**MT  
ANNESS VIII**

**“ANNESS XXI**

**STRUZZJONIJIET GĦALL-MILI TAL-FORMOLA DWAR IL-KONĊENTRAZZJONI TAL-KAPAĊITÀ TA’ KONTROBILANĊ (C 71.00) TAL-ANNESS XX**

Konċentrazzjoni tal-Kapaċità ta’ Kontrobilanċ minn emittent/kontroparti (CCC)(C 71.00)

1. Sabiex jiġbru informazzjoni dwar il-konċentrazzjoni tal-kapaċità ta’ kontrobilanċ tal-istituzzjonijiet tar-rapportar mill-għaxar l-ikbar detenturi ta’ assi jew linji ta’ likwidità mogħtija lill-istituzzjoni għal dan l-għan fil-formola C 71.00, l-istituzzjonijiet għandhom japplikaw l-istruzzjonijiet li jinsabu f’dan l-Anness.

2. Meta l-emittent jew il-kontroparti tkun assenjata lil aktar minn tip ta’ prodott, munita jew skala waħda tal-kwalità kreditizja, għandu jiġi rapportat l-ammont totali. It-tip ta’ prodott, munita jew skala ta’ kwalità kreditizja li għandha tiġi rapportati għandhom ikunu dawk li huma rilevanti għall-akbar proporzjon ta’ konċentrazzjoni tal-kapaċità ta’ kontrobilanċ.

3. Il-kapaċità ta' kontrobilanċ f'C71.00 għandha tkun l-istess bħal dik f'C66.01 bil-kwalifika li l-assi rrapportati bħala kapaċità ta' kontrobilanċ għall-fini ta' C71.00 għandhom ikunu ħielsa minn irbit biex ikunu disponibbli għall-istituzzjoni biex tibdilhom fi flus kontanti fid-data ta' referenza tar-rapportar.

4. Għall-kalkolu tal-konċentrazzjonijiet għall-finijiet tal-mudell ta' rapportar C 71.00 skont munita sinifikanti, l-istituzzjonijiet għandhom jużaw il-konċentrazzjonijiet fil-muniti kollha.

5. Meta emittent jew kontroparti tappartjeni għal diversi gruppi ta’ klijenti konnessi, tkun rappurtata darba biss fil-grupp bl-ogħla konċentrazzjoni tal-kapaċità ta’ kontrobilanċ.

6. Għajr għar-ringiela 0120, il-konċentrazzjonijiet tal-kapaċità ta’ kontrobilanċ ma’ bank ċentrali bħala emittent jew kontroparti ma għandhomx jiġu rapportati f’din il-formola. F’każ li istituzzjoni jkollha assi pożizzjonati minn qabel f’bank ċentrali għal operazzjonijiet standard ta’ likwidità u sal-punt li dawn l-assi jaqgħu taħt l-ikbar għaxar emittenti jew kontropartijiet ta’ kapaċità ta’ kontrabilanċ mhux gravati, l-istituzzjoni għandha tirrapporta l-emittent oriġinali u t-tip oriġinali ta’ prodott.

|  |  |
| --- | --- |
| Kolonna | Referenzi u struzzjonijiet legali |
| 0010 | **Isem l-emittent**  L-isem tal-ikbar għaxar emittenti ta’ assi mhux gravati jew kontropartijiet ta’ linji ta’ likwidità impenjati mhux prelevati mogħtija lill-istituzzjoni għandhom jiġu reġistrati fil-kolonna 0010 f’ordni dekrexxenti. L-ikbar partita tiġi rreġistrata f'1.01, it-tieni fil-partita tal-linja 1.02, eċċ. L-emittenti u l-kontropartijiet li jifformaw grupp ta’ klijenti konnessi jiġu rappurtati bħala konċentrazzjoni waħda.  Isem tal-emittent jew tal-kontroparti rreġistrat ikun l-isem sħiħ tal-entità legali li ħarġet l-assi, jew li tat il-linji ta’ likwidità, inklużi kwalunkwe referenzi tat-tip ta’ kumpanija skont il-liġi nazzjonali dwar il-kumpaniji. |
| 0020 | Kodiċi LEI  Il-kodiċi ta’ identifikazzjoni ġuridika tal-entità tal-kontroparti. |
| 0030 | **Settur tal-Emittent**  Għandu jiġi allokat settur wieħed għal kull emittent jew kontroparti fuq il-bażi tal-klassijiet tas-settur ekonomiku tar-rapportar finanzjarju ([FINREP]) li ġejjin (il-Parti 1 tal-Anness V ta’ dan ir-Regolament ta’ Implimentazzjoni):  (i) Gvernijiet Estiżi; (ii) L-istituzzjonijiet ta’ kreditu; (iii) Korporazzjonijiet finanzjarji oħrajn; (iv) Korporazzjonijiet mhux finanzjarji; (v) Unitajiet domestiċi.  Għal gruppi ta’ klijenti konnessi, ma għandu jiġi rapportat l-ebda settur. |
| 0040 | **Residenza tal-Emittent**  Għandu jintuża l-kodiċi ISO 3166-1-alpha-2 tal-pajjiż tal-inkorporazzjoni tal-emittent jew tal-kontroparti, inklużi l-kodiċijiet pseudo-ISO għal organizzazzjonijiet internazzjonali, disponibbli fl-aħħar edizzjoni ta’ “Vademecum tal-Bilanċ tal-Pagamenti” tal-Eurostat.  Għal gruppi ta’ klijenti konnessi, l-ebda pajjiż ma jiġi rrapportat. |
| 0050 | **Tip ta' Prodott**  L-emittenti/Il-kontropartijiet irreġistrati fil-kolonna 0010 għandhom jiġu assenjati tip ta’ prodott korrispondenti għall-prodott li jkunu miżmuma fih l-assi jew il-faċilità ta’ likwidità għal-lest tkun ġiet riċevuta, bl-użu tal-kodiċijiet li ġejjin indikati b’tipa grassa:  **SrB** (Bond Privileġġjat)  **SubB** (Bond Subordinat)  **CP** (Kambjala tan-Negozju)  **CB** (Bonds Koperti)  **US (**titoli UCITS, jiġifieri strumenti finanzjarji li jirrappreżentaw sehem jew titolu maħruġ minn Impriża ta’ Investimenti Kollettivi f’titoli trasferibbli)  **ABS (**Titolu Garantit b’Assi)  **CrCl** (Talba ta’ Kreditu)  **Eq** (Ekwità)  **Deheb (jekk deheb fiżiku, li jista’ jiġi ttrattat bħala kontroparti waħda)**  **LiqL** (Linja ta’ likwidità impenjata mhux prelevata mogħtija lill-istituzzjoni)  **OPT** (Tip ta’ prodott ieħor) |
| 0060 | **Munita**  L-emittenti/kontropartijiet irreġistrati fil-kolonna 0010 għandhom jiġu assenjati kodiċi ISO tal-munita fil-kolonna 0060 li jikkorrispondi mad-denominazzjoni tal-assi riċevut jew linji ta’ likwidità impenjati mhux prelevati mogħtija lill-istituzzjoni. Għandu jiġi rapportat il-kodiċi tal-unità tal-munita magħmul minn tliet ittri f’konformità mal-ISO 4217.  Fejn linja b’għadd ta’ muniti hija parti minn konċentrazzjoni f’kapaċità ta’ kontrobilanċ, il-linja għandha tiġi magħduda fil-munita li hija predominanti fil-bqija tal-konċentrazzjoni. Fir-rigward tar-rapportar separat f’muniti sinifikanti kif speċifikat fl-Artikolu 415(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, l-istituzzjonijiet għandhom jagħmlu valutazzjoni tal-munita li fiha x’aktarx li jseħħ il-fluss u għandhom jirrapportaw l-entrata f’dik il-munita sinifikanti biss, f’konformità mal-istruzzjonijiet dwar ir-rapportar separat ta’ muniti sinifikanti fir-rekwiżiti ta’ kopertura tal-likwidità (LCR), f’konformità mar-Regolament (UE) 2021/451. |
| 0070 | **Klassi tal-mertu tal-kreditu**  Għandha tiġi assenjata l-iskala tal-kwalità kreditizja xierqa f’konformità mar-Regolament (UE) Nru 575/2013, li għandha tkun l-istess bħal dik tal-entrati rapportati fl-iskala ta’ maturità. Fejn ma hemm l-ebda klassifikazzjoni, l-iskala ta’ “mhux-klassfikata” għandha tiġi assenjata. |
| 0080 | **Valur/nominali MtM**  Il-valur tas-suq jew valur ġust tal-assi, jew, jekk applikabbli, il-valur nominali tal-linja ta’ likwidità mhux prelevata mogħtija lill-istituzzjoni. |
| 0090 | **Valur tal-kollateral eliġibbli għall-bank ċentrali**  Il-valur tal-kollateral f’konformità mar-regoli tal-bank ċentrali għal faċilitajiet permanenti għall-assi speċifiċi.  Għal assi denominati f’munita inkluża fir-Regolament ta’ Implimentazzjoni tal-Kummissjoni (UE) 2015/233\* bħala munita b’eliġibbiltà għall-bank ċentrali ristretta ferm, l-istituzzjonijiet għandhom iħallu din il-kaxxa vojta.” |

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\* Ir-Regolament ta’ Implimentazzjoni tal-Kummissjoni (UE) 2015/233 tat-13 ta’ Frar 2015 li jistabbilixxi standards tekniċi ta’ implimentazzjoni fir-rigward ta’ muniti li fihom ikun hemm definizzjoni stretta ħafna ta’ eliġibbiltà tal-bank ċentrali skont ir-Regolament (UE) Nru 575/2013 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill (ĠU L 39, 14.2.2015, p. 11).