

RO
ANEXA I

RAPORTAREA CERINȚEI MINIME DE FONDURI PROPRII ȘI DATORII ELIGIBILE

MODELE PENTRU MREL ȘI TLAC			
Numărul modelului	Codul modelului	Denumirea modelului/grupului de modele	Denumirea scurtă
		CUANTUMURI: INDICATORI-CHEIE PENTRU MREL ȘI TLAC	
1	M 01.00	Indicatori-cheie pentru MREL și TLAC (grupuri/entități de rezoluție)	KM2
		COMPONENTĂ ȘI SCADENȚĂ	
2	M 02.00	Capacitatea și componenta MREL și TLAC (grupuri și entități de rezoluție)	TLAC1
3	M 03.00	MREL internă și TLAC internă	ILAC
4	M 04.00	Structura de finanțare a datoriilor eligibile	LIAB-MREL
		ORDINEA DE PRIORITATE A CREDITORILOR	
5	M 05.00	Ordinea de prioritate a creditorilor (entitate care nu este entitate de rezoluție)	TLAC2
6	M 06.00	Ordinea de prioritate a creditorilor (entități de rezoluție)	TLAC3
		INFORMAȚII SPECIFICE CONTRACTULUI	
7	M 07.00	Instrumente reglementate de legislația unei țări terțe	MTCI

RO
ANEXA I

M 01.00 – Indicatori-cheie pentru MREL și TLAC (grupuri/entități de rezoluție) (KM2)

		Cerința minimă de fonduri proprii și datorii eligibile (MREL)	Cerința privind fondurile proprii și datoriile eligibile pentru G-SII (TLAC)
		0010	0020
	Cuquantumul total al expunerii la risc și indicatorul de măsurare a expunerii totale		
0100	CUANTUMUL TOTAL AL EXPUNERII LA RISC (TREA)		
0110	INDICATORUL DE MASURARE A EXPUNERII TOTALE (TEM)		
	Fonduri proprii și datorii eligibile		
0200	FONDURI PROPRII ȘI DATORII ELIGIBILE		
0210	Din care: fonduri proprii și datorii subordonate		
0220	Din care: reglementate de legislația unei țări terțe		
0230	Din care: elemente care conțin o clauză de reducere a valorii contabile și de conversie, astfel cum se menționează la articolul 55 din Directiva 2014/59/UE		
	Alte datorii care pot face obiectul recapitalizării interne		
0250	ALTE DATORII CARE POT FACE OBIECTUL RECAPITALIZĂRII INTERNE		
0260	Din care: reglementate de legislația unei țări terțe		
0270	Din care: elemente care conțin o clauză de reducere a valorii contabile și de conversie, astfel cum se menționează la articolul 55 din Directiva 2014/59/UE		
0280	Scadență reziduală < 1 an		
0285	Scadență reziduală >= 1 an și < 2 ani		
0290	Scadență reziduală >= 2 ani		
	Rate și derogări privind subordonarea		
0300	FONDURILE PROPRII ȘI DATORIILE ELIGIBILE CA PROCENT DIN TREA		
0310	Din care: fonduri proprii și datorii subordonate		
0320	FONDURILE PROPRII ȘI DATORIILE ELIGIBILE CA PROCENT DIN TEM		
0330	Din care: fonduri proprii și datorii subordonate		
0340	Se aplică derogarea privind subordonarea prevăzută la articolul 72b alineatul (4) din Regulamentul (UE) nr. 575/2013? (Derogarea de 5 %)		
0350	Cuquantumul agregat al instrumentelor de datorii eligibile nesubordonate permise în cazul în care se aplică opțiunea de subordonare prevăzută la articolul 72b alineatul (3) din Regulamentul (UE) nr. 575/2013 (derogare de maximum 3,5 %)		
0360	Ponderea din totalul datoriilor nesubordonate care este inclusă în fondurile proprii și datoriile eligibile		

RO
ANEXA I

M 02.00 – Capacitatea și componența MREL și TLAC (grupuri/entități de rezoluție) (TLAC1)				
		Cerința minimă de fonduri proprii și datorii eligibile (MREL)	Cerința privind fondurile proprii și datoriile eligibile pentru G-SII (TLAC)	Element memorandum: cuantumuri eligibile în sensul MREL, dar nu și în sensul TLAC
		0010	0020	0030
0010	FONDURI PROPRII ȘI DATORII ELIGIBILE			
0020	Fonduri proprii (eligibile)			
0030	Fonduri proprii de nivel 1 de bază			
0040	Fonduri proprii de nivel 1 suplimentar (eligibile)			
0050	Fonduri proprii de nivel 2 (eligibile)			
0060	Datorii eligibile			
0070	Elemente de datorii eligibile înainte de ajustări			
0080	Din care: datorii eligibile considerate ca fiind subordonate din punct de vedere structural			
0090	Datorii eligibile subordonate datoriilor excluse			
0100	Instrumente de datorii eligibile emise direct de entitatea de rezoluție (care nu își păstrează drepturile obținute)			
0110	Instrumente de datorii eligibile emise de alte entități din cadrul grupului de rezoluție (care nu își păstrează drepturile obținute)			
0120	Instrumente de datorii eligibile emise înainte de 27 iunie 2019			
0130	Instrumente de fonduri proprii de nivel 2 cu o scadență reziduală de cel puțin un an, în măsura în care nu se califică drept elemente de fonduri proprii de nivel 2			
0132	(-) Instrumente proprii de datorii eligibile subordonate datoriilor excluse			
0135	(-) Din care: cuantumuri ale aprobărilor prealabile neutilizate			
0140	Datorii eligibile nesubordonate datoriilor excluse			
0150	Datorii eligibile nesubordonate datoriilor excluse (care nu își păstrează drepturile obținute, înainte de plafonare)			
0160	Datorii eligibile nesubordonate datoriilor excluse emise înainte de 27 iunie 2019 (înainte de plafonare)			
0162	(-) Instrumente proprii de datorii eligibile nesubordonate datoriilor excluse			
0165	(-) Din care: cuantumuri ale aprobărilor prealabile neutilizate			
0170	Cuantumuri eligibile după aplicarea plafonului de la articolul 72b alineatul (3) din Regulamentul (UE) nr. 575/2013 (care nu își păstrează drepturile obținute)			
0180	Cuantumuri eligibile după aplicarea plafonului de la articolul 72b alineatul (3) din Regulamentul (UE) nr. 575/2013, constând în elemente care au fost emise înainte de 27 iunie 2019			
0190	(-) Deduceri			
0200	(-) Expuneri între grupuri de rezoluție cu mai multe puncte de intrare (MPE)			
0211	(-) Investiții în alte instrumente de datorii eligibile			
0220	Deducerile din datoriile eligibile care depășesc datoriile eligibile (deduceri din fondurile proprii de nivel 2)			
ELEMENTE MEMORANDUM				
0400	Fonduri proprii de nivel 1 de bază (%) disponibile după îndeplinirea cerințelor entității			
0410	Cerința amortizorului combinat (%)			
0420	Din care: cerința amortizorului de conservare a capitalului			
0430	Din care: cerința amortizorului anticiclic			
0440	Din care: cerința amortizorului de risc sistemic			
0450	Din care: amortizorul pentru instituții de importanță sistemică globală (G-SII) sau alte instituții de importanță sistemică (O-SII)			
0460	Investiții în datorii eligibile subordonate ale altor instituții			
0470	Investiții în datorii eligibile subordonate ale G-SII			
0480	Investiții în datorii eligibile subordonate ale O-SII			
0490	Investiții în datorii eligibile subordonate ale altor instituții			
0500	Datorii excluse			

RO
ANEXA I

M 03.00 – MREL internă și TLAC internă			
		MREL internă	TLAC internă
		0010	0020
0010	Nivel de aplicare		
	Cuantumul total al expunerii la risc și indicatorul de măsurare a expunerii totale		
0100	Cuantumul total al expunerii la risc (TREA)		
0110	Indicatorul de măsurare a expunerii totale (TEM)		
	Fonduri proprii eligibile și datorii eligibile		
0200	Fonduri proprii eligibile și datorii eligibile		
0210	Fonduri proprii eligibile		
0220	Fonduri proprii de nivel 1 de bază		
0230	Fonduri proprii de nivel 1 suplimentar eligibile		
0240	Fonduri proprii de nivel 2 eligibile		
0250	Datorii eligibile și garanții		
0260	Datorii eligibile (cu excepția garanțiilor)		
0265	(-) Instrumente proprii de datorii eligibile: cuantumuri ale aprobărilor prealabile neutilizate		
0270	Garanții furnizate de entitatea de rezoluție și permise de autoritatea de rezoluție		
0280	Element memorandum: partea garantată a garanției		
0290	(-) Instrumente de fonduri proprii și instrumente de datorii eligibile emise de alte entități decât entitățile de rezoluție din același grup de rezoluție		
0293	(-) Din care: instrumente de fonduri proprii emise de entități destinate lichidării		
0295	Deducerile din datoriile eligibile care depășesc datoriile eligibile		
	Rate ale fondurilor proprii eligibile și datoriilor eligibile		
0400	Fondurile proprii și datoriile eligibile ca procent din TREA		
0410	Din care: garanții permise		
0420	Fondurile proprii și datoriile eligibile ca procent din TEM		
0430	Din care: garanții permise		
0440	Fonduri proprii de nivel 1 de bază (%) disponibile după îndeplinirea cerințelor entității		
	Elemente memorandum		
0500	Cerința amortizorului combinat (%)		
0510	Din care: cerința amortizorului de conservare a capitalului		
0520	Din care: cerința amortizorului anticiclic		
0530	Din care: cerința amortizorului de risc sistemic		
0540	Din care: amortizorul pentru instituții de importanță sistemică globală (G-SII) sau alte instituții de importanță sistemică (O-SII)		
0550	Alte datorii care pot face obiectul recapitalizării interne		
0560	Din care: reglementate de legislația unei țări terțe		
0570	Din care: elemente care conțin o clauză de reducere a valorii contabile și de conversie, astfel cum se menționează la articolul 55 din Directiva 2014/59/UE		
0580	Scadență reziduală < 1 an		
0590	Scadență reziduală >= 1 an și < 2 ani		
0600	Scadență reziduală >= 2 ani		
0610	Datorii excluse		
0620	Instrumente de fonduri proprii emise de entități destinate lichidării din același grup de rezoluție		
0630	Raportul dintre deținerile de instrumente de fonduri proprii emise de entitățile destinate lichidării, pe de o parte, și fondurile proprii eligibile și datoriile eligibile, pe de altă parte		

M 04.00 – Structura de finanțare a datoriilor eligibile (LIAB MREL)		
		Cuantum eligibil în sensul MREL/MREL interne
		0010
0100	DATORII ELIGIBILE	
0200	Depozite neacoperite și nepreferențiale >= 1 an	
0210	Din care: scadența reziduală >= 1 an și < 2 ani	
0220	Din care: scadența reziduală >= 2 ani	
0230	Din care: emise de filiale	
0300	Obligații garantate neacoperite de garanții reale >= 1 an	
0310	Din care: scadența reziduală >= 1 an și < 2 ani	
0320	Din care: scadența reziduală >= 2 ani	
0330	Din care: emise de filiale	
0400	Instrumente financiare structurate >= 1 an	
0410	Din care: scadența reziduală >= 1 an și < 2 ani	
0420	Din care: scadența reziduală >= 2 ani	
0430	Din care: emise de filiale	
0500	Datorii cu rang prioritar negarantate >= 1 an	
0510	Din care: scadența reziduală >= 1 an și < 2 ani	
0520	Din care: scadența reziduală >= 2 ani	
0530	Din care: emise de filiale	
0600	Datorii cu rang prioritar neprivilegiate >= 1 an	
0610	Din care: scadența reziduală >= 1 an și < 2 ani	
0620	Din care: scadența reziduală >= 2 ani	
0630	Din care: emise de filiale	
0700	Datorii subordonate (care nu sunt recunoscute drept fonduri proprii) >= 1 an	
0710	Din care: scadența reziduală >= 1 an și < 2 ani	
0720	Din care: scadența reziduală >= 2 ani	
0730	Din care: emise de filiale	
0800	Alte datorii eligibile MREL >= 1 an	
0810	Din care: scadența reziduală >= 1 an și < 2 ani	
0820	Din care: scadența reziduală >= 2 ani	
0830	Din care: emise de filiale	

RO
ANEXA I

M 05.00 – Ordinea de prioritate a creditorilor (entitate care nu este entitate de rezoluție) (TLAC2)

Rangul de prioritate în caz de insolvență	Tipul de creditor	Descrierea rangului de prioritate în caz de insolvență	Datorii și fonduri proprii		Datorii și fonduri proprii, mai puțin datoriile excluse						
				Din care: datorii excluse		Din care:					
						fonduri proprii și datorii eligibile în sensul MREL interne	Din care: cu o scadență reziduală de				Din care: titluri de valoare perpetue
							≥ 1 an < 2 ani	≥ 2 ani < 5 ani	≥ 5 ani < 10 ani	≥ 10 ani	
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120

RO
ANEXA I

M 06.00 – Ordinea de prioritate a creditorilor (entități de rezoluție) (TLAC3)										
Rangul de prioritate în caz de insolvență	Descrierea rangului de prioritate în caz de insolvență	Datorii și fonduri proprii		Datorii și fonduri proprii, mai puțin datoriile excluse						
			Din care: datorii excluse		Din care: fonduri proprii și datorii eligibile potențial eligibile pentru îndeplinirea MREI					
					Din care: cu o scadență reziduală de				Din care: titluri de valoare perpetue	
					≥ 1 an < 2 ani	≥ 2 ani < 5 ani	≥ 5 ani < 10 ani	≥ 10 ani		
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110

M 07.00 Instrumente reglementate de legislația unei țări terțe (MTCI)

Entitatea emitentă			Identificat orul contractul ui	Legislația aplicabilă (țara terță)	Recunoașterea contractuală a competențelor de reducere a valorii contabile și de conversie	Tratamentul de reglementare		Cuantum	Rangul de prioritate în cadrul procedurii obișnuite de insolvență		Scadență	Data (prima dată) de exercitare a opțiunii call	Opțiune call de reglementare (Da/Nu)
Denum ire	Cod	Tipul de cod				Tipul fondurilor proprii sau al datoriilor eligibile	Tipul de instrument		Legislația aplicabilă	Rangul de prioritate în caz de insolvență			
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120	0130	0140