**MT**

**ANNESS IX**

“ANNESS XXV

**RAPPORTAR DWAR IL-LIKWIDITÀ (PARTI 1: ASSI LIKWIDI)**

1. Assi likwidi

1.1. Rimarki ġenerali

1. Din hija formula fil-qosor 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 ir-restrizzjonijiet tal-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-Artiklu 415(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. L-istituzzjonijiet ta’ kreditu xorta waħda jridu 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 netti ’l barra u l-influssi netti tal-likwidità li jirriżultaw minn għeluq bikri ta’ ħeġġ 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 mis-sezzjonijiet 1.1.1, 1.1.2, 1.2.1, u 1.2.2 tal-formola.

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-formola, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-proporzjon xieraq tal-valur tas-suq tas-CIUs li jikkorrispondi għall-assi likwidi sottostanti għall-impriża, skont l-Artikolu 15(4) tar-Regolament Delegat tal-Kummissjoni (UE) 2015/61.

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

1. L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw entrati kif imsemmija fl-Artikoli 35 sa 37 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 fir-ringieli tal-assi xierqa. Total tal-ammonti tal-assi kollha rrapportati bbażat fuq dawn l-Artikoli għandu jiġi rrapportat ukoll fis-sezzjoni “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 ’il barra 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. Assi kollha li jikkonformaw mal-Artikoli 7, 8 u 9 tar-Regolament Delegat 2015/61 u li jkunu fl-istokk tal-istituzzjoni ta’ kreditu fid-data ta’ referenza għandhom ikunu 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 m’għandhomx jiġu rrapportati f’dan il-formula.

1.2.5. Subformula tal-assi likwidi

1.2.5.1 Struzzjonijiet dwar kolonni speċifiċi

|  |  |
| --- | --- |
| Kolonna | Referenzi legali u struzzjonijiet |
| 010 | **Ammont/Valur tas-suq**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-Kolonna 010 il-valur tas-suq, jew l-ammont fejn applikabbli, tal-assi likwidi skont it-Titolu II tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  L-ammont/il-valur tas-suq irrapportat fil-Kolonna 010:  — għandu jqis il-flussi ’l barra netti u l-influssi netti li jirriżultaw mill-għeluq bikri tal-ħeġġijiet definiti fl-Artikolu 8(5) tal-istess Regolament;  — m’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 ’il barra jew l-influss, li jinħoloq kieku l-ħeġġ kellu jingħalaq fid-data ta’ referenza tar-rapportar. L-istituzzjonijiet ta’ kreditu ma jiħdux inkunsiderazzjoni bidliet potenzjali futuri fil-valur fl-assi. |
| 020 | **Ponderazzjoni standard**  Il-Kolonna 020 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. |
| 030 | **Ponderazzjoni applikabbli**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-Kolonna 030 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 nazzjonali. Iċ-ċifra rrapportata fil-Kolonna 030 ma għandhiex taqbeż iċ-ċifra fil-Kolonna 020. |
| 040 | **Valur skont l-Artikolu 9**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu jirrapportaw fil-Kolonna 040 il-valur tal-assi likwidi ddeterminat skont l-Artikolu 9 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, li jkun l-ammont/il-valur tas-suq, filwaqt li jitqiesu l-l-flussi ’l barra u l-influssi netti tal-likwidità minħabba għeluq bikri tal-ħeġġijiet, multiplikati bil-ponderazzjoni applikabbli. |

1.2.5.2 Struzzjonijiet dwar ringieli speċifiċi

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Ringiela | Referenzi legali u struzzjonijiet | |
| 010 | | **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 f’c010  L-Istituzzjonijiet ta’ Kreditu għandhom jirrapportaw il-valur totali kkalkolat skont l-Artikolu 9 tal-Assi likwidi tagħhom f’c040. |
| 020 | | **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 is-sezzjoni 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 tagħhom tal-Livell 1 f’c010.  L-Istituzzjonijiet ta’ Kreditu għandhom jirrapportaw il-valur totali kkalkolat skont l-Artikolu 9 tal-Assi likwidi tal-Livell 1 tagħhom f’c040. |
| 030 | | 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-subsezzjoni 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-subsezzjoni.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-Kolonna 010 is-somma tal-valur tas-suq / tal-ammont totali ta’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna, mingħajr kunsiderazzjoni tar-rekwiżiti tal-Artikolu 17 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-Kolonna 040 is-somma tat-total tal-ammont ponderat ta’ assi tal-Livell 1, minbarra bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna, mingħajr kunsiderazzjoni tar-rekwiżiti tal-Artikolu 17 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 040 | 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. | |
| 050 | 1.1.1.2. Riżervi tal-bank ċentrali prelevabbli  Il-punt (iii) tal-punt (b) tal-Artikoli 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 — external credit assessment institution) 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 li jista’ jiġi prelevat 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 (iii) tal-punt (b) tal-Artikolu 10(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 060 | 1.1.1.3. Assi ta’ bank ċentrali  Il-punti (i) u (ii) tal-punt (b) tal-Artikolu 10(1) tar-Regolament Delegat (UE) 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) Nru 575/2013. | |
| 070 | 1.1.1.4. Assi ta’ gvern ċentrali  Il-punti (i) u (ii) tal-punt (c) 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. | |
| 080 | 1.1.1.5. Assi ta’ gvern reġjonali/awtoritajiet lokali  Il-punti (iii) u (iv) tal-punt (c) 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 jkunu trattati bħala skoperturi għall-gvern ċentrali tal-Istat Membru skont l-Artiklu 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. | |
| 090 | **1.1.1.6. Assi ta’ Entità mis-Settur Pubbliku**  Il-punti (v) u (vi) tal-punt (c) tal-Artikolu 10(1) tar-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-subsezzjoni għandha tiġi ttrattata bħala skoperturi għall-gvern ċentrali tal-pajjiż terz f'konformità mal-Artikolu 115(4) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. | |
| 100 | 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 garantiti mill-gvern ċentrali, jew il-bank ċentrali u riżervi miżmuma f’bank ċentrali skont il-kundizzjonijiet tal-punt (ii) tal-punt (d) tal-Artikolu 10(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, ta’ pajjiż terz li ma jkunx assenjat klassifikazzjoni tal-kreditu minn ECAI nominata b’minimu tal-livell 1 tal-kwalità tal-kreditu, dment li l-istituzzjoni ta’ kreditu tirrikonoxxi assi bħal dawn f’aggregat bħala Livell 1 sal-ammont tal-fluss ’l barra netti tal-likwidità taħt stress tagħha mġarrba fl-istess munita.  Assi li jirrappreżentaw pretensjonijiet fuq jew garantiti mill-gvern ċentrali, jew il-bank ċentrali u r-riżervi miżmuma f’bank ċentrali skont il-kundizzjonijiet tal-punt (ii) tal-punt (d) tal-Artikolu 10(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, ta’ pajjiż terz li ma jkunx assenjat klassifikazzjoni tal-kreditu minn ECAI nominata mill-inqas tal-iskala 1 tal-kwalità tal-kreditu, u dawk l-assi ma jkunux 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 ’l barra netti tal-likwidità taħt stress tagħha f’dik il-munita barranija li tikkorrispondi għall-operazzjonijiet tagħha fil-ġurisdizzjoni fejn jkun qiegħed jittieħed ir-riskju tal-likwidità. | |
| 110 | 1.1.1.8. Assi ta’ istituzzjoni ta’ kreditu (protetta minn gvern ta’ Stat Membru, mutwanti promozzjonali)  Il-punti (i) u (ii) tal-punt (e) tal-Artikolu 10(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-assi maħruġin mill-istituzzjonijiet ta’ kreditu inkorporati jew stabbiliti mill-gvern ċentrali, il-gvern reġjonali jew l-awtorità lokali ta’ Stat Membru li jkollhom l-obbligu legali li jipproteġu l-bażi ekonomika tal-istituzzjoni ta’ kreditu u li żżommu l-vijabbiltà finanzjarja tagħha.  Assi maħruġa mill-mutwanti promozzjonali skont l-punt (ii) tal-punt (e) 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. | |
| 120 | 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. | |
| 130 | 1.1.1.10. Ishma/unitajiet ta’ CIU kwalifikanti: sottostanti huma muniti/karti ta’ flus u/jew skopertura għall-bank ċentrali  Il-punt (a) tal-Artikolu 15(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Ishma 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. | |
| 140 | 1.1.1.11. Ishma/unitajiet ta’ CIU kwalifikanti: sottostanti huma assi tal-Livell 1 għajr bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna  Il-punt (b) tal-Artikolu 15(2)tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Ishma 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. | |
| 150 | 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 tal-kreditu mill-BĊE, il-bank ċentrali ta’ Stat Membru jew ta’ pajjiż terz dment li l-faċilità hija konformi mar-rekwiżiti stabbiliti fil-punt (i) sa (iii) tal-punt (b) tal-Artikolu 19(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 160 | **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, 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. Dawk l-assi likwidi ma għandhomx jingħaddu biex ikoperu l-flussi ’l barra 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 ’il barra mid-depożiti korrispondenti.  Assi msemmija f’din ir-ringiela għandhom ikunu assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna. | |
| 170 | 1.1.1.14. Approċċi Alternattivi għal-Likwidità: Assi tal-Livell 2 A rikonoxxuti bħala tal-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 2 A li qegħdin jirrikonoxxu bħala tal-Livell 1 u mhux irrapportati bħala tal-Livell 2 A skont il-punt (c) tal-Artikolu 19(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. Dawk l-assi ma għandhomx ikunu rrapportati fis-sezzjoni tal-assi tal-Livell 2A. | |
| 180 | 1.1.2. Total mhux aġġustati ta’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1  L-Artikoli 10, 15 u 16 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Assi rrapportati f’din is-subsezzjoni 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 010 is-somma tal-valur tas-suq / tal-ammont totali 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 040 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. | |
| 190 | 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. | |
| 200 | 1.1.2.2. Ishma/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  Ishma 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. | |
| 210 | **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, 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. Dawk l-assi likwidi ma għandhomx jingħaddu biex ikoperu l-flussi ’l barra ħlief mid-depożiti korrispondenti u ma għandhomx jitqiesu għall-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 ’il barra mid-depożiti korrispondenti.  Assi msemmija f’din ir-ringiela huma bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-livell 1. | |
| 220 | **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 is-sezzjoni 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 tagħhom tal-Livell 2 f’c010.  L-Istituzzjonijiet ta’ Kreditu għandhom jirrapportaw il-valur totali kkalkolat skont l-Artikolu 9 tal-Assi likwidi tal-Livell 2 tagħhom f’c040. | |
| 230 | **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-subsezzjoni 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 010 is-somma totali tal-valur tas-suq / tal-ammont tal-assi tal-Livell 2A, mingħajr kunsiderazzjoni tar-rekwiżiti tal-Artikolu 17 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-Kolonna 040 is-somma tat-total tal-ammont ponderat ta’ assi tal-Livell 2A, mingħajr kunsiderazzjoni tar-rekwiżiti tal-Artikolu 17 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 240 | **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 %. | |
| 250 | **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 %. | |
| 260 | **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 huma konformi mal-punt (c) tal-Artikolu 11(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 dment li dawk l-assi jkunu assenjati valutazzjoni tal-kreditu minn ECAI nominata li tal-inqas ikollha l-iskala 2 tal-kwalità kreditizja f’konformità mal-Artikolu 129(4) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. | |
| 270 | **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 kreditizja f’konformità mal-Artikolu 129(4) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. | |
| 280 | **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. | |
| 290 | **1.2.1.6. Ishma/unitajiet ta’ CIU kwalifikanti: sottostanti huma assi tal-Livell 2A**  Il-punt (d) tal-Artikolu 15(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Ishma 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. | |
| 300 | **1.2.1.7. Istituzzjonijiet ta’ kreditu ċentrali: Assi tal-Livell 2 A 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 ikoperu l-flussi ’l barra 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 ’il barra mid-depożiti korrispondenti.  Assi msemmija f’din ir-ringiela huma assi tal-Livell 2A. | |
| 310 | **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-subsezzjoni 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 010 is-somma totali tal-valur tas-suq / tal-ammont tal-assi tal-Livell 2B, mingħajr kunsiderazzjoni tar-rekwiżiti tal-Artikolu 17 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-Kolonna 040 is-somma tat-total tal-ammont ponderat ta’ assi tal-Livell 2B, mingħajr kunsiderazzjoni tar-rekwiżiti tal-Artikolu 17 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 320 | **1.2.2.1. Titoli garantiti b’assi (residenzjali, CQS1)**  Il-punt (a) tal-Artikolu 12(1) u l-punti (i) u (ii) tal-punt (g) tal-Artikolu 13(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Skoperturi fil-forma ta’ titoli garantiti b’assi li jissodisfaw ir-rekwiżiti tal-Artikolu 13 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 dment li jkunu garantiti b’self residenzjali garantit b’ipoteka tal-ewwel grad jew self residenzjali garantit b’mod sħiħ skont il-punti (i) u (ii) tal-punt (g) 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. | |
| 330 | **1.2.2.2. Titoli garantiti b’assi (vetturi, CQS1)**  Il-punt (a) tal-Artikolu 12(1) u l-punt (iv) tal-punt (g) 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 b’lokazzjonijiet ta’ vetturi skont il-punt (iv) tal-punt (g) tal-Artikolu 13(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 340 | **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-pula 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. | |
| 350 | **1.2.2.4. Titoli garantiti b’assi (kummerċjali jew individwi, Stat Membru, CQS1)**  Il-punt (a) tal-Artikolu 12(1) u l-punti (iii) u (v) tal-punt (g) 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 (iii) u (v) tal-punt (g) tal-Artikolu 13(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. Wieħed għandu jinnota li għall-fini tal-punt (iii) tal-punt (g) tal-Artikolu 13(2), mill-inqas 80 % tal-mutwatarji fil-pula jridu jkunu SMEs fil-ħin tal-ħruġ tat-titolizzazzjoni. | |
| 360 | **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 | |
| 370 | **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 assi li jrendu mgħax għal raġunijiet ta’ osservanza reliġjuża, jidderogaw mill-punti (ii) u (iii) tal-punt (b) 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 msemmija hawn fuq għandhom jirrapportaw it-titoli ta’ dejn korporattiv li fihom assi li ma jrendux imgħax dment li jkunu jissodisfaw ir-rekwiżiti tal-punt (i) tal-punt (b) tal-Artikolu 12(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 u jkunu rċevew deroga xierqa mill-awtorità kompetenti tagħhom. | |
| 380 | **1.2.2.7. Ishma (indiċi tal-borża ewlieni)**  Il-punt (c) tal-Artikolu 12(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Ishma, 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 ishma 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 ’l barra tal-likwidità f’dik il-munita jew fil-ġurisdizzjoni fejn jittieħed ir-riskju tal-likwidità. | |
| 390 | **1.2.2.8. Assi li ma jrendux imgħax (miżmuma minn istituzzjonijiet ta’ kreditu għal raġunijiet reliġjużi) (CQS 3-5)**  Il-punt (f) tal-Artikolu 12(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għall-istituzzjonijiet ta’ kreditu li, skont l-istatuti tal-inkorporazzjoni tagħhom, ma jistgħux iżommu assi li jrendu mgħax għal raġunijiet ta’ osservanza reliġjuża, assi li ma jrendux imgħax li jikkostitwixxu pretensjoni fuq jew huma garantiti minn banek ċentrali jew minn gvern ċentrali jew minn bank ċentrali ta’ pajjiż terz jew minn gvern reġjonali, awtorità lokali jew entità mis-settur pubbliku f’pajjiż terz, dment li dawn l-assi jkollhom valutazzjoni tal-kreditu minn ECAI nominata ta’ mill-inqas tal-iskala 5 tal-kwalità kreditizja skont l-Artikolu 114 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, jew l-iskala kreditizja ekwivalenti fil-każ ta’ valutazzjoni tal-kreditu ta’ terminu qasir. | |
| 400 | **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. | |
| 410 | **1.2.2.10. Ishma/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  Ishma jew unitajiet f’CIUs li l-assi sottostanti tagħhom jikkorrispondu għal assi li jikkwalifikaw bħala assi tal-Livell 2B kif speċifikat fil-punti (i), (ii) u (iv) tal-punt (g) tal-Artikolu 13(2) tar-Regolament Delegat (KE) Nru 2015/61. | |
| 420 | **1.2.2.11. Ishma/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  Ishma 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. | |
| 430 | **1.2.2.12. Ishma/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  Ishma jew unitajiet f’CIUs li l-assi sottostanti tagħhom jikkorrispondu għal assi li jikkwalifikaw bħala assi tal-Livell 2B kif speċifikat fil-punti (iii) u (v) tal-punt (g) tal-Artikolu 13(2) tar-Regolament Delegat (UE) Nru 2015/61. Wieħed għandu jinnota li għall-fini tal-punt (iii) tal-punt (g) tal-Artikolu 13(2), mill-inqas 80 % tal-mutwatarji fil-pula jridu jkunu SMEs fil-ħin tal-ħruġ tat-titolizzazzjoni. | |
| 440 | **1.2.2.13. Ishma/unitajiet ta’ CIU kwalifikanti: sottostanti huma titoli ta’ dejn korporattiv (CQS2/3), ishma (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  Ishma 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, ishma 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. | |
| 450 | **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 ta’ kreditu ma tkunx taħt xi obbligu legali jew kuntrattwali li żżomm jew tinvesti d-depożiti f’assi likwidi ta’ livell jew kategorija speċifikati. | |
| 460 | **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. | |
| 470 | **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 ikoperu l-flussi ’l barra 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 ’il barra mid-depożiti korrispondenti.  Assi msemmija f’din ir-ringiela huma assi tal-Livell 2B. | |
| **ENTRATI TA’ MEMORANDUM** | | |
| 485 | **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 rapportati fis-sezzjonijiet ta’ hawn fuq skont ir-rekwiżiti tal-punt (a) tal-Artikolu 16(1) tar-Regolament Delegat tal-Kummissjoni (UE) 2015/61. | |
| 580 | **3. Assi tal-livell 1/2 A/2B esklużi minħabba raġunijiet ta’ munita**  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  L-istituzzjoni għandha tirrapporta l-porzjon tal-assi tal-Livell 1, Livell 2A u Livell 2B imsemmija fl-Artikoli 10 sa 16 li ma jiġux rikonoxxuti mill-istituzzjoni skont l-Artikolu 8(6), il-punt (d) tal-Artikolu 10(1) u l-punt (c) tal-Artikolu 12(1). | |
| 590 | **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 580 għal raġunijiet ta’ munita. | |

**RAPPORTAR DWAR IL-LIKWIDITÀ (PARTI 2 FLUSSI ’L BARRA)**

1. Flussi ’l barra

1.1. Rimarki ġenerali

1. Din hija l-formula fil-qosor li fiha informazzjoni dwar il-flussi ’l barra 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 assoċjat 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 fis-sezzjonijiet 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 ’l barra 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 ’l barra fi grupp jew skema ta’ protezzjoni istituzzjonali (minbarra l-flussi ’l barra 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 ’l barra minn depożiti operazzjonali miżmuma fil-kuntest ta’ Skema ta’ Protezzjoni istituzzjonali jew netwerk kooperattiv) għandhom ikunu rrapportati fil-kategoriji rilevanti. Dawk il-flussi ’l barra għandhom jiġu rrapportati wkoll b’mod separat bħala entrati ta' memorandum.

7. Il-flussi ’l barra tal-likwidità għandhom ikunu rrapportati darba biss fil-formula dment li ma jkunux applikabbli flussi ’l barra 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 040 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, imsejjaħ “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 aggregazzjoni ta’ kollateral, l-identifikazzjoni tal-assi speċifiċi mwiegħda għall-finijiet tar-rapportar f’dan il-formula għandha ssir, skont il-kategoriji tal-assi likwidi speċifikati fit-Titolu II, il-Kapitolu 2 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, filwaqt li l-ewwel jiġu identifikati l-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 ’l barra 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 ’l barra 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 ’il barra. Fil-każ ta’ repo b’lura, l-ammont li għandu jingħata b’self lill-kontroparti għandu jitqies bħala fluss ’il barra u rrapportat fl-entrata 1.1.8.6 nett mill-valur tas-suq tal-assi li għandu 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 għandu jiġi riċevut ma jikkwalifikax bħala assi likwidu, il-fluss ’il barra 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 ’il barra 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 ’il barra dan il-fluss ’il barra 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 għas-sezzjoni 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-prijoritajiet għall-allokazzjoni ta’ kull entrata rrapportata sabiex jiġi żgurat rapportar omoġenju u komparabbli. L-istudju tal-iskema tad-deċiżjonijiet waħdu mhuwiex 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.

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **#** | **Entrata** | **Deċiżjoni** | **Rapportar** |
| 1 | Tranżazzjoni forward start | Iva | # 2 |
| Le | # 4 |
| 2 | Tranżazzjonijiet forward li tkun daħlet għalihom 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 ’il barra nett | Iva | ID 1.1.8.6 |
| Le | **Tirrapportax** |
| 4 | Entrata li teħtieġ flussi ’l barra addizzjonali skont l-Art.30 ta’ 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 | Responsabbiltà li saret dovuta, tista’ tiġi eżerċitata 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 jkun imiss? | 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 | Depożiti operazzjonali f’konformità mal-Article 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 sabiex jinkisbu servizzi ta’ kklerjar tal-flus u dawk ta’ istituzzjonijiet 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’ klijenti 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 ’il barra 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 ’l barra 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-Art.31 ta’ DA? | 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 | Fluss ’il barra ppjanat relatat mat-tiġdid jew l-estensjoni ta’ self ġdid għall-konsumaturi jew għall-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 | Hemm obbligi oħrajn barra l-karta bilanċjali jew obbligi 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 f'konformità mal-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 |
| 010 | **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 ’l barra, l-ammont ta’ kull entrata rapportat fil-Kolonna 010 tal-formula C 73.00 tal-Anness XXIV għandu jkun innettjat billi jitnaqqas l-ammont rilevanti ta’ influss 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. |
| 020 | **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:  — Fejn istituzzjoni ta’ kreditu tista’ tirrikonoxxu biss parti mill-ishma tagħha f’munita barranija, jew assi f’muniti barranin ta’ gvern ċentrali jew ta' bank, jew assi fil-munita domestika ta' gvern ċentrali jew bank ċentrali fl-HQLA tagħhom, il-parti rikonoxxibbli biss għandha tiġi rrapportata fir-ringieli tal-assi tal-Livelli 1, tal-Livell 2A u tal-Livell 2B, f’konformità mal-punti (ii) tal-punt (c) tal-Artikolu 12(1) u mal-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 eċċessiv għandu jkun irrapportat fis-sezzjoni 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). |
| 030 | **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 kkalkolat billi wieħed jimmultiplika l-Kolonna 020 tal-formula C 73.00 tal-Anness XXIV bil-ponderazzjoni/il-haircut applikabbli mill-formula C 72.00 tal-Anness XXIV korrispondenti għat-tip ta’ assi. Il-Kolonna 030 tal-formula C 73.00 tal-Anness XXIV tintuża fil-kalkolu tal-ammont aġġustat tal-assi likwidi fil-formula C 76.00 tal-Anness XXIV. |
| 040 | Ponderazzjoni Standard  L-Artikoli 24 sa 31a tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Il-ponderazzjoniijiet standard fil-Kolonna 040 huma dawk speċifikati b’mod prestabbilit fir-Regolament Delegat (UE) 2015/61 u huma pprovduti għall-informazzjoni biss. |
| 050 | **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-ponderazzjoniijiet applikabbli jistgħu jirriflettu, iżda mhumiex biss limitati għal, diskrezzjonijiet speċifiċi għall-kumpanija u nazzjonali. |
| 060 | **Fluss ’il barra**  Kemm garantiti kif ukoll mhux garantiti:  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ’l barra. Dawk il-flussi ’l barra jiġu kkalkolati bil-multiplikazzjoni tal-Kolonna 010 C 73.00 tal-Anness XXIV bil-Kolonna 050 C 73.00 tal-Anness XXIV. |

1.4. Struzzjonijiet dwar ringieli speċifiċi

|  |  |
| --- | --- |
| Ringiela | Referenzi legali u struzzjonijiet |
| 010 | **1. FLUSSI ’L BARRA**  Il-Kapitolu 2 tat-Titolu III tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk dwar il-flussi ’l barra skont il-Kapitolu 2 tat-Titolu III tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 020 | **1.1. Flussi ’l barra minn tranżazzjonijiet/depożiti mhux garantiti**  L-Artikoli 20 sa 31a tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Hawnhekk l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw dwar il-flussi ’l barra skont l-Artikoli 21 sa 31a tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, bl-eċċezzjoni tal-flussi ’l barra skont l-Artikolu 28(3) u (4) ta’ dak ir-Regolament Delegat. |
| 030 | **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 tal-konsumatur kif definit fl-Artikolu 411(2) tar-Regolament Delegat (UE) 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 ’l barra 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-ponderazzjonijiet applikabbli rilevanti għal dawn id-depożiti. |
| 035 | * + - 1. **depożiti eżenti mill-kalkolu tal-flussi ’l barra**   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 ’l barra jekk il-kundizzjonijiet tal-punti (a) u (b) tal-Artikolu 25(4) ikunu ġew issodisfati. |
| 040 | **1.1.1.2. depożiti fejn il-ħlas ikun ġie miftiehem fi żmien it-30 jum sussegwenti**  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. |
| 050 | **1.1.1.3. depożiti soġġetti għal flussi ’l barra 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 ’il barra 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. |
| 060 | **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 ’il barra 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. |
| 070 | **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 iktar tal-Artikolu 25(2) sakemm dawn id-depożiti ma jkunux ittieħdu 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 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, kemm dawk ir-rati standard previsti b’mod pristabbilit fis-subparagrafu (b) tal-paragrafu 25 tal-Artikolu 3 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 jew oħrajn ogħla jekk applikati minn awtorità kompetenti, li ġew applikati fuq l-ammont sħiħ ta’ kull depożitu msemmi fil-paragrafi preċedenti u ponderat bl-ammonti korrispondenti ċċitati. |
| 080 | **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 ta’ 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 ta’ garanzija tad-depożiti ekwivalenti f’pajjiż terz u li jew hija parti minn relazzjoni stabbilita li tagħmel il-prelevament ferm improbabbli jew miżmuma 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 ’il barra 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 ’l barra 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. |
| 090 | **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 ta’ depożiti fil-livell tal-konsumatur koperti minn Skema ta’ Garanzija tad-Depożiti skont id-Direttiva 2014/49/UE sa livell massimu ta’ EUR 100,000 u li hija parti minn relazzjoni stabbilita li tagħmel il-prelevament ferm improbabbli jew li hija miżmuma 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 ’il barra 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 ’l barra 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. |
| 100 | **1.1.1.6. depożiti f’pajjiżi terzi fejn huwa applikat fluss ’il barra 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 ’il barra ogħla huwa applikat skont il-liġi nazzjonali li tistabbilixxi rekwiżiti ta’ likwidità f’dak il-pajjiż terz. |
| 110 | **1.1.1.7. depożiti oħrajn fil-livell tal-konsumatur**  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. |
| 120 | **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. |
| 130 | **1.1.2.1. miżmumin għall-ikklerjar, il-kustodja, l-immaniġġjar ta’ flus jew servizzi oħrajn komparabbli fil-kuntest ta’ relazzjoni operazzjonali 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. |
| 140 | **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 is-sehem tal-bilanċ pendenti ta’ depożiti operazzjonali miżmumin 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 huwa kopert minn Skema ta’ Garanzija tad-Depożiti skont id-Direttiva 94/19/KE, jew id-Direttiva 2014/49/UE jew skema ta’ garanzija tad-depożiti ekwivalenti f’pajjiż terz. |
| 150 | **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 is-sehem tal-bilanċ pendenti ta’ 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 mhuwiex kopert minn Skema ta’ Garanzija tad-Depożiti skont id-Direttiva 94/19/KE, jew id-Direttiva 2014/49/UE jew skema ta’ garanzija tad-depożiti ekwivalenti f’pajjiż terz. |
| 160 | **1.1.2.2. miżmumin fil-kuntest ta’ IPS (Institutional Protection Scheme — 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’ qsim ta’ kompiti komuni fi ħdan 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 stabbilit kuntrattwalment 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. |
| 170 | **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 dawn id-depożiti ma jkunux rikonoxxuti bħala assi likwidi għall-istituzzjoni ta’ kreditu depożitanti. |
| 180 | **1.1.2.2.2 ittrattati 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. |
| 190 | **1.1.2.3. miżmumin fil-kuntest ta’ relazzjoni operazzjonali 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. |
| 200 | **1.1.2.4 miżmumin sabiex jinkisbu servizzi ta’ kklerjar tal-flus u dawk ta’ istituzzjonijiet ta’ kreditu ċentrali fi ħdan 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. |
| 203 | **1.1.3 Depożiti operazzjonali eċċessi**  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. |
| 204 | **1.1.3.1 depożiti minn klijenti finanzjarji**  L-Artikoli 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. |
| 205 | **1.1.3.2 depożiti minn klijenti oħrajn**  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). |
| 206 | **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. |
| 207 | **1.1.3.2.2 mhux 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 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. |
| 210 | **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. |
| 220 | **1.1.4.1. depożiti bankarji korrispondenti u 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. |
| 230 | **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. |
| 240 | **1.1.4.3. depożiti minn klijenti oħrajn**  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). |
| 250 | **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. |
| 260 | **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. |
| 270 | **1.1.5. Flussi ’l barra addizzjonali**  L-Artikolu 30 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Hawnhekk l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-flussi ’l barra 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, m’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. |
| 280 | **1.1.5.1. kollateral għajr assi tal-Livell 1 iddepożitati 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. |
| 290 | **1.1.5.2. kollateral ta’ assi ta’ Bonds Koperti EHQ tal-Livell 1 iddepożitati 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. |
| 300 | **1.1.5.3. flussi ’l barra materjali dovuti għad-degradazzjoni fil-kwalità kreditizja proprja**  L-Artikolu 30(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont totali ta’ flussi ’l barra addizzjonali li kkalkolaw u nnotifikaw lill-awtoritajiet kompetenti skont l-Artikolu 30(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Jekk ammont soġġett għal fluss ’il barra minħabba deterjorament fil-kwalità kreditizja proprja jkun ġie rrapportat xi mkien ieħor f’ringiela b’inqas minn ponderazzjoni ta’ 100 %, allura għandu jkun irrapportat ukoll ammont fir-Ringiela 300 b’mod li s-somma tal-flussi ’l barra tkun ta’ 100 % tal-fluss ’il barra għat-tranżazzjoni. |
| 310 | **1.1.5.4. l-impatt ta’ xenarju negattiv tas-suq fuq tranżazzjonijiet ta’ derivattivi**  L-Artikolu 30(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk l-ammont ta’ flussi ’l barra skont ir-Regolament Delegat (UE) 2017/208. |
| 340 | **1.1.5.5. flussi ’l barra minn derivattivi**  L-Artikolu 30(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw l-ammont ta’ flussi ’l barra mistennija fuq perjodu ta’ 30 jum tal-kalendarju mill-kuntratti elenkati fl-Anness II tar-Regolament (KE) 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 ’l barra li jseħħu biss fil-munita sinifikanti rispettiva. In-nettjar 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 ’il barra ta’ EUR10. Ma jistax isir nettjar bejn il-kontropartijiet, pereżempju Kontroparti A: EUR- 10, Kontroparti B: EUR+40 għandu jiġi rrapportat bħala fluss ’il barra ta’ EUR10 f’C73.00 (u influss ta’ EUR40 f’C74.00). |
| 350 | **1.1.5.6. pożizzjonijiet bin-nieqes**  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 ’il barra 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 bin-nieqes tkun koperta minn tranżazzjoni ta’ finanzjament ta’ titoli kollateralizzati, l-istituzzjoni ta’ kreditu għandha tassumi li l-pożizzjoni bin-nieqes se tinżamm matul il-perjodu ta’ 30 jum kalendarju u tirċievi fluss ’il barra ta’ 0 %. |
| 360 | **1.1.5.6.1. koperti minn SFT (tranżazzjonijiet ta’ finanzjament tat-titoli) kollateralizzati**  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. |
| 370 | **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. |
| 380 | **1.1.5.7. kollateral żejjed 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 jista’ jissejjaħ kuntrattwalment fi kwalunkwe ħin mill-kontroparti. |
| 390 | **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. |
| 400 | **1.1.5.9. kollateral ta’ assi likwidi skambjabbli ma’ 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. |
| 410 | **1.1.5.10. telf ta’ finanzjament fuq attivitajiet ta’ finanzjament strutturati**  L-Artikolu 30(8) sa 30(10) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jassumu fluss ’il barra 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. |
| 420 | **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. |
| 430 | **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 maturat ta’ obbligazzjonijiet minn karti kummerċjali, veikoli, veikoli ta’ investiment tat-titoli garantiti b’assi u faċilitajiet oħrajn ta’ finanzjament bħal dawn, diment li ma jaqgħux taħt il-kamp ta’ applikazzjoni tad-definizzjoni tal-istrumenti definiti fl-entrata 1.1.5.10.1., jew l-ammont tal-assi li potenzjalment jistgħu jiġu rritornati jew għal-likwidità meħtieġa fl-ambitu ta’ dawk l-istrumenti.  Il-finanzjament kollu fuq karti kummerċjali, veikoli, veikoli ta’ investiment tat-titoli garantiti b’assi 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 ’l barra 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. |
| 450 | **1.1.5.11. in-nettjar intern tal-pożizzjonijiet ta’ klijenti**  L-Artikolu 30(12) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Hawnhekk l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-valur tas-suq tal-assi mhux likwidi ta’ klijent li, fir-rigward tas-servizzi ta’ senserija primarja, l-istituzzjoni ta’ kreditu tkun użat biex tkopri l-bejgħ bin-nieqes ta’ klijent ieħor billi tqabbilhom internament. |
| 460 | **1.1.6. Faċilitajiet impenjati**  L-Artikolu 31 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk dwar il-flussi ’l barra 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. |
| 470 | **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. |
| 480 | **1.1.6.1.1. lil klijenti fil-livell tal-konsumaturi**  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) 575/2013. |
| 490 | **1.1.6.1.2. lil klijenti mhux finanzjarji minbarra klijenti fil-livell tal-konsum**  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) 575/2013 u lanqas klijenti fil-livell tal-konsumaturi skont l-Artikolu 411(2) tar-Regolament (UE) 575/2013 u li ma jkunux ġew ipprovduti għall-iskop li jiġi sostitwit il-finanzjament tal-klijent f’sitwazzjonijiet fejn il-klijent ma jkunx jista’ jikseb ir-rekwiżiti ta’ finanzjament fis-swieq finanzjarji. |
| 500 | **1.1.6.1.3. lill-istituzzjonijiet ta’ kreditu**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk dwar il-faċilitajiet ta’ kreditu impenjati pprovduti lill-istituzzjonijiet ta’ kreditu. |
| 510 | **1.1.6.1.3.1. għall-finanzjament ta’ self promozzjonali ta’ klijenti fil-livell tal-konsumaturi**  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) 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. |
| 520 | **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) 575/2013 u lanqas klijenti fil-livell tal-konsumaturi skont l-Artikolu 411(2) tar-Regolament (UE) 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. |
| 530 | **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 irrapportati hawn fuq. |
| 540 | **1.1.6.1.4. lil istituzzjonijiet finanzjari rregolati minbarra lill-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 miġbura pprovduti lill-istituzzjonijiet ta’ kreditu għajr l-istituzzjonijiet ta’ kreditu. |
| 550 | **1.1.6.1.5. fi ħdan grupp jew IPS jekk soġġetti 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 ’il barra iktar baxxa skont l-Artikolu 29 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 560 | **1.1.6.1.6. f’IPS jew netwerk kooperattiv jekk trattati bħala assi likwidi mill-istituzzjoni depożitanti**  L-Artikolu 31(7) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  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 tista’ tittratta l-faċilità bħala assi likwidu skont l-Artikolu 16(2). |
| 570 | **1.1.6.1.7. lil klijenti finanzjarji oħrajn**  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 irrapportati hawn fuq lil klijenti finanzjarji oħrajn. |
| 580 | **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. |
| 590 | **1.1.6.2.1. lil klijenti fil-livell tal-konsumaturi**  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) 575/2013. |
| 600 | **1.1.6.2.2. lil klijenti mhux finanzjarji minbarra klijenti fil-livell tal-konsumaturi**  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) 575/2013 u lanqas klijenti fil-livell tal-konsumaturi skont l-Artikolu 411(2) tar-Regolament (UE) 575/2013. |
| 610 | **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 ta’ investiment privat. |
| 620 | **1.1.6.2.4. lil SSPEs (veikolu bi skop speċjali ta’ 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 it-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. |
| 640 | **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 oħrajn għajr dawk imsemmija hawn fuq. Dan jinkludi arranġamenti li taħthom l-istituzzjoni hija meħtieġa tixtri jew tiswappja assi minn SSPE. |
| 650 | **1.1.6.2.5. lill-istituzzjonijiet ta’ kreditu**  Hawnhekk l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw dwar faċilitajiet ta’ likwidità impenjati pprovduti lill-istituzzjonijiet ta’ kreditu. |
| 660 | **1.1.5.2.5.1. għall-finanzjament ta’ self promozzjonali ta’ klijenti fil-livell tal-konsumaturi**  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) 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. |
| 670 | **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) 575/2013 u lanqas klijenti fil-livell tal-konsumaturi skont l-Artikolu 411(2) tar-Regolament (UE) 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. |
| 680 | **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. |
| 690 | **1.1.6.2.6. fi ħdan grupp jew IPS jekk soġġetti 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 ’il barra iktar baxxa skont l-Artikolu 29 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 700 | **1.1.6.2.7. f’IPS jew netwerk kooperattiv jekk trattati bħala assi likwidi mill-istituzzjoni depożitanti**  L-Artikolu 31(7) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  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 tista’ tittratta l-faċilità bħala assi likwidu skont l-Artikolu 16(2). |
| 710 | **1.1.6.2.8. lil klijenti finanzjarji oħrajn**  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 klijenti finanzjarji oħrajn. |
| 720 | **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. |
| 731 | **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 |
| 740 | **1.1.7.2. self u avvanzi mhux prelevati lil kontropartijiet fil-livell ta’ operatur**  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. |
| 750 | **1.1.7.3 self ipotekarju li ġie miftiehem iżda li għadu mhux prelevat**  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. |
| 760 | **1.1.7.4. karti tal-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. |
| 770 | **1.1.7.5. self kurrenti**  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. |
| 780 | **1.1.7.6. flussi ’l barra ppjanati relatati mat-tiġdid jew l-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 flussi ’l barra ippjanati relatati mat-tiġdid jew l-estensjoni ta’ self ġdid għall-konsumaturi jew għall-operaturi msemmi fl-Artikolu 23(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 850 | **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 (KE) Nru 575/2013 u derivattivi ta’ kreditu, imsemmija fl-Artikolu 23(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 860 | **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. |
| 870 | **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 affarijiet oħra, għandhom jiġu rrapportati f’din ir-ringiela.  Il-flussi ’l barra kontinġenti dovuti għal skattaturi ta’ deklassifikazzjoni msemmija fl-Artikolu 30(2) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 għandhom jiġu rrapportati f’din ir-ringiela. |
| 885 | **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 ’l barra minn obbligazzjonijiet oħra u impenji dovuti 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 li huma meħtieġa jinżammu f’riżervi tal-bank ċentrali fejn ikun miftiehem bejn l-awtorità kompetenti rilevanti u l-BĊE jew il-bank ċentrali skont il-punt (iii) tal-punt (b) tal-Artikolu 10(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 890 | **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. |
| 900 | **1.1.8.2. fil-forma ta’ titoli ta’ dejn jekk mhux ittrattati bħala depożiti fil-livell tal-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. |
| 912 | **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 dawn il-konsumaturi msemmija fil-punt (a) tal-Artikolu 32(3) meta tal-ewwel jaqbżu lil tal-aħħar. |
| 913 | **1.1.8.4.1 eċċess ta’ finanzjament lil klijenti fil-livell tal-konsumaturi**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk id-differenza bejn l-impenji kuntrattwali biex jestendu l-finanzjament lil konsumaturi fil-livell tal-konsumatur u l-ammont ta’ influssi minn dawn il-klijenti msemmija fil-punt (a) tal-Artikolu 32(3) meta tal-ewwel jaqbżu lil tal-aħħar. |
| 914 | **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 dawn il-klijenti msemmija fil-punt (a) tal-Artikolu 32(3) meta tal-ewwel jaqbżu lil tal-aħħar. |
| 915 | **1.1.8.4.3 eċċess ta’ finanzjament lil sovrani, MLDBs (banek multilaterali tal-iżvilupp) u PSEs (entitajiet mis-settur pubbliku)**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk id-differenza bejn l-impenji kuntrattrwali biex jestendu l-finanzjament lil sovrani, banek multilaterali tal-iżvilupp u entitajiet tas-settur pubbliku u l-ammont ta’ influssi minn dawn il-klijenti msemmija fil-punt (a) tal-Artikolu 32(3) meta tal-ewwel jaqbżu lil tal-aħħar. |
| 916 | **1.1.8.4.4 eċċess ta’ finanzjament lil entitajiet legali oħrajn**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk id-differenza bejn l-impenji kuntrattwali biex jestendu l-finanzjament lil klijenti entitajiet legali oħra u l-ammont ta’ influssi minn dawn il-klijenti msemmija fil-punt (a) tal-Artikolu 32(3) meta tal-ewwel jaqbżu lil tal-aħħar. |
| 917 | **1.1.8.5 Assi meħuda b’self 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 ’il barra 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. |
| 918 | **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 ’l barra minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali” u taħt l-ID 1.3. fuq “Flussi ’l barra totali minn swaps kollaterali”. |
| 920 | **1.2. Flussi ’l barra minn għoti ta’ 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 ’l barra 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. Tranżazzjonijiet ta’ swaps kollaterali (li jkopri tranżazzjonijiet kollateral ma’ kollateral) għandhom ikunu rrapportati fil-formula C 75.01 tal-Anness XXIV. |
| 930 | **1.2.1. Il-kontroparti hija bank ċentrali**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ’l barra 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. |
| 940 | **1.2.1.1. kollateral tal-Livell 1 minbarra 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 ’l barra 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 minbarra bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna u, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet ikun jikkwalifika skont l-Artikoli 7 u 10 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 945 | **1.2.1.1.1 li minnhom il-kollateral estiż jissodisfa rekwiżiti operazzjonali**  Tranżazzjonijiet fl-entrata 1.2.1.1 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. |
| 950 | **1.2.1.2. kollateral ta’ Bonds Koperti tal-Livell 1 tal-EHQ**  Il-punt (a) tal-Artikolu 28(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ’l barra 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, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet ikun jikkwalifika skont l-Artikoli 7 u 10 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 955 | **1.2.1.2.1 li minnhom il-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. |
| 960 | **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 ’l barra 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, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet ikun jikkwalifika skont l-Artikoli 7 u 11 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 965 | **1.2.1.3.1 li minnhom il-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. |
| 970 | **1.2.1.4. kollateral ta’ titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) 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 ’l barra 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 garantiti b’residenzi jew b’vetturi u tal-iskala 1 tal-kwalità tal-kreditu u li jikkonformaw mal-kundizzjonijiet stabbiliti fil-punti (i), (ii) jew (iv) tal-punt (b) tal-Artikolu 13(2) u, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet ikun jikkwalifika skont l-Artikoli 7 u 13 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 975 | **1.2.1.4.1 li minnhom il-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. |
| 980 | **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 ’l barra 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, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet ikun jikkwalifika skont l-Artikoli 7 u 12 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 985 | **1.2.1.5.1 li minnhom il-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. |
| 990 | **1.2.1.6. kollateral ta’ titoli garantiti b’assi (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) 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 ’l barra 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 garantiti b’self kummerċjali, lokazzjonijiet 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 (iii) jew (v) tal-punt (g) tal-Artikolu 13(2) u, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet ikun jikkwalifika skont l-Artikoli 7 u 13 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 995 | **1.2.1.6.1 li minnhom il-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 tal-Livell 2B oħrajn**  Il-punt (a) tal-Artikolu 28(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ’l barra 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 2B mhux koperti hawn fuq u, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet ikun jikkwalifika skont l-Artikoli 7 u 12 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 1005 | **1.2.1.7.1 li minnhom il-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 ’l barra 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 ’l barra 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. |
| 1030 | **1.2.2.1. kollateral tal-Livell 1 minbarra 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 ’l barra 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 minbarra bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna u, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet ikun jikkwalifika skont l-Artikoli 7 u 10 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 1035 | **1.2.2.1.1. li minnhom il-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 tal-Livell 1 tal-EHQ**  Il-punt (b) tal-Artikolu 28(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ’l barra 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, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet ikun jikkwalifika skont l-Artikoli 7 u 10 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 1045 | **1.2.2.2.1. li minnhom il-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 ’l barra 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, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet ikun jikkwalifika skont l-Artikoli 7 u 11 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 1055 | **1.2.2.3.1. li minnhom il-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 (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B**  Il-punt (d) tal-Artikolu 28(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ’l barra 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 garantiti b’residenzi jew b’vetturi u tal-iskala 1 tal-kwalità tal-kreditu u li jikkonformaw mal-kundizzjonijiet stabbiliti fil-punti (i), (ii) jew (iv) tal-punt (g) tal-Artikolu 13(2) u, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet ikun jikkwalifika skont l-Artikoli 7 u 13 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 1065 | **1.2.2.4.1. li minnhom il-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 ’l barra 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, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet ikun jikkwalifika skont l-Artikoli 7 u 12 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 1075 | **1.2.2.5.1. li minnhom il-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 (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B**  Il-punt (f) tal-Artikolu 28(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ’l barra 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 garantiti b’self kummerċjali, lokazzjonijiet 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 (iii) jew (v) tal-punt (f) tal-Artikolu 13(2) u, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet ikun jikkwalifika skont l-Artikoli 7 u 13 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 1085 | **1.2.2.6.1. li minnhom il-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 tal-Livell 2B oħrajn**  Il-punt (g) tal-Artikolu 28(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ’l barra 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 koperti hawn fuq u, minbarra meta jintuża bħala kollateral għal dawk it-tranżazzjonijiet ikun jikkwalifika skont l-Artikoli 7 u 12 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 bħala assi likwidu. |
| 1095 | **1.2.2.7.1. li minnhom il-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 ’l barra 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 ma tkunx bank ċentrali u l-kollateral estiż huwa kollateral ta’ assi mhux likwidi. |
| 1130 | **1.3. Total ta’ flussi ’l barra minn swaps kollaterali**  Is-somma ta’ flussi ’l barra minn C75.01 tal-Anness XXIV il-Kolonna 0070 għandha tkun irrapportata fil-Kolonna 060. |
| **ENTRATI FIL-MEMORANDUM** | |
| 1170 | **2. Flussi ’l barra 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 010 l-ammont tal-bilanċ pendenti tal-obbligazzjonijiet u l-impenji barra l-karta bilanċjali kollha, li l-flussi ’l barra 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 060 il-flussi ’l barra 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:  — Istituzzjonijiet ta’ kreditu;  — klijenti finanzjarji minbarra istituzzjonijiet ta’ kreditu;  — sovrani, banek ċentrali, banek multilaterali tal-iżvilupp u entitajiet tas-settur pubbliku;  — konsumaturi oħra. |
| 1180 | **3.1. ipprovduti mill-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 minbarra 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 mill-klijenti 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 oħrajn**  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 ’l barra 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 affiljata ma’ 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-klijenti 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 fil-kamp ta’ applikazzjoni tal-entrata 4 li għalihom għadhom ma rċevewx il-permess li japplikaw rata ta’ fluss ’il barra 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 ’il barra 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 eċċessi**  L-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 tal-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 ’l barra FX**  Din l-entrata għandha tkun irrapportata 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 ’l barra 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-nettjar 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 ’il barra ta’ EUR10. Ma jistax isir nettjar bejn il-kontropartijiet, pereżempju Kontroparti A: EUR-10, Kontroparti B: EUR+40 għandu jiġi rrapportat bħala fluss ’il barra 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 jirrappurtaw hawnhekk tranżazzjonijiet ta’ finanzjament garantiti b’maturità residwa sa 30 jum fejn il-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 skont l-Artikolu 17(4) tiegħu. |
| 1400 | **6.1 li minnhom: garantiti bl-L1 minbarra 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 minbarra 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: garantiti bl-EHQCB L1**  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 huwa 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: garantiti 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 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. |
| 1430 | **6.4 li minnhom: garantiti 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 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. |
| 1440 | **6.5 li minnhom: garantiti b’assi mhux likwidi**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk tranżazzjonijiet ta’ finanzjament garantiti li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju meta l-kontroparti hija 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 skont l-Artikolu 17(4) tiegħu. |

**RAPPORTAR DWAR IL-LIKWIDITÀ (PARTI 3: INFLUSSI)**

1. Influssi

1.1. Kummenti ġenerali

1. Din hija l-formula fil-qosor 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. L-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) 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 għadhom ma skadewx u li l-istituzzjoni ta’ kreditu ma jkollha l-ebda raġuni għalfejn tistenna minnhom nuqqas ta’ prestazzjoni fi żmien 30 jum tal-kalendarju.

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 ħdan grupp jew skema ta’ protezzjoni istituzzjonali (minbarra l-influssi minn faċilitajiet ta’ kreditu jew tal-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 ikunu allokati fil-kategoriji rilevanti. L-ammonti mhux ponderati għandhom ikunu wkoll irrapportati bħala entrati ta' memorandum taħt is-sezzjoni 3 tal-formula (ringieli 460-510).
2. Skont l-Artikolu 32(6) tar-Regolament ta’ Delega (UE) 2015/61, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu ma għandhom jirrapportaw l-ebda influssi minn kwalunkwe wieħed mill-assi likwidi rapportati skont it-Titolu II ta’ dak ir-Regolament għajr il-pagamenti dovuti fuq 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 tas-sezzjonijiet 1.1, 1.2 jew 1.3. l-influssi għandu jkun irrapportat kollu, irrispettivament mill-ammont ta’ flussi ’l barra fil-pajjiż terz jew il-munita.
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) 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 ’l barra skont l-Artikolu 21 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 meta jkunu ddenominati fl-istess munita.
7. L-istruttura tal-Kolonni ta’ dan 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 ta’ Kolonni jekk entitajiet differenti taħt l-istess konsolidazzjoni jikkwalifikaw għal trattamenti differenti ta’ limiti massimi.
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 kollateral ma’ kollateral ma għandhomx ikunu rrapportati fil-formula tal-influss (C 74.00 tal-ANNESS XXIV) li tkopri biss tranżazzjonijiet ta’ flus ma’ kollateral.
2. Fejn għoti ta’ self garantit u transazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali ikunu garantiti minn ishma 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’ishma 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’ishma 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) 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’ retroriakkwist tista’ tirriżulta fi influss negattiv. It-tranżazzjonijiet ta’ retroriakkwist irrapportati fl-istess entrata għandhom jingħaddu flimkien (pożittivi u negattivi). Jekk it-total ikun pożittiv dan għandu jiġi rrapportat fil-formula tal-influss. Jekk it-total ikun negattiv dan għandu jiġi rrapportat fil-formula tal-fluss ’il barra. 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. Fejn istituzzjoni ta’ kreditu tista’ tirrikonoxxu biss parti mill-ishma tagħha f’munita barranija, jew assi f’muniti barranin ta’ gvern ċentrali jew ta' bank, jew assi fil-munita domestika ta' gvern ċentrali jew bank ċentrali fl-HQLA tagħhom, il-parti rikonoxxibbli biss għandha tiġi rrapportata fir-ringieli tal-assi tal-Livelli 1, tal-Livell 2A u tal-Livell 2B, f’konformità mal-punti (ii) tal-punt (c) tal-Artikolu 12(1) u mal-punt (d) tal-Artikolu 10(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. Meta l-assi partikolari jintuża bħala kollateral iżda għal ammont li huwa żejjed għall-porzjon li jista’ jkun rikonoxxut bħala assi likwidi, l-ammont żejjed għandu jkun irrapportat fis-sezzjoni mhux likwidi. Assi tal-Livell 2 A għandhom ikunu rrapportati fir-ringiela tal-assi tal-Livell 2 A 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. L-influss li għandu jiġi riċevut għandu jkun irrapportat f’{C 74.00; r260} (“influssi oħrajn”), nett mill-valur tas-suq tal-assi li għandu jiġi kkonsenjat lill-kontroparti wara l-applikazzjoni tal-haircut LCR relatat. 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, retroriakkwist 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 jkun riċevut għandu jkun irrapportat f’{C 74.00; r260} (“influssi oħrajn”), nett mill-valur tas-suq tal-assi li għandu jiġi kkonsenjat lill-kontroparti wara l-applikazzjoni tal-haircut LCR relatat. 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 ’il barra f’C.73.00. 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. Fil-każ ta’ retroriakkwist, fejn il-valur tas-suq tal-assi li għandu jkun riċevut bħala kollateral wara l-applikazzjoni tal-haircut LCR relatat (jekk l-assi jikkwalifika bħala assi likwidu) ikun ikbar mill-ammont ta’ flus li għandu jingħata b’self, id-differenza għandha tiġi rrapportata bħala influss f’C 74.00; r260 (“influssi oħrajn”). Għal swaps kollaterali, fejn l-effett nett tal-iswap inizjali tal-assi (b’kont meħud tal-haircuts LCR) jikkawża influss dan l-influss għandu jkun irrapportat {C 74.00; r260 (“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-prijoritajiet għall-allokazzjoni ta’ kull entrata rrapportata sabiex jiġi żgurat rapportar omoġenju u komparabbli. L-implimentazzjoni tal-iskema tad-deċiżjonijiet waħidha mhijiex biżżejjed — l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jikkonformaw mal-bqija tal-istruzzjonijiet dejjem.
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

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **#** | **Entrata** | | | **Deċiżjoni** | **Rapportar** |
| 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 (Art. 32(1))   L-istituzzjonijiet ta’ kreditu ma għandhom jikkunsidraw l-ebda influssi minn xi obbligu ġdid li jkunu daħlu għalih (Art. 32(7))   L-ebda influssi ma għandu jkun irrapportar f’każ li l-influssi huma diġà nnettjati mill-flussi ’l barra (Art. 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 (Art. 32(6)) | | | Le | Ebda Rapportar |
| Iva | # 2 |
| 2 | Tranżazzjoni forward start | | | Iva | # 3 |
| Le | # 5 |
| 3 | Tranżazzjonijiet forward li tkun daħlet għalihom 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 tat permess li tiġi applikata rata ta’ influss ogħla (Art. 34) | | | Iva | Ringiela 250, ID 1.1.10 |
| Le | # 7 |
| 7 | Influssi minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali minbarra derivattivi (l-Art. 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 200, ID 1.1.6 |
| 12 | Flejjes dovuti minn pożizzjonijiet f’indiċijiet 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 | 31(9) (Art. 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 klijenti mhux finanzjarji (minbarra banek ċentrali) li ma jikkorrispondux ma’ ripagament tal-kapital (Art 32(2)) | | | Iva | Ringiela 040, ID 1.1.1.1 |
| Le | # 18 |
| 18 | Flejjes oħra dovuti minn klijenti mhux finanzjarji (minbarra banek ċentrali) (Art. 32(3)(a)) | | | Iva | # 19 |
| Le | Ringiela 260, ID 1.1.11 |
| 19 | Flejjes oħra dovuti minn klijenti mhux finanzjarji (minbarra banek ċentrali) (Art. 32(3)(a)) | # 19.1 | Klijenti fil-livell tal-konsumaturi | 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 (Art. 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 (Art. 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 bin-nieqes | | | 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 bin-nieqes | | | 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 (Art. 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 (Art. 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 (Art. 32(3)(b)) | # 36.1 | self ta’ marġini: il-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

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **#** | **Entrata** | | | **Deċiżjoni** | **Rapportar** |
| 1 | Influss li għandu jkun irrapportat fir-ringieli 010-430 tal-formula C 74.00 tal-ANNESS XXIV skont l-Art. 32, Art. 33 u Art. 34 u skont il-klassifikazzjoni kif speċifikat fis-sezzjoni 1 (“Skema 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 minbarra derivattivi (l-Art. 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 010 |
| # 7.2 | Ponderazzjoni Applikabbli |  | Kolonna 080 |
| # 7.3 | Influss |  | Kolonna 140 |
| 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 020 |
| # 9.2 | Ponderazzjoni Applikabbli |  | Kolonna 090 |
| # 9.3 | Influss |  | Kolonna 150 |
| 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 030 |
| # 10.2 | Ponderazzjoni Applikabbli |  | Kolonna 100 |
| # 10.3 | Influss |  | Kolonna 160 |
| 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 010 |
| # 16.2 | Valur tas-suq tal-kollateral riċevut |  | Kolonna 040 |
| # 16.3 | Ponderazzjoni Applikabbli |  | Kolonna 080 |
| # 16.4 | Valur tal-kollateral riċevut skont l-Artikolu 9  [biss jekk il-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali] |  | Kolonna 110 |
| # 16.5 | Influss |  | Kolonna 140 |
| 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 020 |
| # 18.2 | Valur tas-suq tal-kollateral riċevut |  | Kolonna 050 |
| # 18.3 | Ponderazzjoni Applikabbli |  | Kolonna 090 |
| # 18.4 | Valur tal-kollateral riċevut skont l-Artikolu 9  [biss jekk il-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali] |  | Kolonna 120 |
| # 18.5 | Influss |  | Kolonna 150 |
| 19 | Influssi li huma eżentati għalkollox mil-limitu massimu fuq l-influssi (Artikolu 33(2)-(3)) | # 19.1 | Flejjes dovuti |  | Kolonna 030 |
| # 19.2 | Valur tas-suq tal-kollateral riċevut |  | Kolonna 060 |
| # 19.3 | Ponderazzjoni Applikabbli |  | Kolonna 100 |
| # 19.4 | Valur tal-kollateral riċevut skont l-Artikolu 9  [biss jekk il-kollateral riċevut jissodisfa r-rekwiżiti operazzjonali] |  | Kolonna 130 |
| # 19.5 | Influss |  | Kolonna 160 |

1.5. Sottoformola tal-influssi

1.5.1. Struzzjonijiet dwar **kolonni** speċifiċi

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Kolonna | Referenzi legali u struzzjonijiet | |
| 010 | **Ammont — Soġġett għal-limitu massimu ta’ 75 % fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 u l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għar-ringieli {040},{060}-{090},{120}-{130},{150}-{260},{269}-{297},{301}-{303},{309-337}, {341}-{345},{450} u {470}-{510}, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-Kolonna 010 l-ammont totali tal-assi/flejjes dovuti/ammonti massimi li jistgħu jinġibdu 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 għandha tkun irrapportata fil-Kolonna 020 jew 030 u l-parti tal-ammont mhux soġġetta għall-eżenzjoni għandha tkun irrapportata fil-Kolonna 010. | |
| 020 | **Ammont — Soġġett għal-limitu massimu ta’ 90 % fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 u l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għar-ringieli {040},{060}-{090},{120}-{130},{150}-{260},{269}-{297},{301}-{303},{309-337}, {341}-{345},{450} u {470}-{510}, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-Kolonna 020 l-ammont totali tal-assi/flejjes dovuti/ammonti massimi li jistgħu jinġibdu 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 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 għandha tkun irrapportata fil-Kolonna 020 jew 030 u l-parti tal-ammont mhux soġġetta għall-eżenzjoni għandha tkun irrapportata fil-Kolonna 010. | |
| 030 | **Ammont – Eżentat mil-limitu massimu fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 u l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għar-ringieli {040},{060}-{090},{120}-{130},{150}-{260},{269}-{297},{301}-{303},{309-337}, {341}-{345},{450} u {470}-{510}, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-Kolonna 030 l-ammont totali tal-assi/flejjes dovuti/ammonti massimi li jistgħu jinġibdu li huma eżentati għalkollox 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 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 għandha tkun irrapportata fil-Kolonna 020 jew 030 u l-parti tal-ammont mhux soġġetta għall-eżenzjoni għandha tkun irrapportata fil-Kolonna 010. | |
| 040 | **Il-valur tas-suq tal-kollateral riċevut — Soġġett għal-limitu massimu ta’ 75 % fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 u l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għar-ringieli {269}-{295},{309-335} għar-ringiela {490}, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-Kolonna 040 il-valur tas-suq tal-kollateral riċevut 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 tas-suq tal-kollateral riċevut f’għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali li huma soġġetti għall-eżenzjoni għandu jkun irrapportat fil-Kolonna 050 jew 060 u l-valur tas-suq tal-kollateral riċevut f’għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali li mhumiex soġġetti għall-eżenzjoni għandhom ikunu rrapportati fil-Kolonna 040. | |
| 050 | **Il-valur tas-suq tal-kollateral riċevut — Soġġett għal-limitu massimu ta’ 90 % fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 u l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għar-ringieli {269}-{295},{309-335} u għar-ringiela {490}, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-Kolonna 050 il-valur tas-suq tal-kollateral riċevut 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 fl-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-swieq kapitali li huma soġġetti għall-eżenzjoni għandu jkun irrapportat fil-Kolonna 050 jew 060 u l-valur tas-suq tal-kollateral riċevut f’għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali li mhumiex soġġetti għall-eżenzjoni għandhom ikunu rrapportati fil-Kolonna 040. | |
| 060 | **Il-valur tas-suq tal-kollateral riċevut — Eżentat mil-limitu massimu fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 u l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għar-ringieli {269}-{295},{309-335} u għar-ringiela {490}, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-Kolonna 060 il-valur tas-suq tal-kollateral riċevut f’għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali li huma eżentati għal kollox 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-swieq kapitali li huma soġġetti għall-eżenzjoni għandu jkun irrapportat fil-Kolonna 050 jew 060 u l-valur tas-suq tal-kollateral riċevut f’għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali li mhumiex soġġetti għall-eżenzjoni għandhom ikunu rrapportati fil-Kolonna 040. | |
| 070 | **Ponderazzjoni Standard**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 u l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Il-ponderazzjoniijiet standard fil-Kolonna 070 huma dawk speċifikati b’mod prestabbilit fir-Regolament Delegat (UE) 2015/61 u huma pprovduti għall-informazzjoni biss. | |
| 080 | **Ponderazzjoni Applikabbli- Soġġetta għal-limitu massimu ta’ 75 % fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 u 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 nazzjonali.  Għar-ringieli {040},{060}-{090},{120}-{130},{150}-{260},{269},{273},{277},{281},{285},{289}, {293},{301}-{303},{309},{313},{317},{321},{325},{329},{333},{341}-{345},{450} u {470} –{510}, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-Kolonna 080 il-ponderazzjoni medja applikata għal assi/flejjes dovuti/ammonti massimi li jistgħu jinġibdu li huma soġġetti għal-limitu massimu ta’ 75 % fuq l-influssi kif speċifikat fl-Artikolu 33(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 090 | **Ponderazzjoni Applikabbli- Soġġetta għal-limitu massimu ta’ 90 % fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 u l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Il-Ponderazzjoniijiet 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 nazzjonali.  Għar-ringieli {040},{060}-{090},{120}-{130},{150}-{260},{269},{273},{277},{281},{285},{289}, {293},{301}-{303},{309},{313},{317},{321},{325},{329},{333},{341}-{345},{450} u {470} –{510}, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-Kolonna 090 il-ponderazzjoni medja applikata għal assi/flejjes dovuti/ammonti massimi li jistgħu jinġibdu 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. | |
| 100 | **Ponderazzjoni Applikabbli — Eżentata mil-limitu massimu fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 u l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Il-Ponderazzjoniijiet 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 nazzjonali.  Għar-ringieli {040},{060}-{090},{120}-{130},{150}-{260},{269},{273},{277},{281},{285},{289}, {293},{301}-{303},{309},{313},{317},{321},{325},{329},{333},{341}-{345},{450} u {470} –{510}, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-Kolonna 100 il-ponderazzjoni medja applikata għal assi/flejjes dovuti/ammonti massimi li jistgħu jinġibdu 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. | |
| 110 | **Il-valur tal-kollateral riċevut skont l-Artikolu 9 — Soġġett għal-limitu massimu ta’ 75 % fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 u l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għar-ringieli {271},{275},{279},{283},{287},{291},{295},{311},{315},{319},{323},{327},{331} u {335}, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-Kolonna 110 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 li huma soġġetti għall-eżenzjoni għandu jkun irrapportat fil-Kolonna 120 jew 130 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-swieq kapitali mhux soġġetti għall-eżenzjoni għandu jkun irrapportat fil-Kolonna 110. | |
| 120 | **Il-valur tal-kollateral riċevut skont l-Artikolu 9 — Soġġett għal-limitu massimu ta’ 90 % fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 u l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għar-ringieli {271},{275},{279},{283},{287},{291},{295},{311},{315},{319},{323},{327},{331} u {335}, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-Kolonna 120 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 li huma soġġetti għall-eżenzjoni għandu jkun irrapportat fil-Kolonna 120 jew 130 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-swieq kapitali mhux soġġetti għall-eżenzjoni għandu jkun irrapportat fil-Kolonna 110. | |
| 130 | **Il-valur tal-kollateral riċevut skont l-Artikolu 9 — Eżentat mil-limitu massimu fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 u l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għar-ringieli {271},{275},{279},{283},{287},{291},{295},{311},{315},{319},{323},{327},{331} u {335}, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-Kolonna 130 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 eżentati għalkollox mil-limitu 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 li huma soġġetti għall-eżenzjoni għandu jkun irrapportat fil-Kolonna 120 jew 130 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-swieq kapitali mhux soġġetti għall-eżenzjoni għandu jkun irrapportat fil-Kolonna 110. | |
| 140 | | **Influss — Soġġett għal-limitu massimu ta’ 75 % fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 u l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għar-ringieli {040},{060}-{090},{120}-{130},{150}-{260},{269},{273},{277},{281},{285},{289}, {293},{301}-{303},{309},{313},{317},{321},{325},{329},{333},{341}-{345},{450} u {470}-{510}, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-Kolonna 140 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 jkun ikkalkolat bil-multiplikazzjoni tal-ammont totali/ammont massimu li jista’ jinġibed mill-Kolonna 010 bil-ponderazzjoni rilevanti mill-Kolonna 080.  Għar-ringiela 170, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-Kolonna 140 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 rċeviet dan l-impenn sabiex jiżborzaw self promozzjonali lil riċevent finali, jew ikunu rċevew impenn simili minn bank multilaterali tal-iżvilupp jew entità tas-settur pubbliku. | |
| 150 | | **Influss — Soġġett għal-limitu massimu ta’ 90 % fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 u l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għar-ringieli {040},{060}-{090},{120}-{130},{150}-{260},{269},{273},{277},{281},{285},{289}, {293},{301}-{303},{309},{313},{317},{321},{325},{329},{333},{341}-{345},{450} u {470}-{510}, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-Kolonna 150 l-influssi totali 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 mmoltiplikat l-ammont totali/l-ammont massimu li jista’ jittieħed mill-Kolonna 020 bil-ponderazzjoni rilevanti mill-Kolonna 090. Għar-ringiela {170}, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-Kolonna 150 l-influssi totali li huma soġġetti għal-limitu massimu ta’ 90 % fuq 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 irċiviet dan l-impenn sabiex jagħtu self promozzjonali lil benefiċjarju finali, jew irċivew impenn simili minn bank multilaterali tal-iżvilupp jew entità tas-settur pubbliku. | |
| 160 | | **Influss — Eżentat mil-limitu massimu fuq l-influssi**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 u l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Għar-ringieli {040},{060}-{090},{120}-{130},{150}-{260},{269},{273},{277},{281},{285},{289}, {293},{301}-{303},{309},{313},{317},{321},{325},{329},{333},{341}-{345},{450} u {470}-{510}, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-Kolonna 160 it-total tal-influssi li huma eżentati għalkollox 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 jkun ikkalkolat bil-multiplikazzjoni tal-ammont totali/ammont massimu li jista’ jinġibed mill-Kolonna 030 bil-ponderazzjoni mill-Kolonna 100.  Għar-ringiela 170, l-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fil-Kolonna 160 it-total tal-influssi li huma eżentati għal kollox 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 rċeviet dan l-impenn sabiex ikunu jistgħu jiżborzaw self promozzjonali lil riċevent 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 |
| 010 | **1. INFLUSSI TOTALI**  L-Artikolu 32, l-Artikolu 33 u l-Artikolu 34 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fir-ringiela 010 ta’ C 74.00 tal-ANNESS XXIV   għal kull Kolonna 010, 020 u 030 l-ammont totali ta’ assi/flejjes dovuti/ammont massimu li jista’ jiġi prelevat bħala s-somma tal-assi/flejjes dovuti/ammont massimu li jista’ jiġi prelevat minn tranżazzjonijiet/depożiti mhux garantiti u għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali;   għall-Kolonna 140 it-total tal-influssi bħala s-somma tal-influssi minn tranżazzjonijiet/depożiti mhux garantiti u tranżazzjonijiet ta’ għoti ta’ self garantit, dawk immotivati mis-swieq tal-kapital u tranżazzjonijiet ta’ swap kollaterali nieqes id-differenza bejn it-total tal-influssi ippeżati u t-total tal-flussi ’l barra ippeżati li jirriżultaw minn tranżazzjonijiet f’pajjiżi terzi fejn hemm restrizzjonijiet fuq trasferimenti jew li jkunu denominati f’muniti mhux konvertibbli; kif ukoll   għall-Kolonna 150 u 160 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’ swap kollaterali nieqes id-differenza bejn it-total tal-influssi ponderati u t-total tal-flussi ’l barra ponderati li jirriżultaw minn tranżazzjonijiet f’pajjiżi terzi fejn hemm restrizzjonijiet fuq trasferimenti jew li jkunu denominati f’muniti mhux konvertibbli u nieqes 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. |
| 020 | **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 020 ta’ C 74.00 tal-ANNESS XXIV   għal kull Kolonna 010, 020 u 030 l-ammont totali ta’ assi/flejjes dovuti/ammont massimu li jista’ jiġi prelevat minn tranżazzjonijiet/depożiti mhux garantiti; kif ukoll   għal kull Kolonna 140, 150 u 160 it-total tal-influssi minn tranżazzjonijiet/depożiti mhux garantiti. |
| 030 | **1.1.1. flejjes dovuti minn klijenti 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 030 ta’ C 74.00 tal-ANNESS XXIV   għal kull Kolonna 010, 020 u 030 l-ammont totali tal-flejjes dovuti minn klijenti mhux finanzjarji (minbarra banek ċentrali) (flejjes dovuti minn klijenti mhux finanzjarji li ma jikkorrispondux għal ripagamenti ta’ kapital kif ukoll kull flejjes oħrajn dovuti minn klijenti mhux finanzjarji) u   għal kull Kolonna 140, 150 u 160 it-total tal-influssi minn klijenti mhux finanzjarji (minbarra banek ċentrali) (influssi minn klijenti mhux finanzjarji li ma jikkorrispondux għal ripagamenti ta’ kapital kif ukoll influssi oħrajn minn klijenti 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 fis-sezzjoni 1.2, u ma għandhomx ikunu rrapportati fis-sezzjoni 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 fis-sezzjoni 1.2, u ma għandhomx ikunu rapportati fis-sezzjoni 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 tas-sezzjoni 1.1.1.  Flejjes dovuti minn banek ċentrali għandhom ikunu rrapportati fis-sezzjoni 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 fis-sezzjoni 1.1.4. u m’għandhomx jiġu rrapportati hawnhekk. Flejjes dovuti minn titoli li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju għandhom ikunu rapportati fis-sezzjoni 1.1.5. u ma għandhomx ikunu rrapportati hawnhekk. |
| 040 | **1.1.1.1. flejjes dovuti minn klijenti mhux finanzjarji (minbarra banek ċentrali) li ma jikkorrispondux għal ripagament ta’ kapital**  Il-punt (a) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Flejjes dovuti minn klijenti mhux finanzjarji (minbarra banek ċentrali) b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum li ma jikkorrispondux għal ripagament ta’ 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 fis-sezzjoni 1.1.2 u ma għandhomx ikunu rrapportati hawnhekk. |
| 050 | **1.1.1.2. flejjes oħrajn dovuti minn klijenti 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 050 ta’ C 74.00 tal-ANNESS XXIV   għal kull Kolonna 010, 020 u 030 l-ammont totali ta’ flejjes oħrajn dovuti minn klijenti mhux finanzjarji (minbarra banek ċentrali) bħala s-somma tal-flejjes dovuti minn klijenti mhux finanzjarji b’kontroparti u   għal kull Kolonna 140, 150 u 160 it-total ta’ influssi oħrajn minn klijenti mhux finanzjarji (minbarra banek ċentrali) bħala s-somma ta’ influssi oħrajn minn klijenti mhux finanzjarji b’kontroparti.  Il-flejjes dovuti minn klijenti mhux finanzjarji (minbarra banek ċentrali) li ma jikkorrispondux għal ripagament prinċipali għandhom ikunu rrapportati fis-sezzjoni 1.1.1.1 u ma għandhomx ikunu rrapportati hawnhekk.  Flejjes oħrajn dovuti minn banek ċentrali għandhom ikunu rrapportati fis-sezzjoni 1.1.2 u ma għandhomx ikunu rrapportati hawnhekk.  Influssi li jikkorrispondu għal flussi ’l barra skont l-impenji ta’ għoti ta’ self promozzjonali msemmija fl-Artikolu 31(9) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 għandhom ikunu rrapportati fis-sezzjoni 1.1.3 u ma għandhomx ikunu rrapportati hawnhekk. |
| 060 | **1.1.1.2.1. flejjes dovuti minn klijenti fil-livell tal-konsumaturi**  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. |
| 070 | **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. |
| 080 | **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. |
| 090 | **1.1.1.2.4. Flejjes dovuti minn entitajiet legali oħrajn**  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. |
| 100 | **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 100 ta’ C 74.00 tal-ANNESS XXIV   għal kull Kolonna 010, 020 u 030 l-ammont totali ta’ flejjes dovuti minn banek ċentrali u klijenti finanzjarji (depożiti operazzjonali kif ukoll mhux operazzjonali); kif ukoll   għal kull Kolonna 140, 150 u 160 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 fis-sezzjoni 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 fis-sezzjoni 1.1.4. u m’għandhomx jiġu rrapportati hawnhekk. Flejjes dovuti minn titoli li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju għandhom ikunu rapportati fis-sezzjoni 1.1.5. u ma għandhomx ikunu rrapportati hawnhekk. |
| 110 | **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 110 ta’ C 74.00 tal-ANNESS XXIV   għal kull Kolonna 010, 020 u 030 l-ammont totali ta’ flejjes dovuti minn klijenti finanzjarji kklassifikati bħala depożiti operazzjonali (irrispettivament minn jekk l-istituzzjoni ta’ kreditu tistax tistabbilixxi rata ta’ influss simmetriku korrispondenti jew le); kif ukoll   għal kull Kolonna 140, 150 u 160 it-total ta’ influssi minn klijenti finanzjarji kklassifikati bħala depożiti operazzjonali (irrispettivament minn jekk l-istituzzjoni ta’ kreditu tistax 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. |
| 120 | **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’ influss 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 tista’ tistabbilixxi rata ta’ influss simmetriku korrispondenti. |
| 130 | **1.1.2.1.2. flejjes dovuti minn klijenti finanzjarji li huma kklassifikati bħala depożiti operazzjonali fejn l-istituzzjoni ta’ kreditu ma tistax tistabbilixxi rata ta’ influss 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 %. |
| 140 | **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 010, 020 u 030 l-ammont totali ta’ flejjes dovuti minn banek ċentrali u klijenti finanzjarji li mhumiex klassifikati bħala depożiti operazzjonali u   għal kull Kolonna 140, 150 u 160 l-influssi totali minn banek ċentrali u klijenti finanzjarji li mhumiex klassifikati 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. |
| 150 | **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. |
| 160 | **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)(d) flimkien mal-Artikolu 27 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Influssi li jikkorrispondu għal flussi ’l barra skont l-impenji ta’ għoti ta’ self promozzjonali msemmija fl-Artikolu 31(9) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61 għandhom ikunu rrapportati fis-sezzjoni 1.1.3 u ma għandhomx ikunu rrapportati hawnhekk. |
| 170 | **1.1.3. influssi li jikkorrispondu għal flussi ’l barra skont l-impenji ta’ għoti 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 ’l barra skont l-impenji ta’ għoti ta’ self promozzjonali msemmija fl-Artikolu 31(9) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. |
| 180 | **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. |
| 190 | **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. |
| 201 | **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. |
| 210 | **1.1.7. flejjes dovuti minn pożizzjonijiet fi strumenti ta’ ekwità ta’ indiċi prinċipali dment li l-assi likwidi ma jingħaddux darbtejn**  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. |
| 230 | **1.1.8. influssi mir-rilaxx ta’ bilanċi miżmumin f’kontijiet segregati skont ir-rekwiżiti regolatorji għall-protezzjoni tal-assi għan-negozju tal-konsumaturi**  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. |
| 240 | **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’ nettjar 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 ’l barra 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’ nettjar bilaterali.  Fil-każ ta’ rapportar separat skont l-Artikolu 415(2) tar-Regolament (UE) 575/2013, it-tranżazzjonijiet ta’ derivattivi jew derivattivi tal-kreditu għandhom jiġu separati f’kull munita rispettiva. In-nettjar skont il-kontroparti jista’ jkun applikat għall-flussi f’dik il-munita. |
| 250 | **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 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. |
| 260 | **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. |
| 263 | **1.2. Influssi minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali**  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 263 ta’ C 74.00 tal-ANNESS XXIV   għal kull Kolonna 010, 020 u 030 l-ammont totali ta’ flejjes dovuti minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq tal-kapital; kif ukoll   għal kull Kolonna 140, 150 u 160 l-influssi totali 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-formola C 75.01 tal-Anness XXIV u ma għandhomx ikunu rrapportati hawnhekk. |
| 265 | **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 265 ta’ C 74.00 tal-ANNESS XXIV   għal kull Kolonna 010, 020 u 030 l-ammont totali ta’ flejjes dovuti minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq tal-kapital fejn il-kontroparti hija bank ċentrali; kif ukoll   għal kull Kolonna 140, 150 u 160 l-influssi totali minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali fejn il-kontroparti hija bank ċentrali. |
| 267 | **1.2.1.1. kollateral li jikkwalifika bħala assi likwidu**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fir-ringiela 267 ta’ C 74.00 tal-ANNESS XXIV   għal kull Kolonna 010, 020 u 030 l-ammont totali ta’ flejjes dovuti minn 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’assi likwidi; kif ukoll   * għal kull Kolonna 140, 150 u 160 l-influssi totali minn 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’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) 2015/61. |
| 269 | **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  Tranżazzjonijiet ta’ għoti ta’ self garantit u mmotivati 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, kemm jekk jerġgħu jintużaw fi tranżazzjoni oħra kif ukoll jekk le, ikunu jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 10 tar-Regolament (UE) 2015/61 bħala assi likwidi ta’ kwalunkwe waħda mill-kategoriji ta’ assi tal-livell 1 imsemmija fl-Artikolu 10, bl-eċċezzjoni tal-bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna msemmija fil-punt (f) tal-Artikolu 10(1). |
| 271 | **1.2.1.1.1.1.** **li minnhom il-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. |
| 273 | **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  Tranżazzjonijiet ta’ għoti ta’ self garantit u mmotivati 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, kemm jekk jerġgħu jintużaw fi tranżazzjoni oħra kif ukoll jekk le, ikunu jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 10 tar-Regolament (UE) 2015/61 bħala assi likwidi tal-kategorija msemmija fil-punt (f) tal-Artikolu 10(1). |
| 275 | **1.2.1.1.2.1.** **li minnhom il-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. |
| 277 | **1.2.1.1.3. Kollateral tal-Livell 2 A**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Tranżazzjonijiet ta’ għoti ta’ self garantit u mmotivati 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, kemm jekk jerġgħu jintużaw fi tranżazzjoni oħra kif ukoll jekk le, ikunu jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 11 tar-Regolament (UE) 2015/61 bħala assi likwidi ta’ kwalunkwe waħda mill-kategoriji tal-assi tal-livell 2A msemmija fl-Artikolu 11. |
| 279 | **1.2.1.1.3.1.** **li minnhom il-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. |
| 281 | **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  Tranżazzjonijiet ta’ għoti ta’ self garantit u mmotivati 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, kemm jekk jerġgħu jintużaw fi tranżazzjoni oħra kif ukoll jekk le, ikunu jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 13 tar-Regolament (UE) 2015/61 bħala assi likwidi ta’ kwalunkwe waħda mill-kategoriji tal-assi tal-livell 2B msemmija fil-punt (i), (ii) jew (iv) tal-punt (g) tal-Artikolu 13(2). |
| 283 | **1.2.1.1.4.1.** **li minnhom il-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. |
| 285 | **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  Tranżazzjonijiet ta’ għoti ta’ self garantit u mmotivati 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, kemm jekk jerġgħu jintużaw fi tranżazzjoni oħra kif ukoll jekk le, ikunu jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 12 tar-Regolament (UE) 2015/61 bħala assi likwidi tal-kategorija tal-assi tal-livell 2B imsemmija fil-punt (e) tal-Artikolu 12(1). |
| 287 | **1.2.1.1.5.1.** **li minnhom il-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. |
| 289 | **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  Tranżazzjonijiet ta’ għoti ta’ self garantit u mmotivati 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, kemm jekk jerġgħu jintużaw fi tranżazzjoni oħra kif ukoll jekk le, ikunu jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 13 tar-Regolament (UE) 2015/61 bħala assi likwidi ta’ kwalunkwe waħda mill-kategoriji tal-assi tal-livell 2B msemmija fil-punt (iii) jew (v) tal-punt (g) tal-Artikolu 13(2). |
| 291 | **1.2.1.1.6.1.** **li minnhom il-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. |
| 293 | **1.2.1.1.7. Kollateral tal-Livell 2B li ma ġiex inkluż diġà fis-sezzjoni 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  Tranżazzjonijiet ta’ għoti ta’ self garantit u mmotivati 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, kemm jekk jerġgħu jintużaw fi tranżazzjoni oħra kif ukoll jekk le, ikunu jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 12 tar-Regolament (UE) 2015/61 bħala assi likwidi ta’ kwalunkwe waħda mill-kategoriji tal-assi tal-livell 2B imsemmija fil-punt (b), (c) jew (f) tal-Artikolu 12(1). |
| 295 | **1.2.1.1.7.1.** **li minnhom il-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. |
| 297 | **1.2.1.2. il-kollateral jintuża biex ikopri pożizzjonijiet bin-nieqes**  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 bin-nieqes, dan għandu jkun irrapportat hawnhekk u mhux f’xi waħda mil-linji ta’ hawn fuq. Ma għandux ikun hemm għadd doppju. |
| 299 | **1.2.1.3. kollateral li ma jikkwalifikax bħala assi likwidu**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrappurtaw fir-ringiela 299 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 fejn il-kontroparti hija bank ċentrali u fejn il-kollateral ma jikkwalifikax bħala assi likwidu. L-Istituzzjonijiet ta’ Kreditu għandhom jirrapportaw   * għal kull Kolonna 010, 020 u 030 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-suq tal-kapital garantiti bi kwalunkwe kollateral mhux likwidu ieħor; kif ukoll * għal kull Kolonna 140, 150 u 160 it-total ta’ influssi minn dawk it-tranżazzjonijiet bħala s-somma ta’ influssi 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-suq tal-kapital garantiti bi kwalunkwe kollateral mhux likwidu ieħor. |
| 301 | **1.2.1.3.1. il-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. |
| 303 | **1.2.1.3.2 il-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 hija bank ċentrali u fejn it-tranżazzjoni hija kollateralizzata b’assi mhux likwidi mhux diġà koperti fis-sezzjoni 1.2.1.3.1. |
| 305 | **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 305 ta’ C 74.00 tal-ANNESS XXIV   għal kull Kolonna 010, 020 u 030 l-ammont totali ta’ flejjes dovuti minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq tal-kapital fejn il-kontroparti mhijiex bank ċentrali; kif ukoll   għal kull Kolonna 140, 150 u 160 l-influssi totali minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-suq kapitali fejn il-kontroparti mhijiex bank ċentrali. |
| 307 | **1.2.2.1. kollateral li jikkwalifika bħala assi likwidu**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fir-ringiela 307 ta’ C 74.00 tal-ANNESS XXIV   għal kull Kolonna 010, 020 u 030 l-ammont totali ta’ flejjes dovuti minn 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’assi likwidi; kif ukoll   * għal kull Kolonna 140, 150 u 160 l-influssi totali minn 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’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) 2015/61. |
| 309 | **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  Tranżazzjonijiet ta’ għoti ta’ self garantit u mmotivati 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, kemm jekk jerġgħu jintużaw fi tranżazzjoni oħra kif ukoll jekk le, ikunu jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 10 tar-Regolament (UE) 2015/61 bħala assi likwidi ta’ kwalunkwe waħda mill-kategoriji ta’ assi tal-livell 1 imsemmija fl-Artikolu 10, bl-eċċezzjoni tal-bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna msemmija fil-punt (f) tal-Artikolu 10(1). |
| 311 | **1.2.2.1.1.1.** **li minnhom il-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. |
| 313 | **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  Tranżazzjonijiet ta’ għoti ta’ self garantit u mmotivati 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, kemm jekk jerġgħu jintużaw fi tranżazzjoni oħra kif ukoll jekk le, ikunu jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 10 tar-Regolament (UE) 2015/61 bħala assi likwidi tal-kategorija msemmija fil-punt (f) tal-Artikolu 10(1). |
| 315 | **1.2.2.1.2.1.** **li minnhom il-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. |
| 317 | **1.2.2.1.3. Kollateral tal-Livell 2 A**  Il-punt (b) tal-Artikolu 32(3) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Tranżazzjonijiet ta’ għoti ta’ self garantit u mmotivati 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, kemm jekk jerġgħu jintużaw fi tranżazzjoni oħra kif ukoll jekk le, ikunu jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 11 tar-Regolament (UE) 2015/61 bħala assi likwidi ta’ kwalunkwe waħda mill-kategoriji tal-assi tal-livell 2A msemmija fl-Artikolu 11. |
| 319 | **1.2.2.1.3.1.** **li minnhom il-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. |
| 321 | **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  Tranżazzjonijiet ta’ għoti ta’ self garantit u mmotivati 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, kemm jekk jerġgħu jintużaw fi tranżazzjoni oħra kif ukoll jekk le, ikunu jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 13 tar-Regolament (UE) 2015/61 bħala assi likwidi ta’ kwalunkwe waħda mill-kategoriji tal-assi tal-livell 2B msemmija fil-punt (i), (ii) jew (iv) tal-punt (g) tal-Artikolu 13(2). |
| 323 | **1.2.2.1.4.1.** **li minnhom il-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. |
| 325 | **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  Tranżazzjonijiet ta’ għoti ta’ self garantit u mmotivati 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, kemm jekk jerġgħu jintużaw fi tranżazzjoni oħra kif ukoll jekk le, ikunu jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 12 tar-Regolament (UE) 2015/61 bħala assi likwidi tal-kategorija tal-assi tal-livell 2B imsemmija fil-punt (e) tal-Artikolu 12(1). |
| 327 | **1.2.2.1.5.1.** **li minnhom il-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. |
| 329 | **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  Tranżazzjonijiet ta’ għoti ta’ self garantit u mmotivati 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, kemm jekk jerġgħu jintużaw fi tranżazzjoni oħra kif ukoll jekk le, ikunu jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 13 tar-Regolament (UE) 2015/61 bħala assi likwidi ta’ kwalunkwe waħda mill-kategoriji tal-assi tal-livell 2B msemmija fil-punt (iii) jew (v) tal-punt (g) tal-Artikolu 13(2). |
| 331 | **1.2.1.1.6.1.** **li minnhom il-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. |
| 333 | **1.2.2.1.7. Kollateral tal-Livell 2B li ma ġiex inkluż diġà fis-sezzjoni 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  Tranżazzjonijiet ta’ għoti ta’ self garantit u mmotivati 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, kemm jekk jerġgħu jintużaw fi tranżazzjoni oħra kif ukoll jekk le, ikunu jikkwalifikaw skont l-Artikoli 7 u 12 tar-Regolament (UE) 2015/61 bħala assi likwidi ta’ kwalunkwe waħda mill-kategoriji tal-assi tal-livell 2B imsemmija fil-punt (b), (c) jew (f) tal-Artikolu 12(1). |
| 335 | **1.2.2.1.7.1.** **li minnhom il-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. |
| 337 | **1.2.2.2. il-kollateral jintuża biex ikopri pożizzjonijiet bin-nieqes**  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 bin-nieqes skont it-tieni sentenza tal-Artikolu 30(5). Fejn kollateral ta’ kwalunkwe tip jintuża sabiex ikopri pożizzjoni bin-nieqes, 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 jirrappurtaw fir-ringiela 339 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 fejn il-kontroparti mhijiex bank ċentrali u fejn il-kollateral ma jikkwalifikax bħala assi likwidu. L-Istituzzjonijiet ta’ Kreditu għandhom jirrapportaw   għal kull Kolonna 010, 020 u 030 l-ammont totali ta’ flejjes dovuti minn dawk it-tranżazzjonijiet bħala s-somma tal-flejjes dovuti minn self ta’ marġini fejn il-kollateral mhuwiex likwidu, 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-suq tal-kapital garantiti bi kwalunkwe kollateral mhux likwidu ieħor; kif ukoll   * għal kull Kolonna 140, 150 u 160 it-total ta’ influssi minn dawk it-tranżazzjonijiet bħala s-somma ta’ influssi minn self ta’ marġini fejn il-kollateral mhuwiex likwidu, 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-suq tal-kapital garantiti bi kwalunkwe kollateral mhux likwidu ieħor. |
| 341 | **1.2.2.3.1. self ta’ 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) 2015/61. |
| 343 | **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. |
| 345 | **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 fis-sezzjoni 1.2.2.3.1 jew 1.2.2.3.2. |
| 410 | **1.3. Total tal-influssi minn swaps kollaterali**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk is-somma tat-total ta’ influssi minn swaps kollaterali kif ikkalkolata fil-formula C 75.01 tal-ANNESS XXIV. |
| 420 | **1.4. (Differenza bejn l-influssi ponderat totali u l-fluss ’il barra ponderat totali li jirriżultaw minn tranżazzjonijiet f’pajjiżi terzi fejn hemm restrizzjonijiet fuq it-trasferiment jew li jkunu denominati f’muniti mhux konvertibbli)**  L-Artikolu 32(8) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw fil-Kolonna rilevanti 140, 150 u 160 is-somma tat-total ta’ influssi ponderati minn pajjiżi terzi fejn hemm restrizzjonijiet fuq trasferimenti jew li jkunu denominati f’muniti mhux konvertibbli nieqes is-somma tat-total ta’ flussi ’l barra ponderati lil pajjiżi terzi fejn hemm restruzzjonijiet fuq it-trasferimenti jew li huma denominati f’muniti mhux konvertibbli kif irrapportati f’C 73.00 tal-ANNESS XXIV. F’każ li dan l-ammont ikun negattiv, l-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw “0”. |
| 430 | **1.5. (Influssi eċċessivi 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 140, 150 jew 160, 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 ’l barra li jirriżultaw mill-istess impriża. |
| **ENTRATI FIL-MEMORANDUM** | |
| 450 | **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) 575/2013.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw il-porzjon ta’ influssi minn derivattivi (irrapportat fis-sezzjoni 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-nettjar skont il-kontroparti jista’ jkun applikat għall-flussi f’dik il-munita. |
| 460 | **3. influssi fi grupp jew skema ta’ protezzjoni istituzzjonali**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk bħala entrati ta’ memorandum it-tranżazzjonijiet kollha rrapportati fis-sezzjoni 1 (minbarra s-sezzjoni 1.1.10) 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.  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw fir-ringiela 460 ta’ C 74.00 tal-ANNESS XXIV   għal kull Kolonna 010, 020 u 030 l-ammont totali ta’ flejjes dovuti/ammont massimu li jistgħu jinġibdu fi ħdan grupp jew skema ta’ protezzjoni istituzzjonali bħala s-somma ta’ flejjes dovuti/ammont massimu li jistgħu jinġibdu fi ħdan grupp jew skema ta’ protezzjoni istituzzjonali skont it-tip ta’ tranżazzjoni u kontroparti; kif ukoll   għal kull Kolonna 140, 150 u 160 it-total ta’ influssi fi ħdan grupp jew skema ta’ protezzjoni istituzzjonali bħala s-somma ta’ influssi fi ħdan grupp jew skema ta’ protezzjoni istituzzjonali skont it-tip ta’ tranżazzjoni u kontroparti. |
| 470 | **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 fis-sezzjoni 1.1.1 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 ta’ kreditu ċentrali jew affiljata ta’ netwerk jew grupp kooperattiv kif imsemmi fl-Artikolu 10 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 480 | **3.2. Flejjes dovuti minn klijenti finanzjarji**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flejjes kollha dovuti minn klijenti finanzjarji rrapportati fis-sezzjoni 1.1.2 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. |
| 490 | **3.3. Tranżazzjonijiet garantiti**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flejjes kollha dovuti minn għoti ta’ self garantit u tranżazzjonijiet immotivati mis-swieq kapitali kif ukoll il-valur tas-suq totali ta’ kollateral riċevut irrapportat fis-sezzjoni 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 ta’ kreditu ċentrali jew affiljata ta’ netwerk jew grupp kooperattiv kif imsemmi fl-Artikolu 10 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 500 | **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 fis-sezzjoni 1.1.5 fejn l-emittent ikun 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’ netwerk jew grupp kooperattiv kif imsemmi fl-Artikolu 10 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 510 | **3.5. Kwalunkwe influssi ieħor fi grupp jew skema ta’ protezzjoni istituzzjonali**  Istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirraportaw kull influssi fi ħdan grupp jew skema ta’ protezzjoni istituzzjonali rrapportat fis-Sezzjoni 1.1.3. sa 1.1.11. (esklużi s-sezzjonijiet 1.1.5. u 1.1.10.) meta 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 ma’ 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 jirrappurtaw hawnhekk tranżazzjonijiet ta’ għoti ta’ self garantiti b’maturità residwa sa 30 jum fejn il-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 skont l-Artikolu 17(4) tiegħu. |
| 530 | **4.1. li minnhom: garantiti bl-L1 minbarra 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. |
| 540 | **4.2. li minnhom: garantiti bl-EHQCB L1**  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 huwa 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. |
| 550 | **4.3. li minnhom: garantiti 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 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. |
| 560 | **4.4. li minnhom: garantiti 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. |
| 570 | **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 hija 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 skont l-Artikolu 17(4) tiegħu. |

**RAPPORTAR DWAR IL-LIKWIDITÀ (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 ’il barra 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 ’il barra għandu jiġi kkalkolat billi l-valur tas-suq tal-assi meħud b’self jiġi mmultiplikat bid-differenza bejn ir-rata ta’ fluss ’il barra applikabbli għall-assi mogħti b’self u fir-rata ta’ fluss ’il barra 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 ’il barra 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 m’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 ’il barra 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 għandu jinqasam f’partijiet li jikkorrispondu għar-ringieli tal-mudell u vvalutat skont il-partijiet. Fil-kuntest ta’ tranżazzjonijiet ta’ swaps ta’ basktijiet jew puli ta’ kollateral li jimmaturaw fit-30 jum kalendarju li jmiss, assi mhux fi flus imsellfa għandhom jiġu assenjati individwalment lil assi mhux fi flus meħuda b’self, skont il-kategoriji tal-assi likwidi kif definiti fit-Titolu II, il-Kapitolu 2 tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61, b’bidu mill-kombinazzjoni l-inqas likwida (jiġifieri assi mhux likwidi mhux flus għotijin b’self, assi mhux likwidi mhux flus meħudin 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 ishma jew unitajiet f’CIUs għandhom jiġu rrapportati bħallikieku t-tranżazzjonijiet jinvolvu l-assi sottostanti tas-CIU. Il-haircuts differenti applikati għal ishma jew unitajiet f’CIUs għandhom jiġu riflessi fir-rata rilevanti ta’ fluss ’il barra 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 ’l barra, 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. Fejn istituzzjoni tista’ tirrikonoxxu biss parti mill-ishma tagħha f’munita barranija, jew assi f’muniti barranin ta’ gvern ċentrali jew ta' bank, jew assi fil-munita domestika ta' gvern ċentrali jew bank ċentrali fl-HQLA tagħhom, il-parti rikonoxxibbli biss għandha tiġi rrapportata fir-ringieli tal-assi tal-Livelli 1, tal-Livell 2A u tal-Livell 2B, f’konformità mal-punti (ii) tal-punt (c) tal-Artikolu 12(1) u mal-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 eċċessiv għandu jkun irrapportat fis-sezzjoni 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 għandu jkun 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) 2015/61. |
| 0020 | **Valur tal-likwidità tal-kollateral mogħti b’self**  Il-valur tal-likwidità tal-kollateral mogħti b’self għandu jkun 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 għandu jkun 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) 2015/61. |
| 0040 | **Valur tal-likwidità tal-kollateral meħud b’self**  Il-valur tal-likwidità tal-kollateral meħud b’self għandu jkun 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-ponderazzjoniijiet 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 nazzjonali. |
| 0070 | **Flussi ’l barra**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrapportaw hawnhekk il-flussi ’l barra. Dawn huma kkalkolati billi l-kolonna 0060 tiġi mmoltiplikata 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 il-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 tas-swaps kollaterali. |
| 0020 | **1.1. Totali għat-tranżazzjonijiet li fihom l-assi tal-Livell 1 (minbarra bonds koperti EHQ) 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 tal-iswaps kollaterali għat-tranżazzjonijiet li fihom assi tal-Livell 1 (minbarra bonds koperti EHQ) jingħataw b’self. |
| 0030 | **1.1.1. Assi tal-Livell 1 (minbarra bonds koperti EHQ)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti EHQ (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti EHQ (meħudin b’self). |
| 0040 | * + - 1. **Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 swappjat assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti EHQ (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 swapped 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; kif ukoll * 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 2 A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti EHQ (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 2 A (meħudin b’self). |
| 0080 | **1.1.3.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti EHQ (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 0100 | **1.1.4.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 koperti EHQ (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 0120 | **1.1.5.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti EHQ (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 0140 | **1.1.6.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 swappajt assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti EHQ (mogħtija b’self) ma’ Oħrajn tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 0160 | **1.1.7.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 koperti EHQ (mogħtija b’self) ma’ Assi mhux likwidi (meħudin b’self). |
| 0180 | **1.1.8.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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. Totali 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 tal-iswaps kollaterali għat-tranżazzjonijiet li fihom bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 jingħataw b’self. |
| 0200 | **1.2.1. Assi tal-Livell 1 (minbarra bonds koperti EHQ)**  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 koperti EHQ (meħudin b’self). |
| 0210 | **1.2.1.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 għamlet swap ta' bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna ta’ Livell 1 (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna ta’ Livell 1 (meħudin b’self). |
| 0230 | **1.2.2.1. Li minnhom il-kollateral fl-iswap 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; kif ukoll * 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 2 A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni għamlet swap ta' bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna ta’ Livell 1 (mogħtija b’self) ma’ assi ta’ Livell 2A (meħudin b’self). |
| 0250 | **1.2.3.1. Li minnhom il-kollateral fl-iswap 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; kif ukoll * 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 (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni għamlet swap ta' bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 1 (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) (meħudin b’self) tal-Livell 2B. |
| 0270 | **1.2.4.1. Li minnhom il-kollateral fl-iswap 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; kif ukoll * 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 għamlet swap ta' 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 fl-iswap 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; kif ukoll * 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 (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni għamlet swap ta' bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 0310 | **1.2.6.1. Li minnhom il-kollateral fl-iswap 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; kif ukoll * 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 tal-Livell 1 (mogħtija b’self) ma’ Oħrajn tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 0330 | **1.2.7.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 għamlet swap ta' 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 swapped 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 tal-iswaps kollaterali għat-tranżazzjonijiet li fihom jingħataw b’self assi tal-Livell 2 A. |
| 0370 | **1.3.1. Assi tal-Livell 1 (minbarra bonds koperti EHQ)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 2 A (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti EHQ (meħudin b’self). |
| 0380 | **1.3.1.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 2 A (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 swapped 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; kif ukoll * 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 2 A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 2 A (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 2 A (meħudin b’self). |
| 0420 | **1.3.3.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 2 A (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 0440 | **1.3.4.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 ħafna tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 0460 | **1.3.5.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 2A (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 0480 | **1.3.6.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 swapped 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; kif ukoll * 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 swapped 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 (residenzjali 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, għal kull kolonna, il-valuri totali tal-iswaps kollateraligħat-tranżazzjonijiet li fihom titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B jingħataw b’self. |
| 0540 | **1.4.1. Assi tal-Livell 1 (minbarra bonds koperti EHQ)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni għamlet swap ta' titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti EHQ (meħudin b’self). |
| 0550 | **1.4.1.1. Li minnhom il-kollateral fl-iswap 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; kif ukoll * 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 għamlet swap ta' titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 1 (meħudin b’self). |
| 0570 | **1.4.2.1. Li minnhom il-kollateral fl-iswap 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; kif ukoll * 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 2 A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni għamelt swap ta' titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 2A (meħudin b’self). |
| 0590 | **1.4.3.1. Li minnhom il-kollateral fl-iswap 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; kif ukoll * 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 (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni għamlet l-iswap ta' titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 0610 | **1.4.4.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 għamlet l-iswap ta' titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 0630 | **1.4.5.1. Li minnhom il-kollateral fl-iswap 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; kif ukoll * 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 (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 0650 | **1.4.6.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ Livell 2B Oħrajn (meħudin b’self). |
| 0670 | **1.4.7.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ Assi mhux likwidi (meħudin b’self). |
| 0690 | **1.4.8.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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 tal-iswaps kollaterali għat-tranżazzjonijiet li fihom bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B jingħataw b’self. |
| 0710 | **1.5.1. Assi tal-Livell 1 (minbarra bonds koperti EHQ)**  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 koperti EHQ (meħudin b’self). |
| 0720 | **1.5.1.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 swapped 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; kif ukoll * 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 2 A**  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 swapped 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; kif ukoll * 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 (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 0780 | **1.5.4.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 swapped 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; kif ukoll * 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 (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 0820 | **1.5.6.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 swapped 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; kif ukoll * 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 swapped 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 tal-iswaps kollaterali għat-tranżazzjonijiet li fihom titoli garantiti b’assi (kummerċjali jew individwi, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B jingħataw b’self. |
| 0880 | **1.6.1. Assi tal-Livell 1 (minbarra bonds koperti EHQ)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti EHQ (meħudin b’self). |
| 0890 | **1.6.1.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (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 swapped 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; kif ukoll * 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 2 A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 2 A (meħudin b’self). |
| 0930 | **1.6.3.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (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 swapped 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; kif ukoll * 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 (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 0970 | **1.6.5.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 0990 | **1.6.6.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ Livell 2B Oħrajn (meħudin b’self). |
| 1010 | **1.6.7.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ Assi mhux likwidi (meħudin b’self). |
| 1030 | **1.6.8.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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 (minbarra bonds koperti EHQ)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Oħrajn tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti EHQ (meħudin b’self). |
| 1060 | **1.7.1.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 swapped 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; kif ukoll * 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 2 A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Oħrajn tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 2 A (meħudin b’self). |
| 1100 | **1.7.3.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Oħrajn tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 1120 | **1.7.4.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 swapped 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; kif ukoll * 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 (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Oħrajn tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 1160 | **1.7.6.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 swapped 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; kif ukoll * 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 swapped 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 tal-iswaps kollaterali għat-tranżazzjonijiet li fihom jingħataw b’self Assi mhux likwidi. |
| 1220 | **1.8.1. Assi tal-Livell 1 (minbarra bonds koperti EHQ)**  Tranżazzjonijiet bħal dawn fejn l-istituzzjoni tkun għamlet swap ta’ assi Nonlikwidi (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti EHQ (meħuda b’self). |
| 1230 | **1.8.1.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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 swapped 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 2 A**  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 swapped 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 (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Assi mhux likwidi (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 1290 | **1.8.4.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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 swapped 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 (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Assi mhux likwidi (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 1330 | **1.8.6.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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 swapped 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 għamlet swap ta' 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 tas-swaps kollaterali. |
| 1380 | **2.1. Totali għat-tranżazzjonijiet li fihom l-assi tal-Livell 1 (minbarra bonds koperti EHQ) 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 tal-iswaps kollaterali għat-tranżazzjonijiet li fihom assi tal-Livell 1 (minbarra bonds koperti EHQ) jingħataw b’self. |
| 1390 | **2.1.1. Assi tal-Livell 1 (minbarra bonds koperti EHQ)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti EHQ (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti EHQ (meħudin b’self). |
| 1400 | * + - 1. **Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 koperti EHQ (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 swapped 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; kif ukoll * 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 2 A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti EHQ (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 2 A (meħudin b’self). |
| 1440 | **2.1.3.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti EHQ (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 1460 | **2.1.4.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 swappajt assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti EHQ (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 1480 | **2.1.5.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti EHQ (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 1500 | **2.1.6.1. Li minnhom il-kollateral fl-iswap 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; kif ukoll * 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 għamlet swap ta' assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti EHQ (mogħtija b’self) ma’ Oħrajn tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 1520 | **2.1.7.1. Li minnhom il-kollateral fl-iswap 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; kif ukoll * 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 għamlet swap ta' assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti EHQ (mogħtija b’self) ma’ Assi mhux likwidi (meħudin b’self). |
| 1540 | **2.1.8.1. Li minnhom il-kollateral fl-iswap 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. Totali 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 tal-iswaps tal-kollateral għat-tranżazzjonijiet li fihom bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 jingħataw b’self. |
| 1560 | **2.2.1. Assi tal-Livell 1 (minbarra bonds koperti EHQ)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni għamlet swap ta' bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti EHQ (meħudin b’self). |
| 1570 | **2.2.1.1. Li minnhom il-kollateral fl-iswap 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; kif ukoll * 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 għamlet swap ta' bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna ta’ Livell 1 (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna ta’ Livell 1 (meħudin b’self). |
| 1590 | **2.2.2.1. Li minnhom il-kollateral fl-iswap 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; kif ukoll * 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 2 A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni għamlet swap ta' bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna ta’ Livell 1 (mogħtija b’self) ma’ assi ta’ Livell 2A (meħudin b’self). |
| 1610 | **2.2.3.1. Li minnhom il-kollateral fl-iswap 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; kif ukoll * 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 (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 1 (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 1630 | **2.2.4.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 għamlet swap ta' 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 swapped 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; kif ukoll * 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 (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B**  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 (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 1670 | **2.2.6.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 tal-Livell 1 (mogħtija b’self) ma’ Oħrajn tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 1690 | **2.2.7.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 għamlet swap ta' 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 swapped 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 tal-iswaps kollaterali għat-tranżazzjonijiet li fihom jingħataw b’self assi tal-Livell 2 A. |
| 1730 | **2.3.1. Assi tal-Livell 1 (minbarra bonds koperti EHQ)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 2 A (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti EHQ (meħudin b’self). |
| 1740 | **2.3.1.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 2 A (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 swapped 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; kif ukoll * 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 2 A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 2 A (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 2 A (meħudin b’self). |
| 1780 | **2.3.3.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 2 A (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 1800 | **2.3.4.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 ħafna tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 1820 | **2.3.5.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat assi tal-Livell 2A (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 1840 | **2.3.6.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 swapped 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; kif ukoll * 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 swapped 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 (residenzjali 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, għal kull kolonna, il-valuri totali tal-iswaps kollaterali u derivattivi kollateralizzati għat-tranżazzjonijiet li fihom titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B jingħataw b’self. |
| 1900 | **2.4.1. Assi tal-Livell 1 (minbarra bonds koperti EHQ)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti EHQ (meħudin b’self). |
| 1910 | **2.4.1.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 1 (meħudin b’self). |
| 1930 | **2.4.2.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 2 A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 2A (meħudin b’self). |
| 1950 | **2.4.3.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni għamlet l-iswap ta' titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 1970 | **2.4.4.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 1990 | **2.4.5.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 2010 | **2.4.6.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ Livell 2B Oħrajn (meħudin b’self). |
| 2030 | **2.4.7.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ Assi mhux likwidi (meħudin b’self). |
| 2050 | **2.4.8.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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 tal-iswaps kollaterali għat-tranżazzjonijiet li fihom bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B jingħataw b’self. |
| 2070 | **2.5.1. Assi tal-Livell 1 (minbarra bonds koperti EHQ)**  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 koperti EHQ (meħudin b’self). |
| 2080 | **2.5.1.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 swapped 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; kif ukoll * 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 2 A**  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 swapped 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; kif ukoll * 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 (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 2140 | **2.5.4.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 swapped 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; kif ukoll * 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 (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 2180 | **2.5.6.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 swapped 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; kif ukoll * 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 swapped 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 tal-iswaps kollaterali għat-tranżazzjonijiet li fihom titoli garantiti b’assi (kummerċjali jew individwi, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B jingħataw b’self. |
| 2240 | **2.6.1. Assi tal-Livell 1 (minbarra bonds koperti EHQ)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti EHQ (meħudin b’self). |
| 2250 | **2.6.1.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (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 swapped 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; kif ukoll * 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 2 A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 2 A (meħudin b’self). |
| 2290 | **2.6.3.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 2310 | **2.6.4.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ bonds koperti ta’ kwalità għolja tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 2330 | **2.6.5.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat titoli garantiti b’assi (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 2350 | **2.6.6.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ Livell 2B Oħrajn (meħudin b’self). |
| 2370 | **2.6.7.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ Assi mhux likwidi (meħudin b’self). |
| 2390 | **2.6.8.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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 (minbarra bonds koperti EHQ)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Oħrajn tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti EHQ (meħudin b’self). |
| 2420 | **2.7.1.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 swapped 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; kif ukoll * 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 2 A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Oħrajn tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 2 A (meħudin b’self). |
| 2460 | **2.7.3.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Oħrajn tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 2480 | **2.7.4.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 swapped 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; kif ukoll * 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 (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni swappjat Oħrajn tal-Livell 2B (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 2520 | **2.7.6.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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; kif ukoll * 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 swapped 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; kif ukoll * 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 swapped 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 tal-iswaps kollaterali għat-tranżazzjonijiet li fihom jingħataw b’self Assi mhux likwidi. |
| 2580 | **2.8.1. Assi tal-Livell 1 (minbarra bonds koperti EHQ)**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjonijiet għamlet swap ta' aasi Mhux likwidi (mogħtija b'self) ma' assi tal-Livell 1 minbarra bonds koperti EHQ (meħuda b'self).. |
| 2590 | **2.8.1.1. Li minnhom il-kollateral fl-iswap 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 għamlet swap ta' 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 fl-iswap 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 2 A**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni għamlet swap ta' Assi mhux likwidi (mogħtija b’self) ma’ assi tal-Livell 2 A (meħudin b’self). |
| 2630 | **2.8.3.1. Li minnhom il-kollateral fl-iswap 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 (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni għamlet swap ta' Assi mhux likwidi (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (residenzjali jew vetturi, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 2650 | **2.8.4.1. Li minnhom il-kollateral fl-iswap 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 għamlet swap ta' 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 fl-iswap 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 (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B**  Dawk it-tranżazzjonijiet li fihom l-istituzzjoni għamlet swap ta' Assi mhux likwidi (mogħtija b’self) ma’ titoli garantiti b’assi (kummerċjali jew individwali, Stat Membru, CQS1) tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 2690 | **2.8.6.1. Li minnhom il-kollateral fl-iswap 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 għamlet swap ta' Assi mhux likwidi (mogħtija b’self) ma’ Oħrajn tal-Livell 2B (meħudin b’self). |
| 2710 | **2.8.7.1. Li minnhom il-kollateral swapped 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 għamlet swap ta' 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 ’il barra 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 fi ħdan il-grupp. |
|  | **5. Swaps kollaterali eżentati mill-Artikolu 17(2) u (3)**  L-istituzzjonijiet ta’ kreditu għandhom jirrappurtaw hawnhekk il-parti tat-tranżazzjonijiet ta’ swaps kollaterali b’maturità residwa ta’ mhux aktar minn 30 jum fejn il-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 skont l-Artikolu 17(4) tiegħu. |
| 2750 | **5.1. li minnhom: il-kollateral missellef huwa L1 minbarra 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 missellef huwa EHQCB L1**  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 huwa 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 missellef 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 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. |
| 2780 | **5.4. li minnhom: il-kollateral missellef 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 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. |
| 2790 | **5.5. li minnhom: il-kollateral mogħti b’self huwa L1 minbarra 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 EHQCB L1**  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 huwa 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 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. |
| 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 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. |

**RAPPORTAR DWAR IL-LIKWIDITÀ (PARTI 5: KALKOLI)**

1. Kalkoli

1.1. Rimarki ġenerali

1. Dan huwa 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, {C 72.00; r130; c040} tirreferi għall-Formula dwar l-Assi Likwidi; ringiela 130; kolonna 040.

1.3. Subformola 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 010 tar-ringiela speċifika. | |
| 010 | **1.** **Buffer tal-likwidità**  Irrapporta ċ-ċifra minn {C 76.00; r290; c010}. | |
| 020 | **2. Fluss ’il Barra Nett tal-Likwidità**  Irrapporta ċ-ċifra minn {C 76.00; r370; c010}. | |
| 030 | **3. Proporzjon ta’ Kopertura tal-Likwidità (%)**  Irrapporta l-proporzjon ta’ kopertura tal-likwidità kkalkolat kif speċifikat fl-Artikolu 4(1) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61.  Il-proporzjon ta’ kopertura tal-likwidità għandu jkun ugwali għall-proporzjon tal-buffer tal-likwidità tal-istituzzjoni ta’ kreditu mal-flussi ’l barra netti tal-likwidità tagħha fuq perjodu ta’ stress ta’ 30 jum tal-kalendarju u għandu jkun espress bħala perċentwal.  Jekk {C 76.00; r020; c010} tkun żero (li toħloq proporzjon ta’ infinità) irrapporta l-valur 999999. | |
| **Kalkoli tan-numeratur**  L-Artikolu 17 u l-ANNESS I tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61  Formula għall-kalkolu tal-Buffer tal-Likwidità.  Daħħal id-*data* kollha li ġejja fil-kolonna 010 tar-ringiela speċifika. | | |
| 040 | **4. Bafer tal-likwidità L1 minbarra EHQCB (valur skont l-Artikolu 9): mhux aġġustata**  Irrapporta ċ-ċifra minn {C 72.00; r030; c040}. | |
| 050 | **5. Flussi ’l barra fuq 30 jum ta’ kollateral L1 minbarra EHQCB**  Irrapporta flussi ’l barra ta’ titoli likwidi tal-Livell 1 (esklużi bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna) mal-istralċ 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) 2015/61. | |
| 060 | **6. Influssi fuq 30 jum ta’ kollateral L1 minbarra EHQCB**  Irrapporta influssi ta’ titoli likwidi tal-Livell 1 (esklużi bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna) mal-istralċ 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) 2015/61. | |
| 070 | **7.** **Flussi ’l barra ta’ flus garantiti**  Irrapporta flussi ’l barra ta’ flus (assi tal-Livell 1) mal-istralċ 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) 2015/61. | |
| 080 | **8. Influssi ta’ flus garantiti**  Irrapporta influssi ta’ flus (assi tal-Livell 1) mal-istralċ 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) 2015/61. | |
| 091 | **9. “Ammont aġġustat” L1 minbarra EHQCB**  Dan huwa msemmi fis-subparagrafu (a) tal-Anness I (3)  Irrapporta l-ammont aġġustat ta’ assi f’bonds mhux koperti tal-Livell 1 qabe l-applikazzjoni tal-limitu massimu.  L-ammont aġġustat iqis l-istralċ tal-finanzjament garantit, għoti ta’ self garantit jew tat-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) 2015/61. | |
| 100 | **10. Valur tal-EHQCB L1 skont l-Artikolu 9: mhux aġġustat**  Irrapporta ċ-ċifra minn {C 72.00; r180; c040}. | |
| 110 | **11. Flussi ’l barra fuq 30 jum ta’ kollateral EHQCB L1**  Irrapporta flussi ’l barra ta’ bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 mal-istralċ 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) 2015/61. | |
| 120 | **12. Influssi fuq 30 jum ta’ kollateral EHQCB L1**  Irrapporta influssi ta’ titoli likwidi esklużi bonds koperti ta’ kwalità għolja ħafna tal-Livell 1 mal-istralċ 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) 2015/61. | |
| 131 | **13.** **“Ammont aġġustat” tal-EHQCB L1**  Dan huwa msemmi mis-subparagrafu (b) tal-Anness I (3)  Irrapporta l-ammont aġġustat ta’ assi f’bonds koperti tal-Livell 1 qabel l-applikazzjoni tal-limitu massimu.  L-ammont aġġustat iqis l-istralċ tal-finanzjament garantit, tal-għoti ta’ self garantit jew tat-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) 2015/61. | |
| 160 | **14. Valur tal-L2A skont l-Artikolu 9: mhux aġġustat**  Irrapporta ċ-ċifra minn {C 72.00; r230; c040}. | |
| 170 | **15. Flussi ’l barra fuq 30 jum tal-kollateral L2A**  Irrapporta flussi ’l barra ta’ titoli likwidi tal-Livell 2A mal-istralċ ta’ kwalunkwe finanzjament garantit, għoti ta’ self garantit jew tranżazzjoni ta’ swaps kollaterali, li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju mid-data ta’ kalkolu sakemm it-tranżazzjoni ma tiġix eżentata skont l-Artikolu 17(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 180 | **16. Influssi fuq 30 jum ta’ kollateral L2A**  Irrapporta influssi ta’ titoli likwidi tal-Livell 2A mal-istralċ ta’ kwalunkwe finanzjament garantit, għoti ta’ self garantit jew tranżazzjoni ta’ swaps kollaterali, li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju mid-data ta’ kalkolu sakemm it-tranżazzjoni ma tiġix eżentata skont l-Artikolu 17(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 191 | **17. “Ammont aġġustat” L2A**  Dan huwa msemmi mis-subparagrafu (c) fl-Anness I (3)  Irrapporta l-ammont aġġustat ta’ assi tal-Livell 2 A qabel l-applikazzjoni tal-limitu massimu.  L-ammont aġġustat iqis l-istralċ tal-finanzjament garantit, tal-għoti ta’ self garantit jew tat-tranżazzjonijiet ta’ swaps kollaterali li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju mid-data ta’ kalkolu sakemm it-tranżazzjoni ma tiġix eżentata skont l-Artikolu 17(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 220 | **18. Valur tal-L2B skont l-Artikolu 9: mhux aġġustat**  Irrapporta ċ-ċifra minn {C 72.00; r310; c040}. | |
| 230 | **19.** **Flussi ’l barra fuq 30 jum tal-kollateral L2B**  Irrapporta flussi ’l barra ta’ titoli likwidi tal-Livell 2B mal-istralċ ta’ kwalunkwe finanzjament garantit, għoti ta’ self garantit jew tranżazzjoni ta’ swaps kollaterali, li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju mid-data ta’ kalkolu sakemm it-tranżazzjoni ma tiġix eżentata skont l-Artikolu 17(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 240 | **20. Influssi fuq 30 jum ta’ kollateral L2B**  Irrapporta influssi ta’ titoli likwidi tal-Livell 2B mal-istralċ ta’ kwalunkwe finanzjament garantit, għoti ta’ self garantit jew tranżazzjoni ta’ swaps kollaterali, li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju mid-data ta’ kalkolu sakemm it-tranżazzjoni ma tiġix eżentata skont l-Artikolu 17(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 251 | **21. “Ammont aġġustat” L2B**  Dan huwa msemmi mis-subparagrafu (d) fl-Anness I (3)  Irrapporta l-ammont aġġustat ta’ assi tal-Livell 2B qabel l-applikazzjoni tal-limitu massimu.  L-ammont aġġustat iqis l-istralċ tal-finanzjament garantit, tal-għoti ta’ self garantit jew tat-tranżazzjonijiet ta’ swaps kollaterali li jimmaturaw fi żmien 30 jum tal-kalendarju mid-data ta’ kalkolu sakemm it-tranżazzjoni ma tiġix eżentata skont l-Artikolu 17(4) tar-Regolament Delegat (UE) 2015/61. | |
| 280 | **22. Ammont ta’ assi likwidi f’eċċess**  Anness I(4)  Irrapporta 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; flimkien ma’  (b) l-ammont aġġustat ta’ bonds koperti tal-livell 1; flimkien ma’  (c) l-ammont aġġustat ta’ assi tal-livell 2A; flimkien 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 darba s-somma ta’ (a) u (b);  (h) 100/85 darba s-somma ta’ (a), (b) u (c). | |
| 290 | **23. BUFFER TAL-LIKWIDITÀ**  Anness I (2)  Irrapporta l-buffer tal-likwidità li għandha tkun ugwali għal:  (a) l-ammont ta’ assi tal-livell 1; flimkien ma’  (b) l-ammont tal-assi tal-livell 2A; flimkien ma’  (c) l-ammont tal-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 ’il barra nett tal-likwidità  Fejn,  NLO = Fluss ’il barra nett tal-likwidità  TO = Flussi ’l barra totali  TI = influssi totali  FEI = influssi kompletament eżentati  IHC = influssi soġġetti għal limitu massimu ogħla ta’ 90 % fi flussi ’l barra  IC = influssi soġġetti għal limitu massimu 75 % fi flussi ’l barra  Daħħal id-*data* kollha li ġejja fil-kolonna 010 tar-ringiela mogħtija | | |
| 300 | **24. Total tal-Flussi ’l Barra**  TO = mill-paġna tal-Fluss ’il Barra  Irrapporta ċ-ċifra minn {C 73.00; r010; c060}. | |
| 310 | **25. Influssi Kompletament Eżentati**  FEI = mill-paġna tal-influssi  Irrapporta ċ-ċifra minn {C 74.00; r010; c160}. | |
| 320 | **26. Influssi Soġġetti għal-Limitu Massimu ta’ 90 %**  IHC = mill-paġna tal-influssi  Irrapporta ċ-ċifra minn {C 74.00; r010; c150}. | |
| 330 | **27. Influssi Soġġetti għal-Limitu Massimu ta’ 75 %**  IC = mill-paġna tal-influssi  Irrapporta ċ-ċifra minn {C 74.00; r010; c140}. | |
| 340 | **28. Tnaqqis għal Influssi Kompletament Eżentati**  Irrapporta l-parti li ġejja tal-kalkolu tal-NLO:  = MIN (FEI, TO). | |
| 350 | **29. Tnaqqis għall-Influssi Soġġetti għal-Limitu Massimu ta’ 90 %**  Irrapporta l-parti li ġejja tal-kalkolu tal-NLO:  = MIN (IHC, 0.9\*MAX(TO-FEI, 0)). | |
| 360 | **30. Tnaqqis għall-Influssi Soġġetti għal-Limitu Massimu ta’ 75 %**  Irrapporta l-parti li ġejja tal-kalkolu tal-NLO:  = MIN (IC, 0.75\*MAX(TO-FEI-IHC/0.9, 0)). | |
| 370 | **31. FLUSS ’IL BARRA NETT TAL-LIKWIDITÀ**  Irrapporta l-fluss ’il barra nett tal-likwidità li huwa ugwali għat-total ta’ flussi ’l barra bit-tnaqqis tar-riduzzjoni għall-influssi eżentati għal kollox bit-tnaqqis tar-riduzzjoni għall-influssi soġġetti għal-limitu massimu ta’ 90 % bit-tnaqqis tar-riduzzjoni 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** | | |
| 380 | **32. REKWIŻIT TAL-PILASTRU 2**  kif stabbilit fl-Artikolu 105 CRD  Irrapporta r-rekwiżit tal-Pilastru 2. | |

**RAPPORTAR DWAR IL-LIKWIDITÀ (PARTI 6: PERIMETRU TA’ KONSOLIDAZZJONI)**

1. Perimetru ta’ konsolidazzjoni

1.1. Kummenti ġenerali

1. Din hija formola li, għall-finijiet biss tal-LCR f’livell konsolidat, tidentifika l-entitajiet li għalihom tirreferi l-informazzjoni rrapportata fil-formoli C 72.00, C 73.00, C 74.00, C 75.01 u C 76.00 refers. Dan il-formola 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) 575/2013, kif applikabbli. Dil-formola 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**  “prinċipali” tiġi rrapportata fil-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” tiġi rrapportata fil-bqija tar-ringieli. |
| 010 | **Isem**  L-isem ta’ kull entità fil-perimetru ta’ konsolidazzjoni għandu jiġi rrapportat fil-Kolonna 010. |
| 020 | **Kodiċi**  Dan il-kodiċi huwa identifikatur tar-ringiela u għandu jkun uniku għal kull ringiela fit-tabella.  Kodiċi assenjat lill-entità fl-ambitu tal-konsolidazzjoni. |
| 030 | **Kodiċi tal-LEI**  Il-kodiċi tal-Identifikatur ta’ Entità Ġuridika ta’ kull entità fil-perimetru ta’ konsolidazzjoni għandu jiġi rrapportat fil-Kolonna 020. Fejn jeżisti kodiċi tal-Identifikatur ta’ Entità Ġuridika (kodiċi tal-LEI) għal entità partikolari, dan għandu jintuża biex jidentifika dik l-entità. |
| 040 | **Kodiċi tal-pajjiż**  Il-kodiċi 3166-1-alfa-2 tal-ISO tal-pajjiż ta’ inkorporazzjoni ta’ kull entità fil-perimetru ta’ konsolidazzjoni għandu jiġi rrapportat fil-Kolonna 030. |
| 050 | **Tip ta’ entità**  Entitajiet irrapportati fil-kolonna 010 għandhom jiġu assenjati tip ta’ entità li jikkorrispondi għall-forma ġuridika tagħhom skont il-lista li ġejja:  “Istituzzjoni ta’ kreditu”  “Ditta tal-investiment”  “Oħra” |

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 wkoll jiġu rrapportati fil-mudell C 75.01 tal-ANNESS XXIV. [↑](#footnote-ref-3)