

MT
ANNEX I

RAPPORTAR DWAR IR-REKWIŻIT MINIMU GHALL-FONDI PROPRJI U L-OBBLIGAZZJONIJIET ELIĠIBBLI

MUDELLI TA' MREL U TLAC			
Numru tal-formola	Kodiċi tal-formola	Isem il-formola /gruppi ta' formoli	Isem fil-qosor
		AMMONTI: METRIĊI EWLENIN TA' MREL U TLAC	
1	M 01.00	Metriċi ewlenin għal MREL u TLAC (gruppi / entitajiet ta' riżoluzzjoni)	KM2
		IL-KOMPOŻIZZJONI U L-MATURITÀ	
2	M 02.00	Il-kapaċità u l-kompożizzjoni ta' MREL u TLAC (gruppi / entitajiet ta' riżoluzzjoni)	TLAC1
3	M 03.00	MREL intern u TLAC interna	ILAC
4	M 04.00	Struttura ta' finanzjament tal-obbligazzjonijiet eliġibbli	LIAB-MREL
		KLASSIFIKAZZJONI TAL-KREDITURI	
5	M 05.00	Klassifikazzjoni tal-kredituri (entità li mhijiex entità ta' riżoluzzjoni)	TLAC2
6	M 06.00	Klassifikazzjoni tal-kredituri (entitajiet ta' riżoluzzjoni)	TLAC3
		INFORMAZZJONI SPEĊIFIKA GHALL-KUNTRATT	
7	M 07.00	Strumenti regolati mil-liġi ta' pajjiż terz	MTCI

MT
ANNEX I

M 01.00 - Metriċi ewlenin għal MREL u TLAC (gruppi / entitajiet ta' riżoluzzjoni) (KM2)

		Rekwiżit minimu għal fondi proprji u obbligazzjonijiet eliġibbli (MREL)	Rekwiżit għal fondi proprji u obbligazzjonijiet eliġibbli għall-G-SIIs (TLAC)
		0010	0020
	L-ammont totali tal-iskopertura għar-riskju u l-kejl tal-iskopertura totali		
0100	AMMONT TOTALI TAL-ISKOPERTURA GħAR-RISKJU (TREA)		
0110	KEJL TAL-ISKOPERTURA TOTALI (TEM)		
	Fondi proprji u obbligazzjonijiet eliġibbli		
0200	FONDI PROPRJI U OBBLIGAZZJONIJIET ELIĠIBBLI		
0210	Li minnhom: fondi proprji u obbligazzjonijiet subordinati		
0220	Li minnhom: li minnhom huma rregolati mil-liġi ta' pajjiż terz		
0230	Li minnhom: fihom klawżola ta' tniżżil fil-valur u ta' konverżjoni kif imsemmi fl-Artikolu 55 tad-Direttiva 2014/59/UE		
	Obbligazzjonijiet oħrajn ta' kapaċità ta' rikapitalizzazzjoni interna		
0250	OBBLIGAZZJONIJIET OĦRAJN TA' KAPAĊITÀ TA' RIKAPITALIZZAZZJONI INTERNA		
0260	Li minnhom: li minnhom huma rregolati mil-liġi ta' pajjiż terz		
0270	Li minnhom: fihom klawżola ta' tniżżil fil-valur u ta' konverżjoni kif imsemmi fl-Artikolu 55 tad-Direttiva 2014/59/UE		
0280	Maturità residwa ta' < sena		
0285	Maturità residwa ta' >= sena u < sentejn		
0290	Maturità residwa ta' >= sentejn		
	Proporzjonijiet u eżenzjonijiet ta' subordinazzjoni		
0300	FONDI PROPRJI U OBBLIGAZZJONIJIET ELIĠIBBLI BĦALA PERSENTAĠĠ TAT-TREA		
0310	Li minnhom: fondi proprji u obbligazzjonijiet subordinati		
0320	FONDI PROPRJI U OBBLIGAZZJONIJIET ELIĠIBBLI BĦALA PERSENTAĠĠ TAT-TEM		
0330	Li minnhom: fondi proprji u obbligazzjonijiet subordinati		
0340	Tapplika l-eżenzjoni ta' subordinazzjoni stipulata fl-Artikolu 72b(4) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013? (eżenzjoni ta' 5 %)		
0350	L-ammont aggregat ta' strumenti ta' obbligazzjonijiet eliġibbli mhux subordinati permessi jekk tiġi applikata d-diskrezzjoni ta' subordinazzjoni stipulata fl-Artikolu 72b(3) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 (eżenzjoni massima ta' 3,5 %)		
0360	Is-sehem tal-obbligazzjonijiet mhux subordinati totali li huwa inkluż fil-fondi proprji u fl-obbligazzjonijiet eliġibbli		

MT
ANNEX I

M 02.00 - Il-kapaċità u l-kompożizzjoni ta' MREL u TLAC (gruppi / entitajiet ta' riżoluzzjoni) (TLAC1)				
		Rekwiżit minimu għal fondi proprji u obbligazzjonijiet eliġibbli (MREL)	Rekwiżit tal-G-SII għal fondi proprji u obbligazzjonijiet eliġibbli (TLAC)	Entrata ta' memorandum: Ammonti eliġibbli għall-finijiet tal-MREL, iżda mhux tat-
		0010	0020	0030
0010	FONDI PROPRJI U OBBLIGAZZJONIJIET ELIĠIBBLI			
0020	Fondi proprji (eliġibbli)			
0030	Kapital tal-Grad 1 ta' Ekwità Komuni			
0040	Kapital tal-Grad 1 Addizzjonali (Eliġibbli)			
0050	Kapital tal-Grad 2 (Eliġibbli)			
0060	Obbligazzjonijiet eliġibbli			
0070	Entrati ta' obbligazzjonijiet eliġibbli qabel l-aġġustamenti			
0080	li minnhom: obbligazzjonijiet eliġibbli meqjusa bħala strutturalment subordinati			
0090	Obbligazzjonijiet eliġibbli subordinati għall-obbligazzjonijiet esklużi			
0100	Strumenti ta' obbligazzjonijiet eliġibbli mahruġa direttament mill-entità ta' riżoluzzjoni (mhux soġġetti għal anterjorità)			
0110	Strumenti ta' obbligazzjonijiet eliġibbli mahruġa minn entitajiet oħrajn fi ħdan il-grupp ta' riżoluzzjoni (mhux soġġetti għal anterjorità)			
0120	Strumenti ta' obbligazzjonijiet eliġibbli mahruġa qabel is-27 ta' Ġunju 2019			
0130	Strumenti tal-Grad 2 b'maturità residwa ta' mill-inqas sena sal-punt li ma jikkwalifikawx bħala entrati tal-Grad 2			
0132	(-) Strumenti ta' obbligazzjonijiet eliġibbli proprji subordinati għall-obbligazzjonijiet esklużi			
0135	(-) li minnu: ammonti ta' permessi minn qabel mhux użati			
0140	Obbligazzjonijiet eliġibbli mhux subordinati għall-obbligazzjonijiet esklużi			
0150	Obbligazzjonijiet eliġibbli li mhumieq subordinati għall-obbligazzjonijiet esklużi (mhux soġġetti għal anterjorità, qabel il-limitu massimu)			
0160	Obbligazzjonijiet eliġibbli li mhumieq subordinati għall-obbligazzjonijiet esklużi mahruġa qabel is-27 ta' Ġunju 2019 (qabel il-limitu massimu)			
0162	(-) Strumenti ta' obbligazzjonijiet eliġibbli proprji mhux subordinati għall-obbligazzjonijiet esklużi			
0165	(-) li minnu: ammonti ta' permessi minn qabel mhux użati			
0170	Ammonti eliġibbli wara l-applikazzjoni tal-limitu massimu tal-Artikolu 72b(3) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 (mhux soġġetti għal anterjorità)			
0180	Ammonti eliġibbli wara l-applikazzjoni tal-limitu massimu tal-Artikolu 72b(3) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, li jikkonsistu f'entrati mahruġa qabel is-27 ta' Ġunju 2019			
0190	(-) Tnaqqis			
0200	(-) Skoperturi bejn gruppi ta' riżoluzzjoni b'punt ta' dħul multiplu (MPE)			
0211	(-) Investimenti fi strumenti ta' obbligazzjonijiet eliġibbli oħrajn			
0220	Eċċess tat-tnaqqis mill-obbligazzjonijiet eliġibbli fuq l-obbligazzjonijiet eliġibbli (imnaqqas mill-Grad 2)			
ENTRATI TA' MEMORANDUM				
0400	CET1 (%) disponibbli wara li jiġu ssodisfati r-rekwiżiti tal-entità			
0410	Rekwiżit ta' riżerva kombinat (%)			
0420	li minnhom: ir-rekwiżit ta' riżerva ta' konservazzjoni ta' kapital			
0430	li minnhom: ir-rekwiżit ta' riżerva kontroċiklika			
0440	li minnhom: ir-rekwiżit ta' riżerva għar-riskju sistemiku			
0450	li minnhom: Riżerva għal Istituzzjoni Globali Sistemikament Importanti (G-SII) jew Istituzzjoni Ohra Sistemikament Importanti (O-SII)			
0460	Investimenti f'obbligazzjonijiet eliġibbli subordinati ta' istituzzjonijiet oħrajn			
0470	Investimenti f'obbligazzjonijiet eliġibbli subordinati ta' G-SIIs			
0480	Investimenti f'obbligazzjonijiet eliġibbli subordinati ta' O-SIIs			
0490	Investimenti f'obbligazzjonijiet eliġibbli subordinati ta' istituzzjonijiet oħrajn			
0500	Obbligazzjonijiet esklużi			

MT
ANNEX I

M 03.00 - MREL intern u TLAC interna (ILAC)			
		MREL intern	TLAC interna
		0010	0020
0010	Livell ta' applikazzjoni		
	L-ammont totali tal-iskopertura għar-riskju u l-kejl tal-iskopertura totali		
0100	Ammont totali tal-iskopertura għar-riskju (TREA)		
0110	Kejl tal-iskopertura totali (TEM)		
	Fondi proprji eliġibbli u obbligazzjonijiet eliġibbli		
0200	Fondi proprji eliġibbli u obbligazzjonijiet eliġibbli		
0210	Fondi proprji eliġibbli		
0220	Kapital tal-Grad 1 ta' Ekwità Komuni (CET1)		
0230	Kapital tal-Grad 1 Addizzjonali Eliġibbli		
0240	Kapital tal-Grad 2 Eliġibbli		
0250	Obbligazzjonijiet u garanziji eliġibbli		
0260	Obbligazzjonijiet eliġibbli (eskluzi l-garanziji)		
0265	(-) Strumenti ta' obbligazzjonijiet eliġibbli proprji: Ammonti ta' permessi minn qabel mhux użati		
0270	Garanziji pprovduti mill-entità ta' riżoluzzjoni u permessi mill-awtorità ta' riżoluzzjoni		
0280	Entrata ta' memorandum: Parti kollateralizzata tal-garanzija		
0290	(-) Strumenti ta' fondi proprji u strumenti ta' obbligazzjonijiet eliġibbli maħruġa minn entitajiet mhux ta' riżoluzzjoni tal-istess grupp ta' riżoluzzjoni		
0293	(-) li minnu: Strumenti ta' fondi proprji maħruġa minn entitajiet ta' likwidazzjoni		
0295	Eċċess tat-tnaqqis mill-obbligazzjonijiet eliġibbli fuq l-obbligazzjonijiet eliġibbli		
	II-proporzjonijiet ta' fondi proprji eliġibbli u obbligazzjonijiet eliġibbli		
0400	Fondi proprji u obbligazzjonijiet eliġibbli bħala persentaġġ tat-TREA		
0410	li minnhom: garanziji permessi		
0420	Fondi proprji u obbligazzjonijiet eliġibbli bħala persentaġġ tat-TEM		
0430	li minnhom: garanziji permessi		
0440	CET1 (%) disponibbli wara li jiġu ssodisfati r-rekwiżiti tal-entità		
	Entrati fil-memorandum		
0500	Rekwiżit ta' riżerva kombinat (%)		
0510	li minnhom: ir-rekwiżit ta' riżerva ta' konservazzjoni ta' kapital		
0520	li minnhom: ir-rekwiżit ta' riżerva kontroċiklika		
0530	li minnhom: ir-rekwiżit ta' riżerva għar-riskju sistemiku		
0540	li minnhom: Riżerva għal Istituzzjoni Globali Sistemikament Importanti (G-SII) jew Istituzzjoni Ohra Sistemikament Importanti (O-SII)		
0550	Obbligazzjonijiet oħrajn ta' kapaċità ta' rikapitalizzazzjoni interna		
0560	li minnhom: li minnhom huma rregolati mil-liġi ta' pajjiż terz		
0570	li minnhom: fihom klawżola ta' tniżżil fil-valur u ta' konverżjoni kif imsemmi fl-Artikolu 55 tad-Direttiva 2014/59/UE		
0580	Maturità residwa ta' < sena		
0590	Maturità residwa ta' >= sena u < sentejn		
0600	Maturità residwa ta' >= sentejn		
0610	Obbligazzjonijiet esklużi		
0620	Strumenti ta' fondi proprji maħruġa minn entitajiet ta' likwidazzjoni tal-istess grupp ta' riżoluzzjoni		
0630	Proporzjon ta' parteċipazzjonijiet ta' strumenti ta' fondi proprji maħruġa minn entitajiet ta' likwidazzjoni fuq fondi proprji eliġibbli u obbligazzjonijiet eliġibbli		

MT
ANNEX I

M 04.00 - L-istruttura ta' finanzjament tal-obbligazzjonijiet eliġibbli (LIAB MREL)		
		Ammont eliġibbli għal MREL / MREL intern
		0010
0100	OBBLIGAZZJONIJIET ELIĠIBBLI	
0200	Depożiti, mhux koperti u mhux preferenzjali >= sena	
0210	li minnhom: maturità residwa >= sena u < sentejn	
0220	li minnhom: maturità residwa >= sentejn	
0230	li minnhom: maħruġa minn sussidjarji	
0300	Obbligazzjonijiet garantiti mhux kollateralizzati >= sena	
0310	li minnhom: maturità residwa >= sena u < sentejn	
0320	li minnhom: maturità residwa >= sentejn	
0330	li minnhom: maħruġa minn sussidjarji	
0400	Noti strutturati >= sena	
0410	li minnhom: maturità residwa >= sena u < sentejn	
0420	li minnhom: maturità residwa >= sentejn	
0430	li minnhom: maħruġa minn sussidjarji	
0500	Obbligazzjonijiet superjuri mhux garantiti >= sena	
0510	li minnhom: maturità residwa >= sena u < sentejn	
0520	li minnhom: maturità residwa >= sentejn	
0530	li minnhom: maħruġa minn sussidjarji	
0600	Obbligazzjonijiet superjuri mhux preferuti >= sena	
0610	li minnhom: maturità residwa >= sena u < sentejn	
0620	li minnhom: maturità residwa >= sentejn	
0630	li minnhom: maħruġa minn sussidjarji	
0700	Obbligazzjonijiet subordinati (mhux rikonoxxuti bħala fondi proprji) >= sena	
0710	li minnhom: maturità residwa >= sena u < sentejn	
0720	li minnhom: maturità residwa >= sentejn	
0730	li minnhom: maħruġa minn sussidjarji	
0800	Obbligazzjonijiet eliġibbli oħrajn ta' MREL >= sena	
0810	li minnhom: maturità residwa >= sena u < sentejn	
0820	li minnhom: maturità residwa >= sentejn	
0830	li minnhom: maħruġa minn sussidjarji	

MT
ANNEX I

M 05.00 - Klassifikazzjoni tal-kredituri (entità li mhijiex entità ta' riżoluzzjoni) (TLAC2)											
Grad ta' insolvenza	Tip ta' kreditur	Deskrizzjoni tal-grad ta' insolvenza	Obbligazzjonijiet u fondi proprji		Obbligazzjonijiet u fondi proprji wara li jitnaqqsu l-obbligazzjonijiet esklużi						
				li minnhom: obbligazzjonijiet esklużi		li minnhom: fondi proprji u obbligazzjonijiet eliġibbli għall-fini ta' MREL intern	li minnhom: b'maturità residwa ta'				li minnhom: titoli perpetwi
							≥ sena < sentejn	≥ sentejn < 5 snin	≥ 5 snin < 10 snin	≥ 10 snin	
							0080	0090	0100	0110	
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070					0120

MT
ANNES I

M 06.00 - Klassifikazzjoni tal-kredituri (entitajiet ta' rizzoluzzjoni) (TLAC3)

Grad ta' insolvenza	Deskrizzjoni tal-grad ta' insolvenza	Obbligazzjonijiet u fondi proprji		Obbligazzjonijiet u fondi proprji wara li jitnaqqsu l-obbligazzjonijiet esklużi						
			li minnhom: obbligazzjonijiet esklużi		li minnhom: fondi proprji u obbligazzjonijiet potenzjalment eligibbli biex jissodisfaw l-MREL	li minnhom: b'maturità residwa ta'				li minnhom: titoli perpetwi
						≥ sena < sentejn	≥ sentejn < 5 snin	≥ 5 snin < 10 snin	≥ 10 snin	
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110

M 07.00 – Strumenti rregolati mil-liġi ta' pajjiż terz (MTCI)

Entità emittenti			Identifikatur tal-kuntratt	Il-liġi regolatorja (pajjiż terz)	Ir-rikonoxximent kuntrattwali tas-setgħat ta' tniżżil fil-valur u ta' konverżjoni	Trattament regolatorju		Ammont	Grad fi proċedimenti normali ta' insolvenza		Maturità	(L-ewwel) Data eżerċitabbli	Talba regolatorja (Iva/Le)
Isem	Kodiċi	Tip ta' kodiċi				Tip ta' fondi proprji jew obbligazzjonijiet eliġibbli	Tip ta' strument		Liġi regolatorja	Grad ta' insolvenza			
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120	0130	0140