|  |
| --- |
| EBA/GL/2020/14 (Verżjoni konsolidata) |
| 4 ta’ Novembru 2020 |

|  |
| --- |
| ØO  Linji gwida |
| dwar l-ispeċifikazzjoni u d-divulgazzjoni tal-indikaturi ta’ importanza sistemika |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | | Data tal-applikazzjoni |
| ØO | | 04.11.2020 |
| Emendat bi: | |  |
| ØA1 | EBA/GL/2023/10 |  |

1. Obbligi ta’ konformità u ta’ rapportar

Status ta’ dawn il-linji gwida

1. Dan id-dokument jinkludi linji gwida maħruġa skont l-Artikolu 16 tar-Regolament (UE) Nru 1093/2010.[[1]](#footnote-2) F’konformità mal-Artikolu 16(3) tar-Regolament (UE) Nru 1093/2010, l-awtoritajiet kompetenti u l-istituzzjonijiet finanzjarji jridu jagħmlu kull sforz sabiex jikkonformaw mal-linji gwida.
2. Il-linji gwida jistabbilixxu l-opinjoni tal-EBA fir-rigward ta’ prattiki superviżorji xierqa fi ħdan is-Sistema Ewropea ta’ Superviżjoni Finanzjarja jew ta’ kif id-dritt tal-Unjoni għandu jiġi applikat f’qasam partikolari. L-awtoritajiet kompetenti kif iddefiniti 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 indirizzati primarjament lejn l-istituzzjonijiet.

Rekwiżiti ta’ rapportar

1. B’konformità mal-Artikolu 16(3) tar-Regolament (UE) Nru 1093/2010, l-awtoritajiet kompetenti jridu jinnotifikaw lill-EBA li jikkonformaw jew hux beħsiebhom jikkonformaw ma’ dawn il-linji gwida, jew inkella jagħtu r-raġunijiet għan-nuqqas ta’ konformità, sa 16.02.2021. 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/2020/14”. In-notifiki għandhom jiġu sottomessi minn persuni bl-awtorità xierqa biex jirrappurtaw il-konformità f’isem l-awtoritajiet kompetenti tagħhom. Kwalunkwe tibdil fl-istatus tal-konformità jrid jiġi rrapportat ukoll lill-EBA.
2. In-notifiki se jiġu ppubblikati fuq is-sit web tal-EBA, f’konformità mal-Artikolu 16(3).
3. Suġġett, kamp ta’ applikazzjoni u definizzjonijiet

Suġġett

1. Dawn il-linji gwidi jirrelataw ma’:
   1. l-ispeċifikazzjoni tal-indikaturi użati għall-identifikazzjoni ta’ istituzzjonijiet globali sistemikament importanti (G-SIIs) kif stabbilit fir-Regolament (UE) Nru 1222/2014 (“l-indikaturi”); u
   2. ir-rappurtar tad-*data* sottostanti (l-indikaturi, id-*data* anċillari u l-entrati ta’ memorandum) u d-divulgazzjoni annwali tal-valuri tal-indikaturi li jirriżultaw użati għall-identifikazzjoni tal-G-SIIs.

Kamp ta’ applikazzjoni

1. Dawn il-linji gwida japplikaw fir-rigward ta’
2. gruppi mmexxija minn istituzzjoni prinċipali tal-UE, kumpanija azzjonarja finanzjarja omm tal-UE jew kumpanija azzjonarja finanzjarja mħallta omm tal-UE; u
3. istituzzjonijiet li mhumiex sussidjarji ta’ istituzzjoni prinċipali tal-UE, kumpanija azzjonarja finanzjarja prinċipali tal-UE jew kumpanija azzjonarja finanzjarja mħallta prinċipali tal-UE

li josservaw miżura tal-iskopertura tal-proporzjon ta’ ingranaġġ li jeċċedi EUR 200 biljun fuq bażi kkonsolidata jew individwali, rispettivament (u inklużi s-sussidjarji tal-assigurazzjoni), bl-użu ta’ rata tal-kambju adegwata li tqis ir-rata tal-kambju ta’ referenza ppubblikata mill-Bank Ċentrali Ewropew applikabbli mal-istandards tas-sena finanzjarja finali u internazzjonali (“l-entitajiet rilevanti”).

Destinatarji

1. Dawn il-linji gwida huma indirizzati lill-awtoritajiet kompetenti kif definit fil-punt (i) tal-Artikolu 4(2) tar-Regolament (UE) Nru 1093/2010 u lill-istituzzjonijiet finanzjarji li fir-rigward tagħhom japplikaw dawn il-linji gwida. L-awtoritajiet nnominati 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”.
2. Implimentazzjoni

Data taʼ applikazzjoni

1. Dawn il-linji gwida japplikaw minn 16.12.2020.

Tħassir

Il-linji gwida riveduti dwar l-ispeċifikazzjoni ulterjuri tal-indikaturi ta’ importanza sistemikament globali u d-divulgazzjoni tagħhom tad-29 ta’ Frar 2016 (EBA/GL/2016/01) hawnhekk qed jiġu mħassra.

1. L-ispeċifikazzjoni tad-*data* u l-indikaturi sottostanti użati għall-identifikazzjoni tal-G-SIIs

⮛A1

1. 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]](#footnote-3)*.
2. 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.

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.

1. Ir-rekwiżiti rigward ir-rappurtar u d-divulgazzjoni minn istituzzjonijiet rilevanti
2. 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.
3. 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-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 rilevantiMeta jiġu biex jirrappurtaw u jiddivulgaw l-informazzjoni msemmija fil-paragrafi 11 u 12, l-entitajiet rilevanti għandhom jużaw il-mudell elettroniku u jsegwu l-istruzzjonijiet annwali ppubblikati għal dan il-għan fuq is-sit web tal-EBA.

⮛O

1. L-entitajiet rilevanti għandhom jirrappurtaw u pubblikament jiddivulgaw l-informazzjoni msemmija fil-paragrafi 11 u 12 fuq bażi annwali, mhux aktar tard minn erba’ xhur wara tmiem ta’ kull sena finanzjarja. Meta jagħmlu dan, l-entitajiet rilevanti għandhom jidentifikaw lilhom infushom billi jużaw l-Identifikaturi tal-Entità Ġuridika (LEIs) tagħhom.

⮛A1

1. 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.

⮛O

1. L-awtoritajiet kompetenti jistgħu jippermettu lill-entitajiet rilevanti li t-tmiem is-sena finanzjarja tagħhom ma tikkoinċidix mal-31 ta’ Diċembru, biex jirrapportaw u jiddivulgaw dik l-informazzjoni abbażi tal-pożizzjoni tagħhom kemm jista’ jkun qrib il-31 ta’ Diċembru. Fi kwalunkwe każ, id-divulgazzjoni tal-informazzjoni għandha sseħħ sa mhux aktar tard mill-31 ta’ Lulju.
2. L-awtoritajiet rilevanti għandhom jiżguraw li d-*data* rrappurtata u divulgata tkun identika għal dik sottomessa lill-Kumitat ta’ Basel dwar is-Superviżjoni Bankarja, fejn applikabbli.
3. Informazzjoni lill-EBA
4. L-awtoritajiet rilevanti għandhom jipprovdu lill-EBA d-*data* kollha, inklużi d-*data* anċillari u l-entrati ta’ memorandum, miġbura skont dawn il-linji gwida sabiex ikunu jistgħu jitqiegħdu fuq is-sit web tal-EBA. L-entitajiet rilevanti għandhom jidentifikaw lilhom infushom bl-użu tal-LEIs tagħhom. L-EBA ma għandhiex tagħmel divulgazzjoni tad-*data* anċillari.

Anness

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| ⮛A1  ***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 | |  |

1. Ir-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). [↑](#footnote-ref-2)
2. https://www.eba.europa.eu/risk-analysis-and-data/global-systemically-important-institutions [↑](#footnote-ref-3)