

RAPPORTAGE OVER HET MINIMUMVEREISTE VOOR EIGEN VERMOGEN EN IN AANMERKING KOMENDE PASSIVA

MREL- en TLAC-TEMPLATES			
Template-nummer	Template-code	Naam template / groep van templates	Verkorte naam
		BEDRAGEN: KERNMAATSTAVEN MREL EN TLAC	
1	M 01.00	Kernmaatstaven MREL en TLAC (af te wikkelen groepen /entiteiten)	KM2
		SAMENSTELLING EN LOOPTIJD	
2	M 02.00	MREL- en TLAC-capaciteit en -samenstelling (af te wikkelen groepen / entiteiten)	TLAC1
3	M 03.00	Interne MREL en interne TLAC	ILAC
4	M 04.00	Financieringsstructuur in aanmerking komende passiva	LIAB-MREL
		RANGORDE SCHULDEISERS	
5	M 05.00	Rangorde schuldeisers (entiteit niet zijnde een af te wikkelen entiteit)	TLAC2
6	M 06.00	Rangorde schuldeisers (af te wikkelen entiteiten)	TLAC3
		CONTRACTSPECIFIEKE INFORMATIE	
7	M 07.00	Onder recht derde land vallende instrumenten	MTCI

NL
BIJLAGE I

M 01.00 – Kernmaatstaven MREL en TLAC (af te wikkelen groepen /entiteiten) (KM2)

		Minimumvereiste voor eigen middelen en in aanmerking komende passiva (MREL)	MSI-vereiste voor eigen vermogen en in aanmerking komende passiva (TLAC)
		0010	0020
	Totaal risicoposten en totale blootstellingsmaatstaf		
0100	Totaal risicoposten (TREA)		
0110	TOTALE BLOOTSTELLINGSMAATSTAF (TEM)		
	Eigen vermogen en in aanmerking komende passiva		
0200	EIGEN VERMOGEN EN IN AANMERKING KOMENDE PASSIVA		
0210	Waarvan: eigen vermogen en achtergestelde passiva		
0220	Waarvan: onder het recht van een derde land vallend		
0230	Waarvan: met een afschrijvings- en omzettingsclausule als bedoeld in artikel 55 van Richtlijn 2014/59/EU		
	Andere bail-inbare passiva		
0250	ANDERE BAIL-INBARE PASSIVA		
0260	Waarvan: onder het recht van een derde land vallend		
0270	Waarvan: met een afschrijvings- en omzettingsclausule als bedoeld in artikel 55 van Richtlijn 2014/59/EU		
0280	Resterende looptijd van < 1 jaar		
0285	Resterende looptijd van ≥ 1 jaar en < 2 jaar		
0290	Resterende looptijd van ≥ 2 jaar		
	Vrijstellingen ratio's en achterstelling		
0300	EIGEN VERMOGEN EN IN AANMERKING KOMENDE PASSIVA ALS TREA-PERCENTAGE		
0310	Waarvan: eigen vermogen en achtergestelde passiva		
0320	EIGEN VERMOGEN EN IN AANMERKING KOMENDE PASSIVA ALS TEM-PERCENTAGE		
0330	Waarvan: eigen vermogen en achtergestelde passiva		
0340	Achterstellingsvrijstelling artikel 72 ter, lid 4, van Verordening (EU) nr. 575/2013 van toepassing? (5 % vrijstelling)		
0350	Totale bedrag toegestane niet-achtergestelde in aanmerking komende passiva-instrumenten indien de in artikel 72 ter, lid 3, van Verordening (EU) nr. 575/2013 bepaalde achterstellingsdiscretie wordt toegepast (vrijstelling van max. 3,5 %)		
0360	Aandeel totale niet-achtergestelde passiva opgenomen in eigen vermogen en in aanmerking komende passiva		

NL
BIJLAGE I

M 02.00 – MREL- en TLAC-capaciteit en -samenstelling (af te wikkelen groepen / entiteiten) (TLAC1)				
		Minimumvereiste voor eigen middelen en in aanmerking komende passiva (MREL)	MSI-vereiste voor eigen vermogen en in aanmerking komende passiva (TLAC)	Pro-memoriepost: Bedragen in aanmerking komend voor MREL, maar niet voor TLAC
		0010	0020	0030
0010	EIGEN VERMOGEN EN IN AANMERKING KOMENDE PASSIVA			
0020	(In aanmerking komend) eigen vermogen			
0030	Tier 1-kernkapitaal			
0040	(In aanmerking komend) aanvullend-tier 1-kapitaal			
0050	(In aanmerking komend) tier 2-kapitaal			
0060	In aanmerking komende passiva			
0070	In aanmerking komende passivabestanddelen vóór aanpassingen			
0080	waarvan: in aanmerking komende passiva beschouwd als structureel achtergesteld			
0090	In aanmerking komende passiva achtergesteld aan uitgesloten passiva			
0100	In aanmerking komende passiva-instrumenten rechtstreeks uitgegeven door de af te wikkelen entiteit (zonder grandfathering)			
0110	In aanmerking komende passiva-instrumenten uitgegeven door andere entiteiten binnen de af te wikkelen groep (zonder grandfathering)			
0120	In aanmerking komende passiva-instrumenten uitgegeven vóór 27 juni 2019			
0130	Tier 2-instrumenten met resterende looptijd van ten minste één jaar, voor zover deze niet als tier 2-bestanddelen kwalificeren			
0132	(-) In aanmerking komende passiva-instrumenten achtergesteld aan uitgesloten passiva			
0135	(-) waarvan: onbenutte bedragen met voorafgaande toestemming			
0140	In aanmerking komende passiva niet achtergesteld aan uitgesloten passiva			
0150	In aanmerking komende passiva niet achtergesteld aan uitgesloten passiva (zonder grandfathering, vóór plafond)			
0160	In aanmerking komende passiva niet achtergesteld aan vóór 27 juni 2019 uitgegeven passiva (vóór plafond)			
0162	(-) In aanmerking komende passiva-instrumenten niet achtergesteld aan uitgesloten passiva			
0165	(-) waarvan: onbenutte bedragen met voorafgaande toestemming			
0170	Na toepassing plafond artikel 72 ter, lid 3, van Verordening (EU) nr. 575/2013 in aanmerking komende bedragen (zonder grandfathering)			
0180	Na toepassing plafond artikel 72 ter, lid 3, van Verordening (EU) nr. 575/2013 in aanmerking komende bedragen bestaande uit vóór 27 juni 2019 uitgegeven bestanddelen			
0190	(-) Aftrekkingen			
0200	(-) Blootstellingen tussen “multiple point of entry” (MPE) af te wikkelen groepen			
0211	(-) Beleggingen in andere in aanmerking komende passiva-instrumenten			
0220	Van in aanmerking komende passiva af te trekken bedrag dat in aanmerking komende passiva overschrijdt (af te trekken van tier 2-kapitaal)			
PRO-MEMORIEPOSTEN				
0400	Tier 1-kernkapitaal (%) beschikbaar nadat aan vereisten voor de entiteit is voldaan			
0410	Gecombineerd buffervereiste (%)			
0420	waarvan: vereiste inzake kapitaalconserveringsbuffer			
0430	waarvan: vereiste inzake contracyclische buffer			
0440	waarvan: vereiste inzake systeemrisicobuffer			
0450	waarvan: buffer inzake mondiaal systeemrelevante instelling (MSI-buffer) of andere systeemrelevante instelling (ASI-buffer)			
0460	Beleggingen in achtergestelde in aanmerking komende passiva van andere instellingen			
0470	Beleggingen in achtergestelde in aanmerking komende passiva van MSI's			
0480	Beleggingen in achtergestelde in aanmerking komende passiva van ASI's			
0490	Beleggingen in achtergestelde in aanmerking komende passiva van andere instellingen			
0500	Uitgesloten passiva			

NL
BIJLAGE I

M 03.00 – Intern MREL en intern TLAC (ILAC)

		Intern MREL	Intern TLAC
		0010	0020
0010	Toepassingsniveau		
	Totaal risicoposten en totale blootstellingsmaatstaf		
0100	Totaal risicoposten (TREA)		
0110	Totale blootstellingsmaatstaf (TEM)		
	In aanmerking komend eigen vermogen en in aanmerking komende passiva		
0200	In aanmerking komend eigen vermogen en in aanmerking komende passiva		
0210	In aanmerking komend eigen vermogen		
0220	Tier 1-kernkapitaal		
0230	In aanmerking komend aanvullend-tier 1-kapitaal		
0240	In aanmerking komend tier 2-kapitaal		
0250	In aanmerking komende passiva en garanties		
0260	In aanmerking komende passiva (met uitsluiting van garanties)		
0265	(-) Eigen in aanmerking komende passiva-instrumenten: Onbenutte bedragen met voorafgaande toestemming		
0270	Garanties afgegeven door de af te wikkelen entiteit en toegestaan door de afwikkelingsautoriteit		
0280	Pro-memorieposten: Door zekerheden gedekte deel garantie		
0290	(-) Eigenvermogensinstrumenten en in aanmerking komende passiva-instrumenten uitgegeven door niet af te wikkelen entiteiten van dezelfde af te wikkelen groep		
0293	(-) waarvan: Eigenvermogensinstrumenten uitgegeven door te liquideren entiteiten		
0295	Van in aanmerking komende passiva af te trekken bedrag dat in aanmerking komende passiva overschrijdt		
	Ratio's van in aanmerking komend eigen vermogen en in aanmerking komende passiva		
0400	Eigen vermogen en in aanmerking komende passiva als TREA-percentages		
0410	waarvan: toegestane garanties		
0420	Eigen vermogen en in aanmerking komende passiva als TEM-percentages		
0430	waarvan: toegestane garanties		
0440	Tier 1-kernkapitaal (%) beschikbaar nadat aan vereisten voor de entiteit is voldaan		
	Pro-memorieposten		
0500	Gecombineerd buffervereiste (%)		
0510	waarvan: vereiste inzake kapitaalconserveringsbuffer		
0520	waarvan: vereiste inzake contracyclische buffer		
0530	waarvan: vereiste inzake systeemrisicobuffer		
0540	waarvan: buffer inzake mondiaal systeemrelevante instelling (MSI-buffer) of andere systeemrelevante instelling (ASI-buffer)		
0550	Andere bail-inbare passiva		
0560	waarvan: onder het recht van een derde land vallend		
0570	waarvan: met een afschrijvings- en omzettingsclausule als bedoeld in artikel 55 van Richtlijn 2014/59/EU		
0580	Resterende looptijd van < 1 jaar		
0590	Resterende looptijd van ≥ 1 jaar en < 2 jaar		
0600	Resterende looptijd van ≥ 2 jaar		
0610	Uitgesloten passiva		
0620	Eigenvermogensinstrumenten uitgegeven door te liquideren entiteiten van dezelfde af te wikkelen groep		
0630	Ratio tussen het bezit aan door te liquideren entiteiten uitgegeven eigenvermogensinstrumenten en in aanmerking komend eigen vermogen en in aanmerking komende passiva		

M 04.00 – Financieringsstructuur in aanmerking komende passiva (LIAB-MREL)		
		Voor MREL / intern MREL in aanmerking komend bedrag
		0010
0100	IN AANMERKING KOMENDE PASSIVA	
0200	Deposito's, niet gedekt en niet preferent ≥ 1 jaar	
0210	waarvan: resterende looptijd ≥ 1 jaar en < 2 jaar	
0220	waarvan: resterende looptijd ≥ 2 jaar	
0230	waarvan: uitgegeven door dochterondernemingen	
0300	Niet door zekerheden gedekte passiva ≥ 1 jaar	
0310	waarvan: resterende looptijd ≥ 1 jaar en < 2 jaar	
0320	waarvan: resterende looptijd ≥ 2 jaar	
0330	waarvan: uitgegeven door dochterondernemingen	
0400	Structured notes ≥ 1 jaar	
0410	waarvan: resterende looptijd ≥ 1 jaar en < 2 jaar	
0420	waarvan: resterende looptijd ≥ 2 jaar	
0430	waarvan: uitgegeven door dochterondernemingen	
0500	Niet-achtergestelde ongedekte passiva ≥ 1 jaar	
0510	waarvan: resterende looptijd ≥ 1 jaar en < 2 jaar	
0520	waarvan: resterende looptijd ≥ 2 jaar	
0530	waarvan: uitgegeven door dochterondernemingen	
0600	Niet-achtergestelde niet-preferente passiva ≥ 1 jaar	
0610	waarvan: resterende looptijd ≥ 1 jaar en < 2 jaar	
0620	waarvan: resterende looptijd ≥ 2 jaar	
0630	waarvan: uitgegeven door dochterondernemingen	
0700	Achtergestelde passiva (niet erkend als eigen vermogen) ≥ 1 jaar	
0710	waarvan: resterende looptijd ≥ 1 jaar en < 2 jaar	
0720	waarvan: resterende looptijd ≥ 2 jaar	
0730	waarvan: uitgegeven door dochterondernemingen	
0800	Andere voor MREL in aanmerking komende passiva ≥ 1 jaar	
0810	waarvan: resterende looptijd ≥ 1 jaar en < 2 jaar	
0820	waarvan: resterende looptijd ≥ 2 jaar	
0830	waarvan: uitgegeven door dochterondernemingen	

NL
BIJLAGE I

M 05.00 – Rangorde schuldeisers (entiteit niet zijnde een af te wikkelen entiteit) (TLAC2)

Rang bij insolventie	Type schuldeiser	Beschrijving rang bij insolventie	Passiva en eigen vermogen		Passiva en eigen vermogen minus uitgesloten passiva						
			waarvan: uitgesloten passiva	waarvan: eigen vermogen en in aanmerking komende passiva ten behoeve van het interne MREL							
				waarvan: met een resterende looptijd van				waarvan: eeuwigdurende effecten			
				≥ 1 jaar < 2 jaar	≥ 2 jaar < 5 jaar	≥ 5 jaar < 10 jaar	≥ 10 jaar				
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120

NL
BIJLAGE I

M 06.00 – Rangorde schuldeisers (af te wikkelen entiteiten) (TLAC3)										
Rang bij insolventie	Beschrijvin g rang bij insolventie	Passiva en eigen vermogen	Passiva en eigen vermogen minus uitgesloten passiva							
			waarvan: uitgesloten passiva	waarvan: eigen vermogen en in aanmerking komende passiva die potentieel in aanmerking komen om aan MREL te voldoen	waarvan: met een resterende looptijd van				waarvan: eeuwigduren de effecten	
		≥ 1 jaar < 2 jaar			≥ 2 jaar < 5 jaar	≥ 5 jaar < 10 jaar	≥ 10 jaar			
		0010			0020	0030	0040	0050		0060

M 07.00 – Onder het recht van een derde land vallende instrumenten (MTCI)

Uitgevende entiteit			Identificatiecode contract	Toepasselijk recht (derde land)	Contractuele erkenning van afschrijvings- en omzettingsbevoegdheden	Door regelgeving voorgeschreven behandeling		Bedrag	Rang bij normale insolventieprocedures		Looptijd	(Eerst mogelijke) call-datum	Regulatory call (J/N)
Naam	Code	Type code				Type eigen vermogen of in aanmerking komende passiva	Type instrument		Toepasselijk recht	Rang bij insolventie			
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120	0130	0140