

OMAVAHENDITE JA KÕLBLIKE KOHUSTUSTE MIINIMUMNÕUDE ARUANDLUS

MAVAHENDITE JA KÕLBLIKE KOHUSTUSTE MIINIMUMNÕUDE (MREL) NING KOGU KAHJUMIKATMISVÕIME (TLAC) VORMID			
Vormi number	Vormi kood	Vormi / vormide rühma nimetus	Lühinimi
		SUMMAD: MRELi JA TLACi KIRJELDAVAD PÕHINÄITAJAD	
1	M 01.00	MRELi ja TLACi kirjeldavad põhinäitajad (kriisilahenduslused grupid/üksused)	KM2
		KOOSTIS JA TÄHTAEG	
2	M 02.00	MRELi ja TLACi summad ja koostis (kriisilahenduslused grupid/üksused)	TLAC1
3	M 03.00	Sisemine MREL ja sisemine TLAC	ILAC
4	M 04.00	Kõlblike kohustuste rahastamisstruktuur	LIAB-MREL
		VÕLAUSALDAJA NÕUETE RAHULDAMISJÄRK	
5	M 05.00	Võlausaldaja nõuete rahuldamisjärk (üksus, kes ei ole kriisilahendusluse subjekt)	TLAC2
6	M 06.00	Võlausaldaja nõuete rahuldamisjärk (kriisilahendusluse subjekt)	TLAC3
		LEPINGUPÕHINE TEAVE	
7	M 07.00	Kolmanda riigi õigusega reguleeritavad instrumendid	MTCI

M 01.00 – MRELi ja TLACi kirjeldavad põhinäitajad (kriisilahendusosalused grupid/üksused) (KM2)

		Omavahendite ja kõlblike kohustuste miinimumnõue (MREL)	Globaalsetele süsteemselt olulistele ettevõtjatele esitatav omavahendite ja kõlblike kohustuste nõue (TLAC)
		0010	0020
	Koguriskipositsioon ja koguriskipositsiooni näitaja		
0100	KOGURISKIPOSITSIOON (TREA)		
0110	KOGURISKIPOSITSIOONI NÄITAJA		
	Omavahendid ja kõlblikud kohustused		
0200	OMAVAHENDID JA KÕLBLIKUD KOHUSTUSED		
0210	millest omavahendid ja allutatud kohustused		
0220	millest kolmanda riigi õigusega reguleeritavad		
0230	millest direktiivi 2014/59/EL artiklis 55 osutatud allahindamise ja konverteerimise klauslit hõlmavad		
	Muud teisendatavad kohustused		
0250	MUUD TEISENDATAVAD KOHUSTUSED		
0260	millest kolmanda riigi õigusega reguleeritavad		
0270	millest direktiivi 2014/59/EL artiklis 55 osutatud allahindamise ja konverteerimise klauslit hõlmavad		
0280	Järelejäänud tähtaeg < 1 aasta		
0285	Järelejäänud tähtaeg ≥ 1 aasta ja < 2 aastat		
0290	Järelejäänud tähtaeg ≥ 2 aastat		
	Suhtarvud ja allutatuse erandid		
0300	OMAVAHENDID JA KÕLBLIKUD KOHUSTUSED PROTSENDINA KOGURISKIPOSITSIOONIST		
0310	millest omavahendid ja allutatud kohustused		
0320	OMAVAHENDID JA KÕLBLIKUD KOHUSTUSED PROTSENDINA KOGURISKIPOSITSIOONI NÄITAJAST		
0330	millest omavahendid ja allutatud kohustused		
0340	Kas kohaldatakse määruse (EL) nr 575/2013 artikli 72b lõikes 4 sätestatud allutatuse erandit? (5 % erand)		
0350	Lubatud allutamata kõlblike kohustuste instrumentide kogusumma, kui kohaldatakse määruse (EL) nr 575/2013 artikli 72b lõikes 3 sätestatud allutatuse määramise kaalutusõigust (kuni 3,5 % erand)		
0360	Omavahendite ja kõlblike kohustuste hulka arvatud allutamata kohustuste osakaal kokku		

ET
I LISA

M 02.00 – MRELi ja TLACi summad ja koostis (kriisilahendusalusel grupid/üksused) (TLAC1)				
		Omavahendite ja kõlblike kohustuste miinimumnõue (MREL)	Globaalsetele süsteemselt olulistele ettevõtjatele esitav omavahendite ja kõlblike kohustuste nõue (TLAC)	Memokirje: summad, mis on kõlblikud MRELi (kuid mitte TLACi) kohaldamisel
		0010	0020	0030
0010	OMAVAHENDID JA KÕLBLIKUD KOHUSTUSED			
0020	(Kõlblikud) omavahendid			
0030	Esimese taseme põhiomavahendid			
0040	(Kõlblikud) täiendavad esimese taseme omavahendid			
0050	(Kõlblikud) teise taseme omavahendid			
0060	Kõlblikud kohustused			
0070	Kõlblike kohustuste kirjed enne korrigeerimisi			
0080	millest kõlblikud kohustused, mis loetakse struktuurselt allutatuks			
0090	Kõlblikud kohustused, mis on allutatud väljajäetud kohustustele			
0100	Kõlblike kohustuste instrumendid, mille kriisilahendussubjekt on otse emiteerinud (mille suhtes ei kohaldata varem kehtinud nõudeid)			
0110	Kõlblike kohustuste instrumendid, mille on emiteerinud muud kriisilahendusala grupi üksused (mille suhtes ei kohaldata varem kehtinud nõudeid)			
0120	Enne 27. juunit 2019 emiteeritud kõlblike kohustuste instrumendid			
0130	Teise taseme omavahenditesse kuuluvad instrumendid, mille järelejäänud tähtaeg on vähemalt üks aasta, sellises ulatuses, kuivõrd need ei kvalifitseeru teise taseme omavahendite kirieteks			
0132	Oma kõlblike kohustuste instrumendid, mis on allutatud väljajäetud kohustustele			
0135	(–) millest: eelneva loa kasutamata summad			
0140	Kõlblikud kohustused, mis ei ole allutatud väljajäetud kohustustele			
0150	Kõlblikud kohustused, mis ei ole allutatud väljajäetud kohustustele (mille suhtes ei kohaldata varem kehtinud nõudeid; enne ülempiiri kohaldamist)			
0160	Kõlblikud kohustused, mis ei ole allutatud väljajäetud kohustustele ja mis on emiteeritud enne 27. juunit 2019 (enne ülempiiri kohaldamist)			
0162	(–) Oma kõlblikud kohustused, mis ei ole allutatud väljajäetud kohustustele			
0165	(–) millest: eelneva loa kasutamata summad			
0170	Kõlblikud summad pärast määruse (EL) nr 575/2013 artikli 72b lõikes 3 sätestatud ülempiiri kohaldamist (mille suhtes ei kohaldata varem kehtinud nõudeid)			
0180	Kõlblikud summad pärast määruse (EL) nr 575/2013 artikli 72b lõikes 3 sätestatud ülempiiri kohaldamist, mille moodustavad enne 27. juunit 2019 emiteeritud kirjed			
0190	(–) Mahaarvamised			
0200	(–) Riskipositsioonid kriisilahendusala grupi vahel mitme isiku suhtes kriisilahenduse algatamise korral			
0211	(–) Investeeringud muudesse kõlblike kohustuste instrumentidesse			
0220	Kõlblikest kohustustest mahaarvamiste summa, mis ületab kõlblike kohustusi (maha arvatud teise taseme omavahenditest)			
MEMOKIRJED				
0400	Esimese taseme põhiomavahendid (%), mis on kättesaadavad pärast üksuse nõuete täitmist			
0410	Kombineeritud puhvri nõue (%)			
0420	millest kapitali säilitamise puhvri nõue			
0430	millest vastutsüklilise puhvri nõue			
0440	millest süsteemse riski puhvri nõue			
0450	millest globaalse süsteemselt olulise ettevõtja puhver või muu süsteemselt olulise ettevõtja puhver			
0460	Investeeringud muude ettevõtjate allutatud kõlblikesse kohustustesse			
0470	Investeeringud globaalsete süsteemselt oluliste ettevõtjate allutatud kõlblikesse kohustustesse			
0480	Investeeringud muude süsteemselt oluliste ettevõtjate allutatud kõlblikesse kohustustesse			
0490	Investeeringud muude ettevõtjate allutatud kõlblikesse kohustustesse			
0500	Väljajäetud kohustused			

ET
I LISA

M 03.00 – sisemine MREL ja sisemine TLAC (ILAC)

		Sisemine MREL	Sisemine TLAC
		0010	0020
0010	Kohaldamise tase		
	Koguriskipositsioon ja koguriskipositsiooni näitaja		
0100	Koguriskipositsioon (TREA)		
0110	Koguriskipositsiooni näitaja		
	Kõlblikud omavahendid ja kõlblikud kohustused		
0200	Kõlblikud omavahendid ja kõlblikud kohustused		
0210	Kõlblikud omavahendid		
0220	Esimese taseme põhiomavahendid		
0230	Kõlblikud täiendavad esimese taseme omavahendid		
0240	Kõlblikud teise taseme omavahendid		
0250	Kõlblikud kohustused ja garantiid		
0260	Kõlblikud kohustused (v.a garantiid)		
0265	(–) Oma kõlblike kohustuste instrumendid: eelneva loa kasutamata summad		
0270	Kriisilahendussubjekti antud ja kriisilahendusasutuse lubatud garantiid		
0280	Memokirje: garantii kollateraliseeritud osa		
0290	(–) Omavahenditesse kuuluvad instrumendid ja kõlblike kohustuste instrumendid, mille on emiteerinud samasse kriisilahendusalausesse gruppi kuuluvad muud kui kriisilahendussubjektid		
0293	(–) millest: likvideerimissubjektide emiteeritud omavahenditesse kuuluvad instrumendid		
0295	Kõlblikest kohustustest mahaarvamiste summa, mis ületab kõlblike kohustusi		
	Kõlblike omavahendite ja kõlblike kohustuste suhtarvud		
0400	Omavahendid ja kõlblikud kohustused protsendina koguriskipositsioonist		
0410	millest lubatud garantiid		
0420	Omavahendid ja kõlblikud kohustused protsendina koguriskipositsiooni näitajast		
0430	millest lubatud garantiid		
0440	Esimese taseme põhiomavahendid (%), mis on kättesaadavad pärast üksuse nõuete täitmist		
	Memokirjed		
0500	Kombineeritud puhvri nõue (%)		
0510	millest kapitali säilitamise puhvri nõue		
0520	millest vastutsüklilise puhvri nõue		
0530	millest süsteemse riski puhvri nõue		
0540	millest globaalse süsteemselt olulise ettevõtja puhver või muu süsteemselt olulise ettevõtja puhver		
0550	Muud teisendatavad kohustused		
0560	millest kolmanda riigi õigusega reguleeritavad		
0570	millest direktiivi 2014/59/EL artiklis 55 osutatud allahindamise ja konverteerimise klauslit hõlmavad		
0580	Järelejäänud tähtaeg < 1 aasta		
0590	Järelejäänud tähtaeg ≥ 1 aasta ja < 2 aastat		
0600	Järelejäänud tähtaeg ≥ 2 aastat		
0610	Väljajäetud kohustused		
0620	Omavahenditesse kuuluvad instrumendid, mille on emiteerinud samasse kriisilahendusalausesse gruppi kuuluvad likvideerimissubjektid		
0630	Sellistes omavahenditesse kuuluvates instrumentides, mille on emiteerinud likvideerimissubjektid, olevate osaluste suhe kõlblikesse omavahenditesse ja kõlblikesse kohustustesse		

M 04.00 – kõlblike kohustuste rahastamisstruktuur (LIAB MREL)		
		Kõlblik summa MRELi / sisemise MRELi kohaldamisel
		0010
0100	KÕLBLIKUD KOHUSTUSED	
0200	Hoiused, tagamata ja mitte-eelistatud ≥ 1 aasta	
0210	millest järelejäänud tähtaeg ≥ 1 aasta < 2 aastat	
0220	millest järelejäänud tähtaeg ≥ 2 aastat	
0230	millest tütaretttevõtjate emiteeritud	
0300	Kollateraliseerimata tagatud kohustused ≥ 1 aasta	
0310	millest järelejäänud tähtaeg ≥ 1 aasta < 2 aastat	
0320	millest järelejäänud tähtaeg ≥ 2 aastat	
0330	millest tütaretttevõtjate emiteeritud	
0400	Struktureeritud väärtpaberid ≥ 1 aasta	
0410	millest järelejäänud tähtaeg ≥ 1 aasta < 2 aastat	
0420	millest järelejäänud tähtaeg ≥ 2 aastat	
0430	millest tütaretttevõtjate emiteeritud	
0500	Kõrgema nõudeõiguse järgu tagatiseta kohustused ≥ 1 aasta	
0510	millest järelejäänud tähtaeg ≥ 1 aasta < 2 aastat	
0520	millest järelejäänud tähtaeg ≥ 2 aastat	
0530	millest tütaretttevõtjate emiteeritud	
0600	Kõrgema nõudeõiguse järguga mitte-eelistatud kohustused ≥ 1 aasta	
0610	millest järelejäänud tähtaeg ≥ 1 aasta < 2 aastat	
0620	millest järelejäänud tähtaeg ≥ 2 aastat	
0630	millest tütaretttevõtjate emiteeritud	
0700	Allutatud kohustused (mida ei käsitata omavahenditena) ≥ 1 aasta	
0710	millest järelejäänud tähtaeg ≥ 1 aasta < 2 aastat	
0720	millest järelejäänud tähtaeg ≥ 2 aastat	
0730	millest tütaretttevõtjate emiteeritud	
0800	Muud MRELi kohaldamisel kõlblikud kohustused ≥ 1 aasta	
0810	millest järelejäänud tähtaeg ≥ 1 aasta < 2 aastat	
0820	millest järelejäänud tähtaeg ≥ 2 aastat	
0830	millest tütaretttevõtjate emiteeritud	

ET
I LISA

M 05.00 – võlausaldaja nõuete rahuldamisjärk (üksus, mis ei ole kriisilahendussubjekt) (TLAC2)

Nõuete rahuldamisjärk maksejõuetusmenetluses	Võlausaldaja liik	Nõuete rahuldamisjärgu kirjeldus	Kohustused ja omavahendid		Kohustused ja omavahendid, millest on lahutatud väljajäetud kohustused						
				millest väljajäetud kohustused		millest					
						millest omavahendid ja kõlblikud kohustused sisemise MRELi kohaldamisel	millest järelejäänud tähtajaga				millest tähtajatud väärtpaberid
							≥ 1 aasta < 2 aastat	≥ 2 aasta < 5 aastat	≥ 5 aastat < 10 aastat	≥ 10 aastat	
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120

ET
I LISA

M 06.00 – võlausaldaja nõuete rahuldamisjärk (kriisilahendussubjektid) (TLAC3)

Nõuete rahuldamisjärk maksejõuetusmenetluses	Nõuete rahuldamisjärgu kirjeldus	Kohustused ja omavahendid		Kohustused ja omavahendid, millest on lahutatud väljajäetud kohustused						
			millest väljajäetud kohustused		millest omavahendid ja kõlblikud kohustused, mis on potentsiaalselt kõlblikud MRELi täitmiseks	millest järelejäänud tähtajaga				millest tähtajatud väärtpaberid
						≥ 1 aasta < 2 aastat	≥ 2 aasta < 5 aastat	≥ 5 aastat < 10 aastat	≥ 10 aastat	
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110

M 07.00 – kolmanda riigi õigusega reguleeritavad instrumendid (MTCI)

Emiteerinud üksus			Lepingu tunnus	Kohaldata v õigus (kolmas riik)	Allahindamise ja konverteerimise õiguse lepinguline tunnustamine	Regulatiivne käsitlemine		Summa	Nõuete rahuldamisjark tavalises maksejõuetusmenetluse		Tähtaeg	(Esimene) tagasiost uõiguse kuupäev	Regulatii vne tagasiost (jah/ei)
Nimi	Kood	Koodi liik				Omavahendite või kõlblike kohustuste liik	Instrumendi liik		Kohaldata v õigus	Nõuete rahuldamisjark			
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120	0130	0140