

PUBLICAREA CERINTEI MINIME DE FONDURI PROPRII SI DATORII ELIGIBILE

| Codul modelului | Denumirea modelului |
|----------------------------|---|
| EU KM2 | Indicatori-cheie – MREL și, după caz, cerința privind fondurile proprii și datoriile eligibile pentru G-SII |
| EU TLAC1 | Componentă – MREL și, după caz, cerința privind fondurile proprii și datoriile eligibile pentru G-SII |
| EU iLAC | Capacitatea internă de absorbție a pierderilor: MREL internă și, după caz, cerința privind fondurile proprii și datoriile eligibile pentru G-SII din afara UE |
| EU TLAC2 | Ordinea de prioritate a creditorilor – entitate care nu este entitate de rezoluție |
| EU TLAC3 | Ordinea de prioritate a creditorilor – entitate de rezoluție |

EU KM2: Indicatori-cheie – MREL si, după caz, cerința privind fondurile proprii si datoriile eligibile pentru G-SII

| | | a | b | c | d | e | f |
|---|---|---|--|-----|-----|-----|-----|
| | | Cerința minimă de fonduri proprii și datorii eligibile (MREL) | Cerința privind fondurile proprii și datoriile eligibile pentru G-SII (TLAC) | | | | |
| | | T | T | T-1 | T-2 | T-3 | T-4 |
| Fonduri proprii și datorii eligibile, rate și componente | | | | | | | |
| 1 | Fonduri proprii și datorii eligibile | | | | | | |
| EU-1a | Din care: fonduri proprii și datorii subordonate | | | | | | |
| 2 | Cuantumul total al expunerii la risc a grupului de rezoluție (TREA) | | | | | | |
| 3 | Fondurile proprii și datoriile eligibile ca procent din TREA | | | | | | |
| EU-3 a | Din care: fonduri proprii și datorii subordonate | | | | | | |
| 4 | Indicatorul de măsurare a expunerii totale (TEM) al grupului de rezoluție | | | | | | |
| 5 | Fondurile proprii și datoriile eligibile ca procent din TEM | | | | | | |
| EU-5 a | Din care: fonduri proprii sau datorii subordonate | | | | | | |
| 6a | Se aplică derogarea privind subordonarea prevăzută la articolul 72b alineatul (4) din Regulamentul (UE) nr. 575/2013? (derogarea de 5 %) | | | | | | |
| 6b | Cuantumul agregat al instrumentelor de datorii eligibile nesubordonate permise dacă se aplică dacă se aplică opțiunea de subordonare prevăzută la articolul 72b alineatul (3) din Regulamentul (UE) nr. 575/2013 (derogare de maximum 3,5 %) | | | | | | |
| 6c | Dacă se aplică derogarea plafonată privind subordonarea prevăzută la articolul 72b alineatul (3) din Regulamentul (UE) nr. 575/2013, cuantumul finanțării emise care este de rang egal cu datoriile excluse și care este recunoscut pe rândul 1, împărțit la finanțarea emisă care este de rang egal cu datoriile excluse și care ar fi recunoscută pe rândul 1 dacă nu s-ar aplica niciun plafon (%) | | | | | | |
| Cerința minimă de fonduri proprii și datorii eligibile (MREL) | | | | | | | |
| EU-7 | MREL exprimată ca procent din TREA | | | | | | |
| EU-8 | Din care: de atins cu fonduri proprii sau datorii subordonate | | | | | | |
| EU-9 | MREL exprimată ca procent din TEM | | | | | | |
| EU-10 | Din care: de atins cu fonduri proprii sau datorii subordonate | | | | | | |

EU TLAC1 – Componentă – MREL și, după caz, cerința privind fondurile proprii și datoriile eligibile pentru G-SII

| | | a | b | c |
|--|---|---|--|---|
| | | Cerința minimă de fonduri proprii și datorii eligibile (MREL) | Cerința privind fondurile proprii și datoriile eligibile pentru G-SII (TLAC) | Element memorandum: cuantumul eligibile în sensul MREL, dar nu și al TLAC |
| Fonduri proprii și datorii eligibile, precum și ajustări | | | | |
| 1 | Fonduri proprii de nivel 1 de bază | | | |
| 2 | Fonduri proprii de nivel 1 suplimentar | | | |
| 3 | Câmp vid în contextul UE | | | |
| 4 | Câmp vid în contextul UE | | | |
| 5 | Câmp vid în contextul UE | | | |
| 6 | Fonduri proprii de nivel 2 | | | |
| 7 | Câmp vid în contextul UE | | | |
| 8 | Câmp vid în contextul UE | | | |
| 11 | Fonduri proprii în sensul articolului 92a din Regulamentul (UE) nr. 575/2013 și al articolului 45 din Directiva 2014/59/UE | | | |
| Fonduri proprii și datorii eligibile: elemente de capital nereglementate | | | | |
| 12 | Instrumente de datorii eligibile emise direct de entitatea de rezoluție care sunt subordonate datoriilor excluse (care nu își păstrează drepturile obținute) | | | |
| EU-12 a | Instrumente de datorii eligibile emise de alte entități din cadrul grupului de rezoluție care sunt subordonate datoriilor excluse (care nu își păstrează drepturile obținute) | | | |
| EU-12b | Instrumente de datorii eligibile subordonate datoriilor excluse emise înainte de 27 iunie 2019 (subordonate, care își păstrează drepturile obținute) | | | |
| EU-12c | 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 | | | |
| 13 | Datorii eligibile nesubordonate datoriilor excluse (care nu își păstrează drepturile obținute înainte de plafonare) | | | |
| EU-13 a | Datorii eligibile nesubordonate datoriilor excluse emise înainte de 27 iunie 2019 (înainte de plafonare) | | | |
| 14 | Cuantumul instrumentelor de datorii eligibile nesubordonate, dacă este cazul după aplicarea articolului 72b alineatul (3) din CRR | | | |
| 15 | Câmp vid în contextul UE | | | |
| 16 | Câmp vid în contextul UE | | | |
| 17 | Elemente de datorii eligibile înainte de ajustări | | | |
| EU-17 a | Din care: elemente de datorii subordonate | | | |
| Fonduri proprii și datorii eligibile: ajustări aduse elementelor de capital nereglementate | | | | |
| 18 | Fonduri proprii și elemente de datorii eligibile înainte de ajustări | | | |
| 19 | (Deducerea expunerilor între grupurile de rezoluție cu mai multe puncte de intrare) | | | |
| 20 | (Deducerea investițiilor în alte instrumente de datorii eligibile) | | | |
| 21 | Câmp vid în contextul UE | | | |
| 22 | Fonduri proprii și datorii eligibile după ajustări | | | |
| EU-22 a | Din care: fonduri proprii și datorii subordonate | | | |
| Cuantumul ponderat la risc al expunerii și indicatorul de măsurare a expunerii pentru calcularea efectului de levier ale grupului de rezoluție | | | | |
| 23 | Cuantumul total al expunerii la risc (TREA) | | | |
| 24 | Indicatorul de măsurare a expunerii totale (TEM) | | | |
| Rata fondurilor proprii eligibile și datoriilor eligibile | | | | |
| 25 | Fondurile proprii și datoriile eligibile ca procent din TREA | | | |
| EU-25 a | Din care: fonduri proprii și datorii subordonate | | | |
| 26 | Fondurile proprii și datoriile eligibile ca procent din TEM | | | |
| EU-26 a | Din care: fonduri proprii și datorii subordonate | | | |
| 27 | Fonduri proprii de nivel 1 de bază (ca procent din TREA) disponibile după îndeplinirea cerințelor grupului de rezoluție | | | |
| 28 | Cerința amortizorului combinat specific instituției | | | |
| 29 | Din care: cerința amortizorului de conservare a capitalului | | | |
| 30 | Din care: cerința amortizorului anticiclic | | | |
| 31 | Din care: cerința amortizorului de risc sistemic | | | |
| EU-31 a | Din care: amortizorul pentru instituții de importanță sistemică globală (G-SII) sau alte instituții de importanță sistemică (O-SII) | | | |
| Elemente memorandum | | | | |
| EU-32 | Cuantumul total al datoriilor excluse prevăzute la articolul 72a alineatul (2) din Regulamentul (UE) nr. 575/2013 | | | |

EU ILAC – Capacitatea internă de absorbție a pierderilor: MREL internă și, după caz, cerința privind fondurile proprii și datoriile eligibile pentru G-SII din afara UE

| | | a | b | c |
|---|--|---|---|-----------------------|
| | | Cerința minimă de fonduri proprii și datorii eligibile (MREL internă) | Cerința privind fondurile proprii și datoriile eligibile pentru G-SII din afara UE (TLAC internă) | Informații calitative |
| Cerința aplicabilă și nivelul de aplicare | | | | |
| EU-1 | Entitatea face obiectul unei cerințe privind fondurile proprii și datoriile eligibile pentru G-SII din afara UE? (Da/Nu) | | | |
| EU-2 | Dacă s-a răspuns „da” la UE-1, cerința se aplică pe bază consolidată sau individuală? (C/I) | | | |
| EU-2 a | Entitatea face obiectul unei MREL interne? (Da/Nu) | | | |
| EU-2b | Dacă s-a răspuns „da” la EU-2a, cerința se aplică pe bază consolidată sau individuală? (C/I) | | | |
| Fonduri proprii și datorii eligibile | | | | |
| EU-3 | Fonduri proprii de nivel 1 de bază | | | |
| EU-4 | Fonduri proprii de nivel 1 suplimentar eligibile | | | |
| EU-5 | Fonduri proprii de nivel 2 eligibile | | | |
| EU-6 | Fonduri proprii eligibile | | | |
| EU-7 | Datorii eligibile | | | |
| EU-8 | Din care: garanții permise | | | |
| EU-9 a | (Ajustări) | | | |
| EU-9b | Fonduri proprii și elemente de datorii eligibile după ajustări | | | |
| Cuantumul total al expunerii la risc și indicatorul de măsurare a expunerii totale | | | | |
| EU-10 | Cuantumul total al expunerii la risc (TREA) | | | |
| EU-11 | Indicatorul de măsurare a expunerii totale (TEM) | | | |
| Rata fondurilor proprii eligibile și datoriilor eligibile | | | | |
| EU-12 | Fondurile proprii și datoriile eligibile ca procent din TREA | | | |
| EU-13 | Din care: garanții permise | | | |
| EU-14 | Fondurile proprii și datoriile eligibile ca procent din TEM | | | |
| EU-15 | Din care: garanții permise | | | |
| EU-16 | Fonduri proprii de nivel 1 de bază (ca procent din TREA) disponibile după îndeplinirea cerințelor entității | | | |
| EU-17 | Cerința amortizorului combinat specific instituției | | | |
| Cerințe | | | | |
| EU-18 | Cerința exprimată ca procent din TREA | | | |
| EU-19 | Din care: parte a cerinței care poate fi îndeplinită printr-o garanție | | | |
| EU-20 | Cerința ca procent din TEM | | | |
| EU-21 | Din care: parte a cerinței care poate fi îndeplinită printr-o garanție | | | |
| Elemente memorandum | | | | |
| EU-22 | Cuantumul total al datoriilor excluse prevăzute la articolul 72a alineatul (2) din Regulamentul (UE) nr. 575/2013 | | | |

EU TLAC2a: Ordinea de prioritate a creditorilor – entitate care nu este entitate de rezoluție

| | | Ordinea de prioritate în caz de insolvență | | | | | | | Suma de la 1 la n |
|----|---|--|----------------------|-----------------------|--------|-----|-----------------------|-----------------------|-------------------|
| | | 1 | 1 | 2 | 2 | ... | n | n | |
| | | (Rangul cel mai mic) | (Rangul cel mai mic) | | | | (Rangul cel mai mare) | (Rangul cel mai mare) | |
| | | Entitate de rezoluție | Altele | Entitate de rezoluție | Altele | ... | Entitate de rezoluție | Altele | |
| 1 | Câmp vid în contextul UE | | | | | | | | |
| 2 | Descrierea rangului de prioritate din cadrul procedurii de insolvență (text liber) | | | | | | | | |
| 3 | Datorii și fonduri proprii | | | | | | | | |
| 4 | Din care: datorii excluse | | | | | | | | |
| 5 | Datorii și fonduri proprii, mai puțin datoriile excluse | | | | | | | | |
| 6 | Subsetul de datorii și fonduri proprii minus datoriile excluse care sunt fonduri proprii și datorii eligibile în scopul [a se alege, după caz: MREL internă/TLAC internă] | | | | | | | | |
| 7 | Din care: scadența reziduală ≥ 1 ani < 2 ani | | | | | | | | |
| 8 | Din care: scadența reziduală ≥ 2 ani < 5 ani | | | | | | | | |
| 9 | Din care: scadența reziduală ≥ 5 ani < 10 ani | | | | | | | | |
| 10 | Din care: scadența reziduală ≥ 10 ani, însă fără titlurile de valoare perpetue | | | | | | | | |
| 11 | Din care: titluri de valoare perpetue | | | | | | | | |

EU TLAC2b: Ordinea de prioritate a creditorilor – entitate care nu este entitate de rezoluție

| | | Ordinea de prioritate în caz de insolvență | | | | | | | Suma de la 1 la n |
|----|--|--|----------------------|-----------------------|--------|-----|-----------------------|-----------------------|-------------------|
| | | 1 | 1 | 2 | 2 | ... | n | n | |
| | | (Rangul cel mai mic) | (Rangul cel mai mic) | | | | (Rangul cel mai mare) | (Rangul cel mai mare) | |
| | | Entitate de rezoluție | Altele | Entitate de rezoluție | Altele | ... | Entitate de rezoluție | Altele | |
| 1 | Câmp vid în contextul UE | | | | | | | | |
| 2 | Descrierea rangului de prioritate din cadrul procedurii de insolvență (text liber) | | | | | | | | |
| 3 | Câmp vid în contextul UE | | | | | | | | |
| 4 | Câmp vid în contextul UE | | | | | | | | |
| 5 | Câmp vid în contextul UE | | | | | | | | |
| 6 | Fondurile proprii și datoriile eligibile în scopul MREL interne | | | | | | | | |
| 7 | Din care: scadența reziduală ≥ 1 ani < 2 ani | | | | | | | | |
| 8 | Din care: scadența reziduală ≥ 2 ani < 5 ani | | | | | | | | |
| 9 | Din care: scadența reziduală ≥ 5 ani < 10 ani | | | | | | | | |
| 10 | Din care: scadența reziduală ≥ 10 ani, însă fără titlurile de valoare perpetue | | | | | | | | |
| 11 | Din care: titluri de valoare perpetue | | | | | | | | |

EU TLAC3a: ordinea de prioritate a creditorilor – entitate de rezoluție

| | | Ordinea de prioritate în caz de insolvență | | | | Suma de la 1 la n |
|----|--|--|---|-----|-----------------------|-------------------|
| | | 1 | 2 | ... | n | |
| | | (Rangul cel mai mic) | | | (Rangul cel mai mare) | |
| 1 | Descrierea rangului de prioritate în caz de insolvență (text liber) | | | | | |
| 2 | Datorii și fonduri proprii | | | | | |
| 3 | Din care: datorii excluse | | | | | |
| 4 | Datorii și fonduri proprii, mai puțin datoriile excluse | | | | | |
| 5 | Subsetul de datorii și fonduri proprii minus datoriile excluse care sunt fonduri proprii și datorii care ar putea fi eligibile pentru îndeplinirea [a se alege, după caz: MREL/TLAC] | | | | | |
| 6 | Din care: scadența reziduală ≥ 1 ani < 2 ani | | | | | |
| 7 | Din care: scadența reziduală ≥ 2 ani < 5 ani | | | | | |
| 8 | Din care: scadența reziduală ≥ 5 ani < 10 ani | | | | | |
| 9 | Din care: scadența reziduală ≥ 10 ani, însă fără titlurile de valoare perpetue | | | | | |
| 10 | Din care: titluri de valoare perpetue | | | | | |

EU TLAC3b: ordinea de prioritate a creditorilor – entitate de rezoluție

| | | Ordinea de prioritate în caz de insolvență | | | | Suma de la 1 la n |
|----|---|--|---|-----|-----------------------|-------------------|
| | | 1 | 2 | ... | n | |
| | | (Rangul cel mai mic) | | | (Rangul cel mai mare) | |
| 1 | Descrierea rangului de prioritate din cadrul procedurii de insolvență (text liber) | | | | | |
| 2 | Câmp vid în contextul UE | | | | | |
| 3 | Câmp vid în contextul UE | | | | | |
| 4 | Câmp vid în contextul UE | | | | | |
| 5 | Fonduri proprii și datorii care ar putea fi eligibile pentru îndeplinirea MREL | | | | | |
| 6 | Din care: scadența reziduală ≥ 1 ani < 2 ani | | | | | |
| 7 | Din care: scadența reziduală ≥ 2 ani < 5 ani | | | | | |
| 8 | Din care: scadența reziduală ≥ 5 ani < 10 ani | | | | | |
| 9 | Din care: scadența reziduală ≥ 10 ani, însă fără titlurile de valoare perpetue | | | | | |
| 10 | Din care: titluri de valoare perpetue | | | | | |