EBA/GL/2020/14

4 ta' Novembru 2020

Linji gwida

dwar l-ispeċifikazzjoni u d-divulgazzjoni tal-indikaturi ta' importanza sistemika

1. Obbligi ta' konformità u ta' rapportar

Status ta' dawn il-linji gwida

1. Dan id-dokument jinkludi linji gwida maħruġa skont l-Artikolu 16 tar-Regolament (UE) Nru 1093/2010.[1] F'konformità mal-Artikolu 16(3) tar-Regolament (UE) Nru 1093/2010, l-awtoritajiet kompetenti u l-istituzzjonijiet finanzjarji jridu jagħmlu kull sforz sabiex jikkonformaw mal-linji gwida.

2. Il-linji gwida jistabbilixxu l-opinjoni tal-EBA fir-rigward ta' prattiki superviżorji xierqa fi ħdan is-Sistema Ewropea ta' Superviżjoni Finanzjarja jew ta' kif id-dritt tal-Unjoni għandu jiġi applikat f'qasam partikolari. L-awtoritajiet kompetenti kif iddefiniti fl-Artikolu 4(2) tar-Regolament (UE) Nru 1093/2010 li għalihom japplikaw il-linji gwida għandhom jikkonformaw billi jinkorporawhom fil-prattiki tagħhom kif xieraq (eż. billi jemendaw il-qafas legali tagħhom jew il-proċessi superviżorji tagħhom), inkluż fejn il-linji gwida huma indirizzati primarjament lejn l-istituzzjonijiet.

Rekwiżiti ta' rapportar

3. B'konformità mal-Artikolu 16(3) tar-Regolament (UE) Nru 1093/2010, l-awtoritajiet kompetenti jridu jinnotifikaw lill-EBA li jikkonformaw jew hux beħsiebhom jikkonformaw ma' dawn il-linji gwida, jew inkella jagħtu r-raġunijiet għan-nuqqas ta' konformità, sa 16.02.2021. Fin-nuqqas ta' kwalunkwe notifika sa din l-iskadenza, l-awtoritajiet kompetenti jiġu kkunsidrati mill-EBA bħala mhux konformi. In-notifiki għandhom jintbagħtu billi tiġi sottomessa l-formola disponibbli fuq is-sit web tal-EBA bir-referenza "EBA/GL/2020/14". In-notifiki għandhom jiġu sottomessi minn persuni bl-awtorità xierqa biex jirrappurtaw il-konformità f'isem l-awtoritajiet kompetenti tagħhom. Kwalunkwe tibdil fl-istatus tal-konformità jrid jiġi rrapportat ukoll lill-EBA.

4. In-notifiki se jiġu ppubblikati fuq is-sit web tal-EBA, f'konformità mal-Artikolu 16(3).

[1] Ir-Regolament (UE) Nru 1093/2010 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill tal-24 ta' Novembru 2010 li jistabbilixxi Awtorità Superviżorja Ewropea (Awtorità Bankarja Ewropea) u li jemenda d-Deċiżjoni Nru 716/2009/KE u jħassar id-Deċiżjoni tal-Kummissjoni 2009/78/KE, (ĠU L 331, 15.12.2010, p. 12).

2. Suġġett, kamp ta' applikazzjoni u definizzjonijiet

Suġġett

5. Dawn il-linji gwidi jirrelataw ma':

   i. l-ispeċifikazzjoni tal-indikaturi użati għall-identifikazzjoni ta' istituzzjonijiet globali sistemikament importanti (G-SIIs) kif stabbilit fir-Regolament (UE) Nru 1222/2014 ("l-indikaturi"); u

   ii. ir-rappurtar tad-*data* sottostanti (l-indikaturi, id-*data* anċillari u l-entrati ta' memorandum) u d-divulgazzjoni annwali tal-valuri tal-indikaturi li jirriżultaw użati għall-identifikazzjoni tal-G-SIIs.

Kamp ta' applikazzjoni

6. Dawn il-linji gwida japplikaw fir-rigward ta'

   i. gruppi mmexxija minn istituzzjoni prinċipali tal-UE, kumpanija azzjonarja finanzjarja omm tal-UE jew kumpanija azzjonarja finanzjarja mħallta omm tal-UE; u

   ii. istituzzjonijiet li mhumiex sussidjarji ta' istituzzjoni prinċipali tal-UE, kumpanija azzjonarja finanzjarja prinċipali tal-UE jew kumpanija azzjonarja finanzjarja mħallta prinċipali tal-UE

li josservaw miżura tal-iskopertura tal-proporzjon ta' ingranaġġ li jeċċedi EUR 200 biljun fuq bażi kkonsolidata jew individwali, rispettivament (u inklużi s-sussidjarji tal-assigurazzjoni), bl-użu ta' rata tal-kambju adegwata li tqis ir-rata tal-kambju ta' referenza ppubblikata mill-Bank Ċentrali Ewropew applikabbli mal-istandards tas-sena finanzjarja finali u internazzjonali ("l-entitajiet rilevanti").

Destinatarji

7. Dawn il-linji gwida huma indirizzati lill-awtoritajiet kompetenti kif definit fil-punt (i) tal-Artikolu 4(2) tar-Regolament (UE) Nru 1093/2010 u lill-istituzzjonijiet finanzjarji li fir-rigward tagħhom japplikaw dawn il-linji gwida. L-awtoritajiet nnominati msemmija fl-Artikolu 131(1) tad-Direttiva 2013/36/UE minbarra l-awtoritajiet kompetenti huma mħeġġa japplikaw dawn il-linji gwida. Kemm l-awtoritajiet kompetenti kif ukoll dawk innominati huma msemmija f'dawn il-linji gwida bħala l-"awtoritajiet rilevanti".

3. Implimentazzjoni

Data ta' applikazzjoni

8. Dawn il-linji gwida japplikaw minn 16.12.2020.

Tħassir

Il-linji gwida riveduti dwar l-ispeċifikazzjoni ulterjuri tal-indikaturi ta' importanza sistemikament globali u d-divulgazzjoni tagħhom tad-29 ta' Frar 2016 (EBA/GL/2016/01) hawnhekk qed jiġu mħassra.

4. L-ispeċifikazzjoni tad-*data* u l-indikaturi sottostanti użati għall-identifikazzjoni tal-G-SIIs

9. Meta jkunu qed jiġu ddeterminati l-punteġġi tal-entitajiet rilevanti abbażi tal-indikaturi, l-awtoritajiet rilevanti għandhom japplikaw l-ispeċifikazzjonijiet tad-*data* sottostanti dwar tali indikaturi kif stabbilit fl-anness għal dawn il-linji gwida.

10. L-awtoritajiet rilevanti għandhom japplikaw id-*data* anċillari (it-Taqsimiet 14 u 15 tal-anness) sabiex jappoġġjaw is-sentenza superviżorja tagħhom b'konformità mal-Artikolu 131(10) tad-Direttiva 2013/36/UE u l-entrati ta' memorandum (it-Taqsimiet 16 sa 21 tal-anness) bil-għan li tittejjeb il-kwalità tad-*data* u jiġi megħjun l-iżvilupp ta' titjib fil-ġejjieni fil-metodoloġija tal-identifikazzjoni. L-entrati ta' memorandum għandhom ikunu kkumplimentati b'kummenti dettaljati rigward il-kwalità u d-disponibbiltà tad-*data*, fejn xieraq.

5. Ir-rekwiżiti rigward ir-rappurtar u d-divulgazzjoni minn istituzzjonijiet rilevanti

11. L-awtoritajiet rilevanti għandhom jiżguraw li jiġbru d-*data* kollha (l-indikaturi, id-*data* anċillari u l-entrati ta’ memorandum) minn entitajiet rilevanti li jissodisfaw il-kriterji speċifikati fil-paragrafu 6 ta’ dawn il-linji gwida fil-31 ta’ Diċembru ta’ kull sena. Id-*data* għandha tinġabar fuq il-bażi tal-ispeċifikazzjonijiet tad-*data* sottostanti kif stabbilit fl-anness għal dawn il-linji gwida. Meta jiġu biex jirrapportaw id-*data*, l-entitajiet rilevanti għandhom isegwu l-istruzzjonijiet annwali ppubblikati fuq is-sit web tal-EBA.

12. L-awtoritajiet rilevanti għandhom jiżguraw li l-entitajiet rilevanti pubblikament jiddivulgaw fuq is-siti web tagħhom id-*data* sottostanti u l-valuri indikaturi speċifikati fit-Taqsimiet 1 sa 13 tal-anness għal dawn il-linji gwida, fuq bażi annwali.

13. Meta jiġu biex jirrappurtaw u jiddivulgaw l-informazzjoni msemmija fil-paragrafi 11 u 12, l-entitajiet rilevanti għandhom jużaw il-mudell elettroniku u jsegwu l-istruzzjonijiet annwali ppubblikati għal dan il-għan fuq is-sit web tal-EBA.

14. L-entitajiet rilevanti għandhom jirrappurtaw u pubblikament jiddivulgaw l-informazzjoni msemmija fil-paragrafi 11 u 12 fuq bażi annwali, mhux aktar tard minn erba’ xhur wara tmiem ta’ kull sena finanzjarja. Meta jagħmlu dan, l-entitajiet rilevanti għandhom jidentifikaw lilhom infushom billi jużaw l-Identifikaturi tal-Entità Ġuridika (LEIs) tagħhom.

15. L-awtoritajiet kompetenti jistgħu jippermettu lill-entitajiet rilevanti li t-tmiem is-sena finanzjarja tagħhom ma tikkoinċidix mal-31 ta’ Diċembru, biex jirrapportaw u jiddivulgaw dik l-informazzjoni abbażi tal-pożizzjoni tagħhom kemm jista’ jkun qrib il-31 ta’ Diċembru. Fi kwalunkwe każ, id-divulgazzjoni tal-informazzjoni għandha sseħħ sa mhux aktar tard mill-31 ta’ Lulju.

16. L-awtoritajiet rilevanti għandhom jiżguraw li d-*data* rrappurtata u divulgata tkun identika għal dik sottomessa lill-Kumitat ta’ Basel dwar is-Superviżjoni Bankarja, fejn applikabbli.

6. Informazzjoni lill-EBA

17. L-awtoritajiet rilevanti għandhom jipprovdu lill-EBA d-*data* kollha, inklużi d-*data* anċillari u l-entrati ta' memorandum, miġbura skont dawn il-linji gwida sabiex ikunu jistgħu jitqiegħdu fuq is-sit web tal-EBA. L-entitajiet rilevanti għandhom jidentifikaw lilhom infushom bl-użu tal-LEIs tagħhom. L-EBA ma għandhiex tagħmel divulgazzjoni tad-*data* anċillari.

Anness

Mudell

Data tal-Bank Ġenerali

Taqsima 1 – Informazzjoni Ġenerali	**Rispons**
a. Informazzjoni ġenerali pprovduta mill-awtorità superviżorja rilevanti:	
(1) Kodiċi tal-pajjiż	
(2) Isem tal-bank	
(3) Data tar-rappurtar (ssss-xx-jj)	
(4) Munita tar-rappurtar	
(5) Rata tal-konverżjoni tal-Euro	
(6) Data tas-sottomissjoni (ssss-xx-jj)	
b. Informazzjoni ġenerali pprovduta mill-istituzzjoni tar-rappurtar:	
(1) Unità tar-rappurtar	
(2) Standard tal-kontabbiltà	
(3) Data tad-divulgazzjoni pubblika (ssss-xx-jj)	
(4) Lingwa tad-divulgazzjoni pubblika	
(5) Indirizz web tad-divulgazzjoni pubblika	

Indikaturi tad-daqs

Taqsima 2 – Skoperturi Totali	**Ammont**
a. Derivattivi	
(1) Skopertura tal-kontroparti ta' kuntratti derivattivi	
(2) Ammont nozzjonali limitat ta' derivattivi ta' kreditu	
(3) Skopertura futura potenzjali ta' kuntratti derivattivi	
b. Tranżazzjonijiet ta' finanzjament tat-titoli (SFTs)	
(1) Valur gross aġġustat tal-SFTs	
(2) Skopertura tal-kontroparti tal-SFTs	
c. Assi oħrajn	
d. Ammont nozzjonali gross ta' entrati li mhumiex fuq il-karta tal-bilanċ	
(1) Entrati soġġetti għal fattur ta' konverżjoni tal-kreditu (CCF) ta' 0 %	
(2) Entrati soġġetti għal CCF ta' 20 %	
(3) Entrati soġġetti għal CCF ta' 50 %	
(4) Entrati soġġetti għal CCF ta' 100 %	
e. Aġġustamenti regolatorji	
f. Indikatur tal-iskoperturi totali (skoperturi totali qabel l-aġġustamenti regolatorji; is-somma tal-entrati 2.a.(1) sa 2.c, 0.1 immultiplikata bl-entrata 2.d.(1), 0.2 immultiplikata bl-entrata 2.d.(2), 0.5 immultiplikata bl-entrata 2.d.(3), u l-entrata 2.d.(4))	

Indikaturi ta' interkonnettività

Taqsima 3 – Assi tas-sistema intrafinanzjarja	**Ammont**
a. Fondi ddepożitati ma' jew mislufin lil istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn	
(1) Ċertifikati ta' depożitu	
b. Porzjon mhux użat ta' linji impenjati estiżi għal istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn	
c. Parteċipazzjonijiet ta' titoli maħruġa minn istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn:	
(1) Titoli ta' dejn garantiti	
(2) Titoli ta' dejn mhux garantiti superjuri	
(3) Titoli ta' dejn subordinati	
(4) Dokument kummerċjali	
(5) Titoli ta' ekwità	
(6) Tpaċija ta' pożizzjonijiet qosra fir-rigward tat-titoli ta' ekwità speċifiċi inklużi fl-entrata 3.c.(5)	
d. Skopertura attwali pożittiva netta ta' tranżazzjonijiet ta' finanzjament tat-titoli ma' istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn	
e. Derivattivi barra l-borża ma' istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn li jkollhom valur ġust pożittiv nett:	
(1) Valur ġust pożittiv nett	
(2) Skopertura futura potenzjali	
f. Indikatur tal-assi tas-sistema intrafinanzjarja (is-somma tal-entrati 3.a, 3.b sa 3.c.(5), 3.d, 3.e.(1) u 3.e.(2), bl-entrata 3.c.(6) imnaqqsa)	

Taqsima 4 – Obbligazzjonijiet tas-sistema intrafinanzjarja	**Ammont**
a. Fondi ddepożitati ma' jew mislufin mingħand istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn	
(1) Depożiti dovuti lil istituzzjonijiet depożitarji	
(2) Depożiti dovuti lil istituzzjonijiet finanzjarji mhux depożitarji	
(3) Self miksub mingħand istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn	
b. Porzjon mhux użat ta' linji impenjati miksuba minn istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn	
c. Skopertura attwali negattiva netta ta' tranżazzjonijiet ta' finanzjament tat-titoli ma' istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn	
d. Derivattivi barra l-borża ma' istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn li għandhom valur ġust negattiv nett:	
(1) Valur ġust negattiv nett	
(2) Skopertura futura potenzjali	
e. Indikatur ta' obbligazzjonijiet tas-sistema intrafinanzjarja (is-somma tal-entrati 4.a.(1) sa 4.d.(2))	

Taqsima 5 – Titoli Pendenti	**Ammont**
a. Titoli ta' dejn garantiti	
b. Titoli ta' dejn mhux garantiti superjuri	
c. Titoli ta' dejn subordinati	
d. Dokument kummerċjali	
e. Ċertifikati ta' depożitu	
f. Ekwità komuni	
g. Ishma ppreferuti u kwalunkwe forma oħra ta' finanzjament subordinat mhux inklużi fl-entrata 5.c.	
h. Indikatur ta' titoli pendenti (is-somma tal-entrati 5.a sa 5.g)	

Indikaturi tas-sostitwibbiltà/tal-infrastruttura tal-istituzzjoni finanzjarja

Taqsima 6 – Pagamenti magħmula fis-sena tar-rappurtar (minbarra l-pagamenti ta' intragrupp)	**Ammont**
a. Dollaru Awstraljan (AUD)	
b. Reais Brażiljan (BRL)	
c. Dollaru Kanadiż (CAD)	
d. Frank Żvizzeru (CHF)	
e. Yuan Ċiniż (CNY)	
f. Euro (EUR)	
g. Lira sterlina (GBP)	
h. Dollaru ta' Ħong Kong (HKD)	
i. Rupi Indjan (INR)	
j. Jen Ġappuniż (JPY)	
k. Peso Messikan (MXN)	
l. Krona Żvediża (SEK)	
m. Dollaru Amerikan (USD)	
n. Indikatur tal-attività tal-pagamenti (is-somma tal-entrati 6.a sa 6.l)	

Taqsima 7 – Assi Taħt Kustodja	**Ammont**
a. Indikatur tal-assi taħt kustodja	

Taqsima 8 – Tranżazzjonijiet sottoskritti fi swieq tad-dejn u tal-ekwità	**Ammont**
a. Attività ta' sottoskrizzjoni tal-ekwità	
b. Attività ta' sottoskrizzjoni tad-dejn	
c. Indikatur tal-attività tas-sottoskrizzjoni (is-somma tal-entrati 8.a u 8.b)	

Indikaturi tal-kumplessità

Taqsima 9 – Ammont Nozzjonali ta' Derivattivi Barra l-Borża (OTC)	**Ammont**
a. Derivattivi OTC ikklerjati permezz ta' kontroparti ċentrali	
b. Derivattivi OTC miftiehma b'mod bilaterali	
c. Indikatur tad-derivattivi OTC (is-somma tal-entrati 9.a u 9.b)	

Taqsima 10 – Titoli għan-negozjar u disponibbli għall-bejgħ	**Ammont**
a. Titoli miżmuma għan-negozjar (HFT)	
b. Titoli disponibbli għall-bejgħ (AFS)	
c. Titoli għan-negozjar u tal-AFS li jissodisfaw id-definizzjoni tal-assi tal-Livell 1	
d. Titoli għan-negozjar u tal-AFS li jissodisfaw id-definizzjoni tal-assi tal-Livell 2, b'haircuts	
e. Indikaturi tat-titoli għan-negozjar u tal-AFS (is-somma tal-entrati 10.a u 10.b, bis-somma ta' 10.c u 10.d imnaqqsa)	

Taqsima 11 – Assi tal-Livell 3	**Ammont**
a. Indikatur tal-assi tal-Livell 3 (assi stmati għall-finijiet tal-kontabbiltà bl-użu tal-inputs tal-kejl fil-Livell 3)	

Indikaturi tal-attività transġurisdizzjonali

Taqsima 12 – Pretensjonijiet transġurisdizzjonali	**Ammont**
a. Indikatur tal-pretensjonijiet transġurisdizzjonali (pretensjonijiet barranin totali abbażi tar-riskju finali)	

Taqsima 13 – Obbligazzjonijiet transġurisdizzjonali	**Ammont**
a. Obbligazzjonijiet barranin (minbarra d-derivattivi u l-obbligazzjonijiet lokali fil-munita lokali)	
(1) Kwalunkwe obbligazzjoni barranija lil uffiċċji relatati inkluża fl-entrata 13.a	
b. Obbligazzjonijiet lokali fil-munita lokali (minbarra l-attività tad-derivattivi)	
c. Indikatur tal-obbligazzjonijiet transġurisdizzjonali (is-somma tal-entrati 13.a u 13.b, b'13.a.(1) imnaqqsa)	

Data anċillari

Taqsima 14 – Indikaturi anċillari	**Ammont**
a. Obbligazzjonijiet totali	
b. Finanzjament fil-livell tal-konsumatur	
c. Proporzjon ta' dipendenza tal-finanzjament tal-operaturi (id-differenza bejn l-entrati 14.a u 14.b, diviża bl-entrata 14.a)	
d. Dħul gross totali	
e. Dħul nett totali	
f. Dħul nett barrani	
g. Valur gross ta' flus kontanti pprovduti u valur ġust gross ta' titoli pprovduti f'SFTs	
h. Valur gross ta' flus kontanti mislufa u valur ġust gross ta' titoli mislufa f'SFTs	
i. Valur ġust pożittiv gross ta' tranżazzjonijiet tad-derivattivi OTC	
j. Valur ġust negattiv gross ta' tranżazzjonijiet tad-derivattivi OTC	
	Ammont f'unitajiet uniċi
k. Numru ta' ġurisdizzjonijiet	

Taqsima 15 – Entrati anċillari	**Ammont**
e. Titoli miżmum sal-maturità	
f. Ħlasijiet magħmula fis-sena tar-rappurtar	
(1) Dollaru tan-New Zealand (NZD)	
(2) Rublu Russu (RUB)	

Entrati ta' memorandum

Taqsima 16 – Entrati dwar id-daqs	**Ammont**
a. Valur tal-kont għal prodotti ta' assigurazzjoni varjabbli b'garanziji minimi, grossi mir-riassigurazzjoni	

b. Valur tal-kont għal prodotti ta' assigurazzjoni varjabbli b'garanziji minimi netti mir-riassigurazzjoni	
c. Valur tal-investiment u l-valur tal-garanzija għall-prodotti marbuta mal-unità grossi mir-riassigurazzjoni	
d. Skoperturi totali, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni	
e. Skoperturi ta' sussidjarji tal-assigurazzjoni:	
(1). Assi tal-assigurazzjoni fuq il-karta tal-bilanċ u barra mill-karta tal-bilanċ	
(2) Skopertura futura potenzjali ta' kuntratti derivattivi għal sussidjarji tal-assigurazzjoni	
(3) Valur tal-investiment f'entitajiet ikkonsolidati	
f. Skoperturi ta' sussidjarji tal-assigurazzjoni diġà inklużi fil-kamp ta' applikazzjoni regolatorju prudenzjali ta' konsolidazzjoni	

Taqsima 17 – Entrati dwar l-interkonnettività	**Ammont**
a. Assi tas-sistema intrafinanzjarja, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni	
(1) Fondi ddepożitati ma' jew mislufin lil istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn	
(2) Porzjon mhux użat ta' linji impenjati estiżi lil istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn	
(3) Parteċipazzjonijiet ta' titoli maħruġa minn istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn	
(4) Skopertura attwali pożittiva netta ta' SFTs ma' istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn	
(5) Derivattivi OTC ma' istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn li għandhom valur ġust pożittiv nett	
b. Assi tas-sistema intrafinanzjarja, inklużi kumpaniji ta' ġestjoni tal-assi	
c. Assi tas-sistema intrafinanzjarja, inklużi fondi ta' ekwità privata	
d. Derivattivi barra l-borża ma' istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn li għandhom valur ġust pożittiv nett (definizzjoni riveduta)	
e. Obbligazzjonijiet tas-sistema intrafinanzjarja, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni	
(1) Fondi ddepożitati ma' jew mislufin minn istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn	
(2) Porzjon mhux użat ta' linji impenjati miksuba minn istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn	
(3) Skopertura attwali negattiva netta ta' SFTs ma' istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn	
(4) Derivattivi OTC ma' istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn li għandhom valur ġust negattiv nett	
f. Assi tas-sistema intrafinanzjarja, inklużi kumpaniji ta' ġestjoni tal-assi	
g. Obbligazzjonijiet tas-sistema intrafinanzjarja, inklużi fondi ta' ekwità privata	
h. Derivattivi barra l-borża ma' istituzzjonijiet finanzjarji oħrajn li għandhom valur ġust negattiv nett (definizzjoni riveduta)	
l. Titoli pendenti, inklużi t-titoli maħruġa minn sussidjarji tal-assigurazzjoni	

Taqsima 18 – Entrati dwar is-sostitwibbiltà/l-infrastruttura finanzjarja	**Ammont**
a. Pagamenti magħmula bħala korrispondent għal banek oħrajn	
(1) Dollaru Awstraljan (AUD)	
(2) Real Brażiljan (BRL)	
(3) Dollaru Kanadiż (CAD)	
(4) Frank Żvizzeru (CHF)	
(5) Yuan Ċiniż (CNY)	
(6) Euro (EUR)	
(7) Lira Sterlina (GBP)	
(8) Dollaru ta' Ħong Kong (HKD)	

(9) Rupi Indjan (INR)	
(10) Jen Ġappuniż (JPY)	
(11) Krona Żvediża (SEK)	
(12) Dollaru Amerikan (USD)	
(13) Peso Messikan (MXN)	
(14) Dollaru tan-New Zealand (NZD)	
(15) Rublu Russu (RUB)	
b Volum tan-negozjar tat-titoli maħruġa minn entitajiet sovrani	
(1) Kwalunkwe tranżazzjoni intragrupp inkluża fil-punt 18.b	
c. Volum tan-negozjar tat-titoli maħruġa minn entitajiet oħrajn fis-settur pubbliku	
(1) Kwalunkwe tranżazzjoni intragrupp inkluża fil-punt 18.c	
d. Volum tan-negozjar ta' titoli oħrajn bi dħul fiss	
(1) Kwalunkwe tranżazzjoni intragrupp inkluża fil-punt 18.d	
e. Volum tan-negozjar tat-titoli elenkati	
(1) Kwalunkwe tranżazzjoni intragrupp inkluża fil-punt 18.e	
f. Volum tan-negozjar tat-titoli l-oħrajn kollha	
(1) Kwalunkwe tranżazzjoni intragrupp inkluża fil-punt 18.f	
g. Marġni inizjali ddepożitat lill-kontropartijiet ċentrali (CCPs) f'isem il-klijenti	
h. Marġni inizjali ddepożitat lis-CCPs għall-kont proprju tal-grupp tar-rappurtar	
i. Kontribuzzjonijiet tal-fond ta' inadempjenza għas-CCPs	
j. Faċilitajiet oħrajn għas-CCPs	
k. Provvista ta' servizzi ta' saldu b'konnessjoni mat-tranżazzjonijiet ikklerjati ċentralment	
l. Pagamenti magħmula fis-sena tar-rappurtar (esklużi pagamenti intragrupp): li minnhom dawk li jsiru lill-banek ċentrali	
(1) Tranżazzjonijiet relatati mal-operazzjonijiet ta' bank ċentrali	
(2) Pagamenti relatati max-xiri ta' dejn sovran	
(3) Tranżazzjonijiet oħra lill-banek ċentrali	

Taqsima 19 – Entrati dwar il-kumplessità	**Ammont**
a. Ammont nozzjonali ta' derivattivi barra l-borża, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni	
(1) Ikklerjat permezz ta' CCP fejn il-grupp (inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni) jaġixxi bħala intermedjarju finanzjarju (komponent tas-CCP)	
(2) Ikklerjat permezz ta' CCP fejn il-grupp (inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni) jaġixxi bħala intermedjarju finanzjarju (komponent tal-klijent)	
(3) Ikklerjat permezz ta' CCP fejn il-grupp, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni, jaġixxi bħala aġent	
(4) Ikklerjat permezz ta' CCP fejn il-grupp, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni, jagħmel kummerċ fuq il-kont proprju tiegħu	
(5) Miftiehma b'mod bilaterali	
b. Titoli għan-negozjar u tal-AFS, li jinkludu sussidjarji tal-assigurazzjoni	
c. Titoli għan-negozjar u tal-AFS, li jinkludu sussidjarji tal-assigurazzjoni, li jissodisfaw id-definizzjoni tal-assi tal-Livell 1	
Titoli għan-negozjar u tal-AFS, li jinkludu sussidjarji tal-assigurazzjoni, li jissodisfaw id-definizzjoni tal-assi tal-Livell 2, b'haircuts	

e. Titoli għan-negozjar u tal-AFS, miżmuma minn sussidjajri tal-assigurazzjoni biss
f. Assi tal-Livell 3, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni
g. Assi tal-Livell 2 (assi stmati għall-finijiet ta' kontabbiltà bl-użu tal-inputs tal-kejl fil-Livell 2)
h. Assi tal-Livell 2, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni
i. Titoli għan-negozjar u tal-AFS grossi ta' tnaqqis ta' assi likwidi, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni
j. Titoli għan-negozjar u tal-AFS, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni, li jissodisfaw id-definizzjoni tal-assi tal-Livell 1
k. Titoli għan-negozjar u tal-AFS, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni, li jissodisfaw id-definizzjoni tal-assi tal-Livell 2, b'haircuts
l. Titoli għan-negozjar u tal-AFS, miżmuma minn sussidjarji tal-assigurazzjoni biss
m. Assi tal-Livell 3, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni
(1) Assi tal-Livell 2, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni, ikklerjati permezz ta' CCP
(2) Assi tal-Livell 2, inklużi sussidjarji tal-assigurazzjoni, miftiehma b'mod bilaterali
(3) Assi tal-Livell 2 oħrajn
n. Valur medju tal-assi tal-Livell 3
o. Valur medju tal-assi tal-Livell 2

Taqsima 20 – Entrati dwar l-attività transġuriżdizzjonali	**Ammont**
a. Pretensjonijiet ta' derivattivi barranin abbażi ta' riskju finali	
b. Obbligazzjonijiet barranin abbażi ta' riskju immedjat (inklużi derivattivi)	
(1) Obbligazzjonijiet ta' derivattivi barranin abbażi ta' riskju immedjat	
c. Obbligazzjonijiet lokali fil-munita lokali (inkluż l-attività tad-derivattivi)	
d. Pretensjonijiet lokali transġurisdizzjonali fil-munita lokali (minbarra l-attività tad-derivattivi)	
e. Obbligazzjonijiet lokali transġurisdizzjonali fil-munita lokali (minbarra l-attività tad-derivattivi)	
f. Pretensjonijiet barranin totali fuq bażi ta' riskju finali (meta wieħed iqis iż-żona tal-euro (ŻE) bħala ġurisdizzjoni waħda)	
g. Pretensjonijiet ta' derivattivi barranin fuq bażi ta' riskju finali (meta wieħed iqis iż-ŻE bħala ġurisdizzjoni waħda)	
h. Obbligazzjonijiet barranin fuq bażi ta' riskju immedjat, inklużi derivattivi (meta wieħed iqis iż-ŻE bħala ġurisdizzjoni waħda)	
(1) Obbligazzjonijiet ta' derivattivi barranin fuq bażi ta' riskju immedjat (meta wieħed iqis iż-ŻE bħala ġurisdizzjoni waħda)	
i. Pretensjonijiet lokali transġurisdizzjonali fil-munita lokali, minbarra l-attività tad-derivattivi (meta wieħed iqis iż-ŻE bħala ġurisdizzjoni waħda)	
j. Pretensjonijiet lokali transġurisdizzjonali fil-munita lokali, inkluż l-attività tad-derivattivi (meta wieħed iqis iż-ŻE bħala ġurisdizzjoni waħda)	
k. Obbligazzjonijiet barranin, minbarra d-derivattivi u l-obbligazzjonijiet lokali fil-munita lokali (meta wieħed iqis iż-ŻE bħala ġurisdizzjoni waħda)	
(1) Kwalunkwe obbligazzjoni barranija lil uffiċċji relatati inklużi fl-entrata 20.h (meta wieħed iqis ż-ŻE bħala ġurisdizzjoni waħda)	
l. Obbligazzjonijiet lokali fil-munita lokali minbarra d-derivattivi (meta wieħed iqis ż-ŻE bħala ġurisdizzjoni waħda)	
m. Obbligazzjonijiet lokali fil-munita lokali inklużi d-derivattivi (meta wieħed	

iqis ż-ŻE bħala ġurisdizzjoni waħda)	
n. Pożizzjonijiet lokali netti totali fil-munita lokali inklużi d-derivattivi, jekk pożittivi netti	
o. Pożizzjonijiet lokali netti totali fil-munita lokali inklużi d-derivattivi, jekk negattivi netti	
p. Pożizzjonijiet lokali netti totali fil-munita lokali fil-pajjiżi li mhumiex fiż-ŻE inklużi d-derivattivi, jekk pożittivi netti (meta wieħed iqis ż-ŻE bħala ġurisdizzjoni waħda)	
q. Pożizzjonijiet lokali netti totali fil-munita lokali fil-pajjiżi li mhumiex fiż-ŻE inklużi d-derivattivi, jekk negattivi netti (meta wieħed iqis ż-ŻE bħala ġurisdizzjoni waħda)	
r. Pożizzjonijiet lokali netti totali fil-munita lokali fil-pajjiżi taż-ŻE inklużi d-derivattivi (meta wieħed iqis ż-ŻE bħala ġurisdizzjoni waħda)	
s. Pretensjonijiet bejn l-uffiċċji rreġistrati minn sussidjarji barranin	
t. Pretensjonijiet bejn l-uffiċċji rreġistrati minn fergħat barranin	
u. Obbligazzjonijiet bejn l-uffiċċji rreġistrati minn sussidjarji barranin	
v. Obbligazzjonijiet bejn l-uffiċċji rreġistrati minn fergħat barranin	

Taqsima 21 – Entrati anċillari	**Ammont**
a. Dħul nett barrani (meta wieħed iqis ż-ŻE bħala ġurisdizzjoni waħda)	
b. In-numru ta' ġurisdizzjonijiet (meta wieħed iqis ż-ŻE bħala ġurisdizzjoni waħda)	

Sommarju tal-kontrolli

Taqsima 22 – Valuri indikaturi	**valur indikatur f'miljuni ta' EUR**
a. Taqsima 2 – Indikatur tal-iskoperturi totali	
b. Taqsima 3 – Indikatur tal-assi tas-sistema intrafinanzjarja	
c. Taqsima 4 – Indikatur tal-obbligazzjonijiet tas-sistema intrafinanzjarja	
d. Taqsima 5 – Indikatur tat-titoli pendenti	
e. Taqsima 6 – Indikatur tal-attività tal-pagamenti	
f. Taqsima 7 – Indikatur tal-assi taħt kustodja	
g. Taqsima 8 – Indikatur tal-attività tas-sottoskrizzjoni	
h. Taqsima 9 – Indikatur tad-derivattivi OTC	
i. Taqsima 10 – Indikatur tat-titoli għan-negozjar u tal-AFS	
j. Taqsima 11 – Indikatur tal-assi tal-Livell 3	
k. Taqsima 12 – Indikatur tal-pretensjonijiet transġurisdizzjonali	
l. Taqsima 13 – Indikatur tal-obbligazzjonijiet transġurisdizzjonali	
m. Taqsimiet oħrajn	
(1) Entrata 1.a – Informazzjoni ġenerali pprovduta mill-awtorità superviżorja	

(2) Entrata 1.b – Informazzjoni ġenerali pprovduta mill-istituzzjoni tar-rappurtar	
(3) Taqsima 14 – Indikaturi anċillari	
(4) Taqsima 15 – Entrati anċillari	
(5) Taqsima 16 – Entrati dwar id-daqs	
(6) Taqsima 17 – Entrati dwar l-interkonnettività	
(7) Taqsima 18 – Entrati dwar is-sostitwibbiltà/l-infrastruttura finanzjarja	
(8) Taqsima 19 – Entrati dwar il-kumplessità	
(9) Taqsima 20 – Entrati dwar l-attività transġuriżdizzjonali	
(10) Taqsima 21 – Entrati anċillari	

Taqsima 23 – Valuri indikaturi (metodoloġija riveduta – Lulju 2018)	**Valur indikatur f'miljuni ta' EUR**
a. Taqsima 16 – Indikatur tal-iskoperturi totali	
b. Taqsima 17 – Indikatur tal-assi tas-sistema intrafinanzjarja	
c. Taqsima 17 – Indikatur tal-obbligazzjonijiet tas-sistema intrafinanzjarja	
d. Taqsima 17 – Indikatur tat-titoli pendenti	
e. Taqsima 6 – Indikatur tal-attività tal-pagamenti	
f. Taqsima 7 – Indikatur tal-assi taħt kustodja	
g. Taqsima 8 – Indikatur tal-attività tas-sottoskrizzjoni	
h. Taqsima 18 – Indikatur tal-volum tal-kummerċ – dħul fiss	
i. Taqsima 18 – Indikatur tal-volum tal-kummerċ – ekwitajiet u titoli oħra	
j. Taqsima 19 – Indikatur tad-derivattivi OTC	
k. Taqsima 10 – Indikatur tat-titoli għan-negozjar u tal-AFS	
l. Taqsima 19 – Indikatur tal-assi tal-Livell 3	
m. Taqsima 20 – Indikatur tal-pretensjonijiet transġurisdizzjonali	
n. Taqsima 20 – Indikatur tal-obbligazzjonijiet transġurisdizzjonali	