

EBA/GL/2023/10

20 de Dezembro de 2023

Orientações que alteram as Orientações EBA/GL/2020/14

relativas à especificação e divulgação dos
indicadores de importância sistémica

1. Obrigações de verificação do cumprimento e informação

Natureza das presentes Orientações

1. O presente documento contém orientações emitidas ao abrigo do artigo 16.º do Regulamento (UE) n.º 1093/2010 ¹. Nos termos do artigo 16.º, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 1093/2010, as autoridades competentes e as instituições financeiras devem desenvolver todos os esforços para dar cumprimento às Orientações.
2. As Orientações definem a posição da EBA sobre práticas de supervisão adequadas no âmbito do Sistema Europeu de Supervisão Financeira ou sobre o modo como a legislação da União deve ser aplicada num domínio específico. As autoridades competentes, na aceção do artigo 4.º, n.º 2, do Regulamento (UE) n.º 1093/2010, às quais as presentes orientações se apliquem devem dar cumprimento às mesmas, incorporando-as nas suas práticas de supervisão conforme for mais adequado (por exemplo, alterando o seu enquadramento jurídico ou os seus processos de supervisão), incluindo nos casos em que as orientações são aplicáveis, em primeira instância, a instituições.

Requisitos de notificação

3. Nos termos do disposto no artigo 16.º, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 1093/2010, as autoridades competentes notificam a EBA de que dão ou se tencionam dar cumprimento às presentes orientações, ou indicam, caso contrário, as razões para o não cumprimento das mesmas até 20.05.2024. Na ausência de qualquer notificação até à referida data, a EBA considerará que as autoridades competentes em causa não cumprem as orientações. As notificações devem ser efetuadas mediante o envio do modelo disponível no sítio Web da EBA com a referência «EBA/GL/2023/10». As notificações devem ser apresentadas por pessoas devidamente autorizadas a notificar a situação de cumprimento em nome das respetivas autoridades competentes. Qualquer alteração no que respeita à situação de cumprimento deve igualmente ser comunicada à EBA.
4. As notificações serão publicadas no sítio Web da EBA, em conformidade com o disposto no artigo 16.º, n.º 3.

¹ Regulamento (UE) n.º 1093/2010 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 24 de Novembro de 2010, que cria uma Autoridade Europeia de Supervisão (Autoridade Bancária Europeia), altera a Decisão n.º 716/2009/CE e revoga a Decisão n.º 2009/78/CE da Comissão (JO L 331, 15.12. 2010, p. 12).

2. Destinatários

5. As presentes orientações destinam-se às autoridades competentes, na aceção do artigo 4.º, n.º 2, alínea i), do Regulamento (UE) n.º 1093/2010, e às instituições financeiras abrangidas pelas Orientações EBA/GL/2020/14. As autoridades designadas referidas no artigo 131.º, n.º 1, da Diretiva 2013/36/UE que não sejam autoridades competentes são incentivadas a aplicar as presentes orientações. Tanto as autoridades competentes como as designadas são referidas nas presentes orientações como «autoridades relevantes».

3. Execução

Data de aplicação

9. As presentes Orientações são aplicáveis a partir de 20.05.2024.

Revogação

As orientações de 29 de setembro de 2022 (EBA/GL/2022/12) que alteram as orientações relativas à especificação e divulgação dos indicadores de importância sistémica são revogadas e substituídas pelas presentes orientações.

4. Alteração às orientações

10. As orientações EBA/GL/2020/14 são alteradas do seguinte modo:

(a). O n.º 9 passa a ter a seguinte redação:

«9. As autoridades relevantes e as entidades relevantes devem seguir as instruções e especificações relativas aos elementos de dados enumerados no anexo, tal como estabelecido na hiperligação denominada «Instruções para a comunicação de informações» no sítio Web da EBA, na secção G-SII².»

(b). O n.º 10 passa a ter a seguinte redação:

«10. As autoridades relevantes devem aplicar os dados complementares (secções 15 e 16 do anexo das presentes orientações) para fundamentar a sua apreciação de supervisão em conformidade com o artigo 131.º, n.º 10, da Diretiva n.º 2013/36/UE, bem como as rubricas por memória (secções 17 a 22 do anexo) a fim de aumentar a qualidade dos dados e de contribuir para o desenvolvimento de melhorias futuras da metodologia de identificação. As rubricas por memória devem ser complementadas com observações detalhadas das entidades relevantes sobre a qualidade e a disponibilidade dos dados, se for caso disso.»

(c). O n.º 10-A passa a ter a seguinte redação:

«10-A. Nos termos do artigo 131.º, n.º 2-A, da Diretiva 2013/36/UE, que exige uma metodologia de identificação adicional que exclua as atividades transfronteiras no âmbito do Mecanismo Único de Resolução (MUR), e em conformidade com o acordo internacional do Comité de Basileia, de 31 de maio de 2022, no sentido de reconhecer os progressos realizados no desenvolvimento da União Bancária Europeia, as rubricas de dados relevantes para o cálculo dos indicadores de atividade transfronteiras ajustados relativos às instituições com sede nos Estados-Membros que aderem ao MUR devem ser consideradas como parte dos indicadores de atividade transfronteiras, em conformidade com o n.º 12, e não como rubricas complementares ou por memória para a metodologia de identificação e atribuição de subcategorias de G-SII.»

(d). O n.º 11 passa a ter a seguinte redação:

«11. As autoridades relevantes devem assegurar-se de que recolhem todos os dados especificados no anexo das presentes orientações das entidades relevantes que satisfaçam os critérios especificados no n.º 6 das presentes orientações em 31 de dezembro de cada ano.»

(e). O n.º 12 passa a ter a seguinte redação:

«12. As autoridades relevantes devem assegurar que as entidades relevantes divulgam publicamente nos seus sítios Web, numa base anual, os valores dos indicadores especificados nas secções 1 a 14 do anexo das presentes orientações

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

e, caso seja necessária a metodologia de identificação adicional do MUR, as alíneas e), f) e g) da secção 21, bem como quaisquer outros elementos da secção 21 referentes à atividade transjurisdicional do MUR que possam ser considerados relevantes para o cálculo dessa metodologia pela autoridade competente relevante.»

(f). O n.º 14 passa a ter a seguinte redação:

«14. As entidades relevantes devem apresentar as informações a que se refere o n.º 11 às autoridades relevantes e divulgar publicamente as informações a que se refere o n.º 12 numa base anual, o mais tardar quatro meses após cada data de encerramento do exercício financeiro, a contar da data de conclusão do segundo exercício financeiro consecutivo em que o limiar especificado no n.º 6 das presentes orientações tenha sido excedido. Para o efeito, as entidades relevantes devem identificar-se através dos seus identificadores de entidade jurídica (LEI).

(g). O anexo é substituído pelo anexo abaixo.

Anexo

DADOS BANCÁRIOS GERAIS

Secção 1 - Informações gerais	Resposta
Informações gerais prestadas pela autoridade de supervisão relevante:	
(1) Código do país	
(2) Designação do banco	
(3) Data de apresentação das informações (aaaa-mm-dd)	
(4) Moeda de reporte	
(5) Taxa de conversão do euro	
(6) Data de apresentação dos dados (aaaa-mm-dd)	
b. Informações gerais prestadas pela instituição que reporta as informações:	
(1) Unidade de reporte	
(2) Normas contabilísticas	
(3) Data de publicação (aaaa-mm-dd)	
(4) Língua de publicação	
(5) Sítio web de publicação	
(6) Código LEI	

INDICADORES DE DIMENSÃO

Secção 2 - Total das posições em risco	Montante
a. Derivados	
(1) Posição em risco de contraparte dos contratos de derivativos	
(2) Montante nominal máximo dos derivativos de crédito	
(3) Posição em risco potencial futura dos contratos de derivativos	
b. Operações de financiamento através de valores mobiliários (OFVM)	
(1) Valor bruto ajustado das OFVM	
(2) Posição em risco de contraparte das OFVM	
c. Outros ativos	
d. Montante nominal bruto dos elementos extrapatrimoniais	
(1) Elementos sujeitos a um fator de conversão de crédito (CCF) de 0 %	
(2) Elementos sujeitos a um fator de conversão de crédito (CCF) de 20 %	
(3) Elementos sujeitos a um fator de conversão de crédito (CCF) de 50 %	
(4) Elementos sujeitos a um fator de conversão de crédito (CCF) de 20 %	
e. Ajustamentos regulamentares	

f. Indicador do total das posições em risco (total das posições em risco antes dos ajustamentos regulamentares) (soma dos elementos 2.a.(1) até 2.c, 0,1 vezes 2.d.(1), 0,2 vezes 2.d.(2), 0,5 vezes 2.d.(3) e 2.d.(4))
g. Posições em risco de filiais de seguros não incluídas em 2.f., líquidas de intragrupo:
(1) Ativos patrimoniais e extrapatrimoniais de filiais de seguros
(2) Posição em risco potencial futura dos contratos de derivados para filiais de seguros
(3) Valor do investimento nas entidades consolidadas
h. Exposições intragrupo incluídas no ponto 2.f. a filiais de seguros relatadas em 2.g.
i. Indicador do total das exposições, incluindo filiais de seguros (soma dos elementos 2.f., 2.g. (1) até 2.g. (2) menos 2.g. (3) até 2.h.)

INDICADORES DE INTERCONNECTIVIDADE

Secção 3 - Ativos no sistema financeiro	Montante
a. Fundos depositados em ou emprestados a outras instituições financeiras	
(1) Certificados de depósito	
b. Partes de linhas de crédito autorizadas e não utilizadas a favor de outras instituições financeiras	
c. Detenções de títulos emitidos por outras instituições financeiras:	
(1) Títulos de dívida garantidos	
(2) Títulos de dívida privilegiada não garantidos	
(3) Títulos de dívida subordinada	
(4) Papel comercial	
(5) Títulos de capital	
(6) Posições curtas compensatórias associadas aos valores mobiliários específicos incluídos no elemento 3.c.(5)	
d. Posição em risco positiva líquida corrente das operações de financiamento através de valores mobiliários (OFVM) com outras instituições financeiras	
e. Contratos de derivados do mercado de balcão com outras instituições financeiras que apresentem um justo valor positivo líquido	
(1) Justo valor positivo líquido	
(2) Posição em risco potencial futura	
f. Indicador de ativos no sistema financeiro, incluindo filiais de seguros (soma dos elementos 3.a, 3.b até 3.c (5), 3.d e 3.e.(1) e 3.e.(2), menos 3.c.(6)	

Secção 4 - Passivos no sistema financeiro	Montante
a. Fundos depositados por ou resultantes de empréstimos contraídos junto de outras instituições financeiras	
(1) Depósitos devidos a instituições depositárias	
(2) Depósitos devidos a instituições financeiras não-depositárias	
(3) Empréstimos obtidos junto de outras instituições financeiras	
b. Partes de linhas de crédito autorizadas e não utilizadas, obtidas junto de outras instituições financeiras	

c. Posição em risco negativa líquida corrente das operações de financiamento através de valores mobiliários com outras instituições financeiras
d. Contratos de derivados do mercado de balcão com outras instituições financeiras que apresentem um justo valor negativo líquido
(1) Justo valor negativo líquido
(2) Posição em risco potencial futura
e. Indicador de passivos no sistema financeiro, incluindo filiais de seguros (soma dos elementos 4.a.(1) até 4.d.(2))

Secção 5 - Títulos em carteira**Montante**

a. Títulos de dívida garantidos
b. Títulos de dívida privilegiada não garantidos
c. Títulos de dívida subordinada
d. Papel comercial
e. Certificados de depósito
f. Ações ordinárias
g. Ações preferenciais e qualquer outra forma de financiamento subordinado não abrangido pelo elemento 5.c.
H. Indicador de títulos em carteira, incluindo os títulos emitidos por filiais de seguros (soma das rubricas 5.a. a 5.g.)

INDICADORES DE POSSIBILIDADE DE SUBSTITUIÇÃO DOS SERVIÇOS OU DA INFRAESTRUTURA FINANCEIRA

Secção 6 - Pagamentos efetuados durante o ano de referência (excluindo pagamentos intragrupo)**Montante**

a. Dólar australiano (AUD)
b. Dólar canadiano (CAD)
c. Franco suíço (CHF)
d. Iuane chinês (CNY)
e. Euro (EUR)
f. Libra esterlina (GBP)
g. Dólar de Hong Kong (HKD)
h. Rupia indiana (INR)
l. Iene japonês (JPY)
j. Dólar da Nova Zelândia (NZD)
k. Coroa sueca (SEK)
l. Dólar dos Estados Unidos (USD)
m. Indicador da atividade de pagamento (soma dos elementos 6.a até 6.l)

Secção 7 - Ativos sob custódia**Montante**

a. Indicador de ativos sob custódia

Secção 8 - Operações de tomada firme nos mercados obrigacionista e bolsista**Montante**

--

a. Atividade de tomada firme de ações
b. Atividade de tomada firme de títulos de dívida
c. Indicador da atividade de tomada firme (soma dos elementos 8.a até 8.b)

Secção 9 - Volume de negociação	Montante
a. Volume de negociação de títulos emitidos por outras entidades do setor público	
b. Volume de negociação de outros valores mobiliários de rendimento fixo, excluindo transações intragrupo	
c. Subindicador de rendimento fixo do volume de negociação (soma das rubricas 9.a. e 9.b.)	
d. Volume de negociação de ações cotadas, excluindo transações intragrupo	
e. Volume de negociação de todos os outros valores mobiliários, excluindo transações intragrupo	
f. Subindicador do volume de negociação de ações e outros valores mobiliários (soma das rubricas 9.d. e 9.e.)	

INDICADORES DE COMPLEXIDADE

Secção 10 - Montante nominal de derivados do mercado de balcão	Montante
a. Derivados do mercado de balcão objeto de compensação através de uma contraparte central	
b. Derivados do mercado de balcão objeto de uma compensação bilateral	
c. Montante nominal do indicador de derivados do mercado de balcão, incluindo filiais de seguros (soma dos elementos 10.a. e 10.b.)	

Secção 11 - Títulos detidos para negociação e disponíveis para venda	Montante
a. Títulos detidos para negociação (negociação de alta frequência)	
b. Títulos disponíveis para venda (DPV)	
c. Títulos detidos para negociação e DPV que correspondam à definição de ativos de nível 1	
d. Títulos detidos para negociação e DPV que correspondam à definição de ativos de nível 2, aos quais são aplicados fatores de redução	
e. Indicador de títulos detidos para negociação e DPV (soma dos elementos 11.a e 11.b, menos a soma de 11.c e 11.d)	

Secção 12 - Ativos de nível 3	Montante
a. Indicador de ativos de nível 3, incluindo filiais de seguros	

INDICADORES DE ATIVIDADE TRANSFRONTEIRAS

Secção 13 - Créditos transfronteiras	Montante
a. Total de créditos estrangeiros numa base de risco em última análise	
b. Créditos em moeda estrangeira sobre derivados numa base de tomador último de risco	

c. Indicador dos créditos transfronteiras de derivados do mercado de balcão (soma dos elementos 913.a até 913.b)

Secção 14 - Passivos transfronteiras

Montante

a. Passivos estrangeiros numa base de risco imediato, excluindo derivados e incluindo passivos locais em moeda local

b. Passivos estrangeiros sobre derivados numa base de risco imediato

c. Indicador dos passivos transfronteiras (soma dos elementos 14.a. até 14.b.)

DADOS COMPLEMENTARES

Secção 15 - Indicadores complementares

Montante

a. Passivo total

b. Financiamento a retalho

c. Rácio de dependência do financiamento por grosso (diferença entre os elementos 15.a e 15.b, dividido por 15.a)

d. Receitas brutas totais

e. Receitas líquidas totais

f. Receitas líquidas estrangeiras

g. Valor bruto dos fundos em numerário emprestados e justo valor bruto dos títulos emprestados no âmbito de OFVM

h. Valor bruto dos fundos em numerário resultantes da contração de empréstimos e justo valor bruto dos títulos cujo empréstimo tenha sido solicitado no âmbito de OFVM

i. Justo valor positivo bruto das operações de derivados do mercado de balcão

j. Justo valor negativo bruto das operações de derivados do OTC

Montante em unidades individuais

k. Número de jurisdições

Secção 16 - Elementos de dimensão

Montante

a. Títulos detidos até ao vencimento

b. Pagamentos efetuados no ano de referência

(1) Real brasileiro (BRL)

(2) Peso mexicano (MXN)

(3) Coroa norueguesa (NOK)

(4) Rublo russo (RUB)

(5) Dólar singapurense (SGD)

(6) Won sul-coreano (KRW)

ELEMENTOS PARA MEMÓRIA

Secção 17 - Elementos de dimensão

Montante

a. Posição em risco de filiais de seguros já incluídas no âmbito regulamentar e prudencial de consolidação	
b. Valor médio trimestral das posições em risco totais	
c. Valor médio mensal das exposições totais	
Secção 18 - Elementos de interligação	Montante
a. Indicador de ativos intrassistema financeiro (indicador antigo)	
b. Valor médio trimestral dos ativos intrassistema financeiro	
c. Valor médio mensal dos ativos intrassistema financeiro	
d. Indicador de passivos no sistema financeiro (indicador antigo)	
e. Valor médio trimestral dos passivos intrassistema financeiro	
f. Valor médio mensal dos passivos intrassistema financeiro	
g. Indicador dos títulos em dívida (antigo indicador)	
h. Valor médio trimestral dos títulos em carteira	
i. Valor médio mensal dos títulos em carteira	
Secção 19 - Substituibilidade/Infraestrutura financeira. Elementos	Montante
a. Volume de negociação de valores mobiliários emitidos por entidades soberanas, excluindo transações intragrupo	
b. Margem inicial dada a contrapartes centrais em nome de clientes	
c. Margem inicial dada a contrapartes centrais por conta própria do grupo que submete o relatório	
d. Contribuições para o fundo de proteção de contrapartes centrais	
e. Outros mecanismos destinados a contrapartes centrais	
f. Prestação de serviços de liquidação associados a transações compensadas através de contrapartes centrais	
g. Valor médio trimestral dos ativos sob custódia	
h. Valor médio mensal dos ativos sob custódia	
Secção 20 - Elementos de complexidade	Montante
a. Indicador de derivados OTC (antigo indicador)	
b. Montante nominal de derivados do mercado de balcão, incluindo filiais de seguros	
(1) Compensado através de uma contraparte central nos casos em que o grupo (incluindo filiais de seguros) atua como intermediário financeiro (componente da contraparte central)	
(2) Compensado através de uma contraparte central nos casos em que o grupo (incluindo filiais de seguros) atua como intermediário financeiro (componente do cliente)	
(3) Compensado através de uma contraparte central nos casos em que o grupo, incluindo filiais de seguros, atua como agente	
(4) Compensado através de uma contraparte central nos casos em que o grupo, incluindo filiais de seguros, negocia por conta própria	
c. Derivados OTC compensados através de uma contraparte central (exclusão de transição LIBOR)	
d. Valor médio trimestral do montante nominal dos derivados do mercado de balcão	
e. Valor médio mensal do montante nominal dos derivados do mercado de balcão (OTC)	

f. Valor médio trimestral dos títulos negociáveis e dos valores mobiliários disponíveis para venda

g. Valor médio mensal dos valores mobiliários negociáveis e dos valores mobiliários disponíveis para venda

h. Indicador de ativos de nível 3 (indicador antigo)

i. Valor médio trimestral dos ativos de nível 3

j. Valor médio mensal dos ativos de nível 3

k. Ativos de nível 2, incluindo filiais de seguros

(1) Ativos de nível 2, incluindo filiais de seguros, objeto de compensação através de uma contraparte central

(2) Ativos de nível 2, incluindo filiais de seguros, objeto de uma compensação bilateral

(3) Ativos de nível 2, incluindo filiais de seguros

l. Valor médio dos ativos de nível 2, incluindo filiais de seguros

Secção 21 - Elementos de atividade transfronteiras

Montante

a. Indicador de passivos transfronteiras (antigo indicador)

(1) Passivos estrangeiros (excluindo derivados e passivos locais em moeda local)

(2) Eventuais passivos estrangeiros associados a serviços conexos incluídos no elemento 21.a.(1)

(3) Passivos locais em moeda local (excluindo atividade no domínio dos derivados)

b. Passivos locais na moeda local (excluindo atividade em matéria de derivados)

c. Créditos locais transfronteiras em moeda local (excluindo atividade no domínio dos derivados)

d. Créditos locais transfronteiras em moeda local (incluindo atividade no domínio dos derivados)

e. Créditos estrangeiros sobre derivados numa base de risco em última análise (considerando o MUR como uma jurisdição única)

f. Créditos estrangeiros sobre derivados numa base de risco em última análise (considerando o MUR como uma jurisdição única)

g. Passivos estrangeiros numa base de risco imediato, incluindo derivados (considerando o MUR como uma jurisdição única)

(1) Passivos estrangeiros sobre derivados numa base de risco imediato (considerando o MUR como uma jurisdição única)

h. Créditos locais transfronteiras em moeda local, excluindo atividade no domínio dos derivados (considerando a zona euro uma única jurisdição)

i. Créditos locais transfronteiras em moeda local, incluindo atividade no domínio dos derivados (considerando a zona euro uma única jurisdição)

j. Passivos estrangeiros, excluindo derivados e passivos locais em moeda local (considerando a zona euro uma única jurisdição)

(1) Eventuais passivos estrangeiros associados a serviços conexos incluídos no elemento 20.j. (considerando o MUR como uma única jurisdição)

k. Passivos locais em moeda local excluindo derivados (considerando o MUR como uma única jurisdição)

l. Passivos locais em moeda local incluindo derivados (considerando o MUR como uma única jurisdição)

m. Total de posições líquidas locais em moeda local incluindo derivados, no caso de positivos líquidos

n. Total de posições líquidas locais em moeda local incluindo derivados, no caso de negativos líquidos
o. Total de posições líquidas locais em moeda local nos países não pertencentes ao MUR, incluindo derivados, no caso de positivos líquidos (considerando o MUR uma única jurisdição)
p. Total de posições líquidas locais em moeda local nos países não pertencentes ao MUR, incluindo derivados, no caso de negativos líquidos (considerando o MUR uma única jurisdição)
q. Total de posições líquidas locais em moeda local nos países pertencentes ao MUR incluindo derivados (considerando o MUR uma única jurisdição)
r. Créditos internos contabilizados por filiais estrangeiras
s. Créditos internos contabilizados por sucursais estrangeiras
t. Passivos internos contabilizados por filiais estrangeiras
u. Passivos internos contabilizados por sucursais estrangeiras
v. Valor médio trimestral dos créditos transfronteiras
w. Valor médio mensal dos créditos transfronteiras
x. Valor médio trimestral das responsabilidades transfronteiras
y. Valor médio mensal das responsabilidades transfronteiras

Secção 22: Indicadores conexos

a. Receitas líquidas estrangeiras (considerando o MUR uma única jurisdição)
b. Número de jurisdições (considerando o MUR uma única jurisdição)

SÍNTESE DE VERIFICAÇÕES

Secção 23 – Valores dos indicadores (metodologia revista)	Valor do indicador na moeda de comunicação
a. Secção 2 - Indicador do total das posições em risco, incluindo filiais de seguros	
b. Secção 3 - Indicador dos ativos no sistema financeiro, incluindo filiais de seguros	
c. Secção 4 - Indicador dos passivos no sistema financeiro, incluindo filiais de seguros	
d. Secção 5 — Indicador de títulos em carteira, incluindo filiais de seguros	
e. Secção 6 – Indicador da atividade de pagamento	
f. Secção 7 – Indicador dos ativos sob custódia	
g. Secção 8 – Indicador da atividade de tomada firme	
h. Secção 9.c - Subindicador de rendimento fixo do volume de negociação	
i. Secção 9.f - Subindicador do volume de negociação de ações e outros títulos	
j. Secção 10 - Indicador de derivados do mercado de balcão, incluindo filiais de seguros	
k. Secção 11 - Indicador de títulos detidos para negociação e DPV	
l. Secção 12 - Indicador de ativos de nível 3, incluindo filiais de seguros	

m. Secção 13 - Indicador de créditos transfronteiras	
n. Secção 14 - Indicador de passivos transfronteiras	
o. Outras secções	
(1) Ponto 1.a - Informações gerais prestadas pela autoridade de supervisão	
(2) Ponto 1.b - Informações gerais prestadas pela instituição que submete o relatório	
(3) Secção 15 - Elementos complementares	
(4) Secção 16 - Elementos de dimensão	
(5) Secção 17 - Elementos de interligação	
(6) Secção 18 - Elementos de interligação	
(7) Secção 19 - Substituibilidade/Infraestrutura financeira. Elementos	
(8) Secção 20 - Elementos de complexidade	
(9) Secção 21 - Elementos de atividade transfronteiras	
(10) Secção 22 - Indicadores conexos	
Secção 24 – Valores dos indicadores (antiga metodologia)	Valor do indicador na moeda de comunicação
a. Secção 2 - Indicador do total das posições em risco	
b. Secção 18 - Indicador dos ativos no sistema financeiro	
c. Secção 18 - Indicador dos passivos no sistema financeiro	
d. Secção 18 - Indicador dos títulos em carteira	
e. Secção 6 – Indicador da atividade de pagamento	
f. Secção 7 – Indicador dos ativos sob custódia	
g. Secção 8 – Indicador da atividade de tomada firme	
h. Secção 20 - Indicador de derivados do mercado de balcão	
i. Secção 11 - Indicador de títulos detidos para negociação e DPV	
j. Secção 20 - Indicador de ativos de nível 3	
k. Secção 13 - Indicador de passivos transfronteiras	
l. Secção 21 - Indicador de passivos transfronteiras	