EBA/GL/2023/10

20 ta' Diċembru 2023

Linji gwida li jemendaw il-Linji gwida EBA/GL/2020/14

dwar l-ispeċifikazzjoni u d-divulgazzjoni tal-indikaturi ta' importanza sistemika

1. Obbligi ta' konformità u ta' rapportar

Status ta' dawn il-Linji gwida

1. Dan id-dokument fih linji gwida maħruġa skont l-Artikolu 16 tar-Regolament (UE) Nru 1093/2010 [1]. F'konformità mal-Artikolu 16(3) tar-Regolament (UE) Nru 1093/2010, l-awtoritajiet kompetenti u l-istituzzjonijiet finanzjarji jridu jagħmlu kull sforz biex jikkonformaw mal-Linji Gwida.

2. Il-Linji gwida jistabbilixxu l-fehma tal-EBA dwar prattiki superviżorji xierqa fi ħdan is-Sistema Ewropea ta' Superviżjoni Finanzjarja jew dwar kif id-dritt tal-UE għandu jiġi applikat f'qasam partikolari. L-awtoritajiet kompetenti kif definiti fl-Artikolu 4(2) tar-Regolament (UE) Nru 1093/2010 li għalihom japplikaw il-Linji gwida għandhom jikkonformaw billi jinkorporawhom fil-prattiki tagħhom kif xieraq (eż. billi jemendaw il-qafas legali tagħhom jew il-proċessi superviżorji tagħhom), inkluż fejn il-Linji gwida huma diretti primarjament lejn l-istituzzjonijiet.

Rekwiżiti tar-rapportar

3. Skont l-Artikolu 16(3) tar-Regolament (UE) Nru 1093/2010, l-awtoritajiet kompetenti jridu jinnotifikaw lill-EBA dwar jekk jikkonformawx jew għandhomx il-ħsieb li jikkonformaw ma' dawn il-Linji gwida, jew inkella bir-raġunijiet għan-nuqqas ta' konformità, sa 20.05.2024. Fin-nuqqas ta' kwalunkwe notifika sa din l-iskadenza, l-awtoritajiet kompetenti jiġu kkunsidrati mill-EBA bħala mhux konformi. In-notifiki għandhom jintbagħtu billi tiġi sottomessa l-formola disponibbli fuq is-sit web tal-EBA bir-referenza "EBA/GL/2023/10". In-notifiki għandhom jiġu sottomessi minn persuni b'awtorità xierqa biex jirrapportaw il-konformità f'isem l-awtoritajiet kompetenti tagħhom. Kwalunkwe bidla fl-istatus ta' konformità trid tiġi rrapportata wkoll lill-EBA.

4. In-notifiki jiġu ppubblikati fuq is-sit web tal-EBA, f'konformità mal-Artikolu 16(3).

[1] Regolament (UE) Nru 1093/2010 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill tal-24 ta' Novembru 2010 li jistabbilixxi Awtorità Superviżorja Ewropea (Awtorità Bankarja Ewropea) u li jemenda d-Deċiżjoni Nru 716/2009/KE u jħassar id-Deċiżjoni tal-Kummissjoni 2009/78/KE (ĠU L 331, 15.12.2010, p. 12).

2. Destinatarji

5. Dawn il-Linji gwida huma indirizzati lill-awtoritajiet kompetenti kif definit fil-punt (2)(i) tal-Artikolu 4 tar-Regolament (UE) Nru 1093/2010 u lill-istituzzjonijiet finanzjarji li fir-rigward tagħhom japplikaw il-Linji Gwida EBA/GL/2020/14. L-awtoritajiet innominati msemmija fl-Artikolu 131(1) tad-Direttiva 2013/36/UE minbarra l-awtoritajiet kompetenti huma mħeġġa japplikaw dawn il-Linji gwida. Kemm l-awtoritajiet kompetenti kif ukoll dawk innominati huma msemmija f'dawn il-linji gwida bħala l-"awtoritajiet rilevanti".

3. Implimentazzjoni

Data ta' applikazzjoni

9. Dawn il-Linji Gwida japplikaw minn 20.05.2024.

Tħassir

Il-Linji gwida emendatorji tad-29 ta' Settembru 2022 (EBA/GL/2022/12) li jemendaw il-Linji Gwida dwar l-ispeċifikazzjoni u d-divulgazzjoni tal-indikaturi ta' importanza sistemika huma b'dan imħassra u sostitwiti b'dawn il-Linji Gwida.

4. Linji gwida ta' Emenda

10. EBA/GL/2020/14 huma emendati kif ġej:
    (a) Il-paragrafu 9 huwa sostitwit bil-paragrafu li ġej:
    "9. L-awtoritajiet rilevanti u l-entitajiet rilevanti għandhom isegwu l-istruzzjonijiet u l-ispeċifikazzjonijiet għall-entrati tad-data elenkati fl-Anness kif stabbilit fil-link imsejjaħ "Struzzjonijiet ta' rapportar" fuq is-sit web tal-EBA taħt it-taqsima tal-G-SIIs[2]."
    (b) Il-paragrafu 10 huwa sostitwit bil-paragrafu li ġej:
    '10. L-awtoritajiet rilevanti għandhom japplikaw id-data anċillari (it-Taqsimiet 15 u 16 tal-Anness għal dawn il-Linji gwida) sabiex jappoġġjaw il-ġudizzju superviżorju tagħhom skont l-Artikolu 131(10) tad-Direttiva 2013/36/UE u l-entrati tal-memorandum (it-Taqsimiet 17 sa 22 tal-Anness) biex itejbu l-kwalità tad-data u bħala għajnuna fl-iżvilupp ta' titjib futur fil-metodoloġija tal-identifikazzjoni. L-entrati tal-memorandum għandhom jiġu kkomplementati b'kummenti dettaljati mill-entitajiet rilevanti dwar il-kwalità u d-disponibbiltà tad-data fejn xieraq."
    (c) Il-paragrafu 10a huwa sostitwit bil-paragrafu li ġej:
    "*10a. "Skont l-Artikolu 131(2a) tad-Direttiva 2013/36/UE li tirrikjedi metodoloġija ta' identifikazzjoni addizzjonali li teskludi attivitajiet transfruntiera fi ħdan il-Mekkaniżmu Uniku ta' Riżoluzzjoni (SRM), u f'konformità mal-ftehim internazzjonali mill-Kumitat ta' Basel tal-31 ta' Mejju 2022 biex jiġi rikonoxxut il-progress li sar fl-iżvilupp tal-Unjoni Bankarja Ewropea, l-entrati tad-data rilevanti għall-kalkolu tal-indikaturi transġuriżdizzjonali aġġustati tal-SRM li jikkonċernaw l-istituzzjonijiet li għandhom il-kwartieri ġenerali tagħhom fl-Istati Membri li jipparteċipaw fl-SRM jenħtieġ li jitqiesu bħala parti mill-indikaturi tal-attività transġuriżdizzjonali u, bħala tali, iddivulgati f'konformità mal-paragrafu 12, u mhux bħala entrati anċillari jew ta' memorandum għall-metodoloġija ta' identifikazzjoni u allokazzjoni tas-subkategorija tal-G-SII.*"
    (d) Il-paragrafu 11 huwa sostitwit bil-paragrafu li ġej:
    "11. L-awtoritajiet rilevanti għandhom jiżguraw li jiġbru l-entrati tad-data kollha speċifikati fl-Anness ta' dawn il-Linji Gwida mill-entitajiet rilevanti li jissodisfaw il-kriterji speċifikati fil-paragrafu 6 ta' dawn il-Linji Gwida fl-31 ta' Diċembru ta' kull sena."
    (e) Il-paragrafu 12 huwa sostitwit bil-paragrafu li ġej:
    "12. L-awtoritajiet rilevanti għandhom jiżguraw li l-entitajiet rilevanti jiddivulgaw pubblikament fuq is-siti web tagħhom fuq bażi annwali l-valuri tal-indikatur speċifikati fit-Taqsimiet 1 sa 14 tal-Anness għal dawn il-Linji gwida u, fejn tkun meħtieġa l-metodoloġija ta' identifikazzjoni addizzjonali tal-SRM, il-

[2] https://www.eba.europa.eu/risk-analysis-and-data/global-systemically-important-institutions

punti e), f) u g) tat-Taqsima 21, kif ukoll kwalunkwe punt ieħor tat-Taqsima 21 li jirreferi għal attività transġuriżdizzjonali tal-SRM li tista' titqies rilevanti għall-kalkolu ta' tali metodoloġija mill-awtorità rilevanti."

(f) Il-paragrafu 14 huwa sostitwit bil-paragrafu li ġej:

"14. L-entitajiet rilevanti għandhom jissottomettu l-informazzjoni msemmija fil-paragrafu 11 lill-awtoritajiet rilevanti u jiddivulgaw pubblikament l-informazzjoni msemmija fil-paragrafu 12 fuq bażi annwali sa mhux aktar tard minn erba' xhur wara kull data ta' tmiem is-sena finanzjarja, li tibda mit-tieni data ta' tmiem is-sena finanzjarja konsekuttiva li fiha jkun inqabeż il-livell limitu speċifikat fil-paragrafu 6 ta' dawn il-Linji gwida. Meta jagħmlu dan, l-entitajiet rilevanti jenħtieġ jidentifikaw lilhom infushom billi jużaw l-Identifikaturi tal-Entità Ġuridika (LEIs) tagħhom.

(g) L-Anness huwa sostitwit bl-Anness ta' hawn taħt.

Anness

DATA TAL-BANK
ĠENERALI

Taqsima 1 - Informazzjoni Ġenerali	Rispons
a. Informazzjoni ġenerali pprovduta mill-awtorità superviżorja rilevanti:	
(1) Kodiċi tal-pajjiż	
(2) Isem tal-bank	
(3) Data tar-rappurtar (ssss-xx-jj)	
(4) Munita tar-rappurtar	
(5) Rata tal-konverżjoni tal-Euro	
(6) Data tas-sottomissjoni (ssss-xx-jj)	
b. Informazzjoni Ġenerali pprovduta mill-istituzzjoni tar-rappurtar:	
(1) Unità tar-rappurtar	
(2) L-istandard ta' kontabilità	
(3) Data tad-divulgazzjoni pubblika (ssss-xx-jj)	
(4) Lingwa tad-divulgazzjoni pubblika	
(5) Indirizz web tad-divulgazzjoni pubblika	
(6) Kodiċi LEI	

INDIKATURI TAD-DAQS

Taqsima 2 - Skoperturi Totali	Ammont
a. Derivattivi	
(1) Skopertura tal-kontroparti ta' kuntratti derivattivi	
(2) Ammont nozzjonali limitat ta' derivattivi ta' kreditu	
(3) Skopertura futura potenzjali ta' kuntratti derivattivi	
b. Tranżazzjonijiet ta' finanzjament tat-titoli (SFTs)	
(1) Valur gross aġġustat tal-SFTs	
(2) Skopertura tal-kontroparti tal-SFTs	
c. Assi oħrajn	
d. Ammont nozzjonali gross ta' entrati li mhumiex fuq il-karta tal-bilanċ	
(1) Entrati soġġetti għal fattur ta' konverżjoni tal-kreditu (CCF) ta' 0 %	
(2) Entrati soġġetti għal CCF ta' 20 %	
(3) Entrati soġġetti għal CCF ta' 50 %	
(4) Entrati soġġetti għal CCF ta' 100 %	
e. Aġġustamenti regolatorji	
f. Skoperturi totali qabel l-aġġustamenti regolatorji (is-somma tal-entrati 2.a.(1) sa 2.c., 0.1 immultiplikata b'2.d(1), 0.2 immultuplikata b'2.d.(2), 0.5 immultiplikata b'2.d.(3), u 2.d.(4))	

g. Skoperturi ta’ sussidjarji tal-assigurazzjoni mhux inklużi f’ 2.f. netti minn intragrupp:	
(1) Assi li jidhru fil-karta tal-bilanċ u li ma jidhrux fil-karta tal-bilanċ ta’ sussidjarji tal-assigurazzjoni	
(2) Skopertura futura potenzjali ta’ kuntratti derivattivi għal sussidjarji tal-assigurazzjoni	
(3) Valur tal-investiment f’entitajiet ikkonsolidati	
h. Skoperturi intragrupp inklużi f’ 2.f. għal sussidjarji tal-assigurazzjoni rrapportati f’ 2.g.	
i. Indikatur tal-iskoperturi totali, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni (is-somma tal-entrati 2.f., 2.g.(1) sa 2.g.(2) nieqes 2.g.(3) sa 2.h.)	

INDIKATURI TA’ INTERKONNETTIVITÀ

Taqsima 3 - Assi tas-Sistema IntraFinanzjarja	Ammont
a. Fondi ddepożitati ma' jew mislufin lil istituzzjonijiet finanzjarji oħra	
(1) Ċertifikati ta’ depożitu	
b. Porzjon mhux użat ta’ linji impenjati estiżi għal istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn	
c. Parteċipazzjonijiet ta' titoli maħruġa minn istituzzjonijiet finanzjarji oħra:	
(1) Titoli ta’ dejn garantiti	
(2) Titoli ta’ dejn mhux garantiti superjuri	
(3) Titoli ta’ dejn subordinati	
(4) Dokument kummerċjali	
(5) Titoli ta’ ekwità	
(6) Tpaċija ta’ pożizzjonijiet qosra fir-rigward tat-titoli ta’ ekwità speċifiċi inklużi fl-entrata 3.c.(5)	
d. Skopertura attwali pożittiva netta ta’ SFTs ma’ istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn	
e. Derivattivi OTC ma’ istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn li għandhom valur ġust pożittiv nett	
(1) Valur ġust pożittiv nett	
(2) Skopertura futura potenzjali	
f. Indikatur tal-assi tas-sistema intrafinanzjarja, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni (is-somma tal-entrati 3.a., 3.b. sa 3.c.(5), 3.d., 3.e.(1), u 3.e.(2), bi 3.c. (6) imnaqqsa)	

Taqsima 4 - Obbligazzjonijiet tas-Sistema Intrafinanzjarja	Ammont
a. Fondi ddepożitati ma’ jew mislufin mingħand istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn	
(1) Depożiti dovuti lil istituzzjonijiet depożitarji	
(2) Depożiti dovuti lil istituzzjonijiet finanzjarji mhux depożitarji	
(3) Self miksub mingħand istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn	
b. Porzjon mhux użat ta’ linji impenjati miksuba minn istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn	
c. Skopertura attwali negattiva netta ta’ SFTs ma’ istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn	
d. Derivattivi OTC ma' istituzzjonijiet finanzjarji oħra li għandhom valur ġust negattiv nett	

(1) Valur ġust negattiv nett	
(2) Skopertura futura potenzjali	
e. Indikatur tal-obbligazzjonijiet tas-sistema intrafinanzjarja, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni (is-somma tal-entrati 4.a.(1) sa 4.d.(2))	

Taqsima 5 - Titoli Pendenti	**Ammont**
a. Titoli ta' dejn garantiti	
b. Titoli ta' dejn mhux garantiti superjuri	
c. Titoli ta' dejn subordinati	
d. Karta kummerċjali	
e. Ċertifikati ta' depożitu	
f. Ekwità komuni	
g. Ishma ppreferuti u kwalunkwe forma oħra ta' finanzjament subordinat mhux inklużi fl-entrata 5.c.	
h. Indikatur tat-titoli pendenti, inklużi t-titoli maħruġa minn sussidjarji tal-assigurazzjoni (is-somma tal-entrati 5.a. sa 5.g.)	

INDIKATURI TAS-SOSTITWIBBILTÀ/TAL-INFRASTRUTTURA TAL-ISTITUZZJONI FINANZJARJA

Taqsima 6 - Pagamenti magħmula fis-sena tar-rappurtar (esklużi pagamenti intragrupp)	**Ammont**
a. Dollaru Awstraljan (AUD)	
b. Dollaru Kanadiż (CAD)	
c. Frank Żvizzeru (CHF)	
d. Yuan Ċiniż (CNY)	
e. Euro (EUR)	
f. Lira sterlina (GBP)	
g. Dollaru ta' Ħong Kong (HKD)	
h. Rupi Indjan (INR)	
i. Jen Ġappuniż (JPY)	
j. Dollaru tan-New Zealand (NZD)	
k. Krona Żvediża (SEK)	
l. Dollaru Amerikan (USD)	
m. Indikatur tal-attività tal-pagamenti (is-somma tal-entrati 6.a sa 6.l)	

Taqsima 7 - Assi Taħt Kustodja	**Ammont**
a. Indikatur tal-assi taħt kustodja	

Taqsima 8 - Tranżazzjonijiet Sottoskritti fi Swieq tad-Dejn u tal-Ekwità	**Ammont**
a. Attività ta' sottoskrizzjoni tal-ekwità	
b. Attività ta' sottoskrizzjoni tad-dejn	
c. Indikatur tal-attività tal-pagamenti (is-somma tal-entrati 8.a sa 8.b)	

Taqsima 9 - Volum tan-Negozjar	**Ammont**

a. Volum tan-negozjar tat-titoli maħruġa minn entitajiet oħrajn fis-settur pubbliku, esklużi tranżazzjonijiet intragrupp	
b. Volum ta' negozjar ta' titoli oħra ta' introjtu fiss, esklużi tranżazzjonijiet intragrupp	
c. Subindikatur tal-introjtu fiss tal-volum tan-negozjar (is-somma tal-entrati 9.a. u 9.b.)	
d. Volum ta' negozjar ta' ekwitajiet elenkati, esklużi tranżazzjonijiet intragrupp	
e. Volum ta' negozjar tat-titoli l-oħra kollha, esklużi t-tranżazzjonijiet intragrupp	
f. Subindikatur tal-volum tal-kummerċ tal-ekwitajiet u ta' titoli oħra (is-somma tal-entrati 9.d. u 9.e.)	

INDIKATURI TAL-KUMPLESSITÀ

Taqsima 10 - Ammont Nozzjonali ta' Derivattivi Barra l-Borża (OTC)	Ammont
a. Derivattivi OTC ikklerjati permezz ta' kontroparti ċentrali	
b. Derivattivi OTC miftiehma b'mod bilaterali	
c. Ammont nozzjonali ta' indikatur tad-derivattivi barra l-Borża (OTC), inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni (is-somma tal-entrati 10.a. u 10.b.)	

Taqsima 11 - Titoli għan-Negozjar u Disponibbli għall-Bejgħ	Ammont
a. Titoli miżmuma għan-negozjar (HFT)	
b. Titoli disponibbli għall-bejgħ (AFS)	
c. Titoli għan-negozjar u tal-AFS li jissodisfaw id-definizzjoni tal-assi tal-ewwel livell	
d. Titoli għan-negozjar u tal-AFS li jissodisfaw id-definizzjoni tal-assi tat-tieni livell, b'haircuts	
e. Indikatur tat-titoli tan-negozjar u tal-AFS (is-somma tal-entrati 11.a. u 11.b., bit-tnaqqis tas-somma ta' 11.c. u 11.d.)	

Taqsima 12 - Assi tal-Livell 3	Ammont
a. Indikatur tal-assi tal-Livell 3, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni	

INDIKATURI TAL-ATTIVITÀ TRANSĠURIŻDIZZJONALI

Taqsima 13 - Pretensjonijiet Transġuriżdizzjonali	Ammont
A. It-total tal-pretensjonijiet barranin fuq bażi ta' riskju finali	
b. Pretensjonijiet ta' derivattivi barranin abbażi ta' riskju finali	
c. Indikatur tal-pretensjonijiet transġuriżdizzjonali (is-somma tal-entrati 13.a. u 13.b.)	

Taqsima 14 - Obbligazzjonijiet Transġuriżdizzjonali	Ammont
a. Obbligazzjonijiet barranin fuq bażi ta' riskju immedjat, esklużi d-derivattivi u inklużi l-obbligazzjonijiet lokali fil-munita lokali	
b. Obbligazzjonijiet derivattivi barranin abbażi ta' riskju immedjat	
c. Indikatur tal-obbligazzjonijiet transġuriżdizzjonali (is-somma tal-entrati 14.a. u 14.b.)	

DATA ANĊILLARI

Taqsima 15 - Indikaturi Anċillari	Ammont
a. Obbligazzjonijiet totali	
b. Finanzjament għall-konsumatur	
c. Proporzjon tad-dipendenza tal-finanzjament bl-ingrossa (id-differenza bejn il-partiti 15.a.u 15.b., diviża b'15.a.)	
d. Dħul gross totali	
e. Dħul nett totali	
f. Dħul nett barrani	
g. Valur gross ta' flus kontanti ipprovduti u valur ġust gross ta' titoli pprovduti f'SFTs	
h. Valur gross ta' flus mislufa u valur ġust gross ta' titoli mislufa f'SFTs	
i. Valur ġust pożittiv gross ta' tranżazzjonijiet derivattivi barra l-borża (OTC)	
j. Il-valur ġust negattiv gross ta' tranżazzjonijiet derivattivi barra l-Borża	
	Ammont f'unitajiet uniċi
k. Għadd ta' ġuriżdizzjonijiet	

Taqsima 16 - Entrati anċillari	Ammont
a. Titoli miżmuma sal-maturità	
b. Ħlasijiet magħmula fis-sena tar-rappurtar	
(1) Real Brażiljan (BRL)	
(2) Peso Messikan (MXN)	
(3) Krona Norveġiża (NOK)	
(4) Rublu Russu (RUB)	
(5) Id-Dollaru Singaporjan (SGD)	
(6) Il-won tal-Korea t'Isfel (KRW)	

ENTRATI TA' MEMORANDUM

Taqsima 17 - Entrati dwar id-daqs	Ammont
a. Skoperturi ta' sussidjarji tal-assigurazzjoni diġà inklużi fil-kamp ta' applikazzjoni regolatorju prudenzjali ta' konsolidazzjoni	
b. Valur medju trimestrali tal-iskoperturi totali	
c. Valur medju ta' kull xahar tal-iskoperturi totali	

Taqsima 18 - Entrati dwar l-Interkonnettività	Ammont
a. Indikatur tal-assi tas-sistema intrafinanzjarja (indikatur antik)	
b. Valur medju trimestrali tal-assi tas-sistema intrafinanzjarja	
c. Valur medju ta' kull xahar tal-assi tas-sistema intra-finanzjarja	
d. Indikatur tal-obbligazzjonijiet tas-sistema intrafinanzjarja (indikatur antik)	

e. Valur medju trimestrali tal-obbligazzjonijiet tas-sistema intrafinanzjarja	
f. Valur medju ta' kull xahar tal-obbligazzjonijiet tas-sistema intrafinanzjarja	
g. Indikatur ta' titoli pendenti (indikatur antik)	
h. Valur medju ta' kull tliet xhur tat-titoli pendenti	
i. Valur medju ta' kull xahar tat-titoli pendenti	

Taqsima 19 - Infrastruttura ta' Sostitwibbiltà/Finanzjarja. Entrati	**Ammont**
a. Volum ta' negozjar ta' titoli maħruġa minn sovrani, esklużi tranżazzjonijiet intragrupp	
b. Marġni inizjali ddepożitat lill-kontropartijiet ċentrali (CCPs) f'isem il-klijenti	
c. Marġni inizjali ddepożitat lis-CCPs għall-kont proprju tal-grupp tar-rappurtar	
d. Kontribuzzjonijiet tal-fond ta' inadempjenza għas-CCPs	
e. Faċilitajiet oħrajn għas-CCPs	
f. Provvista ta' servizzi ta' saldu b'konnessjoni mat-tranżazzjonijiet ikklerjati ċentralment	
g. Valur medju trimestrali tal-assi taħt kustodja	
h. Valur medju ta' kull xahar tal-assi taħt kustodja	

Taqsima 20 - Entrati dwar il-Kumplessità	**Ammont**
a. Indikatur tad-derivattivi OTC (indikatur antik)	
Ammont nozzjonali ta' derivattivi barra l-borża (OTC), inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni:	
(1) Ikklerjat permezz ta' CCP fejn il-grupp (inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni) jaġixxi bħala intermedjarju finanzjarju (komponent tas-CCP)	
(2) Ikklerjat permezz ta' CCP fejn il-grupp (inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni) jaġixxi bħala intermedjarju finanzjarju (komponent tal-klijent)	
(3) Ikklerjat permezz ta' CCP fejn il-grupp, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni, jaġixxi bħala aġent	
(4) Ikklerjat permezz ta' CCP fejn il-grupp, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni, jagħmel kummerċ fuq il-kont proprju tiegħu	
c. Derivattivi OTC ikklerjati permezz ta' kontroparti ċentrali (esklużjoni mit-tranżizzjoni LIBOR)	
d. Valur medju trimestrali tal-ammont nozzjonali ta' derivattivi barra l-Borża (OTC)	
e. Valur medju ta' kull xahar tal-ammont nozzjonali ta' derivattivi barra l-Borża (OTC)	
f. Valur medju ta' kull tliet xhur tan-negozjar u titoli disponibbli għall-bejgħ	
g. Valur medju ta' kull xahar tat-titoli kummerċjali u disponibbli għall-bejgħ	
h. Indikatur tal-assi tal-Livell 3 (indikatur antik)	
i. Valur medju trimestrali tal-Assi tal-Livell 3	
j. Valur medju ta' kull xahar tal-Assi tal-Livell 3	
k. Assi tal-Livell 2, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni	
(1) Assi tal-Livell 2, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni, ikklerjati permezz ta' CCP	

(2) Assi tal-Livell 2, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni, miftiehma b'mod bilaterali	
(3) Assi oħrajn tal-Livell 2, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni	
l. Valur medju ta' assi tal-Livell 2, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni	

Taqsima 21 - Entrati dwar l-Attività Transġuriżdizzjonali	**Ammont**
a. Indikatur tal-obbligazzjonijiet transġuriżdizzjonali (indikatur antik)	
(1) Obbligazzjonijiet barranin (esklużi derivattivi u obbligazzjonijiet lokali fil-munita lokali)	
(2) Kwalunkwe obbligazzjoni barranija lil uffiċċji relatati inklużi fl-entrata 21.a.(1)	
(3) Obbligazzjonijiet lokali fil-munita lokali (eskluża l-attività tad-derivattivi)	
b. Obbligazzjonijiet lokali fil-munita lokali (inkluż l-attività tad-derivattivi)	
c. Pretensjonijiet lokali transġuriżdizzjonali fil-munita lokali (eskluża l-attività tad-derivattivi)	
d. Pretensjonijiet lokali transġuriżdizzjonali fil-munita lokali (eskluża l-attività tad-derivattivi)	
e. Talbiet barranin totali fuq bażi ta' riskju aħħari (b'kunsiderazzjoni tal-SRM bħala ġuriżdizzjoni unika)	
f. Pretensjonijiet ta' derivattivi barranin fuq bażi ta' riskju aħħari (b'kunsiderazzjoni tal-SRM bħala ġuriżdizzjoni waħda)	
g. Obbligazzjonijiet barranin fuq bażi ta' riskju immedjat, inklużi derivattivi (b'kunsiderazzjoni tal-SRM bħala ġuriżdizzjoni unika)	
(1) Obbligazzjonijiet ta'derivattivi barranin fuq bażi ta' riskju immedjat (b'kunsiderazzjoni tal-SRM bħala ġuriżdizzjoni unika)	
h. Pretensjonijiet lokali transġuriżdizzjonali fil-munita lokali, bl-esklużjoni tal-attività tad-derivattivi (b'kunsiderazzjoni tal-SRM bħala ġuriżdizzjoni unika)	
i. Pretensjonijiet lokali transġuriżdizzjonali fil-munita lokali, bl-inklużjoni l-attività tad-derivattivi (b'kunsiderazzjoni tal-SRM bħala ġuriżdizzjoni unika)	
j. Obbligazzjonijiet barranin, esklużi derivattivi u obbligazzjonijiet lokali fil-munita lokali (b'kunsiderazzjoni tal-SRM bħala ġuriżdizzjoni unika)	
(1) Kwalunkwe obbligazzjoni barranija lil uffiċċji relatati inkluża fl-entrata 20.j. (il-kunsiderazzjoni tal-SRM bħala ġuriżdizzjoni unika)	
k. Obbligazzjonijiet lokali fil-munita lokali bl-esklużjoni tad-derivattivi (b'kunsiderazzjoni tal-SRM bħala ġuriżdizzjoni unika)	
l. Obbligazzjonijiet lokali fil-munita lokali inklużi d-derivattivi (meta wieħed iqis l-SRM bħala ġuriżdizzjoni waħda)	
m. Pożizzjonijiet lokali netti totali fil-munita lokali inklużi d-derivattivi, jekk pożittivi netti	
n. Pożizzjonijiet lokali netti totali fil-munita lokali inklużi d-derivattivi, jekk negattivi netti	
o. Pożizzjonijiet lokali netti totali fil-munita lokali f'pajjiżi li mhumiex fl-SRM inklużi d-derivattivi, jekk pożittivi netti (c. SRM bħala s. j.)	
p. Pożizzjonijiet lokali netti totali fil-munita lokali f'pajjiżi li mhumiex fl-SRM inklużi d-derivattivi, jekk negattivi netti (c. SRM bħala s. j.)	
q. Pożizzjonijiet lokali netti totali fil-munita lokali f'pajjiżi SRM inklużi derivattivi (b'kunsiderazzjoni tal-SRM bħala ġuriżdizzjoni unika)	
r. Pretensjonijiet fi ħdan l-uffiċċju rreġistrati minn sussidjarji barranin	
s. Pretensjonijiet fi ħdan l-uffiċċji rreġistrati minn fergħat barranin	
t. Obbligazzjonijiet bejn l-uffiċċji rreġistrati minn sussidjarji barranin	
u. Obbligazzjonijiet bejn l-uffiċċji rreġistrati minn fergħat barranin	

v. Valur medju trimestrali tal-pretensjonijiet transġuriżdizzjonali
w. Valur medju ta' kull xahar tal-pretensjonijiet transġuriżdizzjonali
x. Valur medju trimestrali tal-obbligazzjonijiet transġuriżdizzjonali
y. Valur medju ta' kull xahar ta' obbligazzjonijiet transġuriżdizzjonali

Taqsima 22 - Indikaturi Anċillari
a. Dħul nett barrani (b'kunsiderazzjoni tal-SRM bħala ġuriżdizzjoni unika)
b. Numru ta' ġuriżdizzjonijiet (b'kunsiderazzjoni tal-SRM bħala ġuriżdizzjoni unika)

SOMMARJU TAL-KONTROLLI

Taqsima 23 – Valuri tal-Indikaturi (Metodoloġija riveduta)	Valur tal-indikatur fil-munita tar-rapportar
a. Taqsima 2 - Indikatur tal-iskoperturi totali, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni	
b. Taqsima 3 - Indikatur tal-assi tas-sistema intrafinanzjarja, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni	
c. Taqsima 4 - Indikatur tal-obbligazzjonijiet tas-sistema intrafinanzjarja, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni	
d. Taqsima 5 - Indikatur tat-titoli pendenti, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni	
e. Taqsima 6 – Indikatur tal-attività tal-pagamenti	
f. Taqsima 7 – Indikatur tal-assi taħt kustodja	
g. Taqsima 8 – Indikatur tal-attività tas-sottoskrizzjoni	
h. Taqsima 9.c - Sottoindikatur tal-introjtu fiss tal-Volum tan-Negozjar	
i. Taqsima 9.f - Ekwitajiet ta' Volum tan-Negozjar u subindikatur ieħor tat-titoli	
j. Taqsima 10 - Indikatur tad-derivattivi OTC, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni	
k. Taqsima 11 - Indikatur tat-titoli tan-negozjar u tal-AFS	
l. Taqsima 12 - Indikatur tal-assi tal-Livell 3, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni	
m. Taqsima 13 – Indikatur tal-pretensjonijiet transġuriżdizzjonali	
n. Taqsima 13 – Indikatur tal-obbligazzjonijiet transġuriżdizzjonali	
o. Taqsimiet Oħrajn	
(1) Entrata 1.a - Informazzjoni ġenerali pprovduta mill-awtorità superviżorja	
(2) Entrata 1.b - Informazzjoni ġenerali pprovduta mill-istituzzjoni tar-rapportar	
(3) Taqsima 15 - Indikaturi Anċillari	
(4) Taqsima 16 - Entrati Anċillari	
(5) Taqsima 17 - Entrati dwar id-daqs	
(6) Taqsima 18 — Entrati dwar l-Interkonnettività	
(7) Taqsima 19 - Infrastruttura ta' Sostitwibbiltà/Finanzjarja. Entrati	

(8) Taqsima 20 — Entrati dwar il-Kumplessità
(9) Taqsima 21 - Entrati dwar l-Attività Transġuriżdizzjonali
(10) Taqsima 22 - Indikaturi Anċillari

Taqsima 24 — Valuri tal-Indikaturi (metodoloġija antika)	**Valur tal-indikatur fil-munita tar-rapportar**
a. Taqsima 2 - Indikatur tal-iskoperturi totali	
b. Taqsima 18 - Indikatur tal-assi tas-sistema intrafinanzjarja	
c. Taqsima 18 - Indikatur tal-obbligazzjonijiet tas-sistema intrafinanzjarja	
d. Taqsima 18 - Indikatur tat-titoli pendenti	
e. Taqsima 6 - Indikatur tal-attività tal-pagamenti	
f. Taqsima 7 – Indikatur tal-assi taħt kustodja	
g. Taqsima 8 – Indikatur tal-attività tas-sottoskrizzjoni	
h. Taqsima 20 – Indikatur tad-derivattivi OTC	
i. Taqsima 11 – Indikatur tat-titoli għan-negozjar u tal-AFS	
j. Taqsima 20 - Indikatur tal-assi tal-Livell 3	
k. Taqsima 13 - Indikatur tal-pretensjonijiet transġuriżdizzjonali	
l. Taqsima 21 - Indikatur tal-obbligazzjonijiet transġuriżdizzjonali	