

VYKAZOVANIE MINIMÁLNEJ POŽIADAVKY NA VLASTNÉ ZDROJE A OPRÁVNENÉ ZÁVÄZKY

VZORY MREL A TLAC			
Číslo vzoru	Kód vzoru	Názov vzoru/skupiny vzorov	Skrátený názov
		HODNOTY: KLÚČOVÉ PARAMETRE MREL A TLAC	
1	M 01.00	Kľúčové parametre pre MREL a TLAC (skupiny/subjekty, ktorých krízová situácia sa rieši)	KM2
		ZLOŽENIE A SPLATNOSŤ	
2	M 02.00	Kapacita a zloženie MREL a TLAC (skupiny a subjekty, ktorých krízová situácia sa rieši)	TLAC1
3	M 03.00	Interná MREL a interná TLAC	ILAC
4	M 04.00	Štruktúra financovania oprávnených záväzkov	LIAB-MREL
		PORADIE VERITEĽOV	
5	M 05.00	Poradie veriteľov (subjekt, ktorý nie je subjektom, ktorého krízová situácia sa rieši)	TLAC2
6	M 06.00	Poradie veriteľov (subjekty, ktorých krízová situácia sa rieši)	TLAC3
		INFORMÁCIE TÝKAJÚCE SA KONKRÉTNEJ ZMLUVY	
7	M 07.00	Nástroje upravené právom tretej krajiny	MTCI

SK
PRÍLOHA I

M 01.00 – Kľúčové parametre pre MREL a TLAC (skupiny/subjekty, ktorých krízová situácia sa rieši) (KM2)

		Minimálna požiadavka na vlastné zdroje a oprávnené záväzky (MREL)	Požiadavka na vlastné zdroje a oprávnené záväzky pre G-SII (TLAC)
		0010	0020
	Celková hodnota rizikovej expozície a veľkosť celkovej expozície		
0100	CELKOVÁ HODNOTA RIZIKOVEJ EXPOZÍCIE (TREA)		
0110	VEĽKOSŤ CELKOVEJ EXPOZÍCIE (TEM)		
	Vlastné zdroje a oprávnené záväzky		
0200	VLASTNÉ ZDROJE A OPRÁVNENÉ ZÁVÄZKY		
0210	Z čoho: vlastné zdroje a podriadené záväzky		
0220	Z čoho: upravené právom tretej krajiny		
0230	Z čoho: obsahujúce ustanovenie o odpísaní a konverzii, ako sa uvádza v článku 55 smernice 2014/59/EÚ		
	Iné záväzky použiteľné pri záchrane pomocou vnútorných zdrojov		
0250	INÉ ZÁVÄZKY POUŽITEĽNÉ PRI ZÁCHRANE POMOCOU VNÚTORNÝCH ZDROJOV		
0260	Z čoho: upravené právom tretej krajiny		
0270	Z čoho: obsahujúce ustanovenie o odpísaní a konverzii, ako sa uvádza v článku 55 smernice 2014/59/EÚ		
0280	Zostatková splatnosť < 1 rok		
0285	Zostatková splatnosť ≥ 1 rok a < 2 roky		
0290	Zostatková splatnosť ≥ 2 roky		
	Ukazovatele a výnimky z podriadenosti		
0300	VLASTNÉ ZDROJE A OPRÁVNENÉ ZÁVÄZKY VYJADRENÉ AKO PERCENTUÁLNY PODIEL TREA		
0310	Z čoho: vlastné zdroje a podriadené záväzky		
0320	VLASTNÉ ZDROJE A OPRÁVNENÉ ZÁVÄZKY VYJADRENÉ AKO PERCENTUÁLNY PODIEL TEM		
0330	Z čoho: vlastné zdroje a podriadené záväzky		
0340	Uplatňuje sa výnimka z podriadenosti stanovená v článku 72b ods. 4 nariadenia (EÚ) č. 575/2013? (výnimka vo výške 5 %)		
0350	Súhrnná suma povolených nástrojov nepodriadených oprávnených záväzkov, ak sa uplatňuje diskrečná právomoc v oblasti podriadenosti stanovená v článku 72b ods. 3 nariadenia (EÚ) č. 575/2013 (výnimka vo výške maximálne 3,5 %)		
0360	Podiel celkových nepodriadených záväzkov, ktorý je zahrnutý do vlastných zdrojov a oprávnených záväzkov		

SK
PRÍLOHA I

M 02.00 – Kapacita a zloženie MREL a TLAC (skupiny/subjekty, ktorých krízová situácia sa rieši) (TLAC1)				
		Minimálna požiadavka na vlastné zdroje a oprávnené záväzky (MREL)	Požiadavka pre G-SII na vlastné zdroje a oprávnené záväzky (TLAC)	Doplňujúca položka: sumy oprávnené na účely MREL, ale nie na účely TLAC
		0010	0020	0030
0010	VLASTNÉ ZDROJE A OPRÁVNENÉ ZÁVÄZKY			
0020	(Oprávnené) vlastné zdroje			
0030	Vlastný kapitál Tier 1			
0040	(oprávnený) dodatočný kapitál Tier 1			
0050	(oprávnený) kapitál Tier 2			
0060	Oprávnené záväzky			
0070	Položky oprávnených záväzkov pred úpravami			
0080	Z čoho: oprávnené záväzky považované za štrukturálne podriadené			
0090	Oprávnené záväzky podriadené vylúčeným záväzkom			
0100	Nástroje oprávnených záväzkov emitované priamo subjektom, ktorého krízová situácia sa rieši (nezachované v predchádzajúcom stave)			
0110	Nástroje oprávnených záväzkov emitované inými subjektmi v rámci skupiny, ktorej krízová situácia sa rieši (nezachované v predchádzajúcom stave)			
0120	Nástroje oprávnených záväzkov emitované pred 27. júnom 2019			
0130	Nástroje kapitálu Tier 2 so zostatkovou splatnosťou najmenej jeden rok, ak sa nekvalifikujú ako položky kapitálu Tier 2			
0132	(–) Nástroje vlastných oprávnených záväzkov podriadené vylúčeným záväzkom			
0135	(–) Z čoho: nevyužité sumy predchádzajúceho povolenia			
0140	Oprávnené záväzky nepodriadené vylúčeným záväzkom			
0150	Oprávnené záväzky, ktoré nie sú podriadené vylúčeným záväzkom (nezachované v predchádzajúcom stave, pred uplatnením horného ohraničenia)			
0160	Oprávnené záväzky, ktoré nie sú podriadené vylúčeným záväzkom, emitované pred 27. júnom 2019 (pred uplatnením horného ohraničenia)			
0162	(–) Nástroje vlastných oprávnených záväzkov nepodriadené vylúčeným záväzkom			
0165	(–) Z čoho: nevyužité sumy predchádzajúceho povolenia			
0170	Sumy oprávnené po uplatnení horného ohraničenia podľa článku 72b ods. 3 nariadenia (EÚ) č. 575/2013 (nezachované v predchádzajúcom stave)			
0180	Sumy oprávnené po uplatnení horného ohraničenia podľa článku 72b ods. 3 nariadenia (EÚ) č. 575/2013 pozostávajúce z položiek emitovaných pred 27. júnom 2019			
0190	(–) odpočty			
0200	(–) expozície medzi skupinami, ktorých krízová situácia sa rieši vo viacerých okamihoch (MPE)			
0211	(–) investície do iných nástrojov oprávnených záväzkov			
0220	Nadbytok odpočtov od oprávnených záväzkov presahujúci oprávnené záväzky (odpočítaných od Tier 2)			
DOPLŇUJÚCE POLOŽKY				
0400	CET1 (%) dostupný po splnení požiadaviek subjektom			
0410	Požiadavka na kombinovaný vankúš (%)			
0420	Z čoho: požiadavka na vankúš na zachovanie kapitálu			
0430	Z čoho: požiadavka na proticyklický vankúš			
0440	Z čoho: požiadavka na vankúš na krytie systémového rizika			
0450	Z čoho: vankúš pre globálne systémovo významnú inštitúciu (G-SII) alebo inak systémovo významnú inštitúciu (O-SII)			
0460	Investície do podriadených oprávnených záväzkov iných inštitúcií			
0470	Investície do podriadených oprávnených záväzkov G-SII			
0480	Investície do podriadených oprávnených záväzkov O-SII			
0490	Investície do podriadených oprávnených záväzkov iných inštitúcií			
0500	Vylúčené záväzky			

SK
PRÍLOHA I

M 03.00 – Interná MREL a interná TLAC (ILAC)

		Interná MREL	Interná TLAC
		0010	0020
0010	Úroveň uplatňovania		
	Celková hodnota rizikovej expozície a veľkosť celkovej expozície		
0100	Celková hodnota rizikovej expozície (TREA)		
0110	Veľkosť celkovej expozície (TEM)		
	Vlastné zdroje a oprávnené záväzky		
0200	Vlastné zdroje a oprávnené záväzky		
0210	Oprávnené vlastné zdroje		
0220	Vlastný kapitál TIER 1 (CET1)		
0230	Oprávnený dodatočný kapitál Tier 1		
0240	Oprávnený kapitál Tier 2		
0250	Oprávnené záväzky a záruky		
0260	Oprávnené záväzky (okrem záruk)		
0265	(–) Vlastné nástroje oprávnených záväzkov: nevyužité sumy predchádzajúceho povolenia		
0270	Záruky poskytnuté subjektom, ktorého krízová situácia sa rieši, a povolené orgánom pre riešenie krízových situácií		
0280	Doplňujúca položka: kolaterálom zabezpečená časť záruky		
0290	(–) Nástroje vlastných zdrojov a nástroje oprávnených záväzkov emitované subjektmi inými než subjekty, ktorých krízová situácia sa rieši, v rámci tej istej skupiny, ktorej krízová situácia sa rieši		
0293	(–) Z čoho: Nástroje vlastných zdrojov emitované likvidačnými subjektmi		
0295	(–) nadbytok odpočtov od oprávnených záväzkov presahujúci oprávnené záväzky		
	Pomery oprávnených vlastných zdrojov a oprávnených záväzkov		
0400	Vlastné zdroje a oprávnené vyjadrené záväzky ako percentuálny podiel TREA		
0410	Z čoho: povolené záruky		
0420	Vlastné zdroje a oprávnené záväzky vyjadrené ako percentuálny podiel TEM		
0430	Z čoho: povolené záruky		
0440	CET1 (%) dostupný po splnení požiadaviek subjektom		
	Doplňujúce položky		
0500	Požiadavka na kombinovaný vankúš (%)		
0510	Z čoho: požiadavka na vankúš na zachovanie kapitálu		
0520	Z čoho: požiadavka na proticyklický vankúš		
0530	Z čoho: požiadavka na vankúš na krytie systémového rizika		
0540	Z čoho: vankúš pre globálne systémovo významnú inštitúciu (G-SII) alebo inak systémovo významnú inštitúciu (O-SII)		
0550	Iné záväzky použiteľné pri záchrane pomocou vnútorných zdrojov		
0560	Z čoho: upravené právom tretej krajiny		
0570	Z čoho: obsahujúce ustanovenie o odpísaní a konverzii, ako sa uvádza v článku 55 smernice 2014/59/EÚ		
0580	Zostatková splatnosť < 1 rok		
0590	Zostatková splatnosť ≥ 1 rok a < 2 roky		
0600	Zostatková splatnosť ≥ 2 roky		
0610	Vylúčené záväzky		
0620	Nástroje vlastných zdrojov emitované likvidačnými subjektmi v rámci tej istej skupiny, ktorej krízová situácia sa rieši		
0630	Pomer podielov vo forme nástrojov vlastných zdrojov emitovaných likvidačnými subjektmi k oprávneným vlastným zdrojom a oprávneným záväzkom		

SK
PRÍLOHA I

M 04.00 – Štruktúra financovania oprávnených záväzkov (LIAB-MREL)		
		Suma oprávnená na MREL/internú MREL
		0010
0100	OPRÁVNENÉ ZÁVÄZKY	
0200	Vklady, nekryté a nepreferenčné ≥ 1 rok	
0210	Z čoho: zostatková splatnosť ≥ 1 rok a < 2 roky	
0220	Z čoho: zostatková splatnosť ≥ 2 roky	
0230	Z čoho: emitované dcérskymi spoločnosťami	
0300	Zabezpečené záväzky nezabezpečené kolaterálom ≥ 1 rok	
0310	Z čoho: zostatková splatnosť ≥ 1 rok a < 2 roky	
0320	Z čoho: zostatková splatnosť ≥ 2 roky	
0330	Z čoho: emitované dcérskymi spoločnosťami	
0400	Štruktúrované cenné papiere ≥ 1 rok	
0410	Z čoho: zostatková splatnosť ≥ 1 rok a < 2 roky	
0420	Z čoho: zostatková splatnosť ≥ 2 roky	
0430	Z čoho: emitované dcérskymi spoločnosťami	
0500	Nadriadené nezabezpečené záväzky ≥ 1 rok	
0510	Z čoho: zostatková splatnosť ≥ 1 rok a < 2 roky	
0520	Z čoho: zostatková splatnosť ≥ 2 roky	
0530	Z čoho: emitované dcérskymi spoločnosťami	
0600	Nadriadené záväzky bez prioritného postavenia ≥ 1 rok	
0610	Z čoho: zostatková splatnosť ≥ 1 rok a < 2 roky	
0620	Z čoho: zostatková splatnosť ≥ 2 roky	
0630	Z čoho: emitované dcérskymi spoločnosťami	
0700	Podriadené záväzky (nevykázané ako vlastné zdroje) ≥ 1 rok	
0710	Z čoho: zostatková splatnosť ≥ 1 rok a < 2 roky	
0720	Z čoho: zostatková splatnosť ≥ 2 roky	
0730	Z čoho: emitované dcérskymi spoločnosťami	
0800	Iné oprávnené záväzky pre MREL ≥ 1 rok	
0810	Z čoho: zostatková splatnosť ≥ 1 rok a < 2 roky	
0820	Z čoho: zostatková splatnosť ≥ 2 roky	
0830	Z čoho: emitované dcérskymi spoločnosťami	

SK
PRÍLOHA I

M 05.00 – Poradie veriteľov (subjekt, ktorý nie je subjektom, ktorého krízová situácia sa rieši) (TLAC2)

Postavenie v konkurznom konaní	Typ veriteľa	Opis postavenia v konkurznom konaní	Závazky a vlastné zdroje		Závazky a vlastné zdroje mínus vylúčené záväzky						
				Z čoho: vylúčené záväzky		Z čoho:					
						vlastné zdroje a oprávnené záväzky na účely internej MREL	Z čoho: so zostatkovou splatnosťou				Z čoho: trvalé cenné papiere
							≥ 1 rok < 2 roky	≥ 2 roky < 5 rokov	≥ 5 rokov < 10 rokov	≥ 10 rokov	
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120

SK
PRÍLOHA I

M 06.00 – Poradie veriteľov (subjekty, ktorých krízová situácia sa rieši) (TLAC3)

Postavenie v konkurznom konaní	Opis postavenia v konkurznom konaní	Závazky a vlastné zdroje		Závazky a vlastné zdroje mínus vylúčené záväzky						
		Z čoho: vylúčené záväzky	Z čoho: vlastné zdroje a oprávnené záväzky potenciálne oprávnené na splnenie MREL							
			Z čoho: so zostatkovou splatnosťou				Z čoho: trvalé cenné papiere			
			≥ 1 rok < 2 roky	≥ 2 roky < 5 rokov	≥ 5 rokov < 10 rokov	≥ 10 rokov				
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110

M 07.00 – Nástroje upravené právom tretej krajiny (MTCI)

Emitujúci subjekt			Identifikátor zmluvy	Rozhodné právo (tretia krajina)	Zmluvné uznanie právomocí na odpísanie a konverziu	Regulačné zaobchádzanie		Suma	Postavenie v bežnom konkurznom konaní		Splatnosť	(Prvý) dátum uplatnenia kúpnej opcie	Regulačná kúpna opcia (Á/N)
Názov	Kód	Druh kódu				Druh vlastných zdrojov alebo oprávnených záväzkov	Druh nástroja		Rozhodné právo	Postavenie v konkurznom konaní			
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120	0130	0140