivament mill-ammont ta’ flussi ta’ ħruġ fil-pajjiż terz jew il-munita terza.
4. Il-flejjes dovuti minn titoli maħruġa mill-istituzzjoni ta’ kreditu nnifisha jew minn SSPE li magħha l-istituzzjoni ta’ kreditu jkollha rabtiet mill-qrib għandhom jiġu kkunsidrati fuq bażi netta b’rata ta’ influss applikata fuq il-bażi tar-rata ta’ influss applikabbli għall-assi sottostanti f’konformità mal-punt (h) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.
5. Skont l-Artikolu 32(7) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu ma għandhom jirrapportaw influssi mill-ebda obbligu ġdid li jkunu daħlu għalih. Dan jirreferi għal impenji kuntrattwali li ma ġewx stabbiliti kuntrattwalment fid-data tar-rapportar, iżda li jidħlu jew jidħlu fis-seħħ fit-terminu ta’ 30 jum.
6. Fil-każ ta’ rapportar separat skont l-Artikolu 415(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, il-bilanċi rrapportati għandhom jinkludu dawk biss li huma ddenominati fil-munita rilevanti sabiex jiżguraw li d-diskrepanzi bejn il-muniti jkunu riflessi kif xieraq. Dan jista’ jfisser li naħa waħda biss tat-tranżazzjoni tiġi rrapportata fil-formula tal-munita rilevanti. Pereżempju, fil-każ ta’ derivattivi FX, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu jistgħu biss jinnettjaw influssi u flussi ta’ ħruġ skont l-Artikolu 21 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 meta jkunu ddenominati fl-istess munita.
7. L-istruttura tal-Kolonni ta’ din il-Formula hija mibnija b’mod li takkomoda l-limiti massimi differenti fuq l-influssi applikabbli skont l-Artikolu 33 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. F’dan ir-rigward, il-formula hija bbażata fuq tliet settijiet ta’ Kolonni, sett għal kull trattament ta’ limitu massimu (limitu massimu ta’ 75 %, limitu massimu ta’ 90 %, u eżenti mil-limitu massimu). L-istituzzjonijiet ta’ kreditu li jirrapportaw fuq bażi kkonsolidata jistgħu jużaw iktar minn sett wieħed minn dawn il-Kolonni jekk entitajiet differenti taħt l-istess konsolidazzjoni jikkwalifikaw għal trattamenti differenti tal-limitu massimu.
8. Skont il-punt (c) tal-Artikolu 2(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 rigward il-konsolidazzjoni, l-influssi tal-likwidità f’impriża sussidjarja f’pajjiż terz li, skont il-liġi nazzjonali ta’ dak il-pajjiż terz huma soġġetti għal rati iktar baxxi minn dawk speċifikati fit-Titolu III tar-Regolament għandhom ikunu soġġetti għal konsolidazzjoni skont ir-rati iktar baxxi speċifikati fil-liġi nazzjonali tal-pajjiż terz.
9. Ir-Regolament Delegat (UE) 2015/61 jirreferi biss għal rati u haircuts, u l-kelma “ponderazzjoni” fil-formula tirreferi biss għal dawn fil-kuntest xieraq. F’dan l-Anness il-kelma “ponderati” għandha tinftiehem bħala terminu ġenerali li jindika l-ammont ikkalkolat wara l-applikazzjoni tal-haircuts u r-rati rispettivi u kwalunkwe struzzjoni addizzjonali rilevanti oħra (pereżempju fil-każ ta’ għoti ta’ self u finanzjament garantit).
10. Ċerti “entrati ta’ memorandum” huma inklużi fil-formuli assoċjati ma’ dawn l-istruzzjonijiet. Fost l-oħrajn, dawn l-entrati jipprovdu informazzjoni meħtieġa li tippermetti lill-awtorità kompetenti twettaq valutazzjoni adegwata tal-konformità tal-istituzzjonijiet ta’ kreditu mar-rekwiżiti tal-likwidità.

1.2. Kummenti speċifiċi rigward għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet motivati mis-suq kapitali

1. Il-formula tikkategorizza l-flussi kollateralizzati skont il-kwalità tal-assi sottostanti jew l-eliġibbiltà tal-HQLA. Formula separata hija pprovduta għal swaps kollaterali — C 75.01 tal-Anness XXIV. Swaps kollaterali, li huma tranżazzjonijiet kollaterali kontra kollateral ma għandhomx jiġu rrapportati fil-Formula tal-fluss ta’ dħul (C 74.00 tal-Anness XXIV) li tkopri biss tranżazzjonijiet ta’ flus kontra kollateral.
2. Fejn għoti ta’ self garantit u transazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali ikunu garantiti minn azzjonijiet jew unitajiet f’CIUs, dawn it-transazzjonijiet għandhom jiġu rrapportati bħallikieku jkunu kollateralizzati mill-assi sottostanti tas-CIU. Pereżempju, f’każ li tranżazzjoni ta’ self garantit tkun kollateralizzata b’azzjonijiet jew unitajiet f’CIU li jinvestu b’mod esklussiv f’assi tal-Livell 2A, it-tranżazzjoni ta’ għoti ta’ self garantit għandha tiġi rrapportata daqslikieku tiġi kollateralizzata direttament b’kollateral tal-Livell 2A. Ir-rata potenzjalment ogħla ta’ influss għal tranżazzjonijiet ta’ għoti ta’ self garantiti b’azzjonijiet jew unitajiet f’CIUs għandha tiġi riflessa fir-rata ta’ influss rilevanti li għandha tiġi rrapportata.
3. Fil-każ ta’ rapportar separat skont l-Artikolu 415(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, il-bilanċi rrapportati għandhom jinkludu dawk biss li huma ddenominati fil-munita rilevanti sabiex jiżguraw li d-diskrepanzi bejn il-muniti jkunu riflessi kif xieraq. Dan jista’ jfisser li naħa waħda biss tat-tranżazzjoni tiġi rrapportata fil-formula tal-munita rilevanti. B’hekk tranżazzjoni ta’ retro riakkwist tista’ tirriżulta f’influss negattiv. It-tranżazzjonijiet ta’ retro riakkwist rapportati fl-istess entrata għandhom jingħaddu flimkien (pożittivi u negattivi). Jekk it-total ikun pożittiv dan għandu jiġi rrapportat fil-Formula ta’ influss. Jekk it-total ikun negattiv dan għandu jiġi rrapportat fil-Formula tal-fluss ta’ ħruġ. Dan l-approċċ għandu jkun segwit viċe versa għar-repos.
4. Għall-kalkolu tal-influssi, l-għoti ta’ self garantit u t-tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali għandhom jiġu rrapportati irrispettivament minn jekk il-kollateral sottostanti riċevut jissodisfax ir-rekwiżiti operazzjonali kif previst fl-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. Barra minn hekk, sabiex ikun jista’ jiġi kkalkolat l-istokk aġġustat ta’ assi likwidi skont l-Artikolu 17(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw ukoll b’mod separat dawk it-tranżazzjonijiet fejn il-kollateral sottostanti riċevut addizzjonalment jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali kif previst fl-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.
5. Meta istituzzjoni ta’ kreditu tista’ tirrikonoxxi biss parti mill-azzjonijiet tagħha f’munita barranija, jew assi f’munita barranija tal-gvern ċentrali jew tal-bank, jew assi fil-munita domestika tal-gvern ċentrali jew tal-bank ċentrali fl-HQLA tagħhom, il-parti rikonoxxibbli biss għandha tiġi rrapportata fir-ringieli tal-assi tal-Livell 1, tal-Livell 2A u tal-Livell 2B skont il-punt (c) (ii) tal-Artikolu 12(1) u l-punt (d) tal-Artikolu 10(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. Meta l-assi partikolari jintuża bħala kollateral iżda għal ammont li huwa surplus għall-porzjon li jista’ jkun rikonoxxut bħala assi likwidi, l-ammont surplus għandu jkun irrapportat fit-taqsima mhux likwidi. Assi tal-Livell 2 A għandhom ikunu rrapportati fir-ringiela tal-assi tal-Livell 2A korrispondenti, anki jekk ikun qiegħed jiġi segwit l-Approċċ Alternattiv tal-Likwidità skont l-Artikolu 19 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.

1.3. Kummenti speċifiċi rigward is-saldu u t-tranżazzjonijiet forward start

1. L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-influssi li jinħolqu minn repos forward start fil-perjodu ta’ 30 jum u jimmaturaw wara l-perjodu ta’ 30 jum. Il-fluss ta’ dħul li għandu jiġi riċevut għandu jiġi rrappurtat fid-ir-Riċerka C 74.00; r0260} (“influssi oħrajn”), nett mill-valur tas-suq tal-assi li għandu jiġi kkonsenjat lill-kontroparti wara l-applikazzjoni tal-haircut LCR relatata. Jekk l-assi ma jkunx “assi likwidu”, l-influss li għandu jkun riċevut għandu jiġi rrapportat kollu. Assi li huwa mirhun bħala kollateral għandu jkun irrapportat f’C 72.00 jekk l-istituzzjoni żżomm l-assi fil-kotba tagħha fid-data ta’ referenza u jissodisfa l-kundizzjonijiet relatati.
2. L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-influssi li jinħolqu minn repos forward start, retro riakkwisti u swaps kollaterali li jibdew fil-perjodu ta’ 30 jum u jimmaturaw wara l-perjodu ta’ 30 jum meta l-komponent inizjali jipproduċi influss. Fil-każ ta’ repo, l-influss li għandu jiġi riċevut għandu jiġi rrappurtat fid-ir-Riċerka C 74.00; r0260} (“influssi oħrajn”), nett mill-valur tas-suq tal-assi li għandu jiġi kkonsenjat lill-kontroparti wara l-applikazzjoni tal-haircut LCR relatata. Jekk l-ammont li għandu jkun riċevut huwa iktar baxx mill-valur tas-suq tal-assi (wara l-haircut LCR) li għandu jingħata b’self bħala kollateral, id-differenza għandha tkun irrapportata bħala fluss ta’ ħruġ f’C.73.00. Jekk l-assi ma jkunx “assi likwidu”, l-influss li għandu jkun riċevut għandu jiġi rrapportat kollu. L-assi li huwa mirhun bħala kollateral għandu jkun irrapportat f’C 72.00 jekk l-istituzzjoni żżomm l-assi fil-kotba tagħha fid-data ta’ referenza u jissodisfa l-kundizzjonijiet relatati. Fil-każ ta’ retroriakkwist, fejn il-valur tas-suq tal-assi li għandu jiġi riċevut bħala kollateral wara l-applikazzjoni tal-haircut LCR relatat (jekk l-assi jikkwalifika bħala assi likwidu) ikun akbar mill-ammont ta’ flus li għandu jingħata b’self, id-differenza għandha tiġi rrapportata bħala influss fid-ir-Riċerka C 74.00; r0260} (‘influssi oħrajn’). Għal swaps kollaterali, fejn l-effett nett tal-iswap inizjali tal-assi (b’kunsiderazzjoni tal-haircuts tal-LCR) jagħti lok għal fluss ta’ dħul, dan il-fluss ta’ dħul għandu jiġi rrapportat l-ICT C 74.00; r0260} (‘influssi oħrajn’).
3. Repos forward, retroriakkwisti forward u swaps kollaterali forward li jibdew u jimmaturaw fil-perjodu ta’ 30 jum tal-LCR ma għandhom l-ebda impatt fuq l-LCR ta’ bank u jistgħu jiġu injorati

1.4. Skema ta’ deċiżjoniiet dwar l-influssi LCR skont l-Artikolu 32, l-Artikolu 33 u l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61

1. L-iskema ta’ deċiżjonijiet hija mingħajr preġudizzju għar-rapportar tal-entrati ta’ memorandum. L-iskema tad-deċiżjonijiet hija parti mill-istruzzjonijiet biex jiġu speċifikati l-kriterji tal-valutazzjoni tal-prijoritizzazzjoni għall-allokazzjoni ta’ kull entrata rapportata sabiex jiġi żgurat rapportar omoġenju u komparabbli. L-implimentazzjoni tal-iskema tad-deċiżjonijiet waħidha mhijiex biżżejjed — l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom dejjem jikkonformaw mal-bqija tal-istruzzjonijiet.
2. Għall-fini ta’ sempliċità, l-iskema tad-deċiżjonijiet tinjora t-totali u s-subtotali; madankollu dan ma jfissirx li ma għandhomx ikunu rrapportati wkoll.

1.4.1. L-iskema tad-deċiżjonijiet dwar ir-ringieli fil-formula C 74.00 tal-Anness XXIV

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **#** | **Fattur** | | | **Deċiżjoni** | **Rappurtar** |
| 1 | Influss li jissodisfa l-kriterji operazzjonali kif speċifikat fl-Artikolu 32, bħal:   Skopertura li għadha ma skadietx (Art. 32(1))   L-istituzzjoni ta’ kreditu ma għandha l-ebda raġuni għalfejn tistenna nuqqas ta’ prestazzjoni fi żmien 30 jum tal-kalendarju (Artikolu 32(1))   L-istituzzjonijiet ta’ kreditu ma għandhom jikkunsidraw l-ebda influssi minn xi obbligu ġdid li jkunu daħlu għalih (Artikolu 32(7))   L-ebda influssi ma għandhom ikunu irrapportati f’każ li l-influssi huma diġà nnettjati mill-flussi ta’ ħruġ (Artikolu 26)   L-istituzzjonijiet ta’ kreditu ma għandhom jikkunsidraw l-ebda influssi minn kwalunkwe wieħed mill-assi likwidi msemmija fit-Titolu II għajr il-pagamenti dovuti fuq assi li mhumiex riflessi fil-valur tas-suq tal-assi (Artikolu 32(6)) | | | Le | Ebda Rapportar |
| Iva | # 2 |
| 2 | Tranżazzjoni forward start | | | Iva | # 3 |
| Le | # 5 |
| 3 | Tranżazzjoni forward aċċettata wara d-data ta’ rapportar; | | | Iva | Ebda Rapportar |
| Le | # 4 |
| 4 | Tranżazzjoni forward li tibda fi ħdan il-perjodu ta’ 30 jum u timmatura wara l-perjodu ta’ 30 jum fejn il-komponent inizjali jipproduċi influss nett | | | Iva | Ringiela 260, ID 1.1.11 |
| Le | Ebda Rapportar |
| 5 | Influssi fi grupp jew skema ta’ protezzjoni istituzzjonali | | | Iva | # 6 |
| Le | # 7 |
| 6 | Influssi minn faċilitajiet ta’ kreditu jew ta’ likwidità mhux prelevati pprovduti minn membri ta’ grupp jew skema ta’ protezzjoni istituzzjonali fejn l-awtorità kompetenti tkun tat permess biex tiġi applikata rata ogħla ta’ influss (l-Artikolu 34) | | | Iva | Ringiela 250, ID 1.1.10 |
| Le | # 7 |
| 7 | Influssi minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali bl-eċċezzjoni ta’ derivattivi (l-Artikolu 32(3)(b)-(c); (e)-(f)) | | | Iva | # 23 |
| Le | # 8 |
| 8 | Flejjes dovuti minn titoli li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju (Artikolu 32(2)(c)) | | | Iva | Ringiela 190, ID 1.1.5 |
| Le | # 9 |
| 9 | Flejjes dovuti minn tranżazzjonijiet ta’ finanzjament kummerċjali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum (Artikolu 32(2)(b)) | | | Iva | Ringiela 180, ID 1.1.4 |
| Le | # 10 |
| 10 | Assi b’data tat-tmiem kuntrattwali indefinita (Artikolu 32(3)(i)) | | | Iva | # 11 |
| Le | # 12 |
| 11 | Imgħax u pagamenti minimi minn self b’data ta’ skadenza kuntrattwali indefinita li huma dovuti b’kuntratt u li huma soġġetti għal influss ta’ flus attwali fi żmien it-30 jum li ġejjin | | | Iva | # 12 |
| Le | Ringiela 201, ID 1.1.6 |
| 12 | Flejjes dovuti minn pożizzjonijiet f’indiċi prinċipali ta’ strumenti ta’ ekwità dment li l-assi likwidi ma jingħaddux darbtejn (Artikolu 32(2)(d)) | | | Iva | Ringiela 210, ID 1.1.7 |
| Le | # 13 |
| 13 | Influssi mir-rilaxx ta’ bilanċi miżmuma f’kontijiet segregati skont ir-rekwiżiti regolatorji għall-protezzjoni ta’ assi għan-negozju ta’ konsumaturi (Artikolu 32(4)) | | | Iva | Ringiela 230, ID 1.1.8 |
| Le | # 14 |
| 14 | Influssi ta’ flus ta’ derivattivi netti skont il-kontroparti u l-kollateral (Artikolu 32(5)) | | | Iva | Ringiela 240, ID 1.1.9 |
| Le | # 15 |
| 15 | Influssi relatati ma’ flussi ta’ ħruġ skont l-impenji ta’ self promozzjonali msemmija fl-Artikolu 31(9) (l-Artikolu 32(3)(a)) | | | Iva | Ringiela 170, ID 1.1.3 |
| Le | # 16 |
| 16 | Flejjes dovuti minn banek ċentrali u klijenti finanzjarji b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum (Artikolu 32(2)(a)) | | | Iva | # 20 |
| Le | # 17 |
| 17 | Flejjes dovuti minn konsumaturi mhux finanzjarji (minbarra banek ċentrali) li ma jikkorrispondux għal ripagament tal-kapital (l-Artikolu 32(2)) | | | Iva | Ringiela 040, ID 1.1.1.1 |
| Le | # 18 |
| 18 | Flejjes oħra dovuti minn konsumaturi mhux finanzjarji (minbarra banek ċentrali) (Artikolu 32(3)(a)) | | | Iva | # 19 |
| Le | Ringiela 260, ID 1.1.11 |
| 19 | Flejjes oħra dovuti minn konsumaturi mhux finanzjarji (minbarra banek ċentrali) (Artikolu 32(3)(a)) | # 19.1 | Klijenti fil-livell ta’ konsumatur | Iva | Ringiela 060, ID 1.1.1.2.1 |
| Le | # 19.2 |
| # 19.2 | Korporazzjonijiet mhux finanzjarji | Iva | Ringiela 070, ID 1.1.1.2.2 |
| Le | # 19.3 |
| # 19.3 | Sovrani, MDBs u PSEs | Iva | Ringiela 080, ID 1.1.1.2.3 |
| Le | Ringiela 090, ID 1.1.1.2.4 |
| 20 | Influssi minn klijenti finanzjarji li huma kklassifikati bħala depożiti operazzjonali (Artikolu 32(3)(d)) | | | Iva | # 21 |
| Le | # 22 |
| 21 | L-istituzzjoni ta’ kreditu tista’ tistabbilixxi rata ta’ influss simmetrika korrispondenti (Artikolu 32(3)(d)) | | | Iva | Ringiela 120, ID 1.1.2.1.1 |
| Le | Ringiela 130, ID 1.1.2.1.2 |
| 22 | Flejjes dovuti minn banek ċentrali (Artikolu 32(2)(a)) | | | Iva | Ringiela 150, ID 1.1.2.2.1 |
| Le | Ringiela 160, ID 1.1.2.2.2 |
| 23 | Tranżazzjoni ta’ Swap Kollaterali (l-Artikolu 32(3)(e)) | | | Iva | Ringiela 410, ID 1.3[[2]](#footnote-3) |
| Le | # 24 |
| 24 | It-tranżazzjoni ssir ma’ bank ċentrali | | | Iva | # 25 |
| Le | # 31 |
| 25 | Il-kollateral huwa ġeneralment eliġibbli bħala assi likwidu (irrispettivament minn jekk jintużax mill-ġdid fi tranżazzjoni oħra u irrispettivament minn jekk l-assi jissodisfax ir-rekwiżit operazzjonali skont l-Artikolu 8) | | | Iva | # 26 |
| Le | # 30 |
| 26 | Il-kollateral jintuża biex ikopri pożizzjonijiet qosra | | | Iva | Ringiela 297, ID 1.2.1.2 |
| Le | # 27 |
| 27 | Il-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 | | | Iva | # 28 |
| Le | # 29 |
| 28 | Tranżazzjoni ta’ finanzjament garantit minn (Artikolu 32(3)(b)): | # 28.1 | Kollateral tal-Livell 1 minbarra bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna | Iva | Ringiela 269, ID 1.2.1.1.1 +  Ringiela 271, ID 1.2.1.1.1.1 |
| Le | # 28.2 |
| # 28.2 | Kollateral tal-Livell 1 li huma bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna | Iva | Ringiela 273, ID 1.2.1.1.2 +  Ringiela 275, ID 1.2.1.1.2.1 |
| Le | # 28.3 |
| # 28.3 | Kollateral tal-Livell 2 A | Iva | Ringiela 277, ID 1.2.1.1.3 +  Ringiela 279, ID 1.2.1.1.3.1 |
| Le | # 28.4 |
| # 28.4 | Kollateral ta’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi) | Iva | Ringiela 281, ID 1.2.1.1.4 +  Ringiela 283, ID 1.2.1.1.4.1 |
| Le | # 28.5 |
| # 28.5 | Kollateral ta’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B | Iva | Ringiela 285, ID 1.2.1.1.5 +  Ringiela 287, ID 1.2.1.1.5.1 |
| Le | # 28.6 |
| # 28.6 | Kollateral ta’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali) | Iva | Ringiela 289, ID 1.2.1.1.6 +  Ringiela 291, ID 1.2.1.1.6.1 |
| Le | Ringiela 293, ID 1.2.1.1.7 +  Ringiela 295, ID 1.2.1.1.7.1 |
| 29 | Tranżazzjoni ta’ finanzjament garantit minn (Artikolu 32(3)(b)): | # 29.1 | Kollateral tal-Livell 1 minbarra bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna | Iva | Ringiela 269, ID 1.2.1.1.1 |
| Le | # 29.2 |
| # 29.2 | Kollateral tal-Livell 1 li huma bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna | Iva | Ringiela 273, ID 1.2.1.1.2 |
| Le | # 29.3 |
| # 29.3 | Kollateral tal-Livell 2 A | Iva | Ringiela 277, ID 1.2.1.1.3 |
| Le | # 29.4 |
| # 29.4 | Kollateral ta’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi) | Iva | Ringiela 281, ID 1.2.1.1.4 |
| Le | # 29.5 |
| # 29.5 | Kollateral ta’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B | Iva | Ringiela 285, ID 1.2.1.1.5 |
| Le | # 29.6 |
| # 29.6 | Kollateral ta’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali) | Iva | Ringiela 289, ID 1.2.1.1.6 |
| Le | Ringiela 293, ID 1.2.1.1.7 |
| 30 | Kollateral li ma jikkwalifikax bħala assi likwidu (Artikolu 32(3)(b)) u huwa ekwità mhux likwida | | | Iva | Ringiela 301, ID 1.2.1.3.1 |
| Le | Ringiela 303, ID 1.2.1.3.2 |
| 31 | Il-kollateral huwa ġeneralment eliġibbli bħala assi likwidu (irrispettivament minn jekk jintużax mill-ġdid fi tranżazzjoni oħra u irrispettivament minn jekk l-assi jissodisfax ir-rekwiżit operazzjonali skont l-Artikolu 8) | | | Iva | # 32 |
| Le | # 36 |
| 32 | Il-kollateral jintuża biex ikopri pożizzjonijiet qosra | | | Iva | Ringiela 337, ID 1.2.2.2 |
| Le | # 33 |
| 33 | Il-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 | | | Iva | # 34 |
| Le | # 35 |
| 34 | Tranżazzjoni ta’ finanzjament garantit minn (Artikolu 32(3)(b)) | # 34.1 | Kollateral tal-Livell 1 minbarra bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna | Iva | Ringiela 309, ID 1.2.2.1.1 +  Ringiela 311, ID 1.2.2.1.1.1 |
| Le | # 34.2 |
| # 34.2 | Kollateral tal-Livell 1 li huma bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna | Iva | Ringiela 313, ID 1.2.2.1.2 +  Ringiela 315, ID 1.2.2.1.2.1 |
| Le | # 34.3 |
| # 34.3 | Kollateral tal-Livell 2 A | Iva | Ringiela 317, ID 1.2.2.1.3 +  Ringiela 319, ID 1.2.2.1.3.1 |
| Le | # 34.4 |
| # 34.4 | Kollateral ta’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi) | Iva | Ringiela 321, ID 1.2.2.1.4 +  Ringiela 323, ID 1.2.2.1.4.1 |
| Le | # 34.5 |
| # 34.5 | Kollateral ta’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B | Iva | Ringiela 325, ID 1.2.2.1.5 +  Ringiela 327, ID 1.2.2.1.5.1 |
| Le | # 34.6 |
| # 34.6 | Kollateral ta’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali) | Iva | Ringiela 329, ID 1.2.2.1.6 +  Ringiela 331, ID 1.2.2.1.6.1 |
| Le | Ringiela 333, ID 1.2.2.1.7 +  Ringiela 335, ID 1.2.2.1.7.1 |
| 35 | Tranżazzjoni ta’ finanzjament garantit minn (Artikolu 32(3)(b)) | # 35.1 | Kollateral tal-Livell 1 minbarra bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna | Iva | Ringiela 309, ID 1.2.2.1.1 |
| Le | # 35.2 |
| # 35.2 | Kollateral tal-Livell 1 li huma bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna | Iva | Ringiela 313, ID 1.2.2.1.2 |
| Le | # 35.3 |
| # 35.3 | Kollateral tal-Livell 2 A | Iva | Ringiela 317, ID 1.2.2.1.3 |
| Le | # 35.4 |
| # 35.4 | Kollateral ta’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi) | Iva | Ringiela 321, ID 1.2.2.1.4 |
| Le | # 35.5 |
| # 35.5 | Kollateral ta’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B | Iva | Ringiela 325, ID 1.2.2.1.5 |
| Le | # 35.6 |
| # 35.6 | Kollateral ta’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali) | Iva | Ringiela 329, ID 1.2.2.1.6 |
| Le | Ringiela 333, ID 1.2.2.1.7 |
| 36 | Kollateral li ma jikkwalifikax bħala assi likwidu (Artikolu 32(3)(b)) | # 36.1 | self ta’ marġini: kollateral mhuwiex likwidu | Iva | Ringiela 341, ID 1.2.2.3.1 |
| Le | # 36.2 |
| # 36.2 | il-kollateral huwa ekwità mhux likwida | Iva | Ringiela 343, ID 1.2.2.3.2. |
| Le | Ringiela 345, ID 1.2.2.3.3. |

1.4.2. Skema tad-deċiżjonijiet dwar il-kolonni fil-Formula C 74.00 tal-Anness XXIV

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **#** | **Fattur** | | | **Deċiżjoni** | **Rappurtar** |
| 1 | Fluss ’il ġewwa li għandu jiġi rrapportat fir-ringieli 0010-0430 tal-Formula C 74.00 tal-Anness XXIV skont l-Artikolu 32, l-Artikolu 33 l-Artikolu 34 skont il-klassifikazzjoni kif speċifikat fit-taqsima 1 (“Siġra tad-deċiżjonijiet dwar ir-ringieli fil-formula C 74.00”) | | | Le | Ebda Rapportar |
| Iva | # 2 |
| 2 | Influssi minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali bl-eċċezzjoni ta’ derivattivi (l-Artikolu 32(3)(b)-(c); (e)-(f)) | | | Iva | # 11 |
| Le | # 3 |
| 3 | Eżenzjoni parzjali mil-limitu massimu fuq l-influssi (Artikolu 33(2)-(5)) | | | Iva | # 4 |
| Le | # 6 |
| 4 | Eżenzjoni parzjali mil-limitu massimu fuq l-influssi (Artikolu 33(2)-(5)) | # 4.1 | Parti mill-influssi eżentati mil-limitu massimu fuq l-influssi |  | # 5 |
| # 4.2 | Parti mill-influssi mhux eżentati mil-limitu massimu fuq l-influssi |  | # 7 |
| 5 | Parti mill-influssi eżentati mil-limitu massimu ta’ 75 % fuq l-influssi soġġetti għal-limitu massimu ta’ 90 % fuq l-influssi (Artikolu 33(4) u Artikolu 33(5)) | | | Iva | # 9 |
| Le | # 10 |
| 6 | Influssi soġġett għal-limitu massimu ta’ 75 % fuq l-influssi (Artikolu 33(1)) | | | Iva | # 7 |
| Le | # 8 |
| 7 | Influssi soġġett għal-limitu massimu ta’ 75 % fuq l-influssi (Artikolu 33(1)) | # 7.1 | Flejjes dovuti/ammont massimu li jista’ jiġi prelevat |  | Kolonna 0010 |
| # 7.2 | Ponderazzjoni Applikabbli |  | Kolonna 0080 |
| # 7.3 | Influss |  | Kolonna 0140 |
| 8 | Influss soġġett għal-limitu massimu ta’ 90 % fuq l-influssi (Artikolu 33(4) u Artikolu 33(5)) | | | Iva | # 9 |
| Le | # 10 |
| 9 | Influss soġġett għal-limitu massimu ta’ 90 % fuq l-influssi (Artikolu 33(4) u Artikolu 33(5)) | # 9.1 | Flejjes dovuti/ammont massimu li jista’ jiġi prelevat |  | Kolonna 0020 |
| # 9.2 | Ponderazzjoni Applikabbli |  | Kolonna 0090 |
| # 9.3 | Influss |  | Kolonna 0150 |
| 10 | Influssi li huma eżentati għalkollox mil-limitu massimu fuq l-influssi (Artikolu 33(2)-(3)) | # 10.1 | Flejjes dovuti/ammont massimu li jista’ jiġi prelevat |  | Kolonna 0030 |
| # 10.2 | Ponderazzjoni Applikabbli |  | Kolonna 0100 |
| # 10.3 | Influss |  | Kolonna 0160 |
| 11 | Tranżazzjoni ta’ finanzjament garantit fejn il-kollateral huwa ġeneralment eliġibbli bħala assi likwidu (irrispettivament minn jekk jintużax mill-ġdid fi tranżazzjoni oħra u irrispettivament minn jekk l-assi jissodisfax ir-rekwiżit operazzjonali skont l-Artikolu 8) | | | Iva | # 12 |
| Le | # 3 |
| 12 | Eżenzjoni parzjali mil-limitu massimu fuq l-influssi (Artikolu 33(2)-(5)) | | | Iva | # 13 |
| Le | # 15 |
| 13 | Eżenzjoni parzjali mil-limitu massimu fuq l-influssi (Artikolu 33(2)-(5)) | # 13.1 | Parti mill-influssi eżentati mil-limitu massimu fuq l-influssi |  | # 14 |
| # 13.2 | Parti mill-influssi mhux eżentati mil-limitu massimu fuq l-influssi |  | # 16 |
| 14 | Parti mill-influssi eżentati mil-limitu massimu ta’ 75 % fuq l-influssi soġġetti għal-limitu massimu ta’ 90 % fuq l-influssi (Artikolu 33(4) u Artikolu 33(5)) | | | Iva | # 18 |
| Le | # 19 |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 15 | Influssi soġġett għal-limitu massimu ta’ 75 % fuq l-influssi (Artikolu 33(1)) | | | Iva | # 16 |
| Le | # 17 |
| 16 | Influssi soġġett għal-limitu massimu ta’ 75 % fuq l-influssi (Artikolu 33(1)) | # 16.1 | Flejjes dovuti |  | Kolonna 0010 |
| # 16.2 | Valur tas-suq tal-kollateral riċevut |  | Kolonna 0040 |
| # 16.3 | Ponderazzjoni Applikabbli |  | Kolonna 0080 |
| # 16.4 | Valur tal-kollateral riċevut skont l-Artikolu 9  [biss jekk il-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali] |  | Kolonna 0110 |
| # 16.5 | Influss |  | Kolonna 0140 |
| 17 | Influss soġġett għal-limitu massimu ta’ 90 % fuq l-influssi (Artikolu 33(4) u Artikolu 33(5)) | | | Iva | # 18 |
| Le | # 19 |
| 18 | Influss soġġett għal-limitu massimu ta’ 90 % fuq l-influssi (Artikolu 33(4) u Artikolu 33(5)) | # 18.1 | Flejjes dovuti |  | Kolonna 0020 |
| # 18.2 | Valur tas-suq tal-kollateral riċevut |  | Kolonna 0050 |
| # 18.3 | Ponderazzjoni Applikabbli |  | Kolonna 0090 |
| # 18.4 | Valur tal-kollateral riċevut skont l-Artikolu 9  [biss jekk il-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali] |  | Kolonna 0120 |
| # 18.5 | Influss |  | Kolonna 0150 |
| 19 | Influssi li huma eżentati għalkollox mil-limitu massimu fuq l-influssi (Artikolu 33(2)-(3)) | # 19.1 | Flejjes dovuti |  | Kolonna 0030 |
| # 19.2 | Valur tas-suq tal-kollateral riċevut |  | Kolonna 0060 |
| # 19.3 | Ponderazzjoni Applikabbli |  | Kolonna 0100 |
| # 19.4 | Valur tal-kollateral riċevut skont l-Artikolu 9  [biss jekk il-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali] |  | Kolonna 0130 |
| # 19.5 | Influss |  | Kolonna 0160 |

1.5. SottoFormula tal-influssi

1.5.1. Struzzjonijiet dwar kolonni speċifiċi

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Kolonna | Referenzi legali u struzzjonijiet | |
| 0010 | **Ammont — Soġġett għal-limitu massimu ta’ 75 % fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għar-ringieli 0040, 0060-0090, 0120-0130, 0150-0260, 0269-0297, 0301-0303, 0309-0337, 0341-0345, 0450 u 0470-0510, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-Kolonna 0010 l-ammont totali tal-assi/flejjes dovuti/ammonti massimi li jistgħu jiġu prelevati li huma soġġetti għal-limitu massimu ta’ 75 % fuq l-influssi kif speċifikat fl-Artikolu 33(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 u jsegwu l-istruzzjonijiet rilevanti inklużi hawnhekk.  Meta awtorità kompetenti tkun approvat eżenzjoni parzjali mil-limitu massimu fuq l-influssi skont l-Artikolu 33(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, il-parti tal-ammont soġġetta għall-eżenzjoni tkun irrapportata fil-kolonna 0020 jew 0030 u l-parti tal-ammont mhux soġġetta għall-eżenzjoni tkun irrapportata fil-kolonna 0010. | |
| 0020 | **Ammont — Soġġett għal-limitu massimu ta’ 90 % fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għar-ringieli 0040, 0060-0090, 0120-0130, 0150-0260, 0269-0297, 0301-0303, 0309-0337, 0341-0345, 0450 u 0470-0510, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-Kolonna 0020 l-ammont totali ta’ assi/flejjes dovuti/ammonti massimi li jistgħu jiġu prelevati li huma soġġetti għal-limitu massimu ta’ 90 % fuq l-influssi kif speċifikat fl-Artikolu 33(4) u l-Artikolu 33(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 u billi jsegwu l-istruzzjonijiet rilevanti inklużi hawn.  Meta awtorità kompetenti tkun approvat eżenzjoni parzjali mil-limitu massimu fuq l-influssi skont l-Artikolu 33(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, il-parti tal-ammont soġġetta għall-eżenzjoni tkun irrapportata fil-kolonna 0020 jew 0030 u l-parti tal-ammont mhux soġġetta għall-eżenzjoni tkun irrapportata fil-kolonna 0010. | |
| 0030 | **Ammont — Eżentat mil-limitu massimu fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għar-ringieli 0040, 0060-0090, 0120-0130, 0150-0260, 0269-0297, 0301-0303, 0309-0337, 0341-0345, 0450 u 0470-0510, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-Kolonna 0030 l-ammont totali ta’ assi/flejjes dovuti/ammonti massimi li jistgħu jiġu prelevati li huma kompletament eżentati mil-limitu massimu fuq l-influssi kif speċifikat fl-Artikolu 33(2), l-Artikolu 33(3) u l-Artikolu 33(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 u billi jsegwu l-istruzzjonijiet rilevanti inklużi hawn.  Meta awtorità kompetenti tkun approvat eżenzjoni parzjali mil-limitu massimu fuq l-influssi skont l-Artikolu 33(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, il-parti tal-ammont soġġetta għall-eżenzjoni tkun irrapportata fil-kolonna 0020 jew 0030 u l-parti tal-ammont mhux soġġetta għall-eżenzjoni tkun irrapportata fil-kolonna 0010. | |
| 0040 | **Il-valur tas-suq tal-kollateral riċevut — Soġġett għal-limitu massimu ta’ 75 % fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għar-ringieli 0269-0295, 0309-0335 u għar-ringiela 0490, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu jirrapportaw fil-kolonna 0040 il-valur tas-suq tal-kollateral riċevut f’għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali li huma soġġetti għal-limitu massimu ta’ 75 % fuq l-influssi kif speċifikat fl-Artikolu 33(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Meta awtorità kompetenti tkun approvat eżenzjoni parzjali mil-limitu massimu fuq l-influssi skont l-Artikolu 33(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, il-valur tas-suq tal-kollateral riċevut f’għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali soġġetti għall-eżenzjoni għandu jiġi rrapportat fil-kolonna 0050 jew 0060 u l-valur tas-suq tal-kollateral riċevut f’għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali mhux soġġetti għall-eżenzjoni għandu jiġi rrapportat fil-kolonna 0040. | |
| 0050 | **Il-valur tas-suq tal-kollateral riċevut — Soġġett għal-limitu massimu ta’ 90 % fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għar-ringieli 0269-0295, 0309-0335 u għar-ringiela 0490, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu jirrapportaw fil-kolonna 0050 il-valur tas-suq tal-kollateral riċevut f’għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali li huma soġġetti għal-limitu massimu ta’ 90 % fuq l-influssi kif speċifikat fl-Artikolu 33(4) u l-Artikolu 33(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Meta awtorità kompetenti tkun approvat eżenzjoni parzjali mil-limitu massimu fuq l-influssi skont l-Artikolu 33(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, il-valur tas-suq tal-kollateral riċevut f’għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali soġġetti għall-eżenzjoni għandu jiġi rrapportat fil-kolonna 0050 jew 0060 u l-valur tas-suq tal-kollateral riċevut f’għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali mhux soġġetti għall-eżenzjoni għandu jiġi rrapportat fil-kolonna 0040. | |
| 0060 | **Il-valur tas-suq tal-kollateral riċevut — Eżentat mil-limitu massimu fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għar-ringieli 0269-0295, 0309-0335 u għar-ringiela 0490, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu jirrapportaw fil-kolonna 0060 il-valur tas-suq tal-kollateral riċevut f’għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali li huma kompletament eżentati mil-limitu massimu fuq l-influssi kif speċifikat fl-Artikolu 33(2), l-Artikolu 33(3) u l-Artikolu 33(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Meta awtorità kompetenti tkun approvat eżenzjoni parzjali mil-limitu massimu fuq l-influssi skont l-Artikolu 33(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, il-valur tas-suq tal-kollateral riċevut f’għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali soġġetti għall-eżenzjoni għandu jiġi rrapportat fil-kolonna 0050 jew 0060 u l-valur tas-suq tal-kollateral riċevut f’għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali mhux soġġetti għall-eżenzjoni għandu jiġi rrapportat fil-kolonna 0040. | |
| 0070 | **Ponderazzjoni Standard**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Il-ponderazzjoniijiet standard fil-kolonna 0070 huma dawk speċifikati b’mod prestabbilit fir-Regolament Delegat (UE) 2015/61 u huma pprovduti għall-informazzjoni biss. | |
| 0080 | **Ponderazzjoni Applikabbli — Soġġett għal-limitu massimu ta’ 75 % fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Il-Ponderazzjoni Applikabbli hija dik speċifikata fl-Artikoli 32 sa 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. Il-ponderazzjonijiet applikabbli jistgħu jirriżultaw f’valuri medji ponderati u għandhom ikunu rrapportati f’termini deċimali (jiġifieri 1,00 għal ponderazzjoni applikabbli ta’ 100 fil-mija, jew 0,50 għal ponderazzjoni applikabbli ta’ 50 fil-mija). Il-ponderazzjonijiet applikabbli jistgħu jirriflettu, iżda mhumiex limitati għal, diskrezzjonijiet speċifiċi għall-kumpanija u diskrezzjonijiet nazzjonali.  Għar-ringieli 0040, 0060-0090, 0120-0130, 0150-0260, 0269, 0273, 0277, 0281, 0285, 0289, 0293, 0301-0303, 0309, 0313, 0317, 0321, 0325, 0329, 0333, 0341-0345, 0450 u 0470-0510, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu jirrapportaw fil-kolonna 0080 il-ponderazzjoni medja applikata għal assi/flejjes dovuti/ammonti massimi li jistgħu jiġu prelevati li huma soġġetti għal-limitu massimu ta’ 75 % fuq l-influssi kif speċifikat fl-Artikolu 33(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 0090 | **Ponderazzjoni Applikabbli — Soġġett għal-limitu massimu ta’ 90 % fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Il-ponderazzjonijiet Applikabbli huma dawk speċifikati fl-Artikoli 32 sa 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. Il-ponderazzjonijiet applikabbli jistgħu jirriżultaw f’valuri medji ponderati u għandhom ikunu rrapportati f’termini deċimali (jiġifieri 1,00 għal ponderazzjoni applikabbli ta’ 100 fil-mija, jew 0,50 għal ponderazzjoni applikabbli ta’ 50 fil-mija). Il-ponderazzjonijiet applikabbli jistgħu jirriflettu, iżda mhumiex limitati għal, diskrezzjonijiet speċifiċi għall-kumpanija u diskrezzjonijiet nazzjonali.  Għar-ringieli 0040, 0060-0090, 0120-0130, 0150-0260, 0269, 0273, 0277, 0281, 0285, 0289, 0293, 0301-0303, 0309, 0313, 0317, 0321, 0325, 0329, 0333, 0341-0345, 0450 u 0470-0510, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu jirrapportaw fil-kolonna 0090 il-ponderazzjoni medja applikata għal assi/flejjes dovuti/ammonti massimi li jistgħu jiġu prelevati li huma soġġetti għal-limitu massimu ta’ 90 % fuq l-influssi kif speċifikat fl-Artikolu 33(4) u l-Artikolu 33(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 0100 | **Ponderazzjoni Applikabbli — Eżentata mil-limitu massimu fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Il-ponderazzjonijiet Applikabbli huma dawk speċifikati fl-Artikoli 32 sa 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. Il-ponderazzjonijiet applikabbli jistgħu jirriżultaw f’valuri medji ponderati u għandhom ikunu rrapportati f’termini deċimali (jiġifieri 1,00 għal ponderazzjoni applikabbli ta’ 100 fil-mija, jew 0,50 għal ponderazzjoni applikabbli ta’ 50 fil-mija). Il-ponderazzjonijiet applikabbli jistgħu jirriflettu, iżda mhumiex limitati għal, diskrezzjonijiet speċifiċi għall-kumpanija u diskrezzjonijiet nazzjonali.  Għar-ringieli 0040, 0060-0090, 0120-0130, 0150-0260, 0269, 0273, 0277, 0281, 0285, 0289, 0293, 0301-0303, 0309, 0313, 0317, 0321, 0325, 0329, 0333, 0341-0345, 0450 u 0470 -0510, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu jirrapportaw fil-kolonna 0100 il-ponderazzjoni medja applikata għall-assi/flejjes dovuti/l-ammonti massimi li jistgħu jiġu prelevati li huma eżentati mil-limitu massimu fuq l-influssi kif speċifikat fl-Artikolu 33(2), l-Artikolu 33(3) u l-Artikolu 33(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 0110 | **Il-valur tal-kollateral riċevut skont l-Artikolu 9 — Soġġett għal-limitu massimu ta’ 75 % fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għar-ringieli 0271, 0275, 0279, 0283, 0287, 0291, 0295, 0311, 0315, 0319, 0323, 0327, 0331 u 0335, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-kolonna 0110 il-valur tal-kollateral riċevut skont l-Artikolu 9 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 f’għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali li huma soġġetti għal-limitu massimu ta’ 75 % fuq l-influssi kif speċifikat fl-Artikolu 33(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Meta awtorità kompetenti tkun approvat eżenzjoni parzjali mil-limitu massimu fuq l-influssi skont l-Artikolu 33(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, il-valur tal-kollateral riċevut skont l-Artikolu 9 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 f’għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali soġġetti għall-eżenzjoni għandu jkun irrapportat fil-kolonna 0120 jew 0130 u l-valur tal-kollateral riċevut skont l-Artikolu 9 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 f’għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali mhux soġġetti għall-eżenzjoni għandu jiġi rrapportat fil-kolonna 0110. | |
| 0120 | **Il-valur tal-kollateral riċevut skont l-Artikolu 9 — Soġġett għal-limitu massimu ta’ 90 % fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għar-ringieli 0271, 0275, 0279, 0283, 0287, 0291, 0295, 0311, 0315, 0319, 0323, 0327, 0331 u 0335, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-kolonna 0120 il-valur tal-kollateral riċevut skont l-Artikolu 9 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 f’għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali li huma soġġetti għal-limitu massimu ta’ 90 % fuq l-influssi kif speċifikat fl-Artikolu 33(4) u l-Artikolu 33(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Meta awtorità kompetenti tkun approvat eżenzjoni parzjali mil-limitu massimu fuq l-influssi skont l-Artikolu 33(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, il-valur tal-kollateral riċevut skont l-Artikolu 9 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 f’għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali soġġetti għall-eżenzjoni għandu jkun irrapportat fil-kolonna 0120 jew 0130 u l-valur tal-kollateral riċevut skont l-Artikolu 9 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 f’għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali mhux soġġetti għall-eżenzjoni għandu jiġi rrapportat fil-kolonna 0110. | |
| 0130 | **Il-valur tal-kollateral riċevut skont l-Artikolu 9 — Eżentat mil-limitu massimu fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għar-ringieli 0271, 0275, 0279, 0283, 0287, 0291, 0295, 0311, 0315, 0319, 0323, 0327, 0331 u 0335, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-kolonna 0130 il-valur tal-kollateral riċevut skont l-Artikolu 9 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 f’għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali li huma kompletament eżentati mil-limitu massimu fuq l-influssi kif speċifikat fl-Artikolu 33(2), l-Artikolu 33(3) u l-Artikolu 33(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Meta awtorità kompetenti tkun approvat eżenzjoni parzjali mil-limitu massimu fuq l-influssi skont l-Artikolu 33(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, il-valur tal-kollateral riċevut skont l-Artikolu 9 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 f’għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali soġġetti għall-eżenzjoni għandu jkun irrapportat fil-kolonna 0120 jew 0130 u l-valur tal-kollateral riċevut skont l-Artikolu 9 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 f’għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali mhux soġġetti għall-eżenzjoni għandu jiġi rrapportat fil-kolonna 0110. | |
| 0140 | | **Influss — Soġġett għal-limitu massimu ta’ 75 % fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għar-ringieli 0040, 0060-0090, 0120-0130, 0150-0260, 0269, 0273, 0277, 0281, 0285, 0289, 0293, 0301-0303, 0309, 0313, 0317, 0321, 0325, 0329, 0333, 0341-0345, 0450 u 0470-510, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu jirrapportaw fil-kolonna 0140 it-total tal-influssi li huma soġġetti għal-limitu massimu ta’ 75 % fuq l-influssi kif speċifikat fl-Artikolu 33(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 li għandu jiġi kkalkolat billi jiġi mmultiplikat l-ammont totali/l-ammont massimu li jista’ jiġi prelevat mill-kolonna 0010 bil-kolonna 0080 rilevanti.  Għar-ringiela 0170, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu jirrapportaw fil-kolonna 0140 it-total tal-influssi li huma soġġetti għal-limitu massimu ta’ 75 % fuq l-influssi kif speċifikat fl-Artikolu 33(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 biss jekk l-istituzzjoni ta’ kreditu tkun irċeviet dan l-impenn sabiex ikunu jistgħu jiżborżaw self promozzjonali lil riċevitur finali, jew ikunu rċevew impenn simili minn bank multilaterali tal-iżvilupp jew entità tas-settur pubbliku. |
| 0150 | | **Influss — Soġġett għal-limitu massimu ta’ 90 % fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għar-ringieli 0040, 0060-0090, 0120-0130, 0150-0260, 0269, 0273, 0277, 0281, 0285, 0289, 0293, 0301-0303, 0309, 0313, 0317, 0321, 0325, 0329, 0333, 0341-0345, 0450 u 0470-0510, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-kolonna 0150 it-total tal-influssi li huma soġġetti għal-limitu massimu ta’ 90 % fuq l-influssi kif speċifikat fl-Artikolu 33(4) u l-Artikolu 33(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 li għandu jiġi kkalkolat billi jiġi mmultiplikat l-ammont totali/l-ammont massimu li jista' jiġi prelevat mill-kolonna 0020 bil-kolonna 0090 rilevanti. Għar-ringiela 0170, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu jirrapportaw fil-kolonna 0150 it-total tal-influssi li huma soġġetti għal-limitu massimu ta’ 90 % fuq l-influssi kif speċifikat fl-Artikolu 33(4) u l-Artikolu 33(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 biss jekk l-istituzzjoni ta’ kreditu tkun irċeviet dan l-impenn sabiex ikunu jistgħu jiżborżaw self promozzjonali lil riċevitur finali, jew ikunu rċevew impenn simili minn bank multilaterali tal-iżvilupp jew entità tas-settur pubbliku. |
| 0160 | | **Influss — Eżentat mil-limitu massimu fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għar-ringieli 0040, 0060-0090, 0120-0130, 0150-0260, 0269, 0273, 0277, 0281, 0285, 0289, 0293, 0301-0303, 0309, 0313, 0317, 0321, 0325, 0329, 0333, 0341-0345, 0450 u 0470-0510, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-kolonna 0160 it-total tal-influssi li huma kompletament eżentati mil-limitu massimu fuq l-influssi kif speċifikat fl-Artikolu 33(2), l-Artikolu 33(3) u l-Artikolu 33(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 li għandu jiġi kkalkolat billi jiġi mmultiplikat l-ammont totali/l-ammont massimu li jista' jiġi prelevat mill-kolonna 0030 bil-piż relevanti mill-kolonna 0100.  Għar-ringiela 0170, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu jirrapportaw fil-kolonna 0160 it-total tal-influssi li huma kompletament eżentati mil-limitu massimu fuq l-influssi kif speċifikat fl-Artikolu 33(2), l-Artikolu 33(3) u l-Artikolu 33(5) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 biss jekk l-istituzzjoni ta’ kreditu tkun irċeviet dan l-impenn sabiex ikunu jistgħu jiżborżaw self promozzjonali lil riċevitur finali, jew ikunu rċevew impenn simili minn bank multilaterali tal-iżvilupp jew entità tas-settur pubbliku. |

1.5.2. Struzzjonijiet dwar ringieli speċifiċi

|  |  |
| --- | --- |
| Ringiela | Referenzi legali u struzzjonijiet |
| 0010 | **1. TOTAL TAL-INFLUSSI**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fir-ringiela 0010 ta’ C 74.00 tal-Anness XXIV   għal kull kolonna 0010, 0020 u 0030 l-ammont totali ta’ assi/flejjes dovuti/ammont massimu li jista’ jiġi prelevat bħala s-somma ta’ assi/flejjes dovuti/ammont massimu li jista’ jiġi prelevat minn tranżazzjonijiet/depożiti mhux garantiti u għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali;   għall-kolonna 0140 it-total tal-influssi bħala s-somma tal-influssi minn tranżazzjonijiet/depożiti mhux garantiti, għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali u tranżazzjonijiet ta’ swaps kollaterali nieqes id-differenza bejn it-total tal-influssi ponderati u l-flussi ta’ ħruġ ponderati totali li jirriżultaw minn tranżazzjonijiet f’pajjiżi terzi fejn hemm restrizzjonijiet fuq it-trasferiment jew li huma denominati f’muniti mhux konvertibbli; u   għall-kolonna 0150 u 0160 it-total tal-influssi bħala s-somma tal-influssi minn tranżazzjonijiet/depożiti mhux garantiti, għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali u tranżazzjonijiet ta’ swaps kollaterali bit-tnaqqis tad-differenza bejn it-total tal-influssi ponderati u l-flussi ta’ ħruġ ponderati totali li jirriżultaw minn tranżazzjonijiet f’pajjiżi terzi fejn hemm restrizzjonijiet fuq it-trasferiment jew li huma denominati f’muniti mhux konvertibbli u li minnhom jitnaqqas l-eċċess ta’ influssi minn istituzzjoni ta’ kreditu speċjalizzata relatata msemmija fil-punt (e) tal-Artikolu 2(3) u l-Artikolu 33(6) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0020 | **1.1. Influssi minn tranżazzjonijiet/depożiti mhux garantiti**  L-Artikoli 32, 33 u 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fir-ringiela 0020 ta’ C 74.00 tal-Anness XXIV   għal kull kolonna 0010, 0020 u 0030 l-ammont totali ta’ assi/flejjes dovuti/ammont massimu li jista’ jiġi prelevat minn tranżazzjonijiet/depożiti mhux garantiti; u   għal kull kolonna 0140, 0150 u 0160 it-total tal-influssi minn tranżazzjonijiet/depożiti mhux garantiti. |
| 0030 | **1.1.1. flejjes dovuti minn konsumaturi mhux finanzjarji (minbarra banek ċentrali)**  Il-punt (a) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fir-ringiela 0030 ta’ C 74.00 tal-Anness XXIV   għal kull kolonna 0010, 0020 u 0030 l-ammont totali ta’ flejjes dovuti minn konsumaturi mhux finanzjarji (minbarra banek ċentrali) (flejjes dovuti minn konsumaturi mhux finanzjarji li ma jikkorrispondux għall-ħlasijiet lura tal-kapital kif ukoll kwalunkwe flejjes oħra dovuti minn konsumaturi mhux finanzjarji) u   għal kull kolonna 0140, 0150 u 0160 it-total tal-influssi minn konsumaturi mhux finanzjarji (ħlief għall-banek ċentrali) (influssi minn konsumaturi mhux finanzjarji li ma jikkorrispondux għal ripagamenti tal-kapital kif ukoll kwalunkwe influss ieħor minn konsumaturi mhux finanzjarji).  Il-klijenti mhux finanzjarji għandhom jinkludu, iżda ma jkunux limitati għal, persuni fiżiċi, SMEs, korporattivi, sovrani, banek multilaterali tal-iżvilupp u entitajiet tas-settur pubbliku skont l-Artikolu 31a tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Flejjes dovuti minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali ma’ klijent mhux finanzjarju li huma kkollateralizzati permezz ta’ assi likwidi skont it-Titolu II tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, fejn dawn it-tranżazzjonijiet huma speċifikati fil-punti (2) u (3) tal-Artikolu 192 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, għandhom ikunu rrapportati fit-taqsima 1.2. u ma għandhomx ikunu rrapportati fit-taqsima 1.1.1. Il-flejjes dovuti minn tranżazzjonijiet bħal dawn li huma kollateralizzati minn titoli trasferibbli li ma jikkwalifikawx bħala assi likwidi skont it-Titolu II tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 għandhom ikunu rapportati fit-taqsima 1.2. u ma għandhomx ikunu rapportati fit-taqsima 1.1.1. Il-flejjes dovuti minn tranżazzjonijiet bħal dawn ma’ klijenti mhux finanzjarji li huma kkollateralizzati minn assi mhux trasferibbli li ma jikkwalifikawx bħala assi likwidi skont it-Titolu II tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 għandhom ikunu rapportati fir-ringiela rilevanti tat-taqsima 1.1.1.  Flejjes dovuti minn banek ċentrali għandhom ikunu rapportati fit-taqsima 1.1.2. u ma għandhomx ikunu rrapportati hawnhekk. Flejjes dovuti minn transazzjonijiet ta’ finanzjament tal-kummerċ b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum għandhom jiġu rrapportati fit-taqsima 1.1.4. u ma għandhomx jiġu rrapportati hawnhekk. Flejjes dovuti minn titoli li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju għandhom ikunu rapportati fit-taqsima 1.1.5. u ma għandhomx ikunu rrapportati hawnhekk. |
| 0040 | **1.1.1.1. flejjes dovuti minn konsumaturi mhux finanzjarji (ħlief għal banek ċentrali) li ma jikkorrispondux għal ripagament tal-kapital**  Il-punt (a) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Flejjes dovuti minn konsumaturi mhux finanzjarji (ħlief għal banek ċentrali) b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum li ma jikkorrispondux għal ripagament tal-kapital. Dawn l-influssi jinkludu l-imgħax u t-tariffi dovuti minn klijenti mhux finanzjarji (minbarra banek ċentrali). Flejjes dovuti minn banek ċentrali li ma jikkorrispondux għal ripagament prinċipali għandhom ikunu rrapportati fit-taqsima 1.1.2. u ma għandhomx ikunu rrapportati hawnhekk. |
| 0050 | **1.1.1.2. flejjes oħra dovuti minn konsumaturi mhux finanzjarji (minbarra banek ċentrali)**  Il-punt (a) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fir-ringiela 0050 ta’ C 74.00 tal-Anness XXIV   għal kull kolonna 0010, 0020 u 0030 l-ammont totali ta’ flejjes oħra dovuti minn konsumaturi mhux finanzjarji (minbarra banek ċentrali) bħala s-somma ta’ flejjes dovuti minn konsumaturi mhux finanzjarji skont il-kontroparti u   għal kull kolonna 0140, 0150 u 0160 it-total tal-influssi oħrajn minn konsumaturi mhux finanzjarji (ħlief għall-banek ċentrali) bħala s-somma ta’ influssi oħrajn minn klijenti mhux finanzjarji skont il-kontroparti.  Flejjes dovuti minn konsumaturi mhux finanzjarji (minbarra banek ċentrali) li ma jikkorrispondux għal ripagament ta’ kapital għandhom ikunu rrapportati fit-taqsima 1.1.1.1. u ma għandhomx ikunu rrapportati hawnhekk.  Flejjes oħrajn dovuti minn banek ċentrali għandhom ikunu rrapportati fit-taqsima 1.1.2. u ma għandhomx ikunu rrapportati hawnhekk.  Influssi li jikkorrispondu għal flussi ta’ ħruġ skont l-impenji ta’ għoti ta’ self promozzjonali msemmija fl-Artikolu 31(9) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 għandhom ikunu rrapportati fit-taqsima 1.1.3. u ma għandhomx ikunu rrapportati hawnhekk. |
| 0060 | **1.1.1.2.1. flejjes dovuti minn klijenti bl-imnut**  Il-punt (a) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Il-flejjes dovuti minn klijenti fil-livell tal-konsumaturi b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum. |
| 0070 | **1.1.1.2.2. flejjes dovuti minn korporazzjonijiet mhux finanzjarji**  Il-punt (a) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Flejjes dovuti minn korporazzjonijiet mhux finanzjarji b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum. |
| 0080 | **1.1.1.2.3. flejjes dovuti minn sovrani, banek multilaterali tal-iżvilupp u entitajiet tas-settur pubbliku**  Il-punt (a) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Il-flejjes dovuti minn sovrani, banek multilaterali tal-iżvilupp u entitajiet tas-settur pubbliku b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum. |
| 0090 | **1.1.1.2.4. flejjes dovuti minn entitajiet legali oħra**  Il-punt (a) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Flejjes dovuti minn entitajiet legali oħrajn mhux inklużi band’oħra aktar ’il fuq b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum. |
| 0100 | **1.1.2. flejjes dovuti minn banek ċentrali u klijenti finanzjarji**  Il-punt (a) tal-Artikolu 32(2) u l-punt (d) tal-Artikolu 32(3) flimkien mal-Artikolu 27 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fir-ringiela 0100 ta’ C 74.00 tal-Anness XXIV   għal kull kolonna 0010, 0020 u 0030 l-ammont totali ta’ flejjes dovuti minn banek ċentrali u klijenti finanzjarji (depożiti operazzjonali kif ukoll mhux operazzjonali); u   għal kull kolonna 0140, 0150 u 0160 it-total tal-influssi minn banek ċentrali u klijenti finanzjarji (depożiti operazzjonali kif ukoll mhux operazzjonali).  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flejjes dovuti b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum minn banek ċentrali u klijenti finanzjarji, li għadhom ma skadewx u li għalihom il-bank ma jkollu l-ebda raġuni għalfejn jistenna minnhom nuqqas ta’ prestazzjoni fi żmien 30 jum tal-kalendarju.  Flejjes dovuti minn banek ċentrali u klijenti finanzjarji li ma jikkorrispondux għal ripagament ta’ kapital għandhom ikunu rrapportati fit-taqsima rilevanti.  Depożiti fl-istituzzjoni ċentrali msemmija fl-Artikolu 27(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 ma għandhomx ikunu rrapportati bħala influss.  Flejjes dovuti minn transazzjonijiet ta’ finanzjament tal-kummerċ b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum għandhom jiġu rrapportati fit-taqsima 1.1.4. u ma għandhomx jiġu rrapportati hawnhekk. Flejjes dovuti minn titoli li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju għandhom ikunu rapportati fit-taqsima 1.1.5. u ma għandhomx ikunu rrapportati hawnhekk. |
| 0110 | **1.1.2.1. flejjes dovuti minn klijenti finanzjarji li huma kklassifikati bħala depożiti operazzjonali**  Il-punt (d) tal-Artikolu 32(3) flimkien mal-Artikolu 27 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fir-ringiela 0110 ta’ C 74.00 tal-Anness XXIV   għal kull kolonna 0010, 0020 u 0030 l-ammont totali ta’ flejjes dovuti minn klijenti finanzjarji li huma kklassifikati bħala depożiti operazzjonali (mingħajr ma jitqies jekk l-istituzzjoni ta’ kreditu hijiex kapaċi tistabbilixxi rata ta’ fluss ta’ dħul simmetriku korrispondenti jew le); u   għal kull kolonna 0140, 0150 u 0160 it-total tal-influssi minn klijenti finanzjarji li huma kklassifikati bħala depożiti operazzjonali (mingħajr ma jitqies jekk l-istituzzjoni ta’ kreditu hijiex kapaċi tistabbilixxi rata ta’ influss simmetriku korrispondenti jew le).  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk flejjes dovuti minn klijenti finanzjarji biex, l-istituzzjoni ta’ kreditu, tikseb servizzi ta’ kklerjar, kustodja jew ta’ mmaniġġjar tal-flus skont l-Artikolu 27 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0120 | **1.1.2.1.1. flejjes dovuti minn klijenti finanzjarji li huma kklassifikati bħala depożiti operazzjonali fejn l-istituzzjoni ta’ kreditu tista’ tistabbilixxi rata ta’ fluss ta’ dħul simmetrika korrispondenti**  Il-punt (d) tal-Artikolu 32(3) flimkien mal-Artikolu 27 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Flejjes dovuti minn klijenti finanzjarji b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum biex l-istituzzjoni ta’ kreditu tikseb servizzi ta’ kklerjar, kustodja jew ta’ mmaniġġjar tal-flus skont l-Artikolu 27 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 fejn l-istituzzjoni ta’ kreditu tista’ tistabbilixxi rata ta’ influss simmetriku korrispondenti. |
| 0130 | **1.1.2.1.2. flejjes dovuti minn klijenti finanzjarji li huma kklassifikati bħala depożiti operazzjonali meta l-istituzzjoni ta’ kreditu ma tkunx tista’ tistabbilixxi rata tal-fluss ta’ dħul simmetriku korrispondenti**  Il-punt (d) tal-Artikolu 32(3) flimkien mal-Artikolu 27 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Flejjes dovuti minn klijenti finanzjarji b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum biex l-istituzzjoni ta’ kreditu tikseb servizzi ta’ kklerjar, kustodja jew ta’ mmaniġġjar tal-flus skont l-Artikolu 27 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 fejn l-istituzzjoni ta’ kreditu ma tistax tistabbilixxi rata ta’ influss simmetriku korrispondenti.Għal dawn l-entrati, għandha tiġi applikata rata ta’ influss ta’ 5 %. |
| 0140 | **1.1.2.2. flejjes dovuti minn banek ċentrali u klijenti finanzjarji li mhumiex ikklassifikati bħala depożiti operazzjonali**  Il-punt (a) tal-Artikolu 32(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fir-ringiela 140 ta’ C 74.00 tal-Anness XXIV   għal kull kolonna 0010, 0020 u 0030 l-ammont totali ta’ flejjes dovuti minn banek ċentrali u klijenti finanzjarji li mhumiex ikklassifikati bħala depożiti operazzjonali u   għal kull kolonna 0140, 0150 u 0160 l-influssi totali minn banek ċentrali u klijenti finanzjarji li mhumiex ikklassifikati bħala depożiti operazzjonali.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk flejjes dovuti minn banek ċentrali u klijenti finanzjarji li ma jikkwalifikawx għat-trattament bħala depożiti operazzjonali kif speċifikati fil-punt (d) tal-Artikolu 32(3) flimkien mal-Artikolu 27 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0150 | **1.1.2.2.1. flejjes dovuti minn banek ċentrali**  Il-punt (a) tal-Artikolu 32(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Flejjes dovuti minn banek ċentrali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum skont il-punt (a) tal-Artikolu 32(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0160 | **1.1.2.2.2. flejjes dovuti minn klijenti finanzjarji**  Il-punt (a) tal-Artikolu 32(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Flejjes dovuti minn klijenti finanzjarji b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum li ma jikkwalifikawx għat-trattament bħala depożiti operazzjonali kif speċifikat fl-Artikolu 32(3) flimkien mal-Artikolu 27 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Influssi li jikkorrispondu għal flussi ta’ ħruġ skont l-impenji ta’ għoti ta’ self promozzjonali msemmija fl-Artikolu 31(9) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 għandhom ikunu rrapportati fit-taqsima 1.1.3. u ma għandhomx ikunu rrapportati hawnhekk. |
| 0170 | **1.1.3. influssi li jikkorrispondu għal flussi ta’ ħruġ skont l-impenji ta’ self promozzjonali msemmija fl-Artikolu 31(9) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61**  Il-punt (a) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Influssi li jikkorrispondu għal flussi ta’ ħruġ skont l-impenji ta’ għoti ta’ self promozzjonali msemmija fl-Artikolu 31(9) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0180 | **1.1.4. flejjes dovuti minn tranżazzjonijiet ta’ finanzjament tal-kummerċ**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Flejjes dovuti minn tranżazzjonijiet ta’ finanzjament tal-kummerċ b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum skont il-punt (b) tal-Artikolu 32(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0190 | **1.1.5. flejjes dovuti minn titoli li jimmaturaw fi żmien 30 jum**  Il-punt (c) tal-Artikolu 32(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Flejjes dovuti minn titoli li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju skont il-punt (c) tal-Artikolu 32(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0201 | **1.1.6. self b’data ta’ skadenza kuntrattwali indefinita**  Il-punt (i) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Self b’data ta’ skadenza kuntrattwali indefinita skont il-punt (i) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. L-istituzzjoni ta’ kreditu għandha tikkunsidra biss dak is-self fejn il-kuntratt jippermetti lill-istituzzjoni ta’ kreditu tippreleva jew titlob pagamenti fi żmien 30 jum tal-kalendarju. Imgħax u pagamenti minimi li jkunu se jiġu debitati lill-kont tal-klijent fi żmien 30 jum tal-kalendarju għandhom jiġu inklużi fl-ammont rappurtat. L-imgħax u l-pagamenti minimi minn self b’data ta’ skadenza kuntrattwali indefinita li huma kuntrattwalment dovuti u joħolqu influss reali ta’ flus fi żmien it-30 jum tal-kalendarju li ġejjin għandhom jitqiesu bħala flejjes dovuti u għandhom ikunu rrapportati fir-ringiela rilevanti, skont it-trattament preskritt mill-Artikolu 32 għall-flejjes dovuti. L-istituzzjonijiet ta’ kreditu ma għandhomx jirrapportaw imgħax ieħor li jakkumula, iżda li la huwa ddebitat fuq il-kont tal-klijent u lanqas ma joħloq influss attwali ta’ flus fuq 30 jum tal-kalendarju li jmiss. |
| 0210 | **1.1.7. flejjes dovuti minn pożizzjonijiet fi strumenti ta’ ekwità ta’ indiċi ewlenin sakemm ma jkunx hemm għadd doppju b’assi likwidi**  Il-punt (d) tal-Artikolu 32(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Il-flejjes dovuti minn pożizzjonijiet fi strumenti ta’ ekwità ta’ indiċi ewlenien dment li l-assi likwidi ma jingħaddux darbtejn skont il-punt (d) tal-Artikolu 32(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. Il-pożizzjoni għandha tinkludi l-flejjes kuntrattwalment dovuti fi żmien 30 jum kalendarju, bħal dividendi fi flus minn dawk l-indiċijiet prinċipali u flus dovuti minn dawk l-istrumenti ta’ ekwità mibjugħa iżda li għadhom ma ġewx saldati, jekk ma jiġux rikonoxxuti bħala assi likwidi f’konformità mat-Titolu II tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0230 | **1.1.8. influssi mir-rilaxx ta’ bilanċi miżmumin f’kontijiet segregati skont ir-rekwiżiti regolatorji għall-protezzjoni tal-assi tan-negozjar tal-klijenti**  L-Artikolu 32(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Influssi mir-rilaxx ta’ bilanċi miżmumin f’kontijiet segregati skont ir-rekwiżiti regolatorji għall-protezzjoni tal-assi għan-negozju ta’ konsumaturi skont l-Artikolu 32(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  L-influssi għandhom ikunu kkunsidrati biss jekk dawn il-bilanċi jkunu miżmumin f’assi likwidi kif speċifikat fit-Titolu II tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0240 | **1.1.9. influssi minn derivattivi**  L-Artikolu 32(5) flimkien mal-Artikolu 21 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-ammont nett tal-ammonti riċevibbli mistenni matul il-perjodu ta’ 30 jum tal-kalendarju li ġejjin mill-kuntratti elenkati fl-Anness II tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 u minn derivattivi ta’ kreditu.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jikkalkolaw l-influssi mistennija matul 30 jum tal-kalendarju fuq bażi netta minn kontroparti soġġetti għall-eżistenza ta’ ftehimiet ta’ netting bilaterali skont l-Artikolu 295 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. Il-bażi netta għandha tfisser ukoll in-nett tal-kollateral li għandu jkun riċevut dment li jikkwalifika bħala assi likwidu taħt it-Titolu II tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Il-flussi ta’ ħruġ u l-influssi ta’ flus li jirriżultaw minn tranżazzjonijiet ta’ derivattivi f’munita barranija jew derivattivi ta’ kreditu li jinvolvu skambju sħiħ ta’ ammonti prinċipali fuq bażi simultanja (jew fl-istess jum) għandhom ikunu kkalkolati fuq bażi netta, anki meta dawk it-tranżazzjonijiet mhumiex koperti minn ftehim ta’ netting bilaterali.  Fil-każ ta’ rapportar separat skont l-Artikolu 415(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, it-tranżazzjonijiet ta’ derivattivi jew derivattivi tal-kreditu għandhom jiġu separati f’kull munita rispettiva. In-netting skont il-kontroparti jista’ jkun applikat għall-flussi f’dik il-munita. |
| 0250 | **1.1.10. influssi minn faċilitajiet ta’ kreditu jew ta’ likwidità mhux prelevati pprovduti minn membri ta’ grupp jew skema ta’ protezzjoni istituzzjonali fejn l-awtoritajiet kompetenti jkunu taw permess biex tiġi applikata rata ogħla ta’ influssi**  L-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Influssi minn faċilitajiet ta’ kreditu jew ta’ likwidità mhux prelevati pprovduti minn membri ta’ grupp jew skema ta’ protezzjoni istituzzjonali fejn l-awtoritajiet kompetenti taw permess sabiex japplikaw rata ogħla ta’ influssi skont l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0260 | **1.1.11. influssi oħrajn**  L-Artikolu 32(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-influssi l-oħrajn kollha skont l-Artikolu 32(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 mhux irrapportati x’imkien ieħor fil-formula. |
| 0263 | **1.2. Influssi minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq tal-kapital**  Il-punti (b), (c) u (f) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 jirreferu għall-influssi li jirriżultaw minn tranżazzjonijiet ta’ għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet li huma mmotivati mis-suq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fir-ringiela 0263 ta’ C 74.00 tal-Anness XXIV   għal kull kolonna 0010, 0020 u 0030 l-ammont totali ta’ flejjes dovuti minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali; u   għal kull kolonna 0140, 0150 u 0160 it-total tal-influssi minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali.  Tranżazzjonijiet ta’ swaps kollaterali li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju għandhom ikunu rapportati fil-Formula C 75.01 tal-Anness XXIV u ma għandhomx ikunu rrapportati hawnhekk. |
| 0265 | **1.2.1. il-kontroparti hija bank ċentrali**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk l-influssi minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali kif definit fil-punti (2) u (3) tal-Artikolu 192 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum fejn il-kontroparti hija bank ċentrali.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fir-ringiela 0265 ta’ C 74.00 tal-Anness XXIV   għal kull kolonna 0010, 0020 u 0030 l-ammont totali ta’ flejjes dovuti minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali fejn il-kontroparti hija bank ċentrali; u   għal kull kolonna 0140, 0150 u 0160 it-total tal-influssi minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali fejn il-kontroparti hija bank ċentrali. |
| 0267 | **1.2.1.1. kollateral li jikkwalifika bħala assi likwidu**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fir-ringiela 0267 ta’ C 74.00 tal-Anness XXIV   għal kull kolonna 0010, 0020 u 0030 l-ammont totali ta’ flejjes dovuti minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum fejn il-kontroparti hija bank ċentrali u fejn it-tranżazzjoni hija kollateralizzata b’assi likwidi; u   * għal kull kolonna 0140, 0150 u 0160 it-total tal-influssi minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum fejn il-kontroparti hija bank ċentrali u fejn it-tranżazzjoni hija kollateralizzata b’assi likwidi.   L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum meta l-kontroparti hija bank ċentrali u fejn it-tranżazzjoni hija kollateralizzata b’assi likwidi, kemm jekk jerġgħu jintużaw fi tranżazzjoni oħra kif ukoll jekk le u irrispettivament minn jekk l-assi likwidi riċevuti jissodisfawx ir-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) Nru 2015/61. |
| 0269 | **1.2.1.1.1. Kollateral tal-Livell 1 minbarra bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum meta l-kontroparti tkun bank ċentrali u fejn it-tranżazzjoni tkun kollateralizzata minn assi li, irrispettivament minn jekk jerġgħux jintużaw fi tranżazzjoni oħra jew le, jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 10 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidi ta’ kwalunkwe waħda mill-kategoriji ta’ assi tal-livell 1 imsemmija fl-Artikolu 10 bl-eċċezzjoni ta’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna msemmija fil-punt (f) tal-Artikolu 10(1). |
| 0271 | **1.2.1.1.1.1.** **li minnu l-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.1.1.1, dawk it-tranżazzjonijiet fejn il-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0273 | **1.2.1.1.2. Kollateral tal-Livell 1 li huma bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum meta l-kontroparti tkun bank ċentrali u fejn it-tranżazzjoni tkun kollateralizzata minn assi li, irrispettivament minn jekk jerġgħux jintużaw fi tranżazzjoni oħra jew le, jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 10 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidi tal-kategorija msemmija fil-punt (f) tal-Artikolu 10(1). |
| 0275 | **1.2.1.1.2.1.** **li minnu l-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.1.1.2, dawk it-tranżazzjonijiet fejn il-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0277 | **1.2.1.1.3. Kollateral tal-Livell 2 A**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum meta l-kontroparti tkun bank ċentrali u fejn it-tranżazzjoni tkun kollateralizzata minn assi li, irrispettivament minn jekk jerġgħux jintużaw fi tranżazzjoni oħra jew le, jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 11 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidi ta’ kwalunkwe waħda mill-kategoriji ta’ assi tal-livell 2A msemmija fl-Artikolu 11. |
| 0279 | **1.2.1.1.3.1.** **li minnu l-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.1.1.3, dawk it-tranżazzjonijiet fejn il-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0281 | **1.2.1.1.4. Kollateral ta’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi)**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum meta l-kontroparti tkun bank ċentrali u fejn it-tranżazzjoni tkun kollateralizzata minn assi li, irrispettivament minn jekk jerġgħux jintużaw fi tranżazzjoni oħra jew le, jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 13 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidi ta’ kwalunkwe waħda mill-kategoriji ta’ assi tal-livell 2B imsemmija fil-punt (g)(i), (g)(ii) jew (g)(iv) tal-Artikolu 13(2). |
| 0283 | **1.2.1.1.4.1.** **li minnu l-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.1.1.4, dawk it-tranżazzjonijiet fejn il-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0285 | **1.2.1.1.5. Kollateral ta’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum meta l-kontroparti tkun bank ċentrali u fejn it-tranżazzjoni tkun kollateralizzata minn assi li, irrispettivament minn jekk jerġgħux jintużaw fi tranżazzjoni oħra jew le, jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 12 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidi tal-kategorija ta’ assi tal-livell 2B imsemmija fil-punt (e) tal-Artikolu 12(1). |
| 0287 | **1.2.1.1.5.1.** **li minnu l-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.1.1.5, dawk it-tranżazzjonijiet fejn il-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0289 | **1.2.1.1.6. Kollateral ta’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali)**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum meta l-kontroparti tkun bank ċentrali u fejn it-tranżazzjoni tkun kollateralizzata minn assi li, irrispettivament minn jekk jerġgħux jintużaw fi tranżazzjoni oħra jew le, jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 13 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidi ta’ kwalunkwe waħda mill-kategoriji ta’ assi tal-livell 2B imsemmija fil-punt (g)(iii) jew (g)(v) tal-Artikolu 13(2). |
| 0291 | **1.2.1.1.6.1.** **li minnu l-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.1.1.6, dawk it-tranżazzjonijiet fejn il-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0293 | **1.2.1.1.7. Kollateral tal-Livell 2B li ma ġiex inkluż diġà fit-taqsima 1.2.1.1.4., 1.2.1.1.5. jew 1.2.1.1.6.**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum meta l-kontroparti tkun bank ċentrali u fejn it-tranżazzjoni tkun kollateralizzata minn assi li, irrispettivament minn jekk jerġgħux jintużaw fi tranżazzjoni oħra jew le, jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 12 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidi ta’ kwalunkwe waħda mill-kategoriji ta’ assi tal-livell 2B imsemmija fil-punt (b), (c) jew (f) tal-Artikolu 12(1). |
| 0295 | **1.2.1.1.7.1.** **li minnu l-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.1.1.7, dawk it-tranżazzjonijiet fejn il-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0297 | **1.2.1.2. kollateral jintuża biex ikopri pożizzjoni qasira**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum fejn il-kontroparti hija bank ċentrali u fejn it-tranżazzjoni hija kollateralizzata b’assi li jintużaw biex ikopru pożizzjoni bin-nieqes skont it-tieni sentenza tal-Artikolu 30(5). Fejn kollateral ta’ kwalunkwe tip jintuża sabiex ikopri pożizzjoni qasira, dan għandu jkun irrapportat hawnhekk u mhux f’xi waħda mil-linji ta’ hawn fuq. Ma għandux ikun hemm għadd doppju. |
| 0299 | **1.2.1.3. kollateral li ma jikkwalifikax bħala assi likwidu**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fir-ringiela 0299 ta’ C 74.00 tal-Anness XXIV għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum meta l-kontroparti tkun bank ċentrali u fejn il-kollateral ma jikkwalifikax bħala assi likwidu. L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw   * għal kull kolonna 0010, 0020 u 0030 l-ammont totali ta’ flejjes dovuti minn dawk it-tranżazzjonijiet bħala s-somma tal-flejjes dovuti minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali fejn il-kollateral huwa ekwità mhux likwida u għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali garantiti bi kwalunkwe kollateral mhux likwidu ieħor; u * għal kull kolonna 0140, 0150 u 0160 it-total tal-influssi minn dawk it-tranżazzjonijiet bħala s-somma tal-influssi minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali fejn il-kollateral huwa ekwità mhux likwida u għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali ggarantiti minn kwalunkwe kollateral mhux likwidu ieħor. |
| 0301 | **1.2.1.3.1. kollateral huwa ekwità mhux likwida**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum meta l-kontroparti hija bank ċentrali u fejn it-tranżazzjoni tkun kollateralizzata b’ekwità mhux likwida. |
| 0303 | **1.2.1.3.2 il-kollateral mhux likwidu l-ieħor kollu**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għoti ta’ Self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum fejn il-kontroparti hija bank ċentrali u fejn it-tranżazzjoni hija kollateralizzata b’assi mhux likwidi mhux diġà koperti fit-taqsima 1.2.1.3.1. |
| 0305 | **1.2.2. il-kontroparti mhijiex bank ċentrali**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk l-influssi minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali kif definit fil-punti (2) u (3) tal-Artikolu 192 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum fejn il-kontroparti mhijiex bank ċentrali.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fir-ringiela 0305 ta’ C 74.00 tal-Anness XXIV   għal kull kolonna 0010, 0020 u 0030 l-ammont totali ta’ flejjes dovuti minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali fejn il-kontroparti mhijiex bank ċentrali; u   għal kull kolonna 0140, 0150 u 0160 it-total tal-influssi minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali fejn il-kontroparti mhijiex bank ċentrali. |
| 0307 | **1.2.2.1. kollateral li jikkwalifika bħala assi likwidu**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fir-ringiela 0307 ta’ C 74.00 tal-Anness XXIV   għal kull kolonna 0010, 0020 u 0030 l-ammont totali ta’ flejjes dovuti minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum fejn il-kontroparti mhijiex bank ċentrali u fejn it-tranżazzjoni hija kollateralizzata b’assi likwidi; u   * għal kull kolonna 0140, 0150 u 0160 it-total tal-influssi minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum fejn il-kontroparti mhijiex bank ċentrali u fejn it-tranżazzjoni hija kollateralizzata b’assi likwidi.   L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum meta l-kontroparti mhijiex bank ċentrali u fejn it-tranżazzjoni hija kollateralizzata b’assi likwidi, kemm jekk jerġgħu jintużaw fi tranżazzjoni oħra kif ukoll jekk le u irrispettivament minn jekk l-assi likwidi riċevuti jissodisfawx ir-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) Nru 2015/61. |
| 0309 | **1.2.2.1.1. Kollateral tal-Livell 1 minbarra bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum meta l-kontroparti ma tkunx bank ċentrali u fejn it-tranżazzjoni tkun kollateralizzata minn assi li, irrispettivament minn jekk jerġgħux jintużaw fi tranżazzjoni oħra jew le, jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 10 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidi ta’ kwalunkwe waħda mill-kategoriji ta’ assi tal-livell 1 imsemmija fl-Artikolu 10 bl-eċċezzjoni ta’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna msemmija fil-punt (f) tal-Artikolu 10(1). |
| 0311 | **1.2.2.1.1.1.** **li minnu l-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.2.1.1, dawk it-tranżazzjonijiet fejn il-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0313 | **1.2.2.1.2. Kollateral tal-Livell 1 li huma bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum meta l-kontroparti ma tkunx bank ċentrali u fejn it-tranżazzjoni tkun kollateralizzata minn assi li, irrispettivament minn jekk jerġgħux jintużaw fi tranżazzjoni oħra jew le, jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 10 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidi tal-kategorija msemmija fil-punt (f) tal-Artikolu 10(1). |
| 0315 | **1.2.2.1.2.1.** **li minnu l-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.2.1.2, dawk it-tranżazzjonijiet fejn il-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0317 | **1.2.2.1.3. Kollateral tal-Livell 2 A**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum meta l-kontroparti ma tkunx bank ċentrali u fejn it-tranżazzjoni tkun kollateralizzata minn assi li, irrispettivament minn jekk jerġgħux jintużaw fi tranżazzjoni oħra jew le, jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 11 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidi ta’ kwalunkwe waħda mill-kategoriji ta’ assi tal-livell 2A msemmija fl-Artikolu 11. |
| 0319 | **1.2.2.1.3.1.** **li minnu l-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.2.1.3, dawk it-tranżazzjonijiet fejn il-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0321 | **1.2.2.1.4. Kollateral ta’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi)**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum fejn il-kontroparti mhijiex bank ċentrali u fejn it-tranżazzjoni hija kollateralizzata minn assi li, irrispettivament minn jekk jerġgħux jintużaw fi tranżazzjoni oħra jew le, jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 13 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidi ta’ kwalunkwe waħda mill-kategoriji ta’ assi tal-livell 2B imsemmija fil-punt (g)(i), (g)(ii) jew (g)(iv) tal-Artikolu 13(2). |
| 0323 | **1.2.2.1.4.1.** **li minnu l-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.2.1.4, dawk it-tranżazzjonijiet fejn il-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0325 | **1.2.2.1.5. Kollateral ta’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum fejn il-kontroparti mhijiex bank ċentrali u fejn it-tranżazzjoni hija kollateralizzata minn assi li, irrispettivament minn jekk jerġgħux jintużaw fi tranżazzjoni oħra jew le, jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 12 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidi tal-kategorija ta’ assi tal-livell 2B imsemmija fil-punt (e) tal-Artikolu 12(1). |
| 0327 | **1.2.2.1.5.1.** **li minnu l-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.2.1.5, dawk it-tranżazzjonijiet fejn il-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0329 | **1.2.2.1.6. Kollateral ta’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali)**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum fejn il-kontroparti mhijiex bank ċentrali u fejn it-tranżazzjoni hija kollateralizzata minn assi li, irrispettivament minn jekk jerġgħux jintużaw fi tranżazzjoni oħra jew le, jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 13 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidi ta’ kwalunkwe waħda mill-kategoriji ta’ assi tal-livell 2B imsemmija fil-punt (g) (iii) jew (g)(v) tal-Artikolu 13(2). |
| 0331 | **1.2.1.1.6.1.** **li minnu l-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.2.1.6, dawk it-tranżazzjonijiet fejn il-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0333 | **1.2.2.1.7. Kollateral tal-Livell 2B li ma ġiex inkluż diġà fit-taqsima 1.2.2.1.4., 1.2.2.1.5. jew 1.2.2.1.6.**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum meta l-kontroparti ma tkunx bank ċentrali u fejn it-tranżazzjoni tkun kollateralizzata minn assi li, irrispettivament minn jekk jerġgħux jintużaw fi tranżazzjoni oħra jew le, jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 12 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidi ta’ kwalunkwe waħda mill-kategoriji ta’ assi tal-livell 2B imsemmija fil-punt (b), (c) jew (f) tal-Artikolu 12(1). |
| 0335 | **1.2.2.1.7.1.** **li minnu l-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.2.1.7, dawk it-tranżazzjonijiet fejn il-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0337 | **1.2.2.2. kollateral jintuża biex ikopri pożizzjoni qasira**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għoti ta’ Self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum fejn il-kontroparti mhijiex bank ċentrali u fejn it-tranżazzjoni hija kollateralizzata b’assi li jintużaw biex ikopru pożizzjoni qasira skont it-tieni sentenza tal-Artikolu 30(5). Fejn kollateral ta’ kwalunkwe tip jintuża sabiex ikopri pożizzjoni qasira, dan għandu jkun irrapportat hawnhekk u mhux f’xi waħda mil-linji ta’ hawn fuq. Ma għandux ikun hemm għadd doppju. |
| 339 | **1.2.2.3. kollateral li ma jikkwalifikax bħala assi likwidu**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fir-ringiela 0339 ta’ C 74.00 tal-Anness XXIV għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum meta l-kontroparti ma tkunx bank ċentrali u fejn il-kollateral ma jikkwalifikax bħala assi likwidu. L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw   għal kull kolonna 0010, 0020 u 0030 l-ammont totali ta’ flejjes dovuti minn dawk it-tranżazzjonijiet bħala s-somma ta’ flejjes dovuti minn self ta’ marġini fejn il-kollateral ikun mhux likwidu, għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali fejn il-kollateral ikun ekwità mhux likwida u għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali ggarantiti minn kwalunkwe kollateral mhux likwidu ieħor; u   * għal kull kolonna 0140, 0150 u 0160 it-total tal-influssi minn dawk it-tranżazzjonijiet bħala s-somma tal-influssi minn self ta’ marġni fejn il-kollateral huwa mhux likwidu, għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali fejn il-kollateral huwa ekwità mhux likwida u għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali appoġġati minn kwalunkwe kollateral mhux likwidu ieħor. |
| 0341 | **1.2.2.3.1. self b’marġini: kollateral mhuwiex likwidu**  Il-punt (c) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Self ta’ marġini li jsir kontra assi mhux likwidi b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum fejn il-kontroparti mhijiex bank ċentrali u fejn l-assi rċevuti ma jintużawx biex ikopru pożizzjonijiet bin-nieqes kif deskritt fil-Punt (c) tal-Artikolu 32(3) Regolament Delegat (UE) Nru 2015/61. |
| 0343 | **1.2.2.3.2. kollateral huwa ekwità mhux likwida**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum meta l-kontroparti mhijiex bank ċentrali u fejn it-tranżazzjoni tkun kollateralizzata b’ekwità mhux likwida. |
| 0345 | **1.2.2.3.3. kollateral mhux likwidu ieħor kollu**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum fejn il-kontroparti mhijiex bank ċentrali u fejn it-tranżazzjoni hija kollateralizzata b’assi mhux likwidi mhux diġà koperti fit-taqsima 1.2.2.3.1 jew 1.2.2.3.2. |
| 0410 | **1.3. Total tal-influssi minn swaps kollaterali**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk is-somma tal-influssi totali minn swaps kollaterali kif kalkulat fil-formula C 75.01 tal-Anness XXIV. |
| 0420 | **1.4. (Id-differenza bejn it-total ta’ influssi ponderati u t-total ta’ flussi ta’ ħruġ ponderati li jirriżultaw minn tranżazzjonijiet f’pajjiżi terzi fejn hemm restrizzjonijiet fuq trasferimenti jew li jkunu denominati f’muniti mhux konvertibbli)**  L-Artikolu 32(8) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw fil-kolonna 0140, 0150 u 0160 rilevanti s-somma tal-influssi ponderati totali minn pajjiżi terzi fejn hemm restrizzjonijiet fuq it-trasferiment jew li huma denominati f’muniti mhux konvertibbli nieqes is-somma tal-flussi ta’ ħruġ ponderati totali lejn pajjiżi terzi fejn hemm restrizzjonijiet fuq it-trasferiment jew li huma denominati f’muniti mhux konvertibbli kif irrapportat f’C 73.00 tal-Anness XXIV. F’każ li dan l-ammont ikun negattiv, l-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw “0”. |
| 0430 | **1.5. (Eċċess ta’ influssi minn istituzzjoni ta’ kreditu speċjalizzata relatata)**  Il-punt (e) tal-Artikolu 2(3) u l-Artikolu 33(6) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu li jirrapportaw fuq bażi kkonsolidata għandhom jirrapportaw fil-kolonna rilevanti 0140, 0150 jew 0160, l-ammont tal-influssi li jirriżultaw minn istituzzjoni ta’ kreditu speċjalizzata relatata msemmija fl-Artikolu 33(3) u (4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 li huma f’eċċess fuq l-ammont ta’ flussi ta’ ħruġ li jirriżultaw mill-istess impriża. |
| **ENTRATI TA’ MEMORANDUM** | |
| 0450 | **2. Influssi FX**  Din l-entrata ta’ memorandum għandha tiġi rrapportata biss fil-każ ta’ rapportar separat tal-munita ta’ rapportar jew ta’ munita għajr il-munita ta’ rapportar skont l-Artikolu 415(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-porzjon ta’ influssi minn derivattivi (irrapportat fit-taqsima 1.1.9.) li huma relatati mal-flussi prinċipali FX fil-munita rispettiva minn swaps bejn il-muniti, tranżazzjonijiet spot u forward FX li jimmaturaw matul il-perjodu ta’ 30 jum. In-netting skont il-kontroparti jista’ jkun applikat għall-flussi f’dik il-munita. |
| 0460 | **3. Influssi fi grupp jew skema ta’ protezzjoni istituzzjonali**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk bħala entrati tal-memorandum it-tranżazzjonijiet kollha rrapportati fit-taqsima 1 (eskluża t-taqsima 1.1.10.) meta l-kontroparti tkun kumpanija prinċipali jew sussidjarja tal-istituzzjoni ta’ kreditu jew sussidjarja oħra tal-istess kumpanija prinċipali jew marbuta mal-istituzzjoni ta’ kreditu permezz ta’ relazzjoni skont it-tifsira tal-Artikolu 12(1) tad-Direttiva 83/349/KEE jew membru tal-istess skema ta’ protezzjoni istituzzjonali msemmija fl-Artikolu 113(7) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 jew l-istituzzjoni ċentrali jew affiljata ta’ netwerk jew grupp kooperattiv kif imsemmi fl-Artikolu 10 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fir-ringiela 0460 ta’ C 74.00 tal-Anness XXIV   għal kull kolonna 0010, 0020 u 0030 l-ammont totali ta’ flejjes dovuti/ammont massimu li jista’ jiġi prelevat fi ħdan grupp jew skema ta’ protezzjoni istituzzjonali bħala s-somma ta’ flejjes dovuti/ammont massimu li jista’ jiġi prelevat fi ħdan grupp jew skema ta’ protezzjoni istituzzjonali skont it-tip ta’ tranżazzjoni u kontroparti; u   għal kull kolonna 0140, 0150 u 0160 it-total tal-influssi fi ħdan grupp jew skema ta’ protezzjoni istituzzjonali bħala s-somma tal-influssi fi ħdan grupp jew skema ta’ protezzjoni istituzzjonali skont it-tip ta’ tranżazzjoni u kontroparti. |
| 0470 | **3.1. Flejjes dovuti minn klijenti mhux finanzjarji (minbarra banek ċentrali)**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flejjes kollha dovuti minn klijenti mhux finanzjarji rrapportati fit-taqsima 1.1.1. meta l-kontroparti tkun kumpanija prinċipali jew sussidjarja tal-istituzzjoni ta’ kreditu jew sussidjarja oħra tal-istess kumpanija prinċipali jew marbuta mal-istituzzjoni ta’ kreditu permezz ta’ relazzjoni skont it-tifsira tal-Artikolu 12(1) tad-Direttiva 83/349/KEE jew membru tal-istess skema ta’ protezzjoni istituzzjonali msemmija fl-Artikolu 113(7) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 jew l-istituzzjoni ta’ kreditu ċentrali jew affiljata ta’ network jew grupp kooperattiv kif imsemmi fl-Artikolu 10 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 0480 | **3.2. Flejjes dovuti minn klijenti finanzjarji**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flejjes kollha dovuti minn klijenti finanzjarji rrapportati fit-taqsima 1.1.2. meta l-kontroparti tkun kumpanija prinċipali jew sussidjarja tal-istituzzjoni ta’ kreditu jew sussidjarja oħra tal-istess kumpanija prinċipali jew marbuta mal-istituzzjoni ta’ kreditu permezz ta’ relazzjoni skont it-tifsira tal-Artikolu 12(1) tad-Direttiva 83/349/KEE jew membru tal-istess skema ta’ protezzjoni istituzzjonali msemmija fl-Artikolu 113(7) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 jew l-istituzzjoni ċentrali jew affiljata ta’ netwerk jew grupp kooperattiv kif imsemmi fl-Artikolu 10 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 0490 | **3.3. Tranżazzjonijiet garantiti**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flejjes kollha dovuti minn self garantit u tranżazzjoni mmotivata mis-suq kapitali kif ukoll il-valur tas-suq totali tal-kollateral riċevut irrapportat fit-taqsima 1.2., fejn il-kontroparti hija kumpanija prinċipali jew sussidjarja tal-istituzzjoni ta’ kreditu jew sussidjarja oħra tal-istess kumpanija prinċipali jew marbuta mal-istituzzjoni ta’ kreditu permezz ta’ relazzjoni skont it-tifsira tal-Artikolu 12(1) tad-Direttiva 83/349/KEE jew membru tal-istess skema ta’ protezzjoni istituzzjonali msemmija fl-Artikolu 113(7) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 jew l-istituzzjoni ċentrali jew affiljata ta’ netwerk jew grupp kooperattiv kif imsemmi fl-Artikolu 10 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 0500 | **3.4. Flejjes dovuti minn titoli li jimmaturaw fi żmien 30 jum**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flejjes kollha dovuti minn titoli li jimmaturaw fi żmien 30 jum irrapportati fit-taqsima 1.1.5. fejn l-emittent huwa kumpanija prinċipali jew sussidjarja tal-istituzzjoni ta’ kreditu jew sussidjarja oħra tal-istess kumpanija prinċipali jew marbuta mal-istituzzjoni ta’ kreditu permezz ta’ relazzjoni skont it-tifsira tal-Artikolu 12(1) tad-Direttiva 83/349/KEE jew membru tal-istess skema ta’ protezzjoni istituzzjonali msemmija fl-Artikolu 113(7) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 jew l-istituzzjoni ċentrali jew affiljata ta’ netwerk jew grupp kooperattiv kif imsemmi fl-Artikolu 10 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 0510 | **3.5. Kwalunkwe influss ieħor fi grupp jew skema ta’ protezzjoni istituzzjonali**  Istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirraportaw kull influss fi ħdan grupp jew skema ta’ protezzjoni istituzzjonali rrapportat fit-taqsima 1.1.3. sa 1.1.11. (minbarra t-Taqsima 1.1.5. u 1.1.10.) meta l-kontroparti tkun kumpanija prinċipali jew sussidjarja tal-istituzzjoni ta’ kreditu jew sussidjarja oħra tal-istess kumpanija prinċipali jew marbuta mal-istituzzjoni ta’ kreditu permezz ta’ relazzjoni skont it-tifsira tal-Artikolu 12(1) tad-Direttiva 83/349/KEE jew membru tal-istess skema ta’ protezzjoni istituzzjonali msemmija fl-Artikolu 113(7) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 jew l-istituzzjoni ċentrali jew affiljat ta’ netwerk jew grupp kooperattiv kif imsemmi fl-Artikolu 10 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
|  | **4. Għoti ta’ Self garantit eżentat mill-Artikolu 17(2) u (3)**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk tranżazzjonijiet ta’ għoti ta’ self garantit b’maturità residwa sa 30 jum meta l-kontroparti tkun bank ċentrali u fejn it-tranżazzjonijiet rilevanti huma eżentati mill-applikazzjoni tal-Artikolu 17(2) u (3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bl-Artikolu 17(4) tiegħu. |
| 0530 | **4.1. li minnhom: garantit b’L1 għajr EHQCB**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk tranżazzjonijiet ta’ għoti ta’ self garantit li jimmaturaw fi żmien 30 jum kalendarju meta l-kontroparti tkun bank ċentrali, il-kollateral riċevut huwa kollateral tal-Livell 1 minbarra bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna u li jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali stabbiliti fl-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, u fejn it-tranżazzjonijiet rilevanti huma eżentati mill-applikazzjoni tal-Artikolu 17(2) u (3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bl-Artikolu 17(4) tiegħu. |
| 0540 | **4.2. li minnhom: garantit b’L1 EHQCB**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk tranżazzjonijiet ta’ għoti ta’ self garantit li jimmaturaw fi żmien 30 jum kalendarju meta l-kontroparti tkun bank ċentrali, il-kollateral riċevut huwa kollateral tal-Livell 1 li huma bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna u li jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali stabbiliti fl-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, u fejn it-tranżazzjonijiet rilevanti huma eżentati mill-applikazzjoni tal-Artikolu 17(2) u (3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bl-Artikolu 17(4) tiegħu. |
| 0550 | **4.3. li minnhom: garantit bl-L2A**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk tranżazzjonijiet ta’ għoti ta’ self garantit li jimmaturaw fi żmien 30 jum kalendarju meta l-kontroparti tkun bank ċentrali, il-kollateral riċevut huwa kollateral tal-Livell 2B u li jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali stabbiliti fl-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, u fejn it-tranżazzjonijiet rilevanti huma eżentati mill-applikazzjoni tal-Artikolu 17(2) u (3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bl-Artikolu 17(4) tiegħu. |
| 0560 | **4.4. li minnhom: garantit bl-L2B**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk tranżazzjonijiet ta’ għoti ta’ self garantit li jimmaturaw fi żmien 30 jum kalendarju meta l-kontroparti tkun bank ċentrali, il-kollateral riċevut huwa kollateral tal-Livell 2B u li jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali stabbiliti fl-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, u fejn it-tranżazzjonijiet rilevanti huma eżentati mill-applikazzjoni tal-Artikolu 17(2) u (3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bl-Artikolu 17(4) tiegħu. |
| 0570 | **4.5. li minnhom: garantiti b’assi mhux likwidi**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk tranżazzjonijiet ta’ għoti ta’ self garantit li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju meta l-kontroparti tkun bank ċentrali, il-kollateral riċevut huwa kollateral mhux likwidu u fejn it-tranżazzjonijiet rilevanti huma eżentati mill-applikazzjoni tal-Artikolu 17(2) u (3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bl-Artikolu 17(4) tiegħu. |

**PARTI 4: SWAPS KOLLATERALI**

1. Swaps kollaterali

1.1. Rimarki ġenerali

1. Kwalunkwe tranżazzjoni li timmatura fi żmien 30 jum tal-kalendarju li jmiss li fiha assi mhux ta’ flus jiġu swappjati ma’ assi oħrajn mhux ta’ flus, għandha tkun irrapportata f’din il-formula. L-entrati li ma għandhomx għalfejn jimtlew mill-istituzzjonijiet għandhom lewn griż.
2. Tranżazzjonijiet ta’ swaps kollaterali li jimmaturaw fit-30 jum tal-kalendarju li jmiss għandhom iwasslu għal fluss ta’ ħruġ jekk l-assi meħuda b’self ikunu soġġetti għal haircut aktar baxxa skont il-Kapitolu 2 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 mill-assi mogħtijin b’self. Il-fluss ta’ ħruġ għandu jiġi kkalkolat billi l-valur tas-suq tal-assi meħud b’self jiġi mmultiplikat bid-differenza bejn ir-rata ta’ fluss ta’ ħruġ applikabbli għall-assi mogħti b’self u fir-rata ta’ fluss ta’ ħruġ applikabbli għall-assi b’self fi tranżazzjonijiet ta’ finanzjament garantit li jimmaturaw fi żmien it-30 jum tal-kalendarju li jmiss. F’każ li l-kontroparti hija l-bank ċentrali domestiku tal-istituzzjoni ta’ kreditu, ir-rata ta’ fluss ta’ ħruġ li trid tiġi applikata għall-valur tas-suq tal-assi meħud b’self għandha tkun ta’ 0 %. It-tifsira tal-bank ċentrali domestiku tal-istituzzjoni ta’ kreditu ssegwi d-definizzjoni mogħtija fl-Artikolu 28(8) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.
3. Swaps kollaterali li jimmaturaw fit-30 jum kalendarju li jmiss għandhom iwasslu għal influssi fejn, skont il-Kapitolu 2 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, l-assi mogħtijin b’self ikunu soġġetti għal haircut aktar baxxa mill-assi meħuda b’self. L-influssi għandu jiġi kkalkolat billi l-valur tas-suq tal-assi mogħti b’self jiġi mmultiplikat bid-differenza bejn ir-rata ta’ influss applikabbli għall-assi meħud b’self u fir-rata ta’ influss applikabbli għall-assi mogħtija b’self fi tranżazzjonijiet ta’ għoti b’self garantit li jimmaturaw fi żmien it-30 jum tal-kalendarju li jmiss. Jekk il-kollateral miksub jintuża sabiex ikopri pożizzjonijiet bin-nieqes li jistgħu jiġu estiżi lil hinn minn 30 jum kalendarju ma għandu jiġi rikonoxxut l-ebda influss.
4. Għall-assi likwidi, il-valur tal-likwidità jiġi kkalkolat skont l-Artikolu 9 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.
5. Kull tranżazzjoni ta’ swap kollaterali għandha tkun ivvalutata b’mod individwali u l-fluss irrapportat jew bħala fluss ta’ ħruġ jew influss (għal kull tranżazzjoni) fir-ringiela korrispondenti. Jekk negozju wieħed ikun jinkludi diversi kategoriji ta’ tip ta’ kollateral (eż. basket ta’ kollateral) allura għar-rapportar dan għandu jinqasam f’partijiet li jikkorrispondu għar-ringieli tal-formula u vvalutat f’partijiet. Fil-kuntest ta’ tranżazzjonijiet ta’ swaps ta’ basktijiet jew puli ta’ kollateral li jkunu qed jimmaturaw fit-30 jum tal-kalendarju li jmiss, assi mhux fi flus mislufa għandhom jiġu assenjati individwalment għal assi mhux fi flus mislufa, skont il-kategoriji tal-assi likwidi kif definiti fil-Kapitolu 2 tat-Titolu II tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, li jibdew mill-kombinazzjoni l-inqas likwida (jiġifieri assi mhux likwidi mhux likwidi mogħtija b’self, assi mhux likwidi mhux fi flus meħuda b’self). Kwalunkwe kollateral żejjed f’kombinazzjoni waħda jiġi ttrasferit għall-kategorija ogħla, sabiex sal-aktar kombinazzjoni likwida, il-kombinazzjonijiet rilevanti jkunu mqabbla bis-sħiħ. Kwalunkwe kollateral eċċessiv totali mbagħad jiġi kopert fl-aktar kombinazzjoni likwida.
6. Tranżazzjonijiet ta’ swaps kollaterali li jinvolvu azzjonijiet jew unitajiet f’CIUs għandhom jiġu rrapportati bħallikieku t-tranżazzjonijiet jinvolvu l-assi sottostanti tas-CIU. Il-haircuts differenti applikati għal azzjonijiet jew unitajiet f’CIUs għandhom jiġu riflessi fir-rata rilevanti ta’ fluss ta’ ħruġ jew influss li għandha tiġi rrapportata.
7. L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-formula fil-muniti korrispondenti skont l-Artikolu 415(2) tar-Regolament (UE) 575/2013. F’dan il-każ, il-bilanċi rrapportati għandhom jinkludu biss dawk iddenominati fil-munita rilevanti sabiex jiżguraw li d-differenzi bejn il-muniti jkunu riflessi kif xieraq. Dan jista’ jfisser li naħa waħda biss tat-tranżazzjoni tkun irrapportata fil-formula tal-munita rilevanti, b’impatt korrispondenti fuq il-valur tal-likwidità żejda.

1.2. Kummenti speċifiċi

1. Għall-kalkolu tal-influssi jew il-flussi ta’ ħruġ, t-tranżazzjonijiet ta’ swaps kollaterali għandhom jiġu rrapportati irrispettivament minn jekk il-kollateral sottostanti involut jissodisfax, jew ikunx jissodisfa jekk ma jkunx qed jintuża diġà sabiex jiggarantixxi din it-tranżazzjoni, ir-rekwiżiti operazzjonali kif previst fl-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. Barra minn hekk, sabiex ikun jista’ jiġi kkalkolat l-istokk aġġustat ta’ assi likwidi skont l-Artikolu 17(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw ukoll b’mod separat dawk it-tranżazzjonijiet fejn tal-inqas komponent wieħed tal-kollatearl jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali kif previst fl-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.
2. Meta istituzzjoni tista’ tirrikonoxxi biss parti mill-azzjonijiet tagħha f’munita barranija, jew assi f’munita barranija tal-gvern ċentrali jew tal-bank, jew assi fil-munita domestika tal-gvern ċentrali jew tal-bank ċentrali fl-HQLA tagħha, il-parti rikonoxxibbli biss għandha tiġi rrapportata fir-ringieli tal-assi tal-Livell 1, tal-Livell 2A u tal-Livell 2B skont il-punt (c) (ii) tal-Artikolu 12(1) u l-punt (d) tal-Artikolu 10(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. Meta l-assi partikolari jintuża bħala kollateral iżda għal ammont li huwa f’surplus għall-porzjon li jista’ jkun rikonoxxut bħala assi likwidi, l-ammont f’surplus għandu jkun irrapportat fit-taqsima mhux likwidi.
3. Swaps kollaterali li jinvolvu assi tal-Livell 2A għandhom ikunu rrapportati fir-ringiela tal-assi L2A korrispondenti, anki jekk ikun qiegħed jiġi segwit l-Approċċ Alternattiv ta’ Likwidità (jiġifieri tmexxix L2A lejn L1 fir-rapportar tal-iswaps kollaterali).

1.3. Subformula tal-iswaps kollaterali

1.3.1 Struzzjonijiet dwar kolonni speċifiċi

|  |  |
| --- | --- |
| **Kolonna** | **Referenzi legali u struzzjonijiet** |
| 0010 | **Valur tas-suq tal-kollateral mogħti b’self**  Il-valur tas-suq tal-kollateral mogħti b’self ikun irrapportat fil-kolonna 0010. Il-valur tas-suq għandu jirrifletti l-valur tas-suq attwali, ikun gross bil-haircut u nett mill-flussi li jirriżultaw mill-istralċ tal-ħeġġijiet assoċjati skont l-Artikolu 8(5) tar-Regolament Delegat (UE) Nru 2015/61. |
| 0020 | **Valur tal-likwidità tal-kollateral mogħti b’self**  Il-valur tal-likwidità tal-kollateral mogħti b’self ikun irrapportat fil-kolonna 0020. Fil-każ tal-assi likwidi, il-valur tal-likwidità għandu jirrifletti l-valur tal-assi nett mill-haircut. |
| 0030 | **Valur tas-suq tal-kollateral meħud b’self**  Il-valur tas-suq tal-kollateral meħud b’self ikun irrapportat fil-kolonna 0030. Il-valur tas-suq għandu jirrifletti l-valur tas-suq attwali, ikun gross bil-haircut u nett mill-flussi li jirriżultaw mill-istralċ tal-ħeġġijiet assoċjati skont l-Artikolu 8(5) tar-Regolament Delegat (UE) Nru 2015/61. |
| 0040 | **Valur tal-likwidità tal-kollateral meħud b’self**  Il-valur tal-likwidità tal-kollateral meħud b’self ikun irrapportat fil-kolonna 0040. Fil-każ tal-assi likwidi, il-valur tal-likwidità għandu jirrifletti l-valur tal-assi nett mill-haircut. |
| 0050 | **Ponderazzjoni standard**  L-Artikoli 28 u 32 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Il-ponderazzjoniijiet standard fil-kolonna 0050 huma dawk speċifikati b’mod prestabbilit fir-Regolament Delegat (UE) 2015/61 u huma pprovduti għall-informazzjoni biss. |
| 0060 | **Ponderazzjoni applikabbli**  L-Artikoli 28 u 32 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Il-ponderazzjonijiet applikabbli huma dawk speċifikati fl-Artikoli 28 u 32 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. Il-ponderazzjonijiet applikabbli jistgħu jirriżultaw f’valuri medji ponderati u għandhom ikunu rrapportati f’termini deċimali (jiġifieri 1,00 għal ponderazzjoni applikabbli ta’ 100 fil-mija, jew 0,50 għal ponderazzjoni applikabbli ta’ 50 fil-mija). Il-ponderazzjonijiet applikabbli jistgħu jirriflettu, iżda mhumiex limitati għal, diskrezzjonijiet speċifiċi għall-kumpanija u diskrezzjonijiet nazzjonali. |
| 0070 | **Flussi ta’ Ħruġ**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ta’ ħruġ. Dan jiġi kkalkulat billi l-kolonna 0060 tiġi mmultiplikata bil-kolonna 0030, it-tnejn minn C75.01 tal-Anness XXIV. |
| 0080 | **Influssi soġġetti għal-limitu massimu ta’ 75 % fuq l-influssi**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk l-influssi ta’ tranżazzjonijiet soġġetti għal-limitu massimu ta’ 75 % fuq l-influssi. Dawn l-influssi huma kkalkolati billi l-kolonna 0060 tiġi mmoltiplikata bil-kolonna 0010, it-tnejn minn C 75.01 tal-Anness XXIV. |
| 0090 | **Influssi soġġetti għal-limitu massimu ta’ 90 % fuq l-influssi**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk l-influssi ta’ tranżazzjonijiet soġġetti għal-limitu massimu ta’ 90 % fuq l-influssi. Dawn l-influssi huma kkalkolati billi l-kolonna 0060 tiġi mmoltiplikata bil-kolonna 0010, it-tnejn minn C 75.01 tal-Anness XXIV. |
| 0100 | **Influssi eżentati mil-limitu massimu fuq l-influssi**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk l-influssi ta’ tranżazzjonijiet eżentati mil-limitu massimu fuq l-influssi. Dawn l-influssi huma kkalkolati billi l-kolonna 0060 tiġi mmoltiplikata bil-kolonna 0010, it-tnejn minn C 75.01 tal-Anness XXIV. |

1.3.2 Struzzjonijiet dwar ringieli speċifiċi

|  |  |
| --- | --- |
| **Ringiela** | **Referenzi legali u struzzjonijiet** |
| 0010 | **1. TOTAL TA’ SWAPS KOLLATERALI (il-kontroparti hija bank ċentrali)**  L-Artikoli 28(4) u 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk, għall-kolonni rilevanti, il-valuri totali tal-iswaps kollaterali. |
| 0020 | **1.1. Totali għat-tranżazzjonijiet li fihom l-assi tal-Livell 1 (eskl. bonds EHQ koperti) jingħataw b’self u l-kollateral li ġej jittieħed b’self:**  L-Artikoli 28(4) u 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk, għal kull kolonna rilevanti, il-valuri totali ta’ swaps kollaterali għal tranżazzjonijiet li fihom assi tal-Livell 1 (minbarra bonds EHQ koperti) jingħataw b’self. |
| 0030 | **1.1.1. Assi tal-Livell 1 (eskl. bonds EHQ koperti)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (meħudin b’self) |
| 0040 | * + - 1. **Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**   Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.1.1., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0050 | **1.1.2. Bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappajt assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (meħudin b’self). |
| 0060 | **1.1.2.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.1.2., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0070 | **1.1.3. Assi tal-Livell 2A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 2A (meħudin b’self) |
| 0080 | **1.1.3.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.1.3., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0090 | **1.1.4. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (meħudin b’self). |
| 0100 | **1.1.4.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.1.4., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0110 | **1.1.5. Bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappajt assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 0120 | **1.1.5.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.1.5., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0130 | **1.1.6. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (meħudin b’self) |
| 0140 | **1.1.6.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.1.6., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0150 | **1.1.7. Oħrajn tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (mogħtija b’self) ma’ Oħrajn tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 0160 | **1.1.7.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.1.7., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0170 | **1.1.8. Assi mhux likwidi**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (mogħtija b’self) ma’ assi mhux likwidi (meħudin b’self) |
| 0180 | **1.1.8.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.1.8., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 0190 | **1.2. Total għat-tranżazzjonijiet li fihom bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 jingħataw b’self u l-kollateral li ġej jittieħed b’self:**  L-Artikoli 28(4) u 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk, għall-kolonni rilevanti, il-valuri totali ta’ swaps ta' kollateral għal tranżazzjonijiet li fihom bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 jingħataw b’self. |
| 0200 | **1.2.1. Assi tal-Livell 1 (eskl. bonds EHQ koperti)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (meħudin b’self). |
| 0210 | **1.2.1.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.1., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0220 | **1.2.2. Bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (meħudin b’self) |
| 0230 | **1.2.2.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.2., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0240 | **1.2.3. Assi tal-Livell 2A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 2A (meħudin b’self) |
| 0250 | **1.2.3.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.3., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0260 | **1.2.4. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (meħudin b’self) |
| 0270 | **1.2.4.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.4., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0280 | **1.2.5. Bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 0290 | **1.2.5.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.5., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0300 | **1.2.6. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (meħudin b’self) |
| 0310 | **1.2.6.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.6., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0320 | **1.2.7. Oħrajn tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (mogħtija b’self) ma’ Oħrajn tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 0330 | **1.2.7.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.7., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0340 | **1.2.8. Assi mhux likwidi**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (mogħtija b’self) ma’ assi mhux likwidi (meħudin b’self) |
| 0350 | **1.2.8.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.8., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 0360 | **1.3. Totali għat-tranżazzjonijiet li fihom assi tal-Livell 2 A jingħataw b’self u l-kollateral li ġej jittieħed b’self:**  L-Artikoli 28(4) u 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk, għall-kolonni rilevanti, il-valuri totali ta’ swaps kollaterali għal tranżazzjonijiet li fihom assi tal-Livell 2A jingħataw b’self. |
| 0370 | **1.3.1. Assi tal-Livell 1 (eskl. bonds EHQ koperti)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 2A (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (meħudin b’self) |
| 0380 | **1.3.1.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.3.1., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0390 | **1.3.2. Bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 2A (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (meħudin b’self) |
| 0400 | **1.3.2.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.3.2., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0410 | **1.3.3. Assi tal-Livell 2A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 2A (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 2A (meħudin b’self) |
| 0420 | **1.3.3.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.3.3., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0430 | **1.3.4. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 2A (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (meħudin b’self) |
| 0440 | **1.3.4.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.3.4., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0450 | **1.3.5. Bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 2A (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 0460 | **1.3.5.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.3.5., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0470 | **1.3.6. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 2A (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (meħudin b’self) |
| 0480 | **1.3.6.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.3.6., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0490 | **1.3.7. Oħrajn tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 2A (mogħtija b’self) ma’ Oħrajn tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 0500 | **1.3.7.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.3.7., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0510 | **1.3.8. Assi mhux likwidi**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 2A (mogħtija b’self) ma’ assi mhux likwidi (meħudin b’self) |
| 0520 | **1.3.8.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.3.8., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 0530 | **1.4. Totali għat-tranżazzjonijiet li fihom titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (reżidenzjali jew vetturi CQS1) jingħataw b’self u l-kollateral li ġej jittieħed b’self:**  L-Artikoli 28(4) u 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk, għall-kolonni rilevanti, il-valuri totali ta’ swaps kollaterali għal tranżazzjonijiet li fihom titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) jingħataw b’self. |
| 0540 | **1.4.1. Assi tal-Livell 1 (eskl. bonds EHQ koperti)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (meħudin b’self) |
| 0550 | **1.4.1.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.4.1., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0560 | **1.4.2. Bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (meħudin b’self) |
| 0570 | **1.4.2.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.4.2., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0580 | **1.4.3. Assi tal-Livell 2A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 2A (meħudin b’self) |
| 0590 | **1.4.3.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.4.3., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0600 | **1.4.4. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (meħudin b’self) |
| 0610 | **1.4.4.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.4.4., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0620 | **1.4.5. Bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 0630 | **1.4.5.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.4.5., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0640 | **1.4.6. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (meħudin b’self) |
| 0650 | **1.4.6.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.4.6., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0660 | **1.4.7. Oħrajn tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ Oħrajn tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 0670 | **1.4.7.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.4.7., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0680 | **1.4.8. Assi mhux likwidi**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ assi mhux likwidi (meħudin b’self) |
| 0690 | **1.4.8.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.4.8., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 0700 | **1.5. Totali għat-tranżazzjonijiet li fihom bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B jingħataw b’self u l-kollateral li ġej jittieħed b’self:**  L-Artikoli 28(4) u 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk, għall-kolonni rilevanti, il-valuri totali ta’ swaps kollaterali għal tranżazzjonijiet li fihom bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B jingħataw b’self. |
| 0710 | **1.5.1. Assi tal-Livell 1 (eskl. bonds EHQ koperti)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (meħudin b’self). |
| 0720 | **1.5.1.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.5.1., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0730 | **1.5.2. Bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (meħudin b’self) |
| 0740 | **1.5.2.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.5.2., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0750 | **1.5.3. Assi tal-Livell 2A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 2A (meħudin b’self) |
| 0760 | **1.5.3.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.5.3., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0770 | **1.5.4. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (meħudin b’self) |
| 0780 | **1.5.4.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.5.4., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0790 | **1.5.5. Bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 0800 | **1.5.5.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.5.5., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0810 | **1.5.6. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (meħudin b’self) |
| 0820 | **1.5.6.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.5.6., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0830 | **1.5.7. Oħrajn tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ Oħrajn tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 0840 | **1.5.7.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.5.7., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0850 | **1.5.8. Assi mhux likwidi**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ assi mhux likwidi (meħudin b’self) |
| 0860 | **1.5.8.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.5.8., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 0870 | **1.6. Totali għat-tranżazzjonijiet li fihom titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) jingħataw b’self u l-kollateral li ġej jittieħed b’self:**  L-Artikoli 28(4) u 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk, għall-kolonni rilevanti, il-valuri totali ta’ swaps kollaterali għal tranżazzjonijiet li fihom titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) jingħataw b’self. |
| 0880 | **1.6.1. Assi tal-Livell 1 (eskl. bonds EHQ koperti)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (meħudin b’self) |
| 0890 | **1.6.1.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.6.1., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0900 | **1.6.2. Bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (meħudin b’self) |
| 0910 | **1.6.2.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.6.2., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0920 | **1.6.3. Assi tal-Livell 2A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 2A (meħudin b’self) |
| 0930 | **1.6.3.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.6.3., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0940 | **1.6.4. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 0950 | **1.6.4.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.6.4., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0960 | **1.6.5. Bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 0970 | **1.6.5.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.6.5., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 0980 | **1.6.6. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (meħudin b’self) |
| 0990 | **1.6.6.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.6.6., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1000 | **1.6.7. Oħrajn tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ Oħrajn tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 1010 | **1.6.7.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.6.7., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1020 | **1.6.8. Assi mhux likwidi**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ assi mhux likwidi (meħudin b’self) |
| 1030 | **1.6.8.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.6.8., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 1040 | **1.7. Totali għat-tranżazzjonijiet li fihom Assi oħrajn tal-Livell 2B jingħataw b’self u l-kollateral segwenti jittieħed b’self:**  L-Artikoli 28(4) u 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk, għall-kolonni rilevanti, il-valuri totali tal-iswaps kollaterali għat-tranżazzjonijiet li fihom jingħataw b’self assi Oħrajn tal-Livell 2B. |
| 1050 | **1.7.1. Assi tal-Livell 1 (eskl. bonds EHQ koperti)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Oħrajn tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (meħudin b’self). |
| 1060 | **1.7.1.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.7.1., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1070 | **1.7.2. Bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Oħrajn tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (meħudin b’self) |
| 1080 | **1.7.2.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.7.2., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1090 | **1.7.3. Assi tal-Livell 2A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Oħrajn tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 2A (meħudin b’self) |
| 1100 | **1.7.3.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.7.3., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1110 | **1.7.4. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Oħrajn tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (meħudin b’self) |
| 1120 | **1.7.4.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.7.4., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1130 | **1.7.5. Bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Oħrajn tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 1140 | **1.7.5.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.7.5., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1150 | **1.7.6. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Oħrajn tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (meħudin b’self) |
| 1160 | **1.7.6.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.7.6., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1170 | **1.7.7. Oħrajn tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Oħrajn tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ Oħrajn tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 1180 | **1.7.7.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.7.7., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1190 | **1.7.8. Assi mhux likwidi**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Oħrajn tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ Assi mhux likwidi (meħudin b’self) |
| 1200 | **1.7.8.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.7.8., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 1210 | **1.8. Totali għat-tranżazzjonijiet li fihom Assi mhux likwidi jingħataw b’self u l-kollateral segwenti jittieħed b’self:**  L-Artikoli 28(4) u 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk, għall-kolonni rilevanti, il-valuri totali ta’ swaps kollaterali għal tranżazzjonijiet li fihom jingħataw b’self assi mhux likwidi. |
| 1220 | **1.8.1. Assi tal-Livell 1 (eskl. bonds EHQ koperti)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi mhux likwidi (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (meħudin b’self) |
| 1230 | **1.8.1.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.8.1., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1240 | **1.8.2. Bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi mhux likwidi (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (meħudin b’self) |
| 1250 | **1.8.2.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.8.2., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1260 | **1.8.3. Assi tal-Livell 2A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi mhux likwidi (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 2 A (meħudin b’self) |
| 1270 | **1.8.3.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.8.3., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1280 | **1.8.4. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi mhux likwidi (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (meħudin b’self) |
| 1290 | **1.8.4.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.8.4., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1300 | **1.8.5. Bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi mhux likwidi (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 1310 | **1.8.5.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.8.5., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1320 | **1.8.6. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi mhux likwidi (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (meħudin b’self) |
| 1330 | **1.8.6.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.8.6., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1340 | **1.8.7. Oħrajn tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi mhux likwidi (mogħtija b’self) ma’ Oħrajn tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 1350 | **1.8.7.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 1.8.7., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1360 | **1.8.8. Assi mhux likwidi**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Assi mhux likwidi (mogħtija b’self) ma’ Assi mhux likwidi (meħudin b’self) |
| 1370 | **2. TOTAL TA’ SWAPS KOLLATERALI (il-kontroparti mhijiex bank ċentrali)**  L-Artikoli 28(4) u 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk, għall-kolonni rilevanti, il-valuri totali tal-iswaps kollaterali. |
| 1380 | **2.1. Totali għat-tranżazzjonijiet li fihom l-assi tal-Livell 1 (eskl. bonds EHQ koperti) jingħataw b’self u l-kollateral li ġej jittieħed b’self:**  L-Artikoli 28(4) u 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk, għal kull kolonna rilevanti, il-valuri totali ta’ swaps kollaterali għal tranżazzjonijiet li fihom assi tal-Livell 1 (minbarra bonds EHQ koperti) jingħataw b’self. |
| 1390 | **2.1.1. Assi tal-Livell 1 (eskl. bonds EHQ koperti)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (meħudin b’self) |
| 1400 | * + - 1. **Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**   Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.1.1., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1410 | **2.1.2. Bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (meħudin b’self) |
| 1420 | **2.1.2.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.1.2., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1430 | **2.1.3. Assi tal-Livell 2A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 2A (meħudin b’self) |
| 1440 | **2.1.3.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.1.3., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1450 | **2.1.4. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (meħudin b’self) |
| 1460 | **2.1.4.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.1.4., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1470 | **2.1.5. Bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 1480 | **2.1.5.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.1.5., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1490 | **2.1.6. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (meħudin b’self) |
| 1500 | **2.1.6.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.1.6., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1510 | **2.1.7. Oħrajn tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (mogħtija b’self) ma’ Oħrajn tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 1520 | **2.1.7.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.1.7., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1530 | **2.1.8. Assi mhux likwidi**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (mogħtija b’self) ma’ assi mhux likwidi (meħudin b’self) |
| 1540 | **2.1.8.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.1.8., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 1550 | **2.2. Total għat-tranżazzjonijiet li fihom bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 jingħataw b’self u l-kollateral li ġej jittieħed b’self:**  L-Artikoli 28(4) u 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk, għall-kolonni rilevanti, il-valuri totali ta’ swaps ta' kollateral għal tranżazzjonijiet li fihom bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 jingħataw b’self. |
| 1560 | **2.2.1. Assi tal-Livell 1 (eskl. bonds EHQ koperti)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (meħudin b’self) |
| 1570 | **2.2.1.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.2.1., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1580 | **2.2.2. Bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (meħudin b’self) |
| 1590 | **2.2.2.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.2.2., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1600 | **2.2.3. Assi tal-Livell 2A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 2A (meħudin b’self) |
| 1610 | **2.2.3.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.2.3., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1620 | **2.2.4. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (meħudin b’self) |
| 1630 | **2.2.4.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.2.4., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1640 | **2.2.5. Bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 1650 | **2.2.5.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.2.5., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1660 | **2.2.6. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (meħudin b’self) |
| 1670 | **2.2.6.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.2.6., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1680 | **2.2.7. Oħrajn tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (mogħtija b’self) ma’ Oħrajn tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 1690 | **2.2.7.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.2.7., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1700 | **2.2.8. Assi mhux likwidi**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (mogħtija b’self) ma’ assi mhux likwidi (meħudin b’self) |
| 1710 | **2.2.8.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.2.8., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 1720 | **2.3. Totali għat-tranżazzjonijiet li fihom assi tal-Livell 2 A jingħataw b’self u l-kollateral li ġej jittieħed b’self:**  L-Artikoli 28(4) u 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk, għall-kolonni rilevanti, il-valuri totali ta’ swaps kollaterali għal tranżazzjonijiet li fihom assi tal-Livell 2A jingħataw b’self. |
| 1730 | **2.3.1. Assi tal-Livell 1 (eskl. bonds EHQ koperti)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 2 A (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (meħudin b’self). |
| 1740 | **2.3.1.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.3.1., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1750 | **2.3.2. Bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 2A (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (meħudin b’self) |
| 1760 | **2.3.2.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.3.2., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1770 | **2.3.3. Assi tal-Livell 2A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 2A (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 2A (meħudin b’self) |
| 1780 | **2.3.3.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.3.3., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1790 | **2.3.4. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 2A (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (meħudin b’self) |
| 1800 | **2.3.4.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.3.4., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1810 | **2.3.5. Bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 2A (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 1820 | **2.3.5.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.3.5., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1830 | **2.3.6. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 2A (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (meħudin b’self) |
| 1840 | **2.3.6.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.3.6., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1850 | **2.3.7. Oħrajn tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 2A (mogħtija b’self) ma’ Oħrajn tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 1860 | **2.3.7.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.3.7., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1870 | **2.3.8. Assi mhux likwidi**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 2A (mogħtija b’self) ma’ assi mhux likwidi (meħudin b’self) |
| 1880 | **2.3.8.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.3.8., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 1890 | **2.4. Totali għat-tranżazzjonijiet li fihom titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (reżidenzjali jew vetturi CQS1) jingħataw b’self u l-kollateral li ġej jittieħed b’self:**  L-Artikoli 28(4) u 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk, għall-kolonni rilevanti, il-valuri totali ta’ swaps kollaterali għal tranżazzjonijiet li fihom titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) jingħataw b’self. |
| 1900 | **2.4.1. Assi tal-Livell 1 (eskl. bonds EHQ koperti)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (meħudin b’self) |
| 1910 | **2.4.1.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.4.1., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1920 | **2.4.2. Bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (meħudin b’self) |
| 1930 | **2.4.2.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.4.2., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1940 | **2.4.3. Assi tal-Livell 2A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 2A (meħudin b’self) |
| 1950 | **2.4.3.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.4.3., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1960 | **2.4.4. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (meħudin b’self) |
| 1970 | **2.4.4.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.4.4., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 1980 | **2.4.5. Bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 1990 | **2.4.5.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.4.5., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2000 | **2.4.6. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (meħudin b’self) |
| 2010 | **2.4.6.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.4.6., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2020 | **2.4.7. Oħrajn tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ Oħrajn tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 2030 | **2.4.7.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.4.7., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2040 | **2.4.8. Assi mhux likwidi**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ assi mhux likwidi (meħudin b’self) |
| 2050 | **2.4.8.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.4.8., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 2060 | **2.5. Totali għat-tranżazzjonijiet li fihom bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B jingħataw b’self u l-kollateral li ġej jittieħed b’self:**  L-Artikoli 28(4) u 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk, għall-kolonni rilevanti, il-valuri totali ta’ swaps kollaterali għal tranżazzjonijiet li fihom bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B jingħataw b’self. |
| 2070 | **2.5.1. Assi tal-Livell 1 (eskl. bonds EHQ koperti)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (meħudin b’self) |
| 2080 | **2.5.1.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.5.1., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2090 | **2.5.2. Bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (meħudin b’self) |
| 2100 | **2.5.2.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.5.2., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2110 | **2.5.3. Assi tal-Livell 2A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 2A (meħudin b’self) |
| 2120 | **2.5.3.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.5.3., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2130 | **2.5.4. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (meħudin b’self) |
| 2140 | **2.5.4.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.5.4., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2150 | **2.5.5. Bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 2160 | **2.5.5.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.5.5., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2170 | **2.5.6. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (meħudin b’self) |
| 2180 | **2.5.6.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.5.6., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2190 | **2.5.7. Oħrajn tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ Oħrajn tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 2200 | **2.5.7.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.5.7., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2210 | **2.5.8. Assi mhux likwidi**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ assi mhux likwidi (meħudin b’self) |
| 2220 | **2.5.8.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.5.8., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 2230 | **2.6. Totali għat-tranżazzjonijiet li fihom titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) jingħataw b’self u l-kollateral li ġej jittieħed b’self:**  L-Artikoli 28(4) u 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk, għall-kolonni rilevanti, il-valuri totali ta’ swaps kollaterali għal tranżazzjonijiet li fihom titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) jingħataw b’self. |
| 2240 | **2.6.1. Assi tal-Livell 1 (eskl. bonds EHQ koperti)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (meħudin b’self) |
| 2250 | **2.6.1.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.6.1., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2260 | **2.6.2. Bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (meħudin b’self) |
| 2270 | **2.6.2.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.6.2., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2280 | **2.6.3. Assi tal-Livell 2A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 2A (meħudin b’self) |
| 2290 | **2.6.3.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.6.3., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2300 | **2.6.4. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (meħudin b’self). |
| 2310 | **2.6.4.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.6.4., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2320 | **2.6.5. Bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 2330 | **2.6.5.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.6.5., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2340 | **2.6.6. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (meħudin b’self). |
| 2350 | **2.6.6.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.6.6., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2360 | **2.6.7. Oħrajn tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ Oħrajn tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 2370 | **2.6.7.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.6.7., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2380 | **2.6.8. Assi mhux likwidi**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (mogħtija b’self) ma’ assi mhux likwidi (meħudin b’self) |
| 2390 | **2.6.8.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.6.8., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 2400 | **2.7. Totali għat-tranżazzjonijiet li fihom Assi oħrajn tal-Livell 2B jingħataw b’self u l-kollateral segwenti jittieħed b’self:**  L-Artikoli 28(4) u 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk, għall-kolonni rilevanti, il-valuri totali tal-iswaps kollaterali għat-tranżazzjonijiet li fihom jingħataw b’self assi Oħrajn tal-Livell 2B. |
| 2410 | **2.7.1. Assi tal-Livell 1 (eskl. bonds EHQ koperti)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Oħrajn tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (meħudin b’self) |
| 2420 | **2.7.1.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.7.1., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2430 | **2.7.2. Bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Oħrajn tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (meħudin b’self) |
| 2440 | **2.7.2.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.7.2., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2450 | **2.7.3. Assi tal-Livell 2A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Oħrajn tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 2A (meħudin b’self) |
| 2460 | **2.7.3.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.7.3., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2470 | **2.7.4. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Oħrajn tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (meħudin b’self) |
| 2480 | **2.7.4.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.7.4., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2490 | **2.7.5. Bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Oħrajn tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 2500 | **2.7.5.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.7.5., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2510 | **2.7.6. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Oħrajn tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (meħudin b’self) |
| 2520 | **2.7.6.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.7.6., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2530 | **2.7.7. Oħrajn tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Oħrajn tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ Oħrajn tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 2540 | **2.7.7.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.7.7., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw:   * il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu; u * il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2550 | **2.7.8. Assi mhux likwidi**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Oħrajn tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ Assi mhux likwidi (meħudin b’self) |
| 2560 | **2.7.8.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.7.8., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral mogħti b’self li, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet, jikkwalifika skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 2570 | **2.8. Totali għat-tranżazzjonijiet li fihom Assi mhux likwidi jingħataw b’self u l-kollateral segwenti jittieħed b’self:**  L-Artikoli 28(4) u 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk, għall-kolonni rilevanti, il-valuri totali ta’ swaps kollaterali għal tranżazzjonijiet li fihom jingħataw b’self assi mhux likwidi. |
| 2580 | **2.8.1. Assi tal-Livell 1 (eskl. bonds EHQ koperti)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi mhux likwidi (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds EHQ koperti (meħudin b’self) |
| 2590 | **2.8.1.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.8.1., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2600 | **2.8.2. Bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi mhux likwidi (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (meħudin b’self) |
| 2610 | **2.8.2.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.8.2., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2620 | **2.8.3. Assi tal-Livell 2A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi mhux likwidi (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 2 A (meħudin b’self) |
| 2630 | **2.8.3.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.8.3., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2640 | **2.8.4. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi mhux likwidi (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (residenzjali jew vetturi, CQS1) (meħudin b’self) |
| 2650 | **2.8.4.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.8.4., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2660 | **2.8.5. Bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi mhux likwidi (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 2670 | **2.8.5.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.8.5., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2680 | **2.8.6. Titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi mhux likwidi (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi tal-Livell 2B (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) (meħudin b’self) |
| 2690 | **2.8.6.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.8.6., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2700 | **2.8.7. Oħrajn tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi mhux likwidi (mogħtija b’self) ma’ Oħrajn tal-Livell 2B (meħudin b’self) |
| 2710 | **2.8.7.1. Li minnhom il-kollateral swappjat jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali**  Mit-tranżazzjonijiet fl-entrata 2.8.7., l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-komponent tal-kollateral meħud b’self jekk jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali skont l-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 2720 | **2.8.8. Assi mhux likwidi**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Assi mhux likwidi (mogħtija b’self) ma’ Assi mhux likwidi (meħudin b’self) |
| **ENTRATI TA’ MEMORANDUM** | |
| 2730 | **3. Total ta’ swaps kollaterali (il-kontropartijiet kollha) fejn il-kollateral meħud b’self intuża biex ikopri pożizzjonijiet bin-nieqes**  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw hawnhekk it-total ta’ swaps kollaterali (il-kontropartijiet kollha) irrapportati fil-linji ta’ hawn fuq fejn il-kollateral meħud b’self intuża sabiex ikopri pożizzjonijiet bin-nieqes fejn ġiet applikata rata ta’ fluss ta’ ħruġ ta’ 0 %. |
| 2740 | **4. Total ta’ swaps kollaterali ma’ kontropartijiet intragrupp**  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw hawnhekk it-total ta’ swaps kollaterali rrapportati fil-linji ta’ hawn fuq li huma ma’ kontropartijiet intragrupp. |
|  | **5. Swaps kollaterali eżentati mill-Artikolu 17(2) u (3)**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-parti tat-tranżazzjonijiet ta’ swaps kollaterali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum meta l-kontroparti tkun bank ċentrali u fejn it-tranżazzjonijiet rilevanti jkunu eżentati mill-applikazzjoni tal-Artikolu 17(2) u (3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bl-Artikolu 17(4) tiegħu. |
| 2750 | **5.1. li minnhom: il-kollateral meħud b’self huwa L1 eskl. EHQCB**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-parti tat-tranżazzjonijiet ta’ swaps kollaterali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum fejn il-kontroparti hija bank ċentrali, il-kollateral meħud b’self huwa kollateral tal-Livell 1 minbarra bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna u li jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali stabbiliti fl-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, u fejn it-tranżazzjonijiet rilevanti huma eżentati mill-applikazzjoni tal-Artikolu 17(2) u (3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bl-Artikolu 17(4) tiegħu. |
| 2760 | **5.2. li minnhom: il-kollateral meħud b’self huwa L1 EHQCB**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-parti tat-tranżazzjonijiet ta’ swaps kollaterali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum fejn il-kontroparti hija bank ċentrali, il-kollateral meħud b’self huwa Kollateral tal-Livell 1 li huma bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna u li jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali stabbiliti fl-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, u fejn it-tranżazzjonijiet rilevanti huma eżentati mill-applikazzjoni tal-Artikolu 17(2) u (3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bl-Artikolu 17(4) tiegħu. |
| 2770 | **5.3. li minnhom: il-kollateral meħud b’self huwa L2A**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-parti tat-tranżazzjonijiet ta’ swaps kollaterali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum fejn il-kontroparti hija bank ċentrali, il-kollateral meħud b’self huwa kollateral tal-Livell 2B u li jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali stabbiliti fl-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, u fejn it-tranżazzjonijiet rilevanti huma eżentati mill-applikazzjoni tal-Artikolu 17(2) u (3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bl-Artikolu 17(4) tiegħu. |
| 2780 | **5.4. li minnhom: il-kollateral meħud b’self huwa L2B**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-parti tat-tranżazzjonijiet ta’ swaps kollaterali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum fejn il-kontroparti hija bank ċentrali, il-kollateral meħud b’self huwa kollateral tal-Livell 2A u li jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali stabbiliti fl-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, u fejn it-tranżazzjonijiet rilevanti huma eżentati mill-applikazzjoni tal-Artikolu 17(2) u (3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bl-Artikolu 17(4) tiegħu. |
| 2790 | **5.5. li minnhom: il-kollateral mogħti b’self huwa L1 eskl. EHQCB**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-parti tat-tranżazzjonijiet ta’ swaps kollaterali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum fejn il-kontroparti hija bank ċentrali, il-kollateral mogħti b’self huwa kollateral tal-Livell 1 minbarra bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna u li jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali stabbiliti fl-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, u fejn it-tranżazzjonijiet rilevanti huma eżentati mill-applikazzjoni tal-Artikolu 17(2) u (3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bl-Artikolu 17(4) tiegħu. |
| 2800 | **5.6. li minnhom: il-kollateral mogħti b’self huwa L1 EHQCB**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-parti tat-tranżazzjonijiet ta’ swaps kollaterali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum fejn il-kontroparti hija bank ċentrali, il-kollateral mogħti b’self huwa Kollateral tal-Livell 1 li huma bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna u li jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali stabbiliti fl-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, u fejn it-tranżazzjonijiet rilevanti huma eżentati mill-applikazzjoni tal-Artikolu 17(2) u (3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bl-Artikolu 17(4) tiegħu. |
| 2810 | **5.7. li minnhom: il-kollateral mogħti b’self huwa L2A**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-parti tat-tranżazzjonijiet ta’ swaps kollaterali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum fejn il-kontroparti hija bank ċentrali, il-kollateral mogħti b’self huwa kollateral tal-Livell 2B u li jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali stabbiliti fl-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, u fejn it-tranżazzjonijiet rilevanti huma eżentati mill-applikazzjoni tal-Artikolu 17(2) u (3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bl-Artikolu 17(4) tiegħu. |
| 2820 | **5.8. li minnhom: il-kollateral mogħti b’self huwa L2B**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-parti tat-tranżazzjonijiet ta’ swaps kollaterali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum fejn il-kontroparti hija bank ċentrali, il-kollateral mogħti b’self huwa kollateral tal-Livell 2A u li jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali stabbiliti fl-Artikolu 8 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, u fejn it-tranżazzjonijiet rilevanti huma eżentati mill-applikazzjoni tal-Artikolu 17(2) u (3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bl-Artikolu 17(4) tiegħu. |

**PARTI 5: KALKOLI**

1. Kalkoli

1.1. Rimarki ġenerali

1. Din hija formula ta’ sommarju li tinkludi informazzjoni dwar il-kalkoli għall-finijiet ta’ rapportar tar-rekwiżit ta’ kopertura tal-likwidità kif speċifikat fir-Regolament Delegat (UE) 2015/61. L-entrati li ma għandhomx għalfejn jimtlew mill-istituzzjonijiet għandhom lewn griż.

1.2. Kummenti speċifiċi

1. Ir-referenzi għaċ-ċelloli huma mogħtija fil-format: formula; ringiela; kolonna. Pereżempju, il-Ġappun C 72.00; r0130; c0040} jirreferi għall-formola tal-Assi Likwidi; ringiela 0130; kolonna 0040.

1.3. SubFormula tal-kalkoli - Struzzjonijiet dwar ringieli speċifiċi

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Ringiela** | **Referenzi legali u struzzjonijiet** | |
| **KALKOLI** | |
| **Numeratur, Denominatur, Proporzjon**  L-Artikolu 4 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  In-numeratur, id-denominatur u l-proporzjon tal-Proporzjon ta’ Kopertura tal-Likwidità.  Daħħal id-data kollha li ġejja fil-kolonna 0010 tar-ringiela speċifika. | |
| 0010 | **1.** **Bafer ta’ likwidità**  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw iċ-ċifra minn {C 76.00; r0290; c0010}. | |
| 0020 | **2. Fluss ta’ Ħruġ Nett tal-Likwidità**  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw iċ-ċifra minn {C 76.00; r0370; c0010}. | |
| 0030 | **3. Proporzjon ta’ Kopertura tal-Likwidità (%)**  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw il-proporzjon ta’ kopertura tal-likwidità kalkulat kif speċifikat fl-Artikolu 4(1) tar-Regolament Delegat (UE) Nru 2015/61.  Il-proporzjon ta’ kopertura tal-likwidità għandu jkun ugwali għall-proporzjon tal-buffer tal-likwidità tal-istituzzjoni ta’ kreditu mal-flussi ta’ ħruġ netti tal-likwidità tagħha fuq perjodu ta’ stress ta’ 30 jum tal-kalendarju u għandu jkun espress bħala perċentwal.  Jekk {C 76.00; r0020; c0010} huwa żero (li jikkawża proporzjon ta’ infinità) imbagħad irrapporta l-valur 999999. | |
| **Kalkoli tan-numeratur**  L-Artikolu 17 l-Anness I tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Formula għall-kalkolu tal-Buffer tal-Likwidità.  Daħħal id-data kollha li ġejja fil-kolonna 0010 tar-ringiela speċifika. | | |
| 0040 | **4. Bafer tal-likwidità L1 eskl. EHQCB (valur skont l-Artikolu 9): mhux aġġustat**  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw iċ-ċifra minn {C 72.00; r0030; c0040}. | |
| 0050 | **5. Flussi ta’ ħruġ fuq 30 jum ta’ kollateral L1 eskl. EHQCB**  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw flussi ta’ ħruġ ta’ titoli likwidi tal-Livell 1 (esklużi bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna) max-xoljiment ta’ kwalunkwe finanzjament garantit, għoti ta’ self garantit jew tranżazzjoni ta’ swaps kollaterali, li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju mid-data ta’ referenza sakemm it-tranżazzjoni ma tiġix eżentata skont l-Artikolu 17(4) tar-Regolament Delegat (UE) Nru 2015/61. | |
| 0060 | **6. Influssi fuq 30 jum ta’ kollateral L1 eskl. EHQCB**  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw influssi ta’ titoli likwidi tal-Livell 1 (esklużi bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna) max-xoljiment ta’ kwalunkwe finanzjament garantit, għoti ta’ self garantit, jew tranżazzjoni ta’ swaps kollaterali, li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju mid-data ta’ referenza sakemm it-tranżazzjoni ma tiġix eżentata skont l-Artikolu 17(4) tar-Regolament Delegat (UE) Nru 2015/61. | |
| 0070 | **7.** **Flussi ta’ ħruġ ta’ flus garantiti**  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw il-flussi ta’ ħruġ ta’ flus (assi tal-Livell 1) max-xoljiment ta’ kwalunkwe finanzjament garantit jew tranżazzjoni ta’ għoti ta’ self garantit, li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju mid-data ta’ referenza sakemm it-tranżazzjoni ma tiġix eżentata skont l-Artikolu 17(4) tar-Regolament Delegat (UE) Nru 2015/61. | |
| 0080 | **8. Influssi ta’ flus garantiti**  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw influssi ta’ flus (assi tal-Livell 1) max-xoljiment ta’ kwalunkwe finanzjament garantit jew tranżazzjoni ta’ għoti ta’ self garantit, li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju mid-data ta’ referenza sakemm it-tranżazzjoni ma tiġix eżentata skont l-Artikolu 17(4) tar-Regolament Delegat (UE) Nru 2015/61. | |
| 0091 | **9. “Ammont aġġustat” L1 eskl. EHQCB**  Dan huwa msemmi fis-subparagrafu (a) tal-Anness I (3)  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw l-ammont aġġustat ta’ assi f’bonds mhux koperti tal-Livell 1 qabel l-applikazzjoni tal-limitu massimu.  L-ammont aġġustat għandu jqis l-istralċ ta’ finanzjament garantit, għoti ta’ self garantit jew tranżazzjonijiet ta’ swaps kollaterali, li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju mid-data tal-kalkolu sakemm it-tranżazzjoni ma tiġix eżentata skont l-Artikolu 17(4) tar-Regolament Delegat (UE) Nru 2015/61. | |
| 0100 | **10. Valur L1 EHQCB skont l-Artikolu 9: mhux aġġustat**  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw iċ-ċifra minn {C 72.00; r0180; c0040}. | |
| 0110 | **11. Flussi ta’ ħruġ fuq 30 jum ta’ kollateral EHQCB L1**  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw flussi ta’ ħruġ ta’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 max-xoljiment ta’ kwalunkwe finanzjament garantit, għoti ta’ self garantit jew tranżazzjoni ta’ swaps kollaterali, li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju mid-data ta’ referenza sakemm it-tranżazzjoni ma tiġix eżentata skont l-Artikolu 17(4) tar-Regolament Delegat (UE) Nru 2015/61. | |
| 0120 | **12. Influssi fuq 30 jum ta’ kollateral EHQCB L1**  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw influssi ta’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 max-xoljiment ta’ kwalunkwe finanzjament garantit, għoti ta’ self garantit, jew tranżazzjoni ta’ swaps kollaterali li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju mid-data ta’ referenza sakemm it-tranżazzjoni ma tiġix eżentata skont l-Artikolu 17(4) tar-Regolament Delegat (UE) Nru 2015/61. | |
| 0131 | **13.** **“Ammont aġġustat” tal-EHQCB L1**  Dan huwa msemmi mis-subparagrafu (b) tal-Anness I (3)  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw l-ammont aġġustat ta’ assi f’bonds koperti tal-Livell 1 qabel l-applikazzjoni tal-limitu massimu.  L-ammont aġġustat għandu jqis l-istralċ ta’ finanzjament garantit, għoti ta’ self garantit, jew tranżazzjonijiet ta’ swaps kollaterali li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju mid-data ta’ referenza sakemm it-tranżazzjoni ma tiġix eżentata skont l-Artikolu 17(4) tar-Regolament Delegat (UE) Nru 2015/61. | |
| 0160 | **14. Valur L2A skont l-Artikolu 9: mhux aġġustat**  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw iċ-ċifra minn {C 72.00; r0230; c0040}. | |
| 0170 | **15. Flussi ta’ ħruġ fuq 30 jum tal-kollateral L2A**  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw il-flussi ta’ ħruġ ta’ titoli likwidi tal-Livell 2A max-xoljiment ta’ kwalunkwe finanzjament garantit, għoti ta’ self garantit jew tranżazzjoni ta’ swaps kollaterali, li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju mid-data tal-kalkolu sakemm it-tranżazzjoni ma tiġix eżentata skont l-Artikolu 17(4) tar-Regolament Delegat (UE) Nru 2015/61. | |
| 0180 | **16. Influssi fuq 30 jum ta’ kollateral L2A**  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw influssi ta’ titoli likwidi tal-Livell 2A max-xoljiment ta’ kwalunkwe finanzjament garantit, għoti ta’ self garantit, jew tranżazzjoni ta’ swaps kollaterali li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju mid-data tal-kalkolu sakemm it-tranżazzjoni ma tiġix eżentata skont l-Artikolu 17(4) tar-Regolament Delegat (UE) Nru 2015/61. | |
| 0191 | **17. “Ammont aġġustat” L2A**  Dan huwa msemmi fis-subparagrafu (c) fl-Anness I (3).  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw l-ammont aġġustat ta’ assi tal-Livell 2A qabel l-applikazzjoni tal-limitu massimu.  L-ammont aġġustat għandu jqis l-istralċ ta’ finanzjament garantit, għoti ta’ self garantit jew tranżazzjonijiet ta’ swaps kollaterali, li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju mid-data tal-kalkolu sakemm it-tranżazzjoni ma tiġix eżentata skont l-Artikolu 17(4) tar-Regolament Delegat (UE) Nru 2015/61. | |
| 0220 | **18. Valur L2B skont l-Artikolu 9: mhux aġġustat**  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw iċ-ċifra minn {C 72.00; r0310; c0040}. | |
| 0230 | **19.** **Flussi ta’ ħruġ fuq 30 jum tal-kollateral L2B**  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw il-flussi ta’ ħruġ ta’ titoli likwidi tal-Livell 2B max-xoljiment ta’ kwalunkwe finanzjament garantit, għoti ta’ self garantit, jew tranżazzjoni ta’ swaps kollaterali li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju mid-data tal-kalkolu sakemm it-tranżazzjoni ma tiġix eżentata skont l-Artikolu 17(4) tar-Regolament Delegat (UE) Nru 2015/61. | |
| 0240 | **20. Influssi fuq 30 jum ta’ kollateral L2B**  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw influssi ta’ titoli likwidi tal-Livell 2B max-xoljiment ta’ kwalunkwe finanzjament garantit, għoti ta’ self garantit jew tranżazzjoni ta’ swaps kollaterali, li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju mid-data tal-kalkolu sakemm it-tranżazzjoni ma tiġix eżentata skont l-Artikolu 17(4) tar-Regolament Delegat (UE) Nru 2015/61. | |
| 0251 | **21. “Ammont aġġustat” L2B**  Dan huwa msemmi fis-subparagrafu (d) fl-Anness I (3).  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw l-ammont aġġustat ta’ assi tal-Livell 2B qabel l-applikazzjoni tal-limitu massimu.  L-ammont aġġustat għandu jqis l-istralċ ta’ finanzjament garantit, għoti ta’ self garantit jew tranżazzjonijiet ta’ swaps kollaterali, li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju mid-data tal-kalkolu sakemm it-tranżazzjoni ma tiġix eżentata skont l-Artikolu 17(4) tar-Regolament Delegat (UE) Nru 2015/61. | |
| 0280 | **22. Ammont ta’ assi likwidi f’eċċess**  Anness I(4)  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw l- “ammont ta’ assi likwidi f’eċċess”: dan l-ammont għandu jkun ugwali għal:  (a) l-ammont aġġustat ta’ assi f’bonds mhux koperti tal-livell 1; magħdud ma’  (b) l-ammont aġġustat ta’ bond kopert tal-livell 1; magħdud ma’  (c) l-ammont aġġustat ta’ assi tal-livell 2A; magħdud ma’  (d) l-ammont aġġustat ta’ assi tal-livell 2B;  bit-tnaqqis ta’ dak li jkun l-inqas minn dawn:  (e) is-somma ta’ (a), (b), (c) u (d);  (f) 100/30 darbiet (a);  (g) 100/60 darbiet is-somma ta’ (a) u (b);  (h) 100/85 darbiet is-somma ta’ (a), (b) u (c). | |
| 0290 | **23. BAFER TA’ LIKWIDITÀ**  Anness I (2)  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw ir-riżerva ta’ likwidità li għandha tkun ugwali għal:  (a) l-ammont ta’ assi tal-livell 1; magħdud ma’  (b) l-ammont ta’ assi tal-livell 2A; magħdud ma’  (c) l-ammont ta’ assi tal-livell 2B;  bit-tnaqqis ta’ dak li jkun l-inqas minn dawn:  (d) is-somma ta’ (a), (b), u (c); jew  (e) l-“ammont tal-assi likwidi f’eċċess”. | |
| **Kalkoli tad-denominatur**  Anness II tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Formula għall-kalkolu tal-fluss ta’ ħruġ nett tal-likwidità  Fejn,  NLO = Fluss ta’ ħruġ nett tal-likwidità  TO = Flussi ta’ ħruġ totali  TI = Influssi totali  FEI = Influssi kompletament eżentati  IHC = Influssi soġġetti għal limitu massimu ogħla ta’ 90 % fi flussi ta’ ħruġ  IC = Influssi soġġetti għal limitu massimu ta’ 75 % fi flussi ta’ ħruġ  L-istituzzjonijiet għandhom idaħħlu d-data kollha ta’ hawn taħt fil-kolonna 0010 ta’ ringiela partikolari. | | |
| 0300 | **24. Total tal-Flussi ta’ ħruġ**  TO = mill-paġna tal-Fluss ta’ Ħruġ  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw iċ-ċifra minn {C 73.00; r0010; c0060}. | |
| 0310 | **25. Influssi Kompletament Eżentati**  FEI = mill-paġna tal-influssi  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw iċ-ċifra minn {C 74.00; r0010; c0160}. | |
| 0320 | **26. Influssi Soġġetti għal-Limitu Massimu ta’ 90 %**  IHC = mill-paġna tal-influssi  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw iċ-ċifra minn {C 74.00; r0010; c0150}. | |
| 0330 | **27. Influssi Soġġetti għal-Limitu Massimu ta’ 75 %**  IC = mill-paġna tal-Influssi  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw iċ-ċifra minn {C 74.00; r0010; c0140}. | |
| 0340 | **28. Tnaqqis għal Influssi Eżentati għal Kollox**  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw il-parti li ġejja tal-kalkolu tal-NLO:  = MIN (FEI, TO). | |
| 0350 | **29. Tnaqqis għall-Influssi Soġġetti għal-Limitu Massimu ta’ 90 %**  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw il-parti li ġejja tal-kalkolu tal-NLO:  = MIN (IHC, 0.9 \* MAX (TO-FEI, 0)). | |
| 0360 | **30. Tnaqqis għall-Influssi Soġġetti għal-Limitu Massimu ta’ 75 %**  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw il-parti li ġejja tal-kalkolu tal-NLO:  = MIN (IC, 0.75 \* MAX (TO-FEI-IHC/0.9, 0)). | |
| 0370 | **31. FLUSS TA’ ĦRUĠ NETT TAL-LIKWIDITÀ**  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw il-fluss ta’ ħruġ nett tal-likwidità li huwa ugwali għall-flussi ta’ ħruġ totali bit-tnaqqis tat-tnaqqis għall-influssi eżentati kompletament bit-tnaqqis tat-tnaqqis għall-influssi soġġetti għal-limitu massimu ta’ 90 % bit-tnaqqis għat-tnaqqis għall-influssi soġġetti għal-limitu massimu ta’ 75 %.  NLO = TO — MIN(FEI, TO) - MIN(IHC, 0.9\*MAX(TO-FEI, 0)) - MIN(IC, 0.75\*MAX(T0-FEI-IHC/0.9,0)) | |
| **Pilastru 2** | | |
| 0380 | **32. REKWIŻIT TAL-PILASTRU 2**  L-Artikolu 105 tar-CRD  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw ir-rekwiżit tal-Pilastru 2. | |

**PARTI 6: PERIMETRU TA’ KONSOLIDAZZJONI**

1. Perimetru ta’ konsolidazzjoni

1.1. Rimarki ġenerali

1. Din hija formula li, għall-finijiet biss tal-LCR f’livell konsolidat, tidentifika l-entitajiet li għalihom tirreferi l-informazzjoni rrapportata fil-formuli C 72.00, C 73.00, C 74.00, C 75.01 u C 76.00. Din il-formula tidentifika l-entitajiet kollha li jifformaw parti mill-perimetru ta’ konsolidazzjoni tal-LCR skont l-Artikoli 8 u 10, l-Artikolu 11(3) u (5) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, kif applikabbli. Dil-Formula għandu jkollha numru ta’ ringieli daqs in-numru ta’ entitajiet fil-perimetru ta’ konsolidazzjoni.

1.2 Struzzjonijiet dwar kolonni speċifiċi

|  |  |
| --- | --- |
| **Kolonna** | **Referenzi legali u struzzjonijiet** |
| 0005 | **Prinċipali jew sussidjarja**  “Kumpanija prinċipali” għandha tiġi rrapportata f’każ li l-entità fir-ringiela tkun:   * l-istituzzjoni prinċipali tal-UE, kumpanija azzjonarja finanzjarja prinċipali tal-UE jew kumpanija azzjonarja finanzjarja mħallta prinċipali tal-UE kif previst fl-Artikolu 11(3) tar-Regolament (UE) 575/2013;   l-istituzzjoni prinċipali jew l-istituzzjoni sussidjarja li jeħtieġ li tikkonforma mal-LCR fuq bażi konsolidata jew fuq bażi subkonsolidata, rispettivament, fil-kuntest ta’ sottogrupp waħdieni tal-likwidità skont l-Artikolu 8 tar-Regolament (UE) 575/2013;   * l-istituzzjoni rilevanti meħtieġa tikkonforma mal-LCR fuq bażi subkonsolidata skont l-Artikolu 11(5) tar-Regolament (UE) 575/2013; * l-istituzzjoni ċentrali tal-UE.   ‘Sussidjarja’ tkun irrapportata fil-bqija tar-ringieli. |
| 0010 | **Isem**  L-isem ta’ kull entità fil-perimetru tal-konsolidazzjoni jiġi rrapportat fil-kolonna 0010. |
| 0020 | **Kodiċi**  Il-kodiċi bħala parti minn identifikatur tar-ringiela jrid ikun uniku għal kull entità rrapportata. Għall-istituzzjonijiet u l-impriżi tal-assigurazzjoni l-kodiċi għandu jkun il-kodiċi LEI. Għal entitajiet oħra l-kodiċi għandu jkun il-kodiċi LEI, jew jekk mhux disponibbli, kodiċi nazzjonali. Il-kodiċi għandu jkun uniku u użat b’mod konsistenti fil-formuli kollha u tul iż-żmien. Il-kodiċi għandu dejjem ikollu valur. |
| 0021 | **Tip ta’ kodiċi**  L-istituzzjonijiet jidentifikaw it-tip ta’ kodiċi rrapportat fil-kolonna 0020 bħala “kodiċi LEI” jew “Kodiċi mhux LEI”.  It-tip ta’ kodiċi għandu dejjem jiġi rrapportat. |
| 0022 | **Kodiċi nazzjonali**  L-istituzzjonijiet jistgħu jirrapportaw ukoll il-kodiċi nazzjonali meta jirrapportaw il-kodiċi LEI bħala identifikatur bħal fil-kolonna “Kodiċi”. |
| 0040 | **Kodiċi tal-pajjiż**  Il-kodiċi ISO 3166-1-alpha-2 tal-pajjiż ta’ inkorporazzjoni ta’ kull entità fil-perimetru tal-konsolidazzjoni jiġi rrapportat fil-kolonna 0020. |
| 0050 | **Tip ta’ entità**  Entitajiet irrapportati fil-kolonna 0010 għandhom jiġu assenjati tip ta’ entità li jikkorrispondi għall-forma ġuridika tagħhom skont il-lista li ġejja:  “Istituzzjoni ta’ kreditu”;  “Ditta tal-investiment”;  “Oħrajn”. |

1. Ir-Regolament Delegat tal-Kummissjoni (UE) 2015/61 tal-10 ta’ Ottubru 2014 li jissupplimenta r-Regolament (UE) Nru 575/2013 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill rigward ir-rekwiżit ta’ kopertura tal-likwidità għall-istituzzjonijiet ta’ Kreditu (ĠU L 11, 17.1.2015, p. 1). [↑](#footnote-ref-2)
2. It-tranżazzjonijiet ta’ swaps kollaterali jridu jiġu rrapportati wkoll fil-formola C 75.01 tal-Anness XXIV. [↑](#footnote-ref-3)