

EBA/GL/2023/10

---

20 december 2023

---

# Richtsnoeren tot wijziging van Richtsnoeren EBA/GL/2020/14

---

inzake de specificatie en  
openbaarmaking van indicatoren voor  
systeemrelevantie

# 1. Nalevings- en rapportageverplichtingen

---

## Status van deze richtsnoeren

1. Dit document bevat richtsnoeren die zijn uitgebracht op grond van artikel 16 van Verordening (EU) nr. 1093/2010<sup>1</sup>. Overeenkomstig artikel 16, lid 3, van Verordening (EU) nr. 1093/2010 moeten bevoegde autoriteiten en financiële instellingen zich tot het uiterste inspannen om aan die richtsnoeren te voldoen.
2. Richtsnoeren geven weer wat in de opvatting van EBA passende toezichtpraktijken binnen het Europees Stelsel voor financieel toezicht zijn en hoe het recht van de Unie op een specifiek gebied dient te worden toegepast. Bevoegde autoriteiten als bedoeld in artikel 4, punt 2, van Verordening (EU) nr. 1093/2010 voor wie de richtsnoeren gelden, dienen hieraan te voldoen door deze op passende wijze in hun praktijken te integreren (bijvoorbeeld door hun wettelijk kader of hun toezichtprocessen aan te passen), ook wanneer richtsnoeren primair tot instellingen zijn gericht.

## Rapportageverplichtingen

3. Overeenkomstig artikel 16, lid 3, van Verordening (EU) nr. 1093/2010 stellen bevoegde autoriteiten EBA vóór 20.05.2024 ervan in kennis dat zij aan deze richtsnoeren voldoen of voornemens zijn deze op te volgen, of, indien dit niet het geval is, wat de redenen van de niet-naleving zijn. Bevoegde autoriteiten die bij het verstrijken van de termijn niet hebben gereageerd, worden door EBA geacht niet aan de richtsnoeren te hebben voldaan. Kennisgevingen worden ingediend door het formulier op de EBA-website in te sturen onder vermelding van "EBA/GL/2023/10". Kennisgevingen dienen te worden ingezonden door personen die gemachtigd zijn om namens hun bevoegde autoriteit mee te delen of deze al dan niet aan de richtsnoeren voldoet. Elke verandering in de status van de naleving moet eveneens aan EBA worden gemeld.
4. Kennisgevingen worden overeenkomstig artikel 16, lid 3, van de EBA-verordening op de website van EBA bekendgemaakt.

---

<sup>1</sup> Verordening (EU) nr. 1093/2010 van het Europees Parlement en de Raad van 24 november 2010 tot oprichting van een Europese toezichthoudende autoriteit (Europese Bankautoriteit), tot wijziging van Besluit nr. 716/2009/EG en tot intrekking van Besluit 2009/78/EG van de Commissie (PB L 331 van 15.12.2010, blz. 12).

## 2. Adressaten

---

5. Deze richtsnoeren zijn gericht tot bevoegde autoriteiten als gedefinieerd in artikel 4, punt 2, onder i), van Verordening (EU) nr. 1093/2010 en tot financiële instellingen waarvoor de Richtsnoeren EBA/GL/2020/14 gelden. De in artikel 131, lid 1, van Richtlijn 2013/36/EU bedoelde aangewezen autoriteiten, voor zover deze geen bevoegde autoriteiten zijn, worden aangemoedigd om deze richtsnoeren toe te passen. De bevoegde en de aangewezen autoriteiten worden in deze richtsnoeren “relevante autoriteiten” genoemd.

## 3. Tenuitvoerlegging

---

### Datum van toepassing

9. Deze richtsnoeren zijn van toepassing vanaf 20.05.2024.

### Intrekking

De wijzigingsrichtsnoeren van 29 september 2022 (EBA/GL/2022/12) tot wijziging van de richtsnoeren inzake de specificatie en openbaarmaking van indicatoren voor systeemrelevantie worden hierbij ingetrokken en vervangen door onderhavige richtsnoeren.

## 4. Wijzigingsrichtsnoeren

---

10. De Richtsnoeren EBA/GL/2020/14 worden als volgt gewijzigd:

(a). Punt 9 wordt vervangen door:

*“9. Relevante autoriteiten en relevante entiteiten dienen de instructies en specificaties voor de in de bijlage vermelde gegevensposten te volgen die kunnen worden geraadpleegd door op “Reporting instructions” te klikken op de pagina over MSI’s van de EBA-website<sup>2</sup>.”*

(b). Punt 10 wordt vervangen door:

*“10. De relevante autoriteiten dienen de aanvullende gegevens (afdelingen 15 en 16 van de bijlage bij deze richtsnoeren) te gebruiken om hun degelijke oordeelsvorming in het toezicht te onderbouwen in overeenstemming met artikel 131, lid 10, van Richtlijn 2013/36/EU, en de pro-memoriestaten (afdelingen 17 tot en met 22 van de bijlage) om de gegevenskwaliteit te verbeteren en toekomstige verbeteringen in de identificatiemethode te helpen ontwikkelen. De pro-memoriestaten dienen in voorkomend geval te worden aangevuld met gedetailleerde opmerkingen van de relevante entiteiten over de kwaliteit en beschikbaarheid van gegevens.”*

(c). Punt 10 bis wordt vervangen door:

*“10 bis. Overeenkomstig artikel 131, lid 2 bis, van Richtlijn 2013/36/EU, dat een aanvullende methodiek vereist om te bepalen welke instellingen MSI’s zijn, waarbij grensoverschrijdende activiteiten binnen het gemeenschappelijk afwikkelingsmechanisme (GAM) buiten beschouwing worden gelaten, en in overeenstemming met de internationale overeenkomst van het Bazels Comité van 31 mei 2022, waarin de bij de ontwikkeling van de Europese bankenunie geboekte vooruitgang wordt erkend, moeten gegevensposten die relevant zijn voor de berekening van aangepaste rechtsgebiedoverschrijdende GAM-indicatoren voor instellingen met hoofdkantoor in de lidstaten die deelnemen aan het GAM worden beschouwd als onderdeel van de indicatoren voor rechtsgebiedoverschrijdende activiteiten – en derhalve overeenkomstig punt 12 openbaar worden gemaakt – en niet als aanvullende of pro-memoriestaten voor de methodiek voor het aanwijzen van MSI’s en het onderbrengen ervan in een subcategorie.”*

(d). Punt 11 wordt vervangen door:

*“11. De relevante autoriteiten dienen te waarborgen dat zij op 31 december van elk jaar alle in de bijlage bij deze richtsnoeren genoemde gegevensposten verzamelen bij de relevante entiteiten die voldoen aan de criteria van punt 6 van deze richtsnoeren.”*

(e). Punt 12 wordt vervangen door:

---

<sup>2</sup> <https://www.eba.europa.eu/risk-analysis-and-data/global-systemically-important-institutions>

*“12. De relevante autoriteiten dienen ervoor te zorgen dat de relevante entiteiten jaarlijks op hun website de indicatorwaarden openbaar maken die worden genoemd in de afdelingen 1 tot en met 14 van de bijlage bij deze richtsnoeren. Indien de aanvullende identificatiemethode voor het GAM moet worden gebruikt, moet die informatie bovendien vergezeld gaan van de posten e), f) en g) van afdeling 21, evenals alle andere posten van afdeling 21 met betrekking tot rechtsgebiedoverschrijdende GAM-activiteiten die relevant kunnen worden geacht voor de berekening van die methode door de relevante autoriteit.”*

(f). Punt 14 wordt vervangen door:

*“14. De relevante entiteiten dienen de in punt 11 bedoelde informatie aan de relevante autoriteiten over te leggen en de in punt 12 bedoelde informatie openbaar te maken op jaarlijkse basis, uiterlijk vier maanden na afloop van elk boekjaar, vanaf de tweede opeenvolgende einddatum van een boekjaar waarop de in punt 6 van deze richtsnoeren vastgestelde drempel wordt overschreden. Daarbij identificeren de relevante entiteiten zich door gebruik te maken van hun identificatienummer van juridische entiteiten (LEI).”*

(g). De bijlage wordt vervangen door onderstaande bijlage.

# Bijlage

## ALGEMENE BANKGEGEVENS

Afdeling 1 – Algemene informatie	Antwoord
a. Algemene informatie die is verstrekt door de relevante toezichthoudende autoriteit:	
(1) Code van het land	
(2) Naam van de bank	
(3) Rapportagedatum (jjjj-mm-dd)	
(4) Rapportagevaluta	
(5) Eurowisselkoers	
(6) Datum van indiening (jjjj-mm-dd)	
b. Algemene informatie die door de rapporterende instelling wordt verstrekt:	
(1) Rapportage-eenheid	
(2) Standaard voor jaarrekeningen	
(3) Datum van openbaarmaking (jjjj-mm-dd)	
(4) Taal van openbaarmaking	
(5) Webadres van openbaarmaking	
(6) LEI-code	

## OMVANGSINDICATOREN

Afdeling 2 – Totaal blootstellingen	Bedrag
a. Derivaten	
(1) Tegenpartijblootstelling van derivatencontracten	
(2) Begrensd notioneel bedrag van kredietderivaten	
(3) Potentiële toekomstige blootstelling van derivatencontracten	
b. Effectenfinancieringstransacties (SFT's)	
(1) Gecorrigeerde brutowaarde van SFT's	
(2) Tegenpartijblootstelling van SFT's	
c. Andere activa	
d. Bruto notioneel bedrag van posten buiten de balanstelling	
(1) Posten met een kredietomwisselingsfactor (COF) van 0 %	
(2) Posten met een COF van 20 %	
(3) Posten met een COF van 50 %	
(4) Posten met een COF van 100 %	
e. Regelgevingsaanpassingen	
f. Totaal blootstellingen vóór regelgevingsaanpassingen (som van de posten 2.a.1) tot en met 2.c, 0,1 maal post 2.d.1), 0,2 maal post 2.d.2), 0,5 maal post 2.d.3), en post 2.d.4))	

g. Blootstellingen van verzekeringsdochterondernemingen die niet onder post 2.f vallen binnen de groep:
(1) Binnen en buiten de balansstelling vallende activa van verzekeringsdochterondernemingen
(2) Potentiële toekomstige blootstelling van derivatencontracten van verzekeringsdochterondernemingen
(3) Beleggingswaarde in geconsolideerde entiteiten
h. In post 2.f opgenomen intragroepsblootstellingen aan in post 2.g gerapporteerde verzekeringsdochterondernemingen
i. Indicator voor totaal blootstellingen, met inbegrip van verzekeringsdochterondernemingen (som van de posten 2.f, 2.g.1) tot en met 2.g.2) min 2.g.3) tot en met 2.h)

### VERWEVENHEIDSINDICATOREN

Afdeling 3 – Activa binnen het financiële stelsel	Bedrag
a. Bij andere financiële instellingen gedeponeerde of aan andere financiële instellingen geleende middelen	
(1) Depositocertificaten	
b. Onbenut deel van tot andere financiële instellingen uitgebreide gecommiteerde lijnen	
c. Aangehouden effecten die door andere financiële instellingen zijn uitgegeven	
(1) Gedekte schuldtitels	
(2) Bevoorrechte ongedekte schuldtitels	
(3) Achtergestelde schuldtitels	
(4) Handelspapier	
(5) Aandelen	
(6) Compensatie van shortposities met betrekking tot de specifieke aangehouden aandelen als opgenomen in post 3.c.5)	
d. Netto positieve actuele blootstelling van SFT's met andere financiële instellingen	
e. OTC-derivaten met andere financiële instellingen die een netto positieve reële waarde hebben	
(1) Netto positieve reële waarde	
(2) Potentiële toekomstige blootstelling	
f. Indicator voor activa binnen het financiële stelsel, met inbegrip van verzekeringsdochterondernemingen (som van de posten 3.a, 3.b tot en met 3.c.5), 3.d, 3.e.1), en 3.e.2), min 3.c.6))	

Afdeling 4 – Passiva binnen het financiële stelsel	Bedrag
a. Door andere financiële instellingen gedeponeerde of van andere financiële instellingen geleende middelen	
(1) Aan deposito-instellingen verschuldigde deposito's	
(2) Aan financiële niet-deposito-instellingen verschuldigde deposito's	
(3) Van andere financiële instellingen verkregen leningen	
b. Onbenut deel van van andere financiële instellingen verkregen gecommiteerde lijnen	
c. Netto negatieve actuele blootstelling van SFT's met andere financiële instellingen	

d. OTC-derivaten met andere financiële instellingen die een netto negatieve reële waarde hebben
(1) Netto negatieve reële waarde
(2) Potentiële toekomstige blootstelling
e. Indicator voor passiva binnen het financiële stelsel, met inbegrip van verzekeringsdochterondernemingen (som van de posten 4.a.1) tot en met 4.d.2))

<b>Afdeling 5 – Uitstaande effecten</b>	<b>Bedrag</b>
a. Gedekte schuldtitels	
b. Bevoorrechte ongedekte schuldtitels	
c. Achtergestelde schuldtitels	
d. Handelspapier	
e. Depositocertificaten	
f. Gewone aandelen	
g. Preferente aandelen en alle andere vormen van achtergestelde financiering die niet in post 5.c. zijn opgenomen	
h. Indicator voor uitstaande effecten, met inbegrip van effecten die zijn uitgegeven door verzekeringsdochterondernemingen (som van de posten 5.a tot en met 5.g)	

*INDICATOREN VOOR SUBSTITUEERBAARHEID/INFRASTRUCTUUR  
FINANCIËLE INSTELLING*

<b>Afdeling 6 – In het rapportagejaar gedane betalingen (exclusief intragroepsbetalingen)</b>	<b>Bedrag</b>
a. Australische dollar (AUD)	
b. Canadese dollar (CAD)	
c. Zwitserse frank (CHF)	
d. Chinese yuan (CNY)	
e. Euro (EUR)	
f. Britse pond (GBP)	
g. Hongkongdollar (HKD)	
h. Indiase roepie (INR)	
i. Japanse yen (JPY)	
j. Nieuw-Zeelandse dollar (NZD)	
k. Zweedse kroon (SEK)	
l. US-dollar (USD)	
m. Indicator voor activiteit betalingen (som van de posten 6.a tot en met 6.l)	

<b>Afdeling 7 – In bewaring genomen activa</b>	<b>Bedrag</b>
a. Indicator voor in bewaring genomen activa	

<b>Afdeling 8 – Overnemingstransacties op de markten voor vreemd en eigen vermogen</b>	<b>Bedrag</b>
a. Activiteit overnemen eigen vermogen	



---

b. Activiteit overnemen vreemd vermogen

---

c. Indicator voor activiteit overnemen (som van de posten 8.a en 8.b)

---

**Afdeling 9 – Handelsvolume**

**Bedrag**

---

a. Handelsvolume van effecten die zijn uitgegeven door andere entiteiten uit de publieke sector, exclusief intragroepstransacties

---

b. Handelsvolume van andere vastrentende waardepapieren, exclusief intragroepstransacties

---

c. Subindicator voor handelsvolume met vaste opbrengst (som van de posten 9.a en 9.b)

---

d. Handelsvolume van beursgenoteerde aandelen, exclusief intragroepstransacties

---

e. Handelsvolume van alle overige effecten, exclusief intragroepstransacties

---

f. Subindicator voor handelsvolume van aandelen en andere effecten (som van de posten 9.d en 9.e)

---

*COMPLEXITEITSINDICATOREN*

**Afdeling 10 – Notioneel bedrag van over-the-counter (OTC)-derivaten**

**Bedrag**

---

a. Via een centrale tegenpartij geclearde OTC-derivaten

---

b. Bilateraal afgewikkelde OTC-derivaten

---

c. Indicator voor notioneel bedrag van OTC-derivaten, met inbegrip van verzekeringsdochterondernemingen (som van de posten 10.a en 10.b)

---

**Afdeling 11 – Voor handelsdoeleinden aangehouden en voor verkoop beschikbare effecten**

**Bedrag**

---

a. Voor handelsdoeleinden aangehouden effecten (HFT)

---

b. Voor verkoop beschikbare effecten (AFS)

---

c. HFT- en AFS-effecten die voldoen aan de definitie van activa van niveau 1

---

d. HFT- en AFS-effecten die voldoen aan de definitie van activa van niveau 2, met haircuts

---

e. Indicator voor HFT- en AFS-effecten (som van de posten 11.a en 11.b, min de som van de posten 11.c en 11.d)

---

**Afdeling 12 – Activa van niveau 3**

**Bedrag**

---

a. Indicator voor activa van niveau 3, met inbegrip van verzekeringsdochterondernemingen

---

*INDICATOREN VOOR RECHTSGEBIEDOVERSCHRIJDENDE ACTIVITEIT*

**Afdeling 13 – Rechtsgebiedoverschrijdende vorderingen**

**Bedrag**

---

a. Totale buitenlandse vorderingen op basis van uiteindelijk risico

---

b. Buitenlandse derivatenvorderingen op basis van uiteindelijk risico

---

c. Indicator voor rechtsgebiedoverschrijdende vorderingen (som van de posten 13.a en 13.b)

---

**Afdeling 14 – Rechtsgebiedoverschrijdende passiva****Bedrag**

- |  |  |
|--|--|
| a. Buitenlandse passiva op basis van onmiddellijk risico, exclusief derivaten en inclusief lokale passiva in lokale valuta |  |
| b. Buitenlandse derivatenpassiva op basis van onmiddellijk risico  |  |
| c. Indicator voor rechtsgebiedoverschrijdende passiva (som van de posten 14.a en 14.b)                                     |  |

*NEVENGEDEVENS***Afdeling 15 – Nevenindicatoren****Bedrag**

- |  |  |
|--|--|
| a. Totaal passiva  |  |
| b. Retailfinanciering  |  |
| c. Ratio voor de afhankelijkheid van wholesalefinanciering (verschil tussen de posten 15.a en 15.b, gedeeld door 15.a) |  |
| d. Totaal bruto inkomsten  |  |
| e. Totaal netto inkomsten  |  |
| f. Buitenlandse netto inkomsten  |  |
| g. Bruto waarde van contanten uitgeleend en bruto reële waarde van effecten uitgeleend bij SFT's                       |  |
| h. Bruto waarde van contanten geleend en bruto reële waarde van effecten geleend bij SFT's                             |  |
| i. Bruto positieve reële waarde van over the counter (OTC)-derivatentransacties  |  |
| j. Bruto negatieve reële waarde van OTC-derivatentransacties   |  |

**Bedrag in enkelvoudige eenheden**

- |                          |  |
|--------------------------|--|
| k. Aantal rechtsgebieden |  |
|--------------------------|--|

**Afdeling 16 – Nevenposten****Bedrag**

- |  |  |
|--|--|
| a. Tot einde looptijd aangehouden effecten |  |
| b. In het rapportagejaar gedane betalingen |  |
| (1) Braziliaanse real (BRL)                |  |
| (2) Mexicaanse peso (MXN)                  |  |
| (3) Noorse kroon (NOK)                     |  |
| (4) Russische roebel (RUB)                 |  |
| (5) Singaporedollar (SGD)                  |  |
| (6) Zuid-Koreaanse won (KRW)               |  |

*PRO-MEMORIEPOSTEN***Afdeling 17 – Posten met betrekking tot omvang****Bedrag**

- |  |  |
|--|--|
| a. Blootstelling van verzekeringsdochterondernemingen die reeds vallen onder het prudentiële wettelijke consolidatiebereik |  |
| b. Gemiddelde kwartaalwaarde van totaal blootstellingen  |  |
| c. Gemiddelde maandwaarde van totaal blootstellingen   |  |

**Afdeling 18 – Posten met betrekking tot verwevenheid****Bedrag**

- |  |
|--|
| a. Indicator voor activa binnen het financiële stelsel (oude indicator)  |
| b. Gemiddelde kwartaalwaarde van activa binnen het financiële stelsel    |
| c. Gemiddelde maandwaarde van activa binnen het financiële stelsel       |
| d. Indicator voor passiva binnen het financiële stelsel (oude indicator) |
| e. Gemiddelde kwartaalwaarde van passiva binnen het financiële stelsel   |
| f. Gemiddelde maandwaarde van passiva binnen het financiële stelsel      |
| g. Indicator voor uitstaande effecten (oude indicator)                   |
| h. Gemiddelde kwartaalwaarde van uitstaande effecten                     |
| i. Gemiddelde maandwaarde van uitstaande effecten                        |

**Afdeling 19 – Posten met betrekking tot substitueerbaarheid/financiële infrastructuur****Bedrag**

- |   |
|---|
| a. Handelsvolume effecten uitgegeven door soevereine staten, exclusief intragroepstransacties |
| b. Bij centrale tegenpartijen (CTP's) gestorte initiële marge in opdracht van cliënten        |
| c. Bij CTP's gestorte initiële marge voor eigen rekening van de rapporterende groep           |
| d. Bijdragen aan het wanbetalingsfonds met betrekking tot CTP's                               |
| e. Andere faciliteiten voor CTP's   |
| f. Verlening van afwikkelingsdiensten in verband met centraal geclarede transacties           |
| g. Gemiddelde kwartaalwaarde van bewaring genomen activa                                      |
| h. Gemiddelde maandwaarde van bewaring genomen activa   |

**Afdeling 20 – Posten met betrekking tot complexiteit****Bedrag**

- |   |
|---|
| a. Indicator voor OTC-derivaten (oude indicator)  |
| b. Notioneel bedrag van OTC-derivaten, met inbegrip van verzekeringsdochterondernemingen:   |
| (1) geclareerd via een CTP waarbij de groep (met inbegrip van verzekeringsdochterondernemingen) als financieel tussenpersoon optreedt (CTP-deel)    |
| (2) geclareerd via een CTP waarbij de groep (met inbegrip van verzekeringsdochterondernemingen) als financieel tussenpersoon optreedt (cliënt-deel) |
| (3) geclareerd via een CTP waarbij de groep, met inbegrip van verzekeringsdochterondernemingen, als gemachtigde optreedt                            |
| (4) geclareerd via een CTP waarbij de groep, met inbegrip van verzekeringsdochterondernemingen, voor eigen rekening handelt                         |
| c. Via een centrale tegenpartij geclarede OTC-derivaten (uitzondering voor Libor-transitie)   |
| d. Gemiddelde kwartaalwaarde van het notioneel bedrag van OTC-derivaten   |
| e. Gemiddelde maandwaarde van het notioneel bedrag van OTC-derivaten  |
| f. Gemiddelde kwartaalwaarde van voor handelsdoeleinden aangehouden en voor verkoop beschikbare effecten  |
| g. Gemiddelde maandwaarde van voor handelsdoeleinden aangehouden en voor verkoop beschikbare effecten   |
| h. Indicator voor activa van niveau 3 (oude indicator)  |

i. Gemiddelde kwartaalwaarde van activa van niveau 3
j. Gemiddelde maandwaarde van activa van niveau 3
k. Activa van niveau 2, met inbegrip van verzekeringsdochterondernemingen
(1) Activa van niveau 2, met inbegrip van verzekeringsdochterondernemingen, gecleard via een CTP
(2) Activa van niveau 2, met inbegrip van verzekeringsdochterondernemingen, bilateraal afgewikkeld
(3) Overige activa van niveau 2, met inbegrip van verzekeringsdochterondernemingen
l. Gemiddelde waarde van activa van niveau 2, met inbegrip van verzekeringsdochterondernemingen

**Afdeling 21 – Posten met betrekking tot rechtsgebiedoverschrijdende activiteit**
**Bedrag**

a. Indicator voor rechtsgebiedoverschrijdende passiva (oude indicator)
(1) Buitenlandse passiva (exclusief derivaten en lokale passiva in lokale valuta)
(2) Alle buitenlandse passiva aan verbonden kantoren als opgenomen in post 21.a.1)
(3) Lokale passiva in lokale valuta (exclusief derivatenactiviteit)
b. Lokale passiva in lokale valuta (inclusief derivatenactiviteit)
c. Rechtsgebiedoverschrijdende lokale vorderingen in lokale valuta (exclusief derivatenactiviteit)
d. Rechtsgebiedoverschrijdende lokale vorderingen in lokale valuta (inclusief derivatenactiviteit)
e. Totaal buitenlandse vorderingen op basis van uiteindelijk risico (waarbij het GAM als één enkel rechtsgebied wordt beschouwd)
f. Buitenlandse derivatenvorderingen op basis van uiteindelijk risico (waarbij het GAM als één enkel rechtsgebied wordt beschouwd)
g. Buitenlandse passiva op basis van onmiddellijk risico, met inbegrip van derivaten (waarbij het GAM als één enkel rechtsgebied wordt beschouwd)
(1) Buitenlandse passiva van derivaten op basis van onmiddellijk risico (waarbij het GAM als één enkel rechtsgebied wordt beschouwd)
h. Rechtsgebiedoverschrijdende lokale vorderingen in lokale valuta, exclusief derivatenactiviteit (waarbij het GAM als één enkel rechtsgebied wordt beschouwd)
i. Rechtsgebiedoverschrijdende lokale vorderingen in lokale valuta, inclusief derivatenactiviteit (waarbij het GAM als één enkel rechtsgebied wordt beschouwd)
j. Buitenlandse passiva, exclusief derivaten en lokale passiva in lokale valuta (waarbij het GAM als één enkel rechtsgebied wordt beschouwd)
(1) Alle buitenlandse passiva aan verbonden kantoren als opgenomen in post 20.j (waarbij het GAM als één enkel rechtsgebied wordt beschouwd)
k. Lokale passiva in lokale valuta, exclusief derivaten (waarbij het GAM als één enkel rechtsgebied wordt beschouwd)
l. Lokale passiva in lokale valuta, inclusief derivaten (waarbij het GAM als één enkel rechtsgebied wordt beschouwd)
m. Totaal netto lokale posities in lokale valuta inclusief derivaten, indien netto positief
n. Totaal netto lokale posities in lokale valuta inclusief derivaten, indien netto negatief

- 
- o. Totaal netto lokale posities in lokale valuta in landen buiten het GAM, inclusief derivaten, indien netto positief (waarbij het GAM als één enkel rechtsgebied wordt beschouwd)
- 
- p. Totaal netto lokale posities in lokale valuta in landen buiten het GAM, inclusief derivaten, indien netto negatief (waarbij het GAM als één enkel rechtsgebied wordt beschouwd)
- 
- q. Totaal netto lokale posities in lokale valuta in GAM-landen, inclusief derivaten (waarbij het GAM als één enkel rechtsgebied wordt beschouwd)
- 
- r. Vorderingen binnen een kantoor geboekt door buitenlandse dochterondernemingen
- 
- s. Vorderingen binnen een kantoor geboekt door buitenlandse filialen
- 
- t. Passiva binnen een kantoor geboekt door buitenlandse dochterondernemingen
- 
- u. Passiva binnen een kantoor geboekt door buitenlandse filialen
- 
- v. Gemiddelde kwartaalwaarde van rechtsgebiedoverschrijdende vorderingen
- 
- w. Gemiddelde maandwaarde van rechtsgebiedoverschrijdende vorderingen
- 
- x. Gemiddelde kwartaalwaarde van rechtsgebiedoverschrijdende passiva
- 
- y. Gemiddelde maandwaarde van rechtsgebiedoverschrijdende passiva
- 

## Afdeling 22 – Nevenindicatoren

- 
- a. Buitenlandse netto inkomsten (waarbij het GAM als één enkel rechtsgebied wordt beschouwd)
- 
- b. Aantal rechtsgebieden (waarbij het GAM als één enkel rechtsgebied wordt beschouwd)
- 

### *CONTROLESAMENVATTING*

## Afdeling 23 – Indicatorwaarden (herziene methode)

## Indicatorwaarde in de rapportagevaluta

- 
- a. Afdeling 2 – Indicator voor totaal blootstellingen, met inbegrip van verzekeringsdochterondernemingen
- 
- b. Afdeling 3 – Indicator voor activa binnen het financiële stelsel, met inbegrip van verzekeringsdochterondernemingen
- 
- c. Afdeling 4 – Indicator voor passiva binnen het financiële stelsel, met inbegrip van verzekeringsdochterondernemingen
- 
- d. Afdeling 5 – Indicator voor uitstaande effecten, met inbegrip van verzekeringsdochterondernemingen
- 
- e. Afdeling 6 – Indicator voor activiteit betalingen
- 
- f. Afdeling 7 – Indicator voor in bewaring genomen activa
- 
- g. Afdeling 8 – Indicator voor activiteit overnemen
- 
- h. Afdeling 9.c – Subindicator voor handelsvolume met vaste opbrengst
- 
- i. Afdeling 9.f – Subindicator voor handelsvolume van aandelen en andere effecten
- 
- j. Afdeling 10 – Indicator voor OTC-derivaten, met inbegrip van verzekeringsdochterondernemingen
- 
- k. Afdeling 11 – Indicator voor HFT- en AFS-effecten
-

---

l. Afdeling 12 – Indicator voor activa van niveau 3, met inbegrip van verzekeringsdochterondernemingen

---

m. Afdeling 13 – Indicator voor rechtsgebiedoverschrijdende vorderingen

---

n. Afdeling 14 – Indicator voor rechtsgebiedoverschrijdende passiva

---

o. Overige afdelingen

---

(1) Post 1.a – Algemene informatie die door de toezichhoudende autoriteit wordt verstrekt

---

(2) Post 1.b – Algemene informatie die door de rapporterende instelling wordt verstrekt

---

(3) Afdeling 15 – Nevenindicatoren

---

(4) Afdeling 16 – Nevenposten

---

(5) Afdeling 17 – Posten met betrekking tot omvang

---

(6) Afdeling 18 – Posten met betrekking tot verwevenheid

---

(7) Afdeling 19 – Posten met betrekking tot substitueerbaarheid/financiële infrastructuur

---

(8) Afdeling 20 – Posten met betrekking tot complexiteit

---

(9) Afdeling 21 – Posten met betrekking tot rechtsgebiedoverschrijdende activiteit

---

(10) Afdeling 22 – Nevenindicatoren

---



---

**Afdeling 24 – Indicatorwaarden (oude methode)**

**Indicatorwaarde in de rapportagevaluta**

---

a. Afdeling 2 – Indicator voor totaal blootstellingen

---

b. Afdeling 18 – Indicator voor activa binnen het financiële stelsel

---

c. Afdeling 18 – Indicator voor passiva binnen het financiële stelsel

---

d. Afdeling 18 – Indicator voor uitstaande effecten

---

e. Afdeling 6 – Indicator voor activiteit betalingen

---

f. Afdeling 7 – Indicator voor in bewaring genomen activa

---

g. Afdeling 8 – Indicator voor activiteit overnemen

---

h. Afdeling 20 – Indicator voor OTC-derivaten

---

i. Afdeling 11 – Indicator voor HFT- en AFS-effecten

---

j. Afdeling 20 – Indicator voor activa van niveau 3

---

k. Afdeling 13 – Indicator voor rechtsgebiedoverschrijdende vorderingen

---

l. Afdeling 21 – Indicator voor rechtsgebiedoverschrijdende passiva

---