

II INFORMACJI NA TEMAT MINIMALNEGO WYMOGU W ZAKRESIE FUNDUSZY WŁASNYCH I ZOBOWIĄZAŃ KWALIFIKAC

Kod wzoru	Nazwa wzoru
EU KM2	Najważniejsze wskaźniki – MREL i w stosownych przypadkach wymóg w zakresie funduszy własnych i zobowiązań kwalifikowalnych dotyczący globalnych instytucji o znaczeniu systemowym
EU TLAC1	Elementy składowe – MREL i w stosownych przypadkach wymóg w zakresie funduszy własnych i zobowiązań kwalifikowalnych dotyczący globalnych instytucji o znaczeniu systemowym
EU ILAC	Wewnętrzna zdolność do pokrycia strat: wewnętrzny MREL i w stosownych przypadkach wymóg w zakresie funduszy własnych i zobowiązań kwalifikowalnych dotyczący globalnych instytucji o znaczeniu systemowym spoza UE
EU TLAC2	Kolejność zaspokajania wierzycieli – podmiot, który nie jest podmiotem restrukturyzacji i uporządkowanej likwidacji
EU TLAC3	Kolejność zaspokajania wierzycieli – podmiot restrukturyzacji i uporządkowanej likwidacji

EU KM2: Najważniejsze wskaźniki – MREL i w stosownych przypadkach wymóg w zakresie funduszy własnych i zobow

		a	b	c	d	e	f
		Minimalny wymóg w zakresie funduszy własnych i zobowiązań kwalifikowalnych (MREL)	Wymóg w zakresie funduszy własnych i zobowiązań kwalifikowalnych dotyczący globalnych instytucji o znaczeniu systemowym (TLAC)				
		T	T	T-1	T-2	T-3	T-4
Fundusze własne i zobowiązania kwalifikowalne, współczynniki i elementy składowe							
1	Fundusze własne i zobowiązania kwalifikowalne						
EU-1a	W tym fundusze własne i zobowiązania podporządkowane						
2	Łączna kwota ekspozycji na ryzyko grupy restrukturyzacji i uporządkowanej likwidacji (TREA)						
3	Fundusze własne i zobowiązania kwalifikowalne wyrażone jako odsetek TREA						
EU-3a	W tym fundusze własne i zobowiązania podporządkowane						
4	Miara ekspozycji całkowitej (TEM) grupy restrukturyzacji i uporządkowanej likwidacji						
5	Fundusze własne i zobowiązania kwalifikowalne wyrażone jako odsetek TEM						
EU-5a	W tym fundusze własne i zobowiązania podporządkowane						
6a	Czy ma zastosowanie wyłączenie z podporządkowania przewidziane w art. 72b ust. 4 rozporządzenia (UE) nr 575/2013? (wyłączenie w wysokości 5 %)						
6b	Kwota łączna dozwolonych niepodporządkowanych instrumentów zobowiązań kwalifikowalnych, jeżeli swoboda decyzji co do podporządkowania zgodnie z art. 72b ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 575/2013 jest stosowana (wyłączenie w wysokości maks. 3,5 %)						
6c	w przypadku gdy ograniczone wyłączenie z podporządkowania ma zastosowanie zgodnie z art. 72b ust. 3 rozporządzenia (UE) nr 575/2013, kwota wyemitowanych środków, których stopień uprzywilejowania jest równy stopniowi uprzywilejowania wyłączonych zobowiązań i które ujęto w wierszu 1, podzielona przez kwotę wyemitowanych środków, których stopień uprzywilejowania jest równy stopniowi uprzywilejowania wyłączonych zobowiązań i które zostałyby ujęte w wierszu 1, jeżeli nie zastosowano by ograniczenia (%)						
Minimalny wymóg w zakresie funduszy własnych i zobowiązań kwalifikowalnych (MREL)							
EU-7	MREL wyrażony jako odsetek TREA						
EU-8	W tym część, która musi zostać spełniona z wykorzystaniem funduszy własnych lub zobowiązań podporządkowanych						
EU-9	MREL wyrażony jako odsetek TEM						
EU-10	W tym część, która musi zostać spełniona z wykorzystaniem funduszy własnych lub zobowiązań podporządkowanych						

EU TLAC1 – Elementy składowe – MREL i w stosownych przypadkach wymóg w zakresie funduszy własnych i zobowiązań kwalifikowalnych dotycząc

		a	b	c
		Minimalny wymóg w zakresie funduszy własnych i zobowiązań kwalifikowalnych (MREL)	Wymóg w zakresie funduszy własnych i zobowiązań kwalifikowalnych dotyczący globalnych instytucji o znaczeniu systemowym (TLAC)	Pozycja uzupełniająca: Kwoty kwalifikujące się do celów MREL, ale nie do celów TLAC
Fundusze własne i zobowiązania kwalifikowalne oraz korekty				
1	Kapitał podstawowy Tier I			
2	Kapitał dodatkowy Tier I			
3	Zbiór pusty w UE			
4	Zbiór pusty w UE			
5	Zbiór pusty w UE			
6	Kapitał Tier II			
7	Zbiór pusty w UE			
8	Zbiór pusty w UE			
11	Fundusze własne do celów art. 92a rozporządzenia (UE) nr 575/2013 i art. 45 dyrektywy 2014/59/UE			
Fundusze własne i zobowiązania kwalifikowalne: Elementy kapitału nieregulacyjnego				
12	Instrumenty zobowiązań kwalifikowalnych wyemitowane bezpośrednio przez podmiot restrukturyzacji i uporządkowanej likwidacji podporządkowane wyłączonym zobowiązaniom (niepodlegające zasadzie praw nabytych)			
EU-12a	Instrumenty zobowiązań kwalifikowalnych wyemitowane przez inne podmioty należące do grupy restrukturyzacji i uporządkowanej likwidacji podporządkowane wyłączonym zobowiązaniom (niepodlegające zasadzie praw nabytych)			
EU-12b	Instrumenty zobowiązań kwalifikowalnych podporządkowane wyłączonym zobowiązaniom wyemitowane przed dniem 27 czerwca 2019 r. (podporządkowane podlegające zasadzie praw nabytych)			
EU-12c	Instrumenty w Tier II o rezydualnym terminie zapadalności wynoszącym co najmniej jeden rok, w takim zakresie, w jakim nie kwalifikują się one jako pozycje w Tier II			
13	Zobowiązania kwalifikowalne niepodporządkowane wyłączonym zobowiązaniom (niepodlegające zasadzie praw nabytych, przed zastosowaniem ograniczenia)			
EU-13a	Zobowiązania kwalifikowalne niepodporządkowane wyłączonym zobowiązaniom wyemitowane przed dniem 27 czerwca 2019 r. (przed zastosowaniem ograniczenia)			
14	Kwota niepodporządkowanych instrumentów zobowiązań kwalifikowalnych, w stosownych przypadkach po zastosowaniu przepisów art. 72b ust. 3 CRR			
15	Zbiór pusty w UE			
16	Zbiór pusty w UE			
17	Pozycje zobowiązań kwalifikowalnych przed korektą			
EU-17a	W tym pozycje zobowiązań podporządkowanych			
Fundusze własne i zobowiązania kwalifikowalne: Korekty elementów kapitału nieregulacyjnego				
18	Pozycje funduszy własnych i zobowiązań kwalifikowalnych przed korektą			
19	(Odliczenie ekspozycji między grupami restrukturyzacji i uporządkowanej likwidacji realizującymi strategię wielokrotnych punktów kontaktowych)			
20	(Odliczenie inwestycji w inne instrumenty zobowiązań kwalifikowalnych)			
21	Zbiór pusty w UE			
22	Fundusze własne i zobowiązania kwalifikowalne po korekcie			
EU-22a	W tym: fundusze własne i zobowiązania podporządkowane			
Kwota ekspozycji ważonej ryzykiem i miara ekspozycji wskaźnika dźwigni grupy restrukturyzacji i uporządkowanej likwidacji				
23	Łączna kwota ekspozycji na ryzyko (TREA)			
24	Miara ekspozycji całkowitej (TEM)			
Współczynnik funduszy własnych i zobowiązań kwalifikowalnych				
25	Fundusze własne i zobowiązania kwalifikowalne wyrażone jako odsetek TREA			
EU-25a	W tym fundusze własne i zobowiązania podporządkowane			
26	Fundusze własne i zobowiązania kwalifikowalne wyrażone jako odsetek TEM			
EU-26a	W tym fundusze własne i zobowiązania podporządkowane			
27	Kapitał podstawowy Tier I (wyrażony jako odsetek TREA) dostępny po spełnieniu wymogów grupy restrukturyzacji i uporządkowanej likwidacji			
28	Wymóg połączonego bufora specyficznego dla instytucji			
29	w tym wymóg utrzymywania bufora zabezpieczającego			
30	w tym wymóg utrzymywania bufora antycyklicznego			
31	w tym wymóg utrzymywania bufora ryzyka systemowego			
EU-31a	w tym bufor globalnych instytucji o znaczeniu systemowym lub innych instytucji o znaczeniu systemowym			
Pozycje uzupełniające				
EU-32	Łączna kwota wyłączonych zobowiązań, o których mowa w art. 72a ust. 2 rozporządzenia (UE) nr 575/2013			

EU ILAC – Wewnętrzna zdolność do pokrycia strat: wewnętrzny MREL i w stosownych przypadkach wymóg w zakresie funduszy własnych i zobowiązań kwalifikowalnych dotyczący globalnych instytucji o znaczeniu systemowym spoza UE

		a	b	c
		Minimalny wymóg w zakresie funduszy własnych i zobowiązań kwalifikowalnych (wewnętrzny MREL)	Wymóg w zakresie funduszy własnych i zobowiązań kwalifikowalnych dotyczący globalnych instytucji o znaczeniu systemowym spoza UE (wewnętrzna TLAC)	Informacje jakościowe
Wymóg mający zastosowanie i poziom stosowania				
EU-1	Czy podmiot podlega wymogowi w zakresie funduszy własnych i zobowiązań kwalifikowalnych dotyczącemu globalnych instytucji o znaczeniu systemowym spoza UE? (T/N)			
EU-2	Jeżeli odpowiedź w przypadku EU-1 jest twierdząca, czy wymóg ma zastosowanie na zasadzie skonsolidowanej czy indywidualnej? (S/I)			
EU-2a	Czy podmiot podlega wewnętrznemu MREL? (T/N)			
EU-2b	Jeżeli odpowiedź w przypadku EU-2a jest twierdząca, czy wymóg ma zastosowanie na zasadzie skonsolidowanej czy indywidualnej? (S/I)			
Fundusze własne i zobowiązania kwalifikowalne				
EU-3	Kapitał podstawowy Tier I			
EU-4	Kwalifikowalny kapitał dodatkowy Tier I			
EU-5	Kwalifikowalny kapitał Tier II			
EU-6	Kwalifikowalne fundusze własne			
EU-7	Zobowiązania kwalifikowalne			
EU-8	w tym dozwolone gwarancje			
EU-9a	(Korekty)			
EU-9b	Pozycje funduszy własnych i zobowiązań kwalifikowalnych po korekcie			
Łączna kwota ekspozycji na ryzyko i miara ekspozycji całkowitej				
EU-10	Łączna kwota ekspozycji na ryzyko (TREA)			
EU-11	Miara ekspozycji całkowitej (TEM)			
Współczynnik funduszy własnych i zobowiązań kwalifikowalnych				
EU-12	Fundusze własne i zobowiązania kwalifikowalne wyrażone jako odsetek TREA			
EU-13	w tym dozwolone gwarancje			
EU-14	Fundusze własne i zobowiązania kwalifikowalne wyrażone jako odsetek TEM			
EU-15	w tym dozwolone gwarancje			
EU-16	Kapitał podstawowy Tier I (wyrażony jako odsetek TREA) dostępny po spełnieniu obowiązujących podmiot wymogów			
EU-17	Wymóg połączonego bufora specyficznego dla instytucji			
Wymogi				
EU-18	Wymóg wyrażony jako odsetek TREA			
EU-19	w tym część wymogu, którą można spełnić z wykorzystaniem gwarancji			
EU-20	Wymóg wyrażony jako odsetek TEM			
EU-21	w tym część wymogu, którą można spełnić z wykorzystaniem gwarancji			
Pozycje uzupełniające				
EU-22	Łączna kwota wyłączonych zobowiązań, o których mowa w art. 72a ust. 2 rozporządzenia (UE) nr 575/2013			

EU TLAC2a: Kolejność zaspokajania wierzycieli – podmiot, który nie jest podmiotem restrukturyzacji i uporządkowanej likwidacji

		Klasyfikacja stopni uprzywilejowania w postępowaniu upadłościowym							Suma kolumn 1–n
		1	1	2	2	...	n	n	
		(najniższy stopień)	(najniższy stopień)				(najwyższy stopień)	(najwyższy stopień)	
		Podmiot restrukturyzacji i uporządkowanej likwidacji	Inne	Podmiot restrukturyzacji i uporządkowanej likwidacji	Inne	...	Podmiot restrukturyzacji i uporządkowanej likwidacji	Inne	
1	Zbiór pusty w UE								
2	Opis stopnia uprzywilejowania w postępowaniu upadłościowym (tekst dowolny)								
3	Zobowiązania i fundusze własne								
4	w tym wyłączone zobowiązania								
5	Zobowiązania i fundusze własne pomniejszone o wyłączone zobowiązania								
6	Podzbiór zobowiązań i funduszy własnych pomniejszonych o wyłączone zobowiązania, które są funduszami własnymi i zobowiązaniami kwalifikowalnymi do celów [należy wybrać właściwe: wewnętrznego MREL/wewnętrznej TLAC]								
7	w tym rezydualny termin zapadalności ≥ 1 rok < 2 lata								
8	w tym rezydualny termin zapadalności ≥ 2 lata < 5 lat								
9	w tym rezydualny termin zapadalności ≥ 5 lat < 10 lat								
10	w tym rezydualny termin zapadalności ≥ 10 lat, ale z wyłączeniem wieczystych papierów wartościowych								
11	w tym wieczyste papiery wartościowe								

EU TLAC2b: Kolejność zaspokajania wierzycieli – podmiot, który nie jest podmiotem restrukturyzacji i uporządkowanej likwidacji

		Klasyfikacja stopni uprzywilejowania w postępowaniu upadłościowym							Suma kolumn 1–n
		1	1	2	2	...	n	n	
		(najniższy stopień)	(najniższy stopień)				(najwyższy stopień)	(najwyższy stopień)	
		Podmiot restrukturyzacji i uporządkowanej likwidacji	Inne	Podmiot restrukturyzacji i uporządkowanej likwidacji	Inne	...	Podmiot restrukturyzacji i uporządkowanej likwidacji	Inne	
1	Zbiór pusty w UE								
2	Opis stopnia uprzywilejowania w postępowaniu upadłościowym (tekst dowolny)								
3	Zbiór pusty w UE								
4	Zbiór pusty w UE								
5	Zbiór pusty w UE								
6	Fundusze własne i zobowiązania kwalifikowalne do celów wewnętrznego MREL								
7	w tym rezydualny termin zapadalności ≥ 1 rok < 2 lata								
8	w tym rezydualny termin zapadalności ≥ 2 lata < 5 lat								
9	w tym rezydualny termin zapadalności ≥ 5 lat < 10 lat								
10	w tym rezydualny termin zapadalności ≥ 10 lat, ale z wyłączeniem wieczystych papierów wartościowych								
11	w tym wieczyste papiery wartościowe								

EU TLAC3a: Kolejność zaspokajania wierzycieli – podmiot restrukturyzacji i uporządkowanej likwidacji

		Klasyfikacja stopni uprzywilejowania w postępowaniu upadłościowym				Suma kolumn 1–n
		1	2	...	n	
		(najniższy stopień)			(najwyższy stopień)	
1	Opis stopnia uprzywilejowania w postępowaniu upadłościowym (tekst dowolny)					
2	Zobowiązania i fundusze własne					
3	w tym wyłączone zobowiązania					
4	Zobowiązania i fundusze własne pomniejszone o wyłączone zobowiązania					
5	Podzbiór zobowiązań i funduszy własnych pomniejszonych o wyłączone zobowiązania, które są funduszami własnymi i zobowiązaniami potencjalnie kwalifikującymi się do spełnienia [należy wybrać właściwe: MREL/TLAC]					
6	w tym rezydualny termin zapadalności ≥ 1 rok < 2 lata					
7	w tym rezydualny termin zapadalności ≥ 2 lata < 5 lat					
8	w tym rezydualny termin zapadalności ≥ 5 lat < 10 lat					
9	w tym rezydualny termin zapadalności ≥ 10 lat, ale z wyłączeniem wieczystych papierów wartościowych					
10	w tym wieczyste papiery wartościowe					

EU TLAC3b: Kolejność zaspokajania wierzycieli – podmiot restrukturyzacji i uporządkowanej likwidacji

		Klasyfikacja stopni uprzywilejowania w postępowaniu upadłościowym				Suma kolumn 1–n
		1	2	...	n	
		(najniższy stopień)			(najwyższy stopień)	
1	Opis stopnia uprzywilejowania w postępowaniu upadłościowym (tekst dowolny)					
2	Zbiór pusty w UE					
3	Zbiór pusty w UE					
4	Zbiór pusty w UE					
5	Fundusze własne i zobowiązania potencjalnie kwalifikujące się do spełnienia MREL					
6	w tym rezydualny termin zapadalności ≥ 1 rok < 2 lata					
7	w tym rezydualny termin zapadalności ≥ 2 lata < 5 lat					
8	w tym rezydualny termin zapadalności ≥ 5 lat < 10 lat					
9	w tym rezydualny termin zapadalności ≥ 10 lat, ale z wyłączeniem wieczystych papierów wartościowych					
10	w tym wieczyste papiery wartościowe					