**ANNESS XXX – Tabelli u mudelli ta’ divulgazzjoni tal-approċċ standardizzat u intern għar-riskju tas-suq: Struzzjonijiet**

1. Dan l-anness jinkludi l-istruzzjonijiet li l-istituzzjonijiet għandhom isegwu meta jiddivulgaw l-informazzjoni msemmija fl-Artikoli 435, 445 u 455 tar-Regolament (UE) 575/2013[[1]](#footnote-2) (“CRR”) sabiex jimlew it-tabelli u l-mudelli tad-divulgazzjoni tar-riskju tas-suq li huma ppreżentati fl-Anness XXIX tas-soluzzjonijiet tal-informatika tal-EBA.

**Tabella EU MRA - Rekwiżiti ta’ divulgazzjoni kwalitattiva relatati mar-riskju tas-suq:** Kaxxi tat-test b’format liberu

1. L-istituzzjonijiet għandhom jiddivulgaw l-informazzjoni msemmija fl-Artikolu 435(1), il-punti minn (a) sa (d) tar-Regolament (UE) 575/2013 fir-rigward tar-riskju tas-suq billi jsegwu l-istruzzjonijiet ipprovduti hawn taħt f’dan l-Anness sabiex jimlew it-tabella EU MRA li hija ppreżentata fl-Anness XXIX.

|  |  |
| --- | --- |
| **Referenzi u struzzjonijiet legali** | |
| **Numru tar-ringiela** | **Spjegazzjoni** |
| (a) | Meta jiddivulgaw l-informazzjoni msemmija fl-Artikolu 435 (1), il-punti (a) u (d) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 dwar l-objettivi u l-politiki ta’ ġestjoni tar-riskju sabiex jimmaniġġjaw ir-riskju tas-suq, l-istituzzjonijiet għandhom jinkludu:   * spjegazzjoni tal-objettivi strateġiċi tal-ġestjoni tagħhom fit-twettiq ta’ attivitajiet ta’ negozjar; * deskrizzjoni tal-politiki msemmija fl-Artikolu 104(1) għad-determinazzjoni ta’ liema pożizzjoni għandha tiġi inkluża fil-portafoll tan-negozjar, inkluża d-definizzjoni ta’ pożizzjonijiet stazzjonarji u l-politiki tal-ġestjoni tar-riskju għall-monitoraġġ ta’ dawk il-pożizzjonijiet. Barra minn hekk, l-istituzzjonijiet għandhom jiddeskrivu każijiet fejn l-istrumenti jiġu assenjati lill-portafoll tan-negozjar jew bankarju għall-kuntrarju tal-preżunzjonijiet ġenerali tal-kategorija tal-istrumenti tagħhom, inkluż il-valur ġust u tas-suq tagħhom ta’ każijiet bħal dawn kif ukoll kwalunkwe riklassifikazzjoni minn ktieb għall-ieħor mill-aħħar perjodu ta’ rapportar, inkluż il-valur ġust tat-tali każijiet u r-raġuni għar-riklassifikazzjoni; * deskrizzjoni tal-attivitajiet interni ta’ trasferiment tar-riskju, inklużi t-tipi ta’ unità interni għat-trasferiment tar-riskju; * il-proċessi implimentati sabiex jidentifikaw, ikejlu, jimmonitorjaw u jikkontrollaw ir-riskji tas-suq tal-istituzzjoni; * il-politiki għall-iħħeġġjar u għall-mitigazzjoni tar-riskju; * l-istrateġiji u l-proċessi għall-monitoraġġ tal-effettività kontinwa tal-ħeġġijiet. |
| (b) | Meta jiddivulgaw l-informazzjoni msemmija fl-Artikolu 435(1) , il-punt (b) tar-Regolament (UE) 575/2013 dwar l-istruttura u l-organizzazzjoni tal-funzjoni tal-ġestjoni tar-riskji tas-suq, l-istituzzjonijiet għandhom jinkludu:   * deskrizzjoni tal-istruttura tal-governanza tar-riskju tas-suq stabbilita sabiex jiġu implimentati l-istrateġiji u l-proċessi tal-istituzzjoni diskussi fir-ringiela (a) aktar ’il fuq, * deskrizzjoni tar-relazzjonijiet u tal-mekkaniżmi ta’ komunikazzjoni bejn il-partijiet differenti involuti fil-ġestjoni tar-riskju tas-suq. |
| (c) | Meta jiddivulgaw l-informazzjoni msemmija fl-Artikolu 435(1), il-punt (c) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 dwar il-kamp ta’ applikazzjoni u n-natura tas-sistemi ta’ rappurtar u ta’ kejl tar-riskju tas-suq, l-istituzzjonijiet għandhom jipprovdu deskrizzjoni tal-kamp ta’ applikazzjoni u tan-natura tas-sistemi ta’ rappurtar u ta’ kejl tar-riskju tas-suq. |
| (EU d) | Meta jiddivulgaw l-informazzjoni msemmija fl-Artikolu 445(1) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 dwar ħarsa ġenerali lejn il-pożizzjonijiet tal-portafoll tan-negozjar, l-istituzzjonijiet għandhom jipprovdu deskrizzjoni ta’ livell għoli tal-pożizzjonijiet tal-portafoll tan-negozjar tagħhom. |

**Mudell EU MR1 - Ir-riskju tas-suq skont l-approċċ alternattiv standardizzat (AAS):** format fiss

1. L-istituzzjonijiet għandhom jiddivulgaw l-informazzjoni msemmija fl-Artikolu 445 tar-Regolament (UE) 575/2013 billi jsegwu l-istruzzjonijiet ipprovduti hawn taħt f’dan l-Anness sabiex jimlew il-Mudell EU MR1 li huwa ppreżentat fl-Anness XXIX. L-istituzzjonijiet ma għandhom jinkludu l-ebda *data* dwar l-unità tat-trasferiment tar-Riskju Intern (IRT, Internal Risk Transfer) tagħhom f’dan il-mudell.

|  |  |
| --- | --- |
| **Referenzi u struzzjonijiet legali** | |
| **Numru tar-ringiela** | **Spjegazzjoni** |
|  | **Metodu bbażat fuq is-sensittività**  f’konformità mat-Tielet Parti, it-Titolu IV, tal-Kapitolu 1a, it-Taqsima 2 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 1 | **Riskju ġenerali tar-rata tal-imgħax (GIRR, General Interest Rate Risk)**  skont l-Artikolu 325c (2), il-punt (a) u l-Artikolu 325d(1), il-punt (i), tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 2 | **Riskju tal-ekwità (EQU, Equity Risk)**  skont l-Artikolu 325c (2), il-punt (a) u l-Artikolu 325d(1) , il-punt (v),tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 3 | **Riskju tal-komoditajiet (COM)**  skont l-Artikolu 325c(2), il-punt (a) u l-Artikolu 325d(1) , il-punt (vi), tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 4 | **Riskju tal-kambju (FX, Foreign Exchange)**  skont l-Artikolu 325c(2), il-punt (a) u l-Artikolu 325d(1) , il-punt (vii),tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 5 | **Riskju tal-firxa tal-kreditu għal nontitolizzazzjonijiet (CSR, Credit Spread Risk)**  skont l-Artikolu 325c(2), il-punt (a) u l-Artikolu 325d(1) , il-punt (ii), tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 6 | **Riskju ta’ firxiet tal-kreditu għal titolizzazzjoni mhux inkluż fil-portafoll tan-negozjar ta’ korrelazzjoni alternattiva (non-ACTP CSR, Alternativ correlation trading portfolio, Credit spread risk)**  skont l-Artikolu 325c(2), il-punt (a) u l-Artikolu 325d(1) , il-punt (iii), tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 7 | **Riskju ta’ firxiet tal-kreditu għal titolizzazzjoni inkluża fil-portafoll tan-negozjar ta’ korrelazzjoni alternattiva (ACTP CSR)**  skont l-Artikolu 325c(2), il-punt (a) u l-Artikolu 325d(1), il-punt (iv), tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
|  | **Riskju ta’ inadempjenza**  f’konformità mat-Tielet Parti, it-Titolu IV, il-Kapitolu 1a, it-Taqsima 5 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 8 | **Nontitolizzazzjonijiet**  skont l-Artikolu 325c(2), il-punt (b) u l-Parti Tlieta, it-Titolu IV, il-Kapitolu 1a, it-Taqsima 5, is-Subtaqsima 1 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 9 | **Titolizzazzjoni mhux inkluża fil-portafoll alternattiv ta’ negozjar ta’ korrelazzjoni (non-ACTP)**  skont l-Artikolu 325c(2), il-punt (b) u l-Parti Tlieta, it-Titolu IV, il-Kapitolu 1a, it-Taqsima 5, is-Subtaqsima 2 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 10 | **Titolizzazzjoni inkluża fil-portafoll alternattiv ta’ negozjar ta’ korrelazzjoni (ACTP)**  skont l-Artikolu 325c(2), il-punt (b) u l-Parti Tlieta, it-Titolu IV, il-Kapitolu 1a, it-Taqsima 5, is-Subtaqsima 3 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
|  | **Riskju residwu**  It-Tielet Parti, it-Titolu IV, il-Kapitolu 1a, it-Taqsima 4 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| UE 11a | **Sottostanti eżotiċi**  skont l-Artikolu 325c(2), il-punt (c) u l-Artikolu 325u(2) , il-punt (a),tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| UE 11b | **Riskji residwi oħra**  skont l-Artikolu 325c(2), il-punt (c) u l-Artikolu 325u(2) , il-punt (b),tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 12 | **Total tar-rekwiżiti ta’ fondi proprji (OFN, Own Funds Requirements)**  Is-somma tar-ringieli minn 1 sa EU11b. |
| **Ittra tal-kolonna** | **Spjegazzjoni** |
|  | **Total tar-rekwiżiti ta’ fondi proprji (OFR, Own Funds Requirements)** |
| a | Divulgazzjoni tar-rekwiżiti ta’ fondi proprji msemmija fl-Artikolu 438, il-punt (d) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, ikkalkolata bħala s-somma sempliċi tal-ammonti hawn fuq fir-ringieli minn 1 sa EU 11b. |

**Tabella EU MRB: Rekwiżiti ta’ divulgazzjoni kwalitattiva għall-istituzzjonijiet li jużaw l-approċċ tal-mudell intern alternattiv**: format b’test liberu

1. L-istituzzjonijiet għandhom jiddivulgaw l-informazzjoni msemmija fl-Artikolu 455, il-punti (a), (b), (c), (d), (e) u (f) tar-Regolament (UE) 575/2013 billi jsegwu l-istruzzjonijiet ipprovduti hawn taħt f’dan l-Anness sabiex jimlew it-Tabella EU MRB li hija ppreżentata fl-Anness XXIX.

|  |  |
| --- | --- |
| **Referenzi u struzzjonijiet legali** | |
| **Numru tar-ringiela** | **Spjegazzjoni** |
|  | Meta jiddivulgaw l-informazzjoni msemmija fl-Artikolu 455, il-punt (1a) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 dwar il-mudelli interni alternattivi għar-riskju tas-suq, l-istituzzjonijiet għandhom jinkludu: |
| EU (a) | l-objettivi tal-istituzzjoni fit-twettiq ta’ attivitajiet ta’ negozjar, kif ukoll il-proċessi implimentati biex jidentifikaw, ikejlu, jimmonitorjaw u jikkontrollaw ir-riskji tas-suq tal-istituzzjoni. Din l-informazzjoni tista’ tiġi pprovduta billi ssir kontroreferenza għat-tabella EU MRA |
| EU (b) | il-politiki msemmija fl-Artikolu 104(1) biex jiġi ddeterminat liema pożizzjoni għandha tiġi inkluża fil-portafoll tan-negozjar. Din l-informazzjoni tista’ tiġi pprovduta billi ssir kontroreferenza għat-tabella EU MR A; |
| EU (c) | l-istruttura u l-organizzazzjoni tal-funzjoni u l-governanza għall-ġestjoni tar-riskju tas-suq; |
| (A) (B) Deskrizzjoni ġenerali tal-istruttura tal-unità tan-negozjar u t-tipi ta’ strumenti inklużi fl-unità tan-negozjar tal-AIMA f’konformità mal-Artikolu 455(1), il-punti (c), (d) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. | |
| B (a) | Meta jiddivulgaw l-informazzjoni msemmija fl-Artikolu 455(1), il-punt (c) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, l-istituzzjonijiet għandhom jipprovdu deskrizzjoni ġenerali tal-istruttura tal-unitajiet tan-negozjar koperti mill-mudelli interni msemmija fl-Artikolu 325az, inkluż għal kull unità deskrizzjoni wiesgħa tal-istrateġija tan-negozju tal-unità, l-istrumenti permessi fiha u t-tipi ta’ riskju ewlenin fir-rigward ta’ dik l-unità; |
| Meta jiddivulgaw l-informazzjoni msemmija fl-Artikolu 455(1), il-punt (d) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, l-istituzzjonijiet għandhom jipprovdu ħarsa ġenerali lejn il-pożizzjonijiet tal-portafoll tan-negozjar mhux koperti mill-mudelli interni msemmija fl-Artikolu 325az, inkluża deskrizzjoni ġenerali tal-istruttura tal-unità u tat-tip ta’ strumenti inklużi fl-unità jew fil-kategoriji tal-unità f’konformità mal-Artikolu 104b; |
| B) C) E) Deskrizzjoni tal-karatteristiċi ewlenin tal-mudelli użati fil-livell konsolidat, inklużi l-approċċi użati fil-validazzjoni tal-mudelli u l-proċessi tal-immudellar. | |
| B (b) (c) (d) (e) | Meta jiddivulgaw l-informazzjoni msemmija fl-Artikolu 455(1), il-punt (f)(i) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, l-istituzzjonijiet għandhom jipprovdu: il-kamp ta’ applikazzjoni, il-karatteristiċi ewlenin u l-għażliet ewlenin ta’ mmudellar tal-mudelli interni differenti msemmija fl-Artikolu 325az tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 biex jiġu kkalkulati l-ammonti tal-iskopertura għar-riskju għall-mudelli ewlenin użati fil-livell konsolidat, u deskrizzjoni sa liema punt dawk il-mudelli interni jirrappreżentaw il-mudelli kollha użati fil-livell konsolidat, inkluż fejn applikabbli: (i) deskrizzjoni wiesgħa tal-approċċ ta’ mmudellar użat għall-kalkolu tan-nuqqas mistenni msemmi fl-Artikolu 325ba(1), il-punt (a) tas-CRR, inkluża l-frekwenza tal-aġġornament tad-*data*. |
| C (a) | Meta jiddivulgaw l-informazzjoni msemmija fl-Artikolu 455(1), il-punt (f)(ii) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, l-istituzzjonijiet għandhom jinkludu, fejn applikabbli: deskrizzjoni wiesgħa tal-metodoloġija użata għall-kalkolu tal-miżura tar-riskju tax-xenarju ta’ stress imsemmija fl-Artikolu 325ba(1), il-punt (b) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 minbarra l-ispeċifikazzjonijiet previsti fl-Artikolu 325bk (3) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| D) Deskrizzjoni tal-mudelli interni għall-kalkolu tal-imposta għar-riskju ta’ inadempjenza | |
| 1. (b) | Meta jiddivulgaw l-informazzjoni msemmija fl-Artikolu 455(1), il-punt (f)(iii) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, l-istituzzjonijiet għandhom jinkludu, fejn applikabbli: deskrizzjoni wiesgħa tal-approċċ ta’ mmudellar użat għall-kalkolu tal-imposta għar-riskju ta’ inadempjenza msemmija fl-Artikolu 325ba(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 inkluża l-frekwenza tal-aġġornament tad-*data*. |

**Mudell EU MR2 - Ir-riskju tas-suq skont l-approċċ ta’ mudell intern alternattiv (AMIA):** format fiss

1. L-istituzzjonijiet għandhom jiddivulgaw l-informazzjoni msemmija fil-punt (2) tal-Artikolu 455 tar-Regolament (UE) 575/2013 billi jsegwu l-istruzzjonijiet ipprovduti hawn taħt f’dan l-Anness sabiex jimlew il-mudell EU MR2 li huwa ppreżentat fl-Anness XXIX. L-istituzzjonijiet ma għandhom jinkludu l-ebda *data* dwar l-unità tat-trasferiment tar-Riskju Intern (IRT, Internal Risk Transfer) tagħhom f’dan il-mudell.

|  |  |
| --- | --- |
| **Referenzi u struzzjonijiet legali** | |
| **Numru tar-ringiela** | **Spjegazzjoni** |
| 1 | **Miżura ta’ nuqqas mistenni mingħajr restrizzjonijiet (UESt, Unconstrained expected shortfall measure)**  Il-valur divulgat għandu jiġi kkalkolat fil-livell tal-portafoll ġenerali u mhux fil-livell ta’ kategorija wiesgħa ta’ riskju skont l-Artikoli 325bb u 325bc tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 2 | **Miżura ta’ nuqqas mistenni mingħajr restrizzjonijiet għall-kategorija tal-fatturi ta’ riskju tar-rati tal-imgħax**  Il-valur divulgat għandu jiġi kkalkolat għall-fatturi ta’ riskju tal-kategorija ta’ riskju ta’ ċaqliq fir-rata tal-imgħax skont l-Artikoli 325bb, 325bc u 325bd tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 3 | **Miżura ta’ nuqqas mistenni mingħajr restrizzjonijiet għall-kategorija tal-fatturi ta’ riskju tal-ekwità**  Il-valur divulgat għandu jiġi kkalkolat għall-fatturi ta’ riskju tal-kategorija ta’ riskju ta’ ekwità skont l-Artikoli 325bb, 325bc u 325bd tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 4 | **Miżura ta’ nuqqas mistenni mingħajr restrizzjonijiet għall-kategorija tal-fattur ta’ riskju tal-komoditajiet**  Il-valur divulgat għandu jiġi kkalkolat għall-fatturi ta’ riskju tal-kategorija ta’ riskju tal-komoditajiet skont l-Artikoli 325bb, 325bc u 325bd tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| 5 | **Miżura ta’ nuqqas mistenni mingħajr restrizzjonijiet għall-kategorija ta’ fatturi ta’ riskju tal-kambju**  Il-valur divulgat għandu jiġi kkalkolat għall-fatturi ta’ riskju tal-kategorija tar-riskju tal-kambju skont l-Artikoli 325bb, 325bc u 325bd tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 6 | **Miżura ta’ nuqqas mistenni mingħajr restrizzjonijiet għall-kategorija ta’ fatturi ta’ riskju tal-firxa tal-kreditu**  Il-valur divulgat għandu jiġi kkalkolat għall-fatturi ta’ riskju tal-kategorija ta’ riskju tal-firxa tal-kreditu skont l-Artikoli 325bb, 325bc u 325bd tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 7 | **Somma tal-miżura ta’ nuqqas mistenni mingħajr restrizzjonijiet għal kategoriji b’fattur ta’ riskju wiesgħa** (∑UESit)  Somma tar-ringieli minn 2 sa 6. |
| 8 | **Miżura ta’ nuqqas mistenni (ESt)**  Il-miżura tar-riskju tan-nuqqas mistenni għandha tiġi kkalkulata f’konformità mal-Artikolu 325ba (1), il-punt (a)(i) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 9 | **Miżura ta’ riskju ta’ xenarju ta’ kriżi (SSt)**  Il-miżura ta’ riskju ta’ xenarju ta’ kriżi għandha tiġi kkalkolata f’konformità mal-Artikolu 325ba(1), il-punt (a)(ii) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 10 | **Imposta għar-riskju ta’ inadempjenza (DRCt)**  L-imposta għar-riskju ta’ inadempjenza għandha tiġi kkalkulata f’konformità mal-punt 325ba(2), il-punt (a) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 11 | **PLAaddon**  Dan il-valur għandu jiġi kkalkulat f’konformità mal-Artikolu 325ba(3) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 flimkien mal-Artikolu 10(1) tar-Regolament (UE) 2022/2059. |
| 12 | **OFR għan-negozju fil-karta bilanċjali u barra l-karta bilanċjali flimkien mal-PLAaddon (AIMA + PLAaddon)**  Dan il-valur għandu jiġi kkalkulat f’konformità mal-Artikolu 10(1) tar-Regolament (UE) 2022/2059. Il-valur tar-ringiela 11 għandu jiżdied. |
| 13 | **Total tal-ASA OFR għall-unitajiet tan-negozjar ineliġibbli għall-użu tal-AIMA (ASAnon-aima)**  Dan il-valur għandu jiġi kkalkulat kif stipulat fl-Artikolu 325ba(3) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 14 | **Differenza fl-OFR skont l-AIMA u l-ASA għall-unitajiet tan-negozjar tal-AIMA (AIMA-ASAaima)**  Dan il-valur għandu jiġi kkalkulat bħala d-differenza bejn ir-rekwiżiti ta’ fondi proprji tal-AIMA għall-postijiet tal-AIMA (l-Artikolu 10(1) tar-Regolament (UE) 2022/2059) u l-valur tar-rekwiżiti ta’ fondi proprji tal-ASA għall-unitajiet kollha tal-AIMA (stampa ġenerali tal-portafoll) (l-Artikolu 10(1) tar-Regolament (UE) 2022/2059). |
| 15 | **ASA OFR għall-unitajiet tan-negozjar kollha (inklużi dawk soġġetti għall-AIMA) (portafoll ASAall)**  Dan il-valur għandu jiġi kkalkulat kif stipulat fl-Artikolu 325ba(3) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 16 | **Total ta’ rekwiżi ta’ fondi proprji għall-AIMA (TotalAIMA)**  Dan il-valur għandu jiġi kkalkulat kif stipulat fl-Artikolu 325ba(3) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| **Ittra tal-kolonna** | **Spjegazzjoni** |
| a | Divulgazzjoni tal-aktar kejl tar-riskju reċenti [ringieli minn 1 sa 10] jew tar-rekwiżiti ta’ fondi proprji [ringieli minn 11 sa 16] fit-trimestru attwali. |
| b | Il-valur medju tal-kejl tar-riskju [ringieli minn 1 sa 10] matul is-60 jum ta’ negozju preċedenti [ringieli minn 1 sa 9] jew matul it-12-il ġimgħa preċedenti [ringiela 10] fit-trimestru attwali. |
| c | Il-kejl tal-ogħla riskju matul is-60 jum ta’ negozju preċedenti [ringieli 1 sa 6] fit-trimestru attwali. |
| d | Il-kejl tar-riskju l-aktar baxx matul is-60 jum ta’ negozju preċedenti [ringieli minn 1 sa 6] fit-trimestru attwali. |
| e | L-għadd ta’ qabżiet fil-valur tal-ittestjar retrospettiv [ringiela 1]  L-għadd ta’ qabżiet fil-valur irrapportat f’din iċ-ċellola għandu jkun in-numru użat għad-determinazzjoni tas-supplimentazzjoni f’konformità mat-Tabella 3 tal-Artikolu 325bf(6), il-punt (b) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. Il-qbiż fil-valur li huwa eskluż bil-permess tal-awtorità kompetenti ma għandux jiġi inkluż. |
| f | Il-kejl tar-riskju l-aktar reċenti [ir-ringieli minn 1 sa 10] jew ir-rekwiżiti ta’ fondi proprji [ir-ringieli minn 11 sa 16] fit-trimestru preċedenti. |
| g | Il-valur medju tal-kejl tar-riskju [ringiela minn 1 sa 10] matul is-60 jum tax-xogħol preċedenti [ringieli minn 1 sa 9] jew matul it-12-il ġimgħa preċedenti [ringiela 10] fit-trimestru preċedenti. |

**Mudell EU MR 3 - Ir-riskju tas-suq skont l-approċċ standardizzat simplifikat (SSA, simplified standardised approach):** format fiss

1. L-istituzzjonijiet għandhom jiddivulgaw l-informazzjoni msemmija fl-Artikolu 445 tar-Regolament (UE) 575/2013 billi jsegwu l-istruzzjonijiet ipprovduti hawn taħt f’dan l-Anness sabiex jimlew il-mudell EU MR 3 li huwa ppreżentat fl-Anness XXIX tas-soluzzjonijiet tal-informatika.

|  |  |
| --- | --- |
| **Referenzi u struzzjonijiet legali** | |
| **Numru tar-ringiela** | **Spjegazzjoni** |
|  |  |
| 1 | **Riskju taċ-ċaqliq fir-rata tal-imgħax (ġenerali u speċifiku)**  Riskju ġenerali u speċifiku ta’ pożizzjonijiet fi strumenti ta’ dejn negozjati fil-portafoll tan-negozjar, f’konformità mal-Kapitolu 2 tat-Titolu IV tal-Parti Tlieta tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, eskluż ir-riskju speċifiku relatat mat-titolizzazzjoni. |
| 2 | **Riskju ta’ ekwità (ġenerali u speċifiku)**  Riskju ġenerali u speċifiku ta’ pożizzjonijiet f’ekwitajiet fil-portafoll tan-negozjar, f’konformità mal-Kapitolu 2 tat-Titolu IV tal-Parti Tlieta tar-Regolament (UE) 575/2013. |
| 3 | **Riskju tal-komoditajiet**  Riskju ta’ pożizzjonijiet fil-komoditajiet f’konformità mal-Kapitolu 4 tat-Titolu IV tal-Parti Tlieta tar-Regolament (UE) 575/2013. |
| 4 | **Riskju tal-kambju**  Riskju ta’ pożizzjonijiet fil-kambju f’konformità mal-Kapitolu 3 tat-Titolu IV tal-Parti Tlieta tar-Regolament (UE) 575/2013. |
| 5 | **Titolizzazzjoni (riskju speċifiku)**  Riskju speċifiku ta’ pożizzjonijiet ta’ titolizzazzjoni fil-portafoll tan-negozjar f’konformità mal-Artikoli 337 u 338 tal-Kapitolu 2 tat-Titolu IV tal-Parti Tlieta tar-Regolament (UE) 575/2013. |
| 6 | **Total OFR S-SA**  Divulgazzjoni tar-rekwiżiti ta’ fondi proprji msemmija fl-Artikolu 438, il-punt (d) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, ikkalkolati bħala s-somma sempliċi tal-ammonti fir-ringieli minn 1 sa 5 ta’ hawn fuq għall-kolonna a u kkalkulati bħala s-somma sempliċi tal-ammonti fir-ringieli minn 1 sa 4 ta’ hawn fuq għall-kolonni b, c u d. |
| **Ittra tal-kolonna** | **Spjegazzjoni** |
|  | **Prodotti diretti** |
| a | Pożizzjonijiet fi prodotti li mhumiex fakultattivi u li mhumiex inklużi fl-approċċi tal-RTS għar-riskju non-delta marbut mal-opzjonijiet fl-approċċ standardizzat tar-riskju tas-suq[[2]](#footnote-3). |
|  | **Opzjonijiet** |
| b | **Approċċ simplifikat**  Opzjonijiet jew warrants kif iddefiniti fl-Artikolu 329(3) tal-Kapitolu 2 tat-Titolu IV tal-Parti Tlieta tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 li għalihom l-istituzzjonijiet jikkalkolaw ir-rekwiżiti ta’ fondi proprji relatati mar-riskju non-delta billi jużaw l-approċċ simplifikat[[3]](#footnote-4). |
| c | **Approċċ delta plus**  Opzjonijiet jew warrants fil-portafoll tan-negozjar kif definiti fl-Artikolu 329(3) tal-Kapitolu 2 tat-Titolu IV tal-Parti Tlieta tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 li għalihom l-istituzzjonijiet jikkalkolaw ir-rekwiżiti ta’ fondi proprji relatati mar-riskju non-delta billi jużaw l-approċċ delta plus[[4]](#footnote-5). |
| d | **Approċċ abbażi tax-xenarju**  Opzjonijiet jew warrants fil-portafoll tan-negozjar kif definiti fl-Artikolu 329(3) tal-Kapitolu 2 tat-Titolu IV tal-Parti Tlieta tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 li għalihom l-istituzzjonijiet jikkalkolaw ir-rekwiżiti ta’ fondi proprji relatati mar-riskju non-delta billi jużaw l-approċċ abbażi tax-xenarju[[5]](#footnote-6). |

1. Ir-Regolament (UE) Nru 575/2013 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill tas-26 ta’ Ġunju 2013 dwar ir-rekwiżiti prudenzjali għall-istituzzjonijiet ta’ kreditu u d-ditti tal-investiment u li jemenda r-Regolament (UE) Nru 648/2012, kif emendat bir-Regolament (UE) 2024/1623 ([ĠU L 176, 27.6.2013, p. 1](https://eur-lex.europa.eu/legal-content/MT/AUTO/?uri=OJ:L:2013:176:TOC); [Ir-Regolament - UE - 2024/1623 - MT - EUR-Lex (europa.eu)](https://eur-lex.europa.eu/legal-content/MT/TXT/?uri=CELEX:32024R1623)). [↑](#footnote-ref-2)
2. Kif definit fir-REGOLAMENT TA' DELEGA TAL-KUMMISSJONI (UE) Nru 528/2014 tat-12 ta’ Marzu 2014 li jissupplimenta r-Regolament (UE) Nru 575/2013 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill fir-rigward tal-istandards tekniċi regolatorji tal-opzjonijiet fl-approċċ standardizzat tar-riskju tas-suq (ĠU L 148, 20.5.2014, p. 29). [↑](#footnote-ref-3)
3. Kif definit fir-REGOLAMENT TA' DELEGA TAL-KUMMISSJONI (UE) Nru 528/2014 tat-12 ta’ Marzu 2014 li jissupplimenta r-Regolament (UE) Nru 575/2013 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill fir-rigward tal-istandards tekniċi regolatorji tal-opzjonijiet fl-approċċ standardizzat tar-riskju tas-suq (ĠU L 148, 20.5.2014, p. 29). [↑](#footnote-ref-4)
4. Kif definit fir-REGOLAMENT TA' DELEGA TAL-KUMMISSJONI (UE) Nru 528/2014 tat-12 ta’ Marzu 2014 li jissupplimenta r-Regolament (UE) Nru 575/2013 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill fir-rigward tal-istandards tekniċi regolatorji tal-opzjonijiet fl-approċċ standardizzat tar-riskju tas-suq (ĠU L 148, 20.5.2014, p. 29). [↑](#footnote-ref-5)
5. Kif definit fir-REGOLAMENT TA' DELEGA TAL-KUMMISSJONI (UE) Nru 528/2014 tat-12 ta’ Marzu 2014 li jissupplimenta r-Regolament (UE) Nru 575/2013 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill fir-rigward tal-istandards tekniċi regolatorji tal-opzjonijiet fl-approċċ standardizzat tar-riskju tas-suq (ĠU L 148, 20.5.2014, p. 29). [↑](#footnote-ref-6)