# REGOLAMENT TA' IMPLIMENTAZZJONI TAL-KUMMISSJONI (UE) 2025/379

**tas-26 ta' Frar 2025**

**li jemenda l-istandards tekniċi ta' implimentazzjoni stabbiliti fir-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) 2016/2070 fir-rigward ta' portafolli ta' parametraġġ referenzjarju, mudelli ta' rappurtar u struzzjonijiet ta' rappurtar li għandhom jiġu applikati fl-Unjoni għar-rappurtar imsemmi fl-Artikolu 78(2) tad-Direttiva 2013/36/UE tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill**

**(Test b'rilevanza għaż-ŻEE)**

IL-KUMMISSJONI EWROPEA,

Wara li kkunsidrat it-Trattat dwar il-Funzjonament tal-Unjoni Ewropea,

Wara li kkunsidrat id-Direttiva 2013/36/UE tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill tas-26 ta' Ġunju 2013 dwar l-aċċess għall-attività tal-istituzzjonijiet ta' kreditu u s-superviżjoni prudenzjali tal-istituzzjonijiet ta' kreditu u tad-ditti tal-investiment, li temenda d-Direttiva 2002/87/KE u li tħassar id-Direttivi 2006/48/KE u 2006/49/KE [1], u b'mod partikolari l-Artikolu 78(8), it-tielet subparagrafu, tagħha,

Billi:

(1) Skont l-Artikolu 78(1) tad-Direttiva 2013/36/UE, l-istituzzjonijiet awtorizzati li jużaw approċċi interni huma meħtieġa jippreżentaw lill-awtorità kompetenti tagħhom bi frekwenza xierqa, u tal-inqas darba fis-sena, ir-riżultati tal-kalkoli tal-ammonti tal-iskoperturi ponderati għar-riskju jew tar-rekwiżiti ta' fondi proprji tagħhom fl-ambitu tal-approċċi interni tagħhom għall-iskoperturi jew il-pożizzjonijiet li huma inklużi fil-portafolli ta' parametraġġ referenzjarju, biex dik l-awtorità kompetenti tkun tista' tivvaluta l-kwalità ta' dawk l-approċċi interni ("eżerċizzju ta' parametraġġ referenzjarju"). Skont l-Artikolu 78(3), it-tieni subparagrafu, ta' dik id-Direttiva, l-Awtorità Bankarja Ewropea (l-"EBA", European Banking Authority) għandha tipproduċi rapport biex tassisti lill-awtoritajiet kompetenti fil-valutazzjoni tal-kwalità tal-approċċi interni tal-istituzzjonijiet, abbażi tar-riżultati tal-eżerċizzju ta' parametraġġ referenzjarju. Ir-rekwiżiti ta' rapportar għall-eżerċizzju ta' parametraġġ referenzjarju huma speċifikati fir-Regolament ta' Implimentazzjoni tal-Kummissjoni (UE) 2016/2070 [2] li ġie emendat diversi drabi. Bil-għan li jiġu riflessi l-bidliet fil-fokus tal-valutazzjonijiet tal-awtoritajiet kompetenti u tar-rapporti tal-EBA, u fid-dawl tal-bidliet leġiżlattivi fil-qasam tar-riskju tas-suq, jeħtieġ li l-portafolli ta' parametraġġ referenzjarju jerġgħu jiġu aġġornati, flimkien mar-rekwiżiti ta' rapportar stabbiliti f'dak ir-Regolament ta' Implimentazzjoni.

(2) Għall-parametraġġ referenzjarju tar-riskju tal-kreditu, l-istruzzjonijiet jenħtieġ li jinbidlu biex jispeċifikaw in-natura obbligatorja tar-rapportar tal-parametri tar-riskju tal-probabbiltà ta' inadempjenza (PD, probability of default) u t-telf fil-każ ta' inadempjenza (LGD, loss given default) fir-rigward tal-komponenti tal-marġni ta' konservattività (MoC, margin of conservativeness), iż-żieda regolatorja, u r-reċessjoni ekonomika (DWT, downturn), li jistgħu jkunu sors ta' varjabbiltà fil-mudelli. Barra minn hekk, jenħtieġ li jiġi speċifikat li l-istituzzjonijiet huma meħtieġa jirrappurtaw l-identifikatur tal-mudelli assenjat mill-awtorità kompetenti, u b'hekk tiġi simplifikata l-operazzjonalizzazzjoni tal-allokazzjoni tar-rapportar tad-data.

(3) Ir-Regolament Delegat tal-Kummissjoni (UE) 2024/2795 [3] ippospona d-data tal-applikazzjoni tar-rekwiżiti l-ġodda ta' fondi proprji għar-riskju tas-suq. Għalhekk, il-mudelli għall-approċċ tal-mudell intern eżistenti mhumiex qed jiġu sostitwiti għal dan l-eżerċizzju. B'mod parallel, il-mudelli għall-validazzjoni tal-approċċ standardizzat jenħtieġ li jiġu estiżi biex jinkludu portafolli addizzjonali meta mqabbla mal-eżerċizzju tal-2024, fejn kienu fil-kamp ta' applikazzjoni biss l-istrumenti tar-rati tal-imgħax. Dan għandu l-għan li jiżgura sorveljanza adegwata u implimentazzjoni bla xkiel tal-approċċ standardizzat il-ġdid, li jintuża għall-kalkolu tal-minimu tal-output.

[1] ĠU L 176, 27.6.2013, p. 338, ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2013/36/oj.

[2] Ir-Regolament ta' Implimentazzjoni tal-Kummissjoni (UE) 2016/2070 tal-14 ta' Settembru 2016 li jistipula l-istandards tekniċi ta' implimentazzjoni għall-mudelli, definizzjonijiet, u soluzzjonijiet tal-IT li għandhom jintużaw mill-istituzzjonijiet meta jirrapportaw lill-Awtorità Bankarja Ewropea u lil awtoritajiet kompetenti skont l-Artikolu 78(2) tad-Direttiva 2013/36/UE tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill (ĠU L 328, 2.12.2016, p. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2016/2070/oj).

[3] Ir-Regolament Delegat tal-Kummissjoni (UE) 2024/2795 tal-24 ta' Lulju 2024li jemenda r-Regolament (UE) Nru 575/2013 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill fir-rigward tad-data ta' applikazzjoni tar-rekwiżiti ta' fondi proprji għar-riskju tas-suq (ĠU L, 2024/2795, 31.10.2024, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2024/2795/oj).

(4) Għaldaqstant, ir-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) 2016/2070 jenħtieġ li jiġi emendat skont dan.

(5) Dan ir-Regolament huwa bbażat fuq l-abbozz tal-istandards tekniċi ta' implimentazzjoni ppreżentat lill-Kummissjoni mill-EBA.

(6) L-EBA wettqet konsultazzjonijiet pubbliċi miftuħa dwar l-abbozz tal-istandards tekniċi ta' implimentazzjoni li fuqhom huwa bbażat dan ir-Regolament, analizzat il-kostijiet u l-benefiċċji potenzjali relatati u talbet l-opinjoni tal-Grupp tal-Partijiet Bankarji Interessati stabbilit f'konformità mal-Artikolu 37 tar-Regolament (UE) Nru 1093/2010 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill ([4]),

ADOTTAT DAN IR-REGOLAMENT:

*Artikolu 1*

Ir-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) 2016/2070 huwa emendat kif ġej:

(1) L-Anness IV huwa sostitwit bit-test fl-Anness I ta' dan ir-Regolament;

(2) l-Anness V huwa sostitwit bit-test fl-Anness II ta' dan ir-Regolament;

(3) l-Anness VI huwa sostitwit bit-test fl-Anness III ta' dan ir-Regolament;

(4) L-Anness VII huwa sostitwit bit-test fl-Anness IV ta' dan ir-Regolament;

(5) L-Anness X huwa sostitwit bit-test fl-Anness V ta' dan ir-Regolament;

*Artikolu 2*

Dan ir-Regolament għandu jidħol fis-seħħ fl-għoxrin jum wara dak tal-pubblikazzjoni tiegħu f'*Il-Ġurnal Uffiċjali tal-Unjoni Ewropea*.

Dan ir-Regolament għandu jorbot fl-intier tiegħu u japplika direttament fl-Istati Membri kollha.

Magħmul fi Brussell, is-26 ta' Frar 2025.

*Għall-Kummissjoni*
*Il-President*
Ursula VON DER LEYEN

([4]) 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, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2010/1093/oj).

*ANNESS I*

*"ANNESS IV*

**RIŻULTATI TAL-PORTAFOLLI TA' PARAMETRAĠĠ REFERENZJARJU SUPERVIŻORJU**

**PARTI I: STRUZZJONIJIET ĠENERALI**

**PARTI II: STRUZZJONIJIET RELATATI MAL-MUDELL**

C 101 – Dettalji dwar l-iskoperturi fil-Portafolli b'Riskju Baxx ta' Inadempjenza skont il-kontroparti

C 102 – Dettalji dwar l-iskoperturi fil-Portafolli b'Riskju Baxx ta' Inadempjenza

C 103 – Dettalji dwar l-iskoperturi fil-Portafoll b'Riskju Għoli ta' Inadempjenza

C 105.01 – Definizzjoni ta' mudelli interni

C 105.02 – Immappjar ta' mudelli interni għal portafolli

C 105.03 – Immappjar ta' mudelli interni għal pajjiżi

**PARTI I: STRUZZJONIJIET ĠENERALI**

1. L-informazzjoni għandha tiġi sottomessa biss għal dawk il-kontropartijiet u portafolli fejn teżisti skopertura attwali fid-data ta' referenza fil-forma ta' Skopertura Oriġinali jew ta' Skopertura wara s-CRM (Credit Risk Management). Il-kontropartijiet u l-portafolli li għalihom ma teżisti l-ebda skopertura fid-data ta' referenza ma għandhomx jiġu sottomessi.

2. L-informazzjoni għandha tiġi sottomessa biss għal dawk l-iskoperturi li għalihom l-awtorità kompetenti tkun approvat mudell intern għall-kalkolu tal-ammonti ta' skoperturi ponderati għar-riskju (RWA, risk weighted exposure amounts). Fil-mudell C 101, il-kodiċijiet tal-kontroparti li jintemmu b'"STDA" ma għandhomx jiġu rrapportati. Għall-kodiċijiet tal-kontroparti li jifdal tal-mudell C 101 tal-Anness I u għall-portafolli ta' parametraġġ referenzjarju msemmija fil-mudelli C 102 u C 103, għandhom jiġu esklużi l-iskoperturi skont l-Approċċ Standardizzat u l-iskoperturi li għalihom l-awtorità kompetenti rispettiva tkun ippermettiet l-użu parzjali temporanju jew permanenti tal-Approċċ Standardizzat.

3. Il-valuri li jiġbru l-informazzjoni mhux applikabbli/mhux definita sew għandhom jew jitħallew vojta jew għandha tiddaħħal l-indikazzjoni "NULL"; dan japplika wkoll għal kwantitajiet ponderati skont l-iskopertura fl-inadempjenza (EAD, exposure at default) jew għal parametri li ma jistgħux jiġu kkalkolati. Bl-istess mod, il-kampijiet tad-data li r-rappurtar tagħhom mhuwiex obbligatorju jistgħu jitħallew vojta jew jitniżżlu bħala "NULL". Il-valuri żero għandhom jiġu rrapportati biss meta l-intenzjoni tkun li tiġi rrapportata kwantità jew parametru li jkunu żero. L-ebda waħda mill-indikazzjonijiet "blank" jew "NULL" ma għandha tintuża sabiex jiġu rrapportati kwantitajiet jew parametri li jkunu żero.

4. L-ammonti monetarji għandhom jiġu rrapportati bl-istess mod kif jiġu rrapportati għall-kalkolu tar-rekwiżiti ta' fondi proprji f'data ta' referenza speċifika f'konformità mar-Regolament ta' Implimentazzjoni tal-Kummissjoni (UE) Nru 2021/451 ([1]).

([1]) Ir-Regolament ta' Implimentazzjoni tal-Kummissjoni (UE) 2021/451 tas-17 ta' Diċembru 2020 li jistabbilixxi standards tekniċi ta' implimentazzjoni għall-applikazzjoni tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill fir-rigward tar-rapportar superviżorju tal-istituzzjonijiet u li jħassar ir-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) Nru 680/2014 (ĠU L 97, 19.3.2021, p. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2021/451/oj).

**PARTI II: STRUZZJONIJIET RELATATI MAL-MUDELL**

## C 101 — Dettalji dwar l-iskoperturi fil-Portafolli b'Riskju Baxx ta' Inadempjenza skont il-kontroparti

Skoperturi speċjalizzati ta' għoti ta' self jiġu esklużi.

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0010 | Kodiċi tal-Kontroparti | Il-Mudell C 101, il-kolonna 0010 tal-Anness I | Għandu jiġi rrapportat il-kodiċi tal-kontroparti tal-mudell C 101, il-kolonna 0010 tal-Anness I li jiddefinixxi l-kontroparti inkluża fil-portafolli tal-kampjuni tal-portafoll b'riskju baxx ta' inadempjenza ("LDP", low default portfolio). Dan il-kodiċi huwa identifikatur tar-ringiela u għandu jkun uniku għal kull ringiela fil-mudell. |
| 0020 | Klassi tal-iskopertura | Il-paragrafu 76 tal-Anness II tar-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) 2021/451 | Kull kontroparti għandha tiġi assenjata għal waħda mill-klassijiet tal-iskoperturi li ġejjin:<br>(a) Bank ċentrali u gvernijiet ċentrali;<br>(b) Istituzzjonijiet;<br>(c) Korporattiva – SME (intrapriża żgħira u ta' daqs medju, small- and medium-sized enterprise);<br>(d) Korporattiva – Self speċjalizzat<br>(e) Korporattiva – Oħrajn;<br>(f) Fil-livell tal-konsumatur – Iggarantita minn SME ta' proprjetà immobbli;<br>(g) Fil-livell tal-konsumatur – Iggarantita minn SME mhux ta' proprjetà immobbli;<br>(h) Fil-livell tal-konsumatur – Rotanti kwalifikanti<br>(i) Fil-livell tal-konsumaturi – SME oħrajn;<br>(j) Fil-livell tal-konsumatur – Oħrajn mhux SME;<br>(k) Mhux applikabbli<br>"Mhux applikabbli" għandha tintuża meta ma tapplika l-ebda waħda mit-tweġibiet fil-lista, li huwa l-każ fejn l-iskoperturi għal kontroparti jiġu kklassifikati fi klassijiet ta' skoperturi multipli mingħajr ma waħda tkun predominanti b'mod ċar. |
| 0040 | Klassifikazzjoni | | Għandha tiġi rrapportata l-klassifikazzjoni tal-grad ta' klassifikazzjoni interna assenjat lill-kontroparti fl-iskala ta' klassifikazzjoni interna applikabbli tal-istituzzjoni. Għandha ssegwi l-ordni numerika 1, 2, 3, eċċ., mill-iktar riskju baxx għall-ogħla riskju, bl-esklużjoni ta' inadempjenzi b'PD li tikkorrispondi għal 100%.<br>Meta istituzzjoni tuża skala ta' klassifikazzjoni kontinwa f'konformità mal-Artikolu 169(3) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill ([2]), għandhom jintużaw il-gradi ta' klassifikazzjoni kif irrapportati fil-kolonna 0005 tal-mudell C 08.02 tal-Anness I tar-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) Nru 2021/451.<br>Meta l-iskoperturi għal kontroparti jkunu ġew assenjati fi gradi ta' klassifikazzjoni multipli f'konformità mal-Artikolu 172(1), il-punt (e)(i) jew (iii), tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, għandu jiġi rrapportat il-grad ta' klassifikazzjoni żero (0). |

([2]) Ir-Regolament (UE) Nru 575/2013 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill tas-26 ta' Ġunju 2013 dwar ir-rekwiżiti prudenzjali għall-istituzzjonijiet ta' kreditu u d-ditti tal-investiment u li jemenda r-Regolament (UE) Nru 648/2012 (ĠU L 176, 27.6.2013, p. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2013/575/oj).

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0050 | Data tal-aktar klassifikazzjoni reċenti tal-kontroparti | | Għandha tiġi rrapportata d-data tal-aktar klassifikazzjoni reċenti tal-kontroparti. |
| 0060 | PD | Il-mudell C 08.01, il-kolonna 0010 tal-Anness I tar-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) 2021/451 | Għandha tiġi rrapportata l-PD assenjata lill-kontroparti. Il-PD għandha tkun il-PD użata fil-kalkolu tal-RWA, għajr l-effett tal-miżuri f'konformità mal-Artikolu 458 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. Il-PD għandha tiġi espressa bħala valur bejn 0 u 1. |
| 0070 | Status ta' inadempjenza | | L-istatus ta' inadempjenza tal-kontroparti għandu jiġi rrapportat. Għandu jkun wieħed minn dawn li ġejjin skont l-Artikolu 178 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013:<br>(a) Inadempjenti;<br>(b) Mhux inadempjenti; |
| 0080 | Skopertura oriġinarja qabel il-fatturi ta' konverżjoni | Il-mudell C 08.01, il-kolonna 0020 tal-Anness I tar-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) 2021/451 | Il-valur tal-iskopertura oriġinarja qabel jiġi meqjus kwalunkwe aġġustament tal-valur, provvediment, effett dovut għal tekniki ta' mitigazzjoni tar-riskju ta' kreditu jew fattur ta' konverżjoni tal-kreditu għandhom jiġu rrapportati. |
| 0090 | Skopertura wara li s-sostituzzjoni CRM taffettwa l-fatturi ta' qabel il-konverżjoni | Il-mudell C 08.01, il-kolonna 0090 tal-Anness I tar-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) 2021/451 | L-ammont li fuqu jiġu applikati fatturi ta' konverżjoni ta' kreditu ("CCF", conversion factors) sabiex tinkiseb l-EAD (kolonna 0110) għandu jiġi rrapportat. Dan għandu jsir billi jitqiesu t-tekniki tal-mitigazzjoni tar-riskju ta' kreditu b'effetti ta' sostituzzjoni fuq l-iskopertura. |
| 0100 | CCF | L-Artikolu 166(8) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Għandha tiġi rrapportata l-medja ponderata tas-CCFs. Il-pożijiet użati għandhom ikunu l-ammonti li fuqhom jiġu applikati s-CCFs biex tinkiseb l-EAD.<br>Għal kontropartijiet li l-faċilitajiet tagħhom jikkorrispondu eskluživament għall-entrati msemmija fl-Artikolu 166(8) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, il-medja ponderata rrapportata tas-CCFs għandha tkun ibbażata fuq il-faċilitajiet kollha.<br>Għal kontropartijiet li l-faċilitajiet tagħhom ma jaqgħux taħt l-entrati msemmija fl-Artikolu 166(8) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, is-CCF għandu jew jitħalla vojt jew għandha tiddaħħal l-indikazzjoni "NULL". |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| | | | Għal kontropartijiet b'faċilitajiet li jikkorrispondu għall-entrati msemmija fl-Artikolu 166(8) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 u faċilitajiet li ma jaqgħux taħt l-entrati msemmija fl-Artikolu 166(8) ta' dak ir-Regolament, il-medja ponderata rrapportata tas-CCF għandha tkun ibbażata biss fuq il-faċilitajiet li jikkorrispondu għall-entrati msemmija fl-Artikolu 166(8) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. B'mod partikolari, il-faċilitajiet li jikkorrispondu għall-oġġetti msemmija fl-Artikolu 166(10) ta' dak ir-Regolament ma għandhomx jitqiesu fil-kalkolu.<br><br>Meta l-istituzzjoni tapplika l-istimi proprji tas-CCFs għall-entrati msemmija fl-Artikolu 166(8) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, dawk is-CCFs għandhom jintużaw biex tiġi kkalkulata l-medja ponderata tas-CCFs. Meta l-istituzzjoni ma tapplikax l-istimi proprji tas-CCFs għall-entrati msemmija fl-Artikolu 166(8) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, għandhom jintużaw is-CCFs regolatorji mogħtija fl-Artikolu 166(8) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.<br><br>Is-CCF għandu jiġi espress bħala valur bejn 0 u 1. |
| 0110 | EAD | Il-mudell C 08.01, il-kolonna 0110 tal-Anness I tar-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) 2021/451 | Għandu jiġi rrapportat il-valur tal-iskopertura. |
| 0120 | Valur tal-kollateral | Il-mudell C 08.01, il-kolonni minn 0150 sa 0210, tal-Anness I tar-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) 2021/451 | Għandu jiġi rrapportat il-valur tas-suq tal-kollateral. |
| 0130 | HYP LGD prijoritarju (senior) mhux garantit mingħajr klawżola ta' rahan negattiv | L-Artikolu 161 ta' Regolament (UE) Nru 575/2013 | L-istimi proprji ipotetiċi tat-telf fil-każ ta' inadempjenza ("LGD", loss given default) li jiġu applikati mill-istituzzjoni għall-iskoperturi fir-rigward tal-kontroparti għandhom jiġu rrapportati f'konformità ma' dan li ġej:<br>(a) l-ambitu tal-iskoperturi huwa l-istess bħall-valur tal-LGD irrapportat fil-kolonna 0150;<br>(b) l-iskoperturi huma prijoritarji u mhux garantiti;<br>(c) ma hemm l-ebda klawżola ta' rahan negattiv.<br><br>Klawżola ta' rahan negattiv hija klawżola li tiddikjara li l-mutwatarju jew l-emittent ta' dejn mhuwa se jirhan l-ebda assi tiegħu lil xi parti oħra. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0140 | HYP LGD prijoritarju (senior) mhux garantit bi klawżola ta' rahan negattiv | L-Artikolu 161 ta' Regolament (UE) Nru 575/2013 | L-istimi proprji ipotetiċi tal-LGD li jiġu applikati mill-istituzzjoni għall-iskoperturi fir-rigward ta' kontroparti għandhom jiġu rrapportati f'konformità ma' dan li ġej:<br>(a) l-ambitu tal-iskoperturi huwa l-istess bħall-valur tal-LGD irrapportat fil-kolonna 0150;<br>(b) l-iskoperturi huma prijoritarji u mhux garantiti;<br>(c) hemm klawżola ta' rahan negattiv.<br>Klawżola ta' rahan negattiv hija klawżola li tiddikjara li l-mutwatarju jew l-emittent ta' dejn mhuwa se jirhan l-ebda assi tiegħu lil xi parti oħra. |
| 0150 | LGD | Il-mudell C08.01, il-kolonni 0230 u 0240, tal-Anness I tar-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) 2021/451 | Għandha tiġi rrapportata l-medja ponderata skont l-EAD tal-valuri tal-LGD tal-iskoperturi fir-rigward ta' kontroparti fil-portafoll rispettiv.<br>L-LGDs għandhom ikunu dawk użati għall-kalkolu tal-RWA. B'mod speċifiku, meta l-istituzzjoni tkun kisbet permess mill-awtorità kompetenti tagħha biex tuża l-istimi proprji għal-LGDs, l-LGDs għandhom ikunu bbażati fuq l-istimi proprji tal-istituzzjoni, inkella l-LGDs għandhom ikunu bbażati fuq il-valuri regolatorji tal-LGD filwaqt li titqies il-mitigazzjoni tar-riskji applikabbli.<br>L-LGDs għall-entitajiet regolati tas-settur finanzjarju kbar u entitajiet finanzjarji mhux regolati għandhom jiġu inklużi.<br>L-effett ta' miżuri introdotti skont l-Artikolu 458 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 għandhom ikunu esklużi.<br>L-LGD għandu jiġi espress bħala valur bejn 0 u 1. |
| 0160 | Maturità | Il-mudell C 08.01, il-kolonna 0250 tal-Anness I tar-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) 2021/451 | Għandha tiġi rrapportata l-maturità ponderata skont l-EAD għall-iskoperturi fir-rigward tal-kontroparti. Din għandha tiġi espressa f'għadd ta' ġranet. |
| 0170 | RWA | Il-mudell C 08.01, il-kolonna 0260 tal-Anness I tar-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) 2021/451 | Għandu jiġu rrapportat l-RWA wara fatturi ta' sostenn (fatturi ta' sostenn għall-SMEs u l-insfrastrutturi). L-RWA ma għandux jinkludi l-effett tal-miżuri potenzjali skont l-Artikolu 458 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |

**C 102 – Dettalji dwar l-iskoperturi fil-Portafolli b'Riskju Baxx ta' Inadempjenza**

Għall-portafolli msemmija fl-Anness I bi status ta' kollateralizzazzjoni li ma huwiex "Mhux applikabbli", l-informazzjoni li ġejja tista' titħalla barra meta l-mudell approvat ma jakkomodax kalkoli distinti tal-LGD għall-partijiet garantiti u le ta' skopertura: LGD (il-kolonna 0130), LGD mingħajr miżuri superviżorji (il-kolonna 0131), LGD mingħajr marġni ta' konservattiviżmu (MoC, margin of conservatism) u miżuri superviżorji (il-kolonna 0132), LGD mingħajr MoC, miżuri superviżorji u l-komponent ta' reċessjoni ekonomika (il-kolonna 0133), Ammont ta' Telf Mistenni (il-kolonna 0150) u RWA (il-kolonna 0170).

Għall-portafolli bl-approċċ regolatorju definit bħala "Kriterji ta' klassifikazzjoni ta' self speċjalizzat", l-informazzjoni li ġejja għandha titħalla barra: PD (kolonna 0060), PD mingħajr miżuri superviżorji (kolonna 0061), PD mingħajr MoC u miżuri superviżorji (kolonna 0062), LGD (kolonna 0130), LGD mingħajr miżuri superviżorji (kolonna 0131), LGD mingħajr MoC u miżuri superviżorji (kolonna 0132), LGD mingħajr MoC, miżuri superviżorji u l-komponent ta' reċessjoni ekonomika (kolonna 0133).

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0010 | ID tal-Portafoll | Il-mudell C102, il-Kolonna 0010 tal-Anness I | Għandha tiġi rrapportata l-ID tal-portafoll tal-kolonna 0010 tal-mudell C.102 tal-Anness I li tiddefinixxi l-portafoll. Dan l-ID huwa identifikatur tar-ringiela u għandu jkun uniku għal kull ringiela fil-mudell.<br>L-assenjazzjoni ta' skoperturi għal IDs tal-portafoll mhijiex esklużiva: Skoperturi jew partijiet minn skoperturi għandhom jiġu rrapportati taħt kull ID tal-portafoll li hija applikabbli. |
| 0040 | Għadd ta' obbliganti | | Għandu jiġi rrapportat l-għadd ta' obbliganti.<br>Għandu jkun ibbażat fuq obbliganti li jkollhom valur strettament pożittiv irrapportat jew fil-kolonna 0080 jew fil-kolonna 0090. Meta tiġi applikata s-sostituzzjoni sħiħa minħabba t-teknika ta' mitigazzjoni tar-riskju, l-obbligant oriġinali għandu jiżdied mal-"Għadd ta' obbliganti" tal-portafoll oriġinali tiegħu, u l-garanti għandu jiżdied mal-"Għadd ta' obbliganti" tal-portafoll tal-garanti. |
| 0060 | PD | Il-mudell C08.01, il-kolonna 0010 tal-Anness I tar-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) Nru 2021/451 | Il-PD għandha tkun il-PD użata fil-kalkolu tal-RWA, għajr l-effett tal-miżuri potenzjali introdotti f'konformità mal-Artikolu 458 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. Għal portafolli li jikkorrispondu għal grad jew pula, tiġi rapportata l-PD assenjata għall-grad jew grupp speċifiku tal-obbligant. Għal portafolli li jikkorrispondu għal aggregazzjoni ta' gradi jew gruppi differenti ta' obbliganti, għandha tiġi pprovduta l-medja ponderata skont l-EAD tal-PDs assenjati lill-iskoperturi inklużi fl-aggregazzjoni. Il-PD għandha tiġi espressa bħala valur bejn 0 u 1. |
| 0061 | PD mingħajr miżuri superviżorji | | Il-PD mingħajr miżuri superviżorji għandha tkun il-PD ibbażata fuq id-dispożizzjonijiet stabbiliti fl-Artikoli 179 u 180 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 li jinkludi l-MoC miżjud mill-istituzzjoni iżda jeskludi miżuri (multiplikaturi, żidiet, limiti minimi jew miżuri simili li jżidu direttament il-PD) li ġew imposti mill-awtoritajiet kompetenti.<br>Għall-portafolli li jikkorrispondu għal grad jew grupp individwali, għandu jiġi rrapportat il-PD għal dak il-grad li jinkludi l-MoC iżda li huwa nett mill-miżuri superviżorji. Għall-portafolli li jikkorrispondu għal ġabra ta' obbliganti ta' gradi jew gruppi differenti, għandha tiġi pprovduta l-medja ponderata skont l-EAD tal-PDs tal-iskoperturi rispettivi li jinkludu l-MoCs iżda li huma netti mill-miżuri superviżorji.<br>Il-PD mingħajr miżuri superviżorji għandha tiġi espressa bħala valur bejn 0 u 1.<br>F'każ li l-istituzzjoni ma tkunx tista' tiżola l-aġġustamenti konservattivi rilevanti, għandha tapplika l-Parti I, il-punt 3. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0062 | PD mingħajr MoC u miżuri superviżorji | | Il-PD mingħajr MoC u l-miżuri superviżorji għandhom ikunu l-PD li la tinkludi l-MoC miżjud mill-istituzzjoni f'konformità mal-Artikolu 179(1), il-punt (f), u l-Artikolu 180(1), il-punt (e), tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 u lanqas l-effett tal-miżuri imposti mill-awtoritajiet kompetenti (multiplikaturi, żidiet, limiti minimi jew miżuri simili li jżidu direttament il-PD).<br><br>Għall-portafolli li jikkorrispondu għal grad jew grupp individwali, għandha tiġi rrapportata l-PD għal dak il-grad li hija netta mill-MoC u netta mill-miżuri superviżorji. Għal portafolli li jikkorrispondu għal aggregazzjoni ta' obbliganti ta' gradi jew pula differenti, għandha tiġi rrapportata l-medja ponderata skont l-EAD tal-PDs tal-iskoperturi rispettivi li huma netti mill-MoCs u netti mill-miżuri superviżorji.<br><br>Il-PD mingħajr MoC u miżuri superviżorji għandha tiġi espressa bħala valur bejn 0 u 1.<br>F'każ li l-istituzzjoni ma tkunx tista' tiżola l-aġġustamenti konservattivi rilevanti, għandha tapplika l-Parti I, il-punt 3. |
| 0080 | Skopertura oriġinarja qabel il-fatturi ta' konverżjoni | Il-mudell C08.01, il-kolonna 0020 tal-Anness I tar-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) Nru 2021/451 | Il-valur tal-iskopertura oriġinarja qabel jiġi meqjus kwalunkwe aġġustament tal-valur, provvediment, effett dovut għal tekniki ta' mitigazzjoni tar-riskju ta' kreditu jew fattur ta' konverżjoni tal-kreditu għandhom jiġu rrapportati. |
| 0090 | Skopertura wara li s-sostituzzjoni CRM taffettwa l-fatturi ta' qabel il-konverżjoni | Il-mudell C08.01, il-kolonna 0090 tal-Anness I tar-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) Nru 2021/451 | L-ammont li fuqu jiġu applikati fatturi ta' konverżjoni ta' kreditu ("CCF") sabiex tinkiseb l-EAD (kolonna 0110) għandu jiġi rrapportat. Dan għandu jsir billi jitqiesu t-tekniki tal-mitigazzjoni tar-riskju ta' kreditu b'effetti ta' sostituzzjoni fuq l-iskopertura. |
| 0100 | CCF | L-Artikolu 166(8) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Għandha tiġi rrapportata l-medja ponderata tas-CCFs. Il-fatturi ta' ponderazzjoni użati għandhom ikunu l-ammonti li fuqhom jiġu applikati s-CCFs sabiex tinkiseb l-EAD.<br><br>Għall-portafolli li jinkludu faċilitajiet li jikkorrispondu esklużivament għall-entrati msemmija fl-Artikolu 166(8) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, il-medja ponderata rrapportata tas-CCFs għandha tkun ibbażata fuq il-faċilitajiet kollha.<br><br>Għall-portafolli li għalihom l-ebda waħda mill-faċilitajiet ma taqa' taħt l-entrati msemmija fl-Artikolu 166 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, is-CCF għandu jew jitħalla vojt jew għandha tiddaħħal l-indikazzjoni "NULL".<br><br>Għal portafolli li jinkludu faċilitajiet li jikkorrispondu għall-elementi msemmija fl-Artikolu 166(8) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 u faċilitajiet li ma jaqgħux taħt l-entrati msemmija fl-Artikolu 166(8) ta' dak ir-Regolament, il-medja ponderata rrapportata tas-CCF għandha tkun ibbażata biss fuq il-faċilitajiet li jikkorrispondu għall-elementi msemmija fl-Artikolu 166(8) |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| | | | tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. B'mod partikolari, il-faċilitajiet li jikkorrispondu għall-oġġetti msemmija fl-Artikolu 166(10) ta' dak ir-Regolament ma għandhomx jitqiesu fil-kalkolu.<br>Meta l-istituzzjoni tapplika l-istimi proprji tas-CCFs għall-entrati msemmija fl-Artikolu 166(8) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, dawk is-CCFs għandhom jintużaw biex tiġi kkalkulata l-medja ponderata tas-CCFs. Meta l-istituzzjoni ma tapplikax l-istimi proprji tas-CCFs għall-entrati msemmija fl-Artikolu 166(8) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, għandhom jintużaw is-CCFs regolatorji mogħtija fl-Artikolu 166(8) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.<br>Is-CCF għandu jiġi espress bħala valur bejn 0 u 1. |
| 0110 | EAD | Il-mudell C08.01, il-kolonna 0110 tal-Anness I tar-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) Nru 2021/451 | Għandu jiġi rrapportat il-valur tal-iskopertura. |
| 0120 | Valur tal-kollateral | Il-mudell C08.01, il-kolonni minn 0150 sa 0210 tal-Anness I tar-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) Nru 2021/451 | Għandu jiġi rrapportat il-valur tas-suq tal-kollateral. |
| 0130 | LGD | Il-mudell C08.01, il-kolonni 0230 u 0240 tal-Anness I tar- Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) Nru 2021/451 | Għandha tiġi rrapportata l-medja ponderata skont l-EAD tal-valuri tal-LGD tal-iskoperturi fil-portafoll rispettiv.<br>L-LGDs għandhom ikunu dawk użati għall-kalkolu tal-RWA. B'mod speċifiku, meta l-istituzzjoni tkun kisbet permess mill-awtorità kompetenti tagħha biex tuża l-istimi proprji għal-LGDs, l-LGDs għandhom ikunu bbażati fuq l-istimi proprji tal-istituzzjonijiet, inkella l-LGDs għandhom ikunu bbażati fuq il-valuri regolatorji tal-LGD filwaqt li titqies il-mitigazzjoni tar-riskji applikabbli.<br>Skoperturi u l-LGDs rispettivi għal entitajiet regolati kbar tas-settur finanzjarju u entitajiet finanzjarji mhux regolati għandhom jiġu inklużi.<br>L-effett ta' miżuri introdotti skont l-Artikolu 458 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 għandhom ikunu esklużi.<br>L-LGD għandu jiġi espress bħala valur bejn 0 u 1. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0131 | LGD mingħajr miżuri superviżorji | | Il-LGD mingħajr miżuri superviżorji għandha tkun il-LGD ibbażata fuq id-dispożizzjonijiet stabbiliti fl-Artikoli 179 u 181 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 li jinkludi l-MoC miżjud mill-istituzzjoni iżda jeskludi miżuri (multiplikaturi, żidiet, limiti minimi jew miżuri simili li jżidu direttament il-LGD) li ġew imposti mill-awtoritajiet kompetenti.<br><br>Għall-portafolli li jikkorrispondu għal grad jew grupp individwali, għandu jiġi rrapportat l-LGD għal dak il-grad li jinkludi l-MoC iżda li huwa nett mill-miżuri superviżorji.<br><br>Għall-portafolli li jikkorrispondu għal ġabra ta' obbliganti ta' gradi jew gruppi differenti, għandha tiġi pprovduta l-medja ponderata skont l-EAD tal-LGDs tal-iskoperturi rispettivi li jinkludu l-MoCs iżda li huma netti mill-miżuri superviżorji.<br><br>L-LGD mingħajr miżuri superviżorji għandu jiġi espress bħala valur bejn 0 u 1.<br><br>F'każ li l-istituzzjoni ma tkunx tista' tiżola l-aġġustamenti konservattivi rilevanti, għandha tapplika l-Parti I, il-punt 3. |
| 0132 | LGD mingħajr MoC u mingħajr miżuri superviżorji | | L-LGD mingħajr MoC u miżuri superviżorji għandu jkun l-LGD li la jinkludi l-MoC miżjud mill-istituzzjoni f'konformità mal-Artikolu 179(1), il-punt (f), u l-Artikolu 181 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 u lanqas l-effett tal-miżuri imposti mill-awtoritajiet kompetenti (multiplikaturi, supplimentazzjonijiet, limiti minimi jew miżuri simili li jżidu direttament l-LGD).<br><br>Għall-portafolli li jikkorrispondu għal grad jew grupp individwali, għandu jiġi rrapportat l-LGD għal dak il-grad li huwa nett mill-MoC u nett mill-miżuri superviżorji. Għal portafolli li jikkorrispondu għal aggregazzjoni ta' obbliganti ta' gradi jew pula differenti, għandha tiġi rrapportata l-medja ponderata skont l-EAD tal-LGDs tal-iskoperturi rispettivi li huma netti mill-MoCs u netti mill-miżuri superviżorji.<br><br>Il-LGD mingħajr MoC u miżuri superviżorji għandha tiġi espressa bħala valur bejn 0 u 1.<br><br>F'każ li l-istituzzjoni ma tkunx tista' tiżola l-aġġustamenti konservattivi rilevanti, għandha tapplika l-Parti I, il-punt 3. |
| 0133 | LGD mingħajr MoC, miżuri superviżorji u l-komponent ta' reċessjoni ekonomika, | | L-LGD mingħajr MoC, il-miżuri superviżorji u l-komponent ta' reċessjoni ekonomika għandhom ikunu l-LGD li la jinkludi l-(MoC miżjud mill-istituzzjoni f'konformità mal-Artikolu 179(1), il-punt (f), u l-Artikolu 181 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 u lanqas l-effett tal-miżuri imposti mill-awtoritajiet kompetenti (multiplikaturi, żidiet, limiti minimi jew miżuri simili li jżidu direttament l-LGD) u lanqas il-komponent ta' reċessjoni ekonomika kif meħtieġ mill-Artikolu 181(1), il-punt (b), ta' dak ir-Regolament.<br><br>Għall-portafolli li jikkorrispondu għal grad jew grupp individwali, għandu jiġi rrapportat l-LGD għal dak il-grad li huwa nett mill-MoC u nett mill-miżuri superviżorji u nett mill-komponent ta' reċessjoni ekonomika. Għal portafolli li jikkorrispondu għal aggregazzjoni ta' obbliganti ta' gradi jew pula differenti, għandha tiġi rrapportata l-medja ponderata skont l-EAD tal-LGDs tal-iskoperturi rispettivi li huma netti mill-MoCs, netti mill-miżuri superviżorji u netti mill-komponent ta' reċessjoni ekonomika. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| | | | L-LGD mingħajr MoC, miżuri superviżorji u l-komponent ta' reċessjoni ekonomika għandu jiġi espress bħala valur bejn 0 u 1.<br>F'każ li l-istituzzjoni ma tkunx tista' tiżola l-aġġustamenti konservattivi rilevanti, għandha tapplika l-Parti I, il-punt 3. |
| 0140 | Maturità | Il-mudell C08.01, il-kolonna 0250 tal-Anness I tar-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) Nru 2021/451 | Għandha tiġi rrapportata l-maturità ponderata skont l-EAD. Din għandha tiġi espressa f'għadd ta' ġranet.<br>Din l-informazzjoni ma għandhiex tiġi rrapportata għall-iskoperturi li għalihom il-maturità mhijiex element fil-kalkolu tal-RWA. B'mod partikolari, il-maturità ma għandhiex tiġi rrapportata għall-portafolli li jirrappreżentaw skoperturi tal-klassi tal-iskoperturi "Livell tal-konsumaturi". |
| 0150 | Ammont ta' Telf mistenni | Il-mudell C08.01, il-kolonna 0280 tal-Anness I tar-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) Nru 2021/451 | Għandu jiġi rrapportat l-ammont tat-telf mistenni. |
| 0160 | Provvedimenti għal skoperturi inadempjenti | Il-mudell C09.02, il-kolonni 0050, 0055 u 0060 tal-Anness I tar-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) Nru 2021/451 | Għandhom jiġu rrapportati l-provvedimenti għal skoperturi inadempjenti. Dawn għandhom jinkludu l-aġġustamenti kollha ġenerali u dawk speċifiċi għar-riskju ta' kreditu relatati mal-skoperturi inadempjenti, kif imsemmi fl-Artikolu 110 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. L-aġġustamenti għar-riskju ta' kreditu (ta' darba) li istituzzjoni tapplika b'rabta mal-bidliet fl-implimentazzjoni tad-definizzjoni ta' inadempjenza (DoD) għandhom jiġu rrapportati kif irreġistrati fil-bażi tad-data tal-istituzzjoni. |
| 0170 | RWA | Il-mudell C08.01, il-kolonna 0260 tal-Anness I tar-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) Nru 2021/451 | Għandu jiġu rrapportat l-RWA wara fatturi ta' sostenn (fatturi ta' sostenn għall-SMEs u l-insfrastrutturi). L-RWA ma għandux jinkludi l-effett tal-miżuri potenzjali skont l-Artikolu 458 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 0180 | RWA Standardizzata | Parti Tlieta, Titolu II, Kapitolu 2 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | L-RWA Standardizzat huwa l-ammont ipotetiku tal-RWA miksub bl-applikazzjoni tal-approċċ standardizzat għar-riskju ta' kreditu għall-iskoperturi, minflok l-approċċ IRB. |

**C 103 – Dettalji dwar l-iskoperturi fil-Portafoll b'Riskju Għoli ta' Inadempjenza**

Għal portafolli msemmija fl-Anness I bi status ta' kollateralizzazzjoni differenti minn "Mhux applikabbli", l-informazzjoni li ġejja tista' titħalla barra meta l-mudell approvat ma jakkomodax kalkoli distinti tal-LGD għall-partijiet ta' skopertura garantiti u dawk mhux garantiti: LGD (il-kolonna 0130), LGD mingħajr miżuri superviżorji (il-kolonna 0131), LGD mingħajr MoC u miżuri superviżorji (il-kolonna 0132), LGD mingħajr MoC, miżuri superviżorji u l-komponent ta' reċessjoni ekonomika (il-kolonna 0133), Ammont ta' Telf Mistenni (il-kolonna 0150), RWA (il-kolonna 0170), Rata ta' telf tal-aħħar sena (il-kolonna 0210) u Rata ta' telf tal-aħħar 5 snin (il-kolonna 0220).

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0010 | ID tal-Portafoll | | Għandha tiġi rrapportata l-ID tal-portafoll tal-mudell C 103, il-kolonna 0010 tal-Anness I li tiddefinixxi l-portafoll. Dan l-ID huwa identifikatur tar-ringiela u għandu jkun uniku għal kull ringiela fil-mudell.<br>L-assenjazzjoni ta' skoperturi għal IDs tal-portafoll mhijiex esklużiva: skoperturi jew partijiet minn skoperturi għandhom jiġu rrapportati taħt kull ID tal-portafoll li hija applikabbli. |
| 0040 | Għadd ta' obbliganti | | Għandhom japplikaw l-istruzzjonijiet għall-mudell C 102, il-kolonna 0040 tal-Anness I. |
| 0060 | PD | | Għandhom japplikaw l-istruzzjonijiet għall-mudell C 102, il-kolonna 0060 tal-Anness I. |
| 0061 | PD mingħajr miżuri superviżorji | | Għandhom japplikaw l-istruzzjonijiet għall-mudell C 102, il-kolonna 0061 tal-Anness I. |
| 0062 | PD mingħajr MoC u miżuri superviżorji | | Għandhom japplikaw l-istruzzjonijiet għall-mudell C 102, il-kolonna 0062 tal-Anness I. |
| 0080 | Skopertura oriġinarja qabel il-fatturi ta' konverżjoni | | Għandhom japplikaw l-istruzzjonijiet għall-mudell C 102, il-kolonna 0080 tal-Anness I. |
| 0090 | Skopertura wara li s-sostituzzjoni CRM taffettwa l-fatturi ta' qabel il-konverżjoni | | Għandhom japplikaw l-istruzzjonijiet għall-mudell C 102, il-kolonna 0090 tal-Anness I. |
| 0100 | CCF | | Għandhom japplikaw l-istruzzjonijiet għall-mudell C 102, il-kolonna 0100 tal-Anness I. |
| 0110 | EAD | | Għandhom japplikaw l-istruzzjonijiet għall-mudell C 102, il-kolonna 0110 tal-Anness I. |
| 0120 | Valur kollaterali | | Għandhom japplikaw l-istruzzjonijiet għall-mudell C 102, il-kolonna 0120 tal-Anness I. |
| 0130 | LGD | | Għandhom japplikaw l-istruzzjonijiet għall-mudell C 102, il-kolonna 0130 tal-Anness I. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0131 | LGD mingħajr miżuri superviżorji | | Għandhom japplikaw l-istruzzjonijiet għall-mudell C 102, il-kolonna 0131 tal-Anness I. |
| 0132 | LGD mingħajr MoC u mingħajr miżuri superviżorji | | Għandhom japplikaw l-istruzzjonijiet għall-mudell C 102, il-kolonna 0132 tal-Anness I. |
| 0133 | LGD mingħajr MoC, miżuri superviżorji u l-komponent ta' reċessjoni ekonomika | | Għandhom japplikaw l-istruzzjonijiet għall-mudell C 102, il-kolonna 0133 tal-Anness I. |
| 0140 | Maturità | | Għandhom japplikaw l-istruzzjonijiet għall-mudell C 102, il-kolonna 0140 tal-Anness I. |
| 0150 | Ammont ta' Telf mistenni | | Għandhom japplikaw l-istruzzjonijiet għall-mudell C 102, il-kolonna 0150 tal-Anness I. |
| 0160 | Provvedimenti għal skoperturi inadempjenti | | Għandhom japplikaw l-istruzzjonijiet għall-mudell C 102, il-kolonna 0160 tal-Anness I. |
| 0170 | RWA | | Għandhom japplikaw l-istruzzjonijiet għall-mudell C 102, il-kolonna 0170 tal-Anness I. |
| 0180 | RWA Standardizzata | | Għandhom japplikaw l-istruzzjonijiet għall-mudell C 102, il-kolonna 0180 tal-Anness I. |
| 0190 | Rata ta' inadempjenza tal-aħħar sena | | Ir-rata ta' inadempjenza tal-aktar sena reċenti għandha tiġi rrapportata. Għal dak l-għan, ir-rata ta' inadempjenza għandha tiġi definita bħala l-proporzjon bejn il-valuri li ġejjin:<br>a) is-somma tal-iskoperturi (skopertura oriġinarja, il-kolonna 0080, imkejla sena qabel id-data ta' referenza) li ma kinux inadempjenti eżattament sena qabel id-data ta' referenza u saru inadempjenti bejn id-data ta' referenza nieqes sena u d-data ta' referenza;<br>b) is-somma tal-iskoperturi (skopertura oriġinarja, il-kolonna 0080, imkejla sena qabel id-data ta' referenza) li ma kinux inadempjenti fid-data ta' referenza nieqes sena.<br>Skoperturi ġodda li ġew iġġenerati matul is-sena qabel id-data ta' referenza m'għandhomx ikunu inklużi. Skoperturi li jkunu saru inadempjenti u kienu rimedjati mill-ġdid matul is-sena qabel id-data ta' referenza għandhom jiġu inklużi kemm fin-numeratur kif ukoll fid-denominatur. Inadempjenzi multipli għall-istess obbligant għandhom jiġu inklużi darba biss. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| | | | Din l-informazzjoni għandha tiġi rrapportata għall-IDs ta' portafoll li għandhom x'jaqsmu ma' skoperturi mhux inadempjenti biss; għandha tiġi espressa bħala valur bejn 0 u 1.<br><br>L-inadempjenzi u d-dati tal-inadempjenza għandhom jintużaw kif irreġistrati skont l-implimentazzjoni tad-DoD applikabbli fiż-żmien tal-event, jiġifieri istituzzjoni għandha tqis li seħħet inadempjenza fir-rigward tad-DoD li kienet applikata mill-istituzzjoni fiż-żmien meta ġie rreġistrat l-event. Il-bidliet fid-DoD għandhom jitqiesu biss b'mod prospettiv mid-data tal-implimentazzjoni tagħhom, filwaqt li ma għandhiex tintuża l-applikazzjoni retrospettiva tal-bidliet tad-DoD wara l-event ta' inadempjenza jkun qed jiġi kkunsidrat (simulazzjoni b'lura). |
| 0200 | Rata ta' inadempjenza tal-aħħar 5 snin | | Għandha tiġi rrapportata l-medja ponderata tar-rati ta' inadempjenza osservati fl-aħħar 5 snin qabel id-data ta' referenza. Għandha tintuża d-definizzjoni tar-rata ta' inadempjenza msemmija fil-kolonna 0190. Il-piżijiet li għandhom jintużaw huma l-iskoperturi mhux inadempjenti użati fil-kalkolu tar-rata ta' inadempjenza skont il-kolonna 0190.<br><br>Meta l-istituzzjoni ma tkunx meħtieġa tikkalkola rata ta' inadempjenza għall-aħħar ħames snin qabel id-data ta' referenza skont l-Artikolu 180(1), il-punt (h), jew l-Artikolu 180(2), il-punt (e), tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, l-istituzzjoni għandha tiżviluppa indikatur billi tuża l-aktar storja twila tagħha, sa ħames snin qabel id-data ta' referenza, u tipprovdi d-dokumentazzjoni li tispeċifika l-kalkolu lill-awtorità kompetenti tagħha.<br><br>Din l-informazzjoni għandha tiġi rrapportata għal IDs tal-portafoll relatati ma' skoperturi "mhux inadempjenti" biss; għandha tiġi espressa bħala valur bejn 0 u 1.<br><br>L-inadempjenzi u d-dati tal-inadempjenza għandhom jintużaw kif irreġistrati skont l-implimentazzjoni tad-DoD applikabbli fiż-żmien tal-event, jiġifieri istituzzjoni għandha tqis li seħħet inadempjenza fir-rigward tad-DoD li kienet applikata mill-istituzzjoni fiż-żmien meta ġie rreġistrat l-event. Il-bidliet fid-DoD għandhom jitqiesu biss b'mod prospettiv mid-data tal-implimentazzjoni tagħhom, filwaqt li ma għandhiex tintuża l-applikazzjoni retrospettiva tal-bidliet tad-DoD wara l-event ta' inadempjenza jkun qed jiġi kkunsidrat (simulazzjoni b'lura). |
| 0210 | Rata ta' telf tal-aħħar sena | | Ir-rata ta' telf osservata fl-aktar sena riċenti għandha tiġi rrapportata għal IDs tal-portafoll relatati ma' skoperturi "mhux inadempjenti" u "inadempjenti" biss.<br><br>Għal portafolli mhux inadempjenti, ir-rata ta' telf għandha tkun is-somma ta' aġġustamenti għar-riskju ta' kreditu u tħassir applikat, fis-sena qabel id-data ta' referenza, għal skoperturi li ma kinux inadempjenti eżattament sena qabel id-data ta' referenza u li saru inadempjenti tul is-sena qabel id-data ta' referenza, diviżi bis-somma tal-EAD, imkejla eżattament sena qabel id-data ta' referenza, tal-iskoperturi li ma kinux inadempjenti eżattament sena qabel id-data ta' referenza u li saru inadempjenti matul is-sena ta' qabel id-data ta' referenza. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| | | | In-numeratur tar-rata ta' telf għandu jinkorpora l-aġġustamenti għar-riskju ta' kreditu u t-tħassir kollha relatati mal-iskoperturi inadempjenti fis-sena ta' qabel ir-referenza, inklużi l-aġġustamenti għar-riskju ta' kreditu applikati qabel id-data tal-inadempjenza.<br><br>Skoperturi ġodda ġġenerati matul is-sena qabel id-data ta' referenza m'għandhomx ikunu inklużi. Skoperturi li saru inadempjenti u kienu rimedjati mill-ġdid matul is-sena ta' qabel id-data ta' referenza għandhom jiġu inklużi fid-denominatur tar-rata ta' telf, u aġġustamenti għar-riskju ta' kreditu u tħassir għal dawk l-iskoperturi għandhom jitqiesu fin-numeratur tar-rata ta' telf. L-inadempjenzi multipli tal-istess obbligant għandhom jitqiesu darba biss.<br><br>Għal portafolli inadempjenti, ir-rata ta' telf għandha tikkunsidra skoperturi li kienu inadempjenti eżattament sena qabel id-data ta' referenza. Għandha tkun is-somma ta'<br>a) aġġustamenti għar-riskju ta' kreditu għal dawn l-iskoperturi sena qabel id-data ta' referenza, u<br>b) aġġustamenti għar-riskju ta' kreditu u tħassir applikati fis-sena ta' qabel id-data ta' referenza,<br><br>diviżi bis-somma tal-EAD, imkejla eżattament sena qabel id-data ta' referenza tal-iskoperturi li jkunu qed jiġu kkunsidrati.<br><br>Inadempjenzi ġodda matul is-sena ta' qabel id-data ta' referenza m'għandhomx ikunu inklużi. Skoperturi li kienu rimedjati mill-ġdid matul is-sena ta' qabel id-data ta' referenza għandhom jiġu inklużi fid-denominatur tar-rata ta' telf, u aġġustamenti għar-riskju ta' kreditu u tħassir għal dawk l-iskoperturi għandhom jiġu inklużi fin-numeratur tar-rata ta' telf. Inadempjenzi multipli għall-istess obbligant għandhom jiġu inklużi darba biss.<br><br>Ir-rata ta' telf għandha tiġi espressa bħala valur bejn 0 u 1.<br><br>L-inadempjenzi u d-dati tal-inadempjenza għandhom jintużaw kif irreġistrati skont l-implimentazzjoni tad-DoD applikabbli fiż-żmien tal-event, jiġifieri istituzzjoni għandha tqis li seħħet inadempjenza fir-rigward tad-DoD li kienet applikata mill-istituzzjoni fiż-żmien meta ġie rreġistrat l-event. Il-bidliet fid-DoD għandhom jitqiesu biss b'mod prospettiv mid-data tal-implimentazzjoni tagħhom, filwaqt li ma għandhiex tintuża l-applikazzjoni retrospettiva tal-bidliet tad-DoD wara l-event ta' inadempjenza jkun qed jiġi kkunsidrat (simulazzjoni b'lura). |
| 0220 | Rata ta' telf tal-aħħar 5 snin | | Il-medja ponderata skont l-EAD tar-rati ta' telf osservati fl-aħħar ħames snin qabel id-data ta' referenza għandha tiġi rrapportata għall-IDs tal-portafoll relatati ma' skoperturi "mhux inadempjenti" u "inadempjenti" biss. Għandha tapplika d-definizzjoni tar-rata ta' telf fil-kolonna 0210.<br><br>Ir-rata ta' telf tal-aħħar 5 snin għandha tkun ibbażata fuq ir-rati ta' telf annwali tal-aħħar 5 snin, fejn dawn ir-rati ta' telf annwali huma definiti b'analoġija mad-definizzjoni tar-rata ta' telf tal-kolonna 0210; b'mod partikolari, ir-rati ta' telf annwali ma għandhomx jinkludu bidliet addizzjonali fl-aġġustamenti għar-riskju ta' kreditu u tħassir li jkunu seħħew wara l-perjodu ta' osservazzjoni (sena kalendarja) ta' kull rata ta' telf annwali.<br><br>Meta l-istituzzjoni ma tkunx meħtieġa tuża d-data għall-aħħar ħames snin qabel id-data ta' referenza skont l-Artikolu 181(2), l-aħħar paragrafu, tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, l-istituzzjoni għandha tiżviluppa indikatur billi tuża l-itwal storja tagħha sa ħames snin qabel id-data ta' referenza u tipprovdi d-dokumentazzjoni bid-dettalji tal-kalkolu lill-awtorità kompetenti tagħha.<br><br>Ir-rata ta' telf għandha tiġi espressa bħala valur bejn 0 u 1.<br><br>L-inadempjenzi u d-dati tal-inadempjenza għandhom jintużaw kif irreġistrati skont l-implimentazzjoni tad-DoD applikabbli fiż-żmien tal-event, jiġifieri istituzzjoni għandha tqis li seħħet inadempjenza fir-rigward tad-DoD li kienet applikata mill-istituzzjoni fiż-żmien meta ġie rreġistrat l-event. Il-bidliet fid-DoD għandhom jitqiesu biss b'mod prospettiv mid-data tal-implimentazzjoni tagħhom, filwaqt li ma għandhiex tintuża l-applikazzjoni retrospettiva tal-bidliet tad-DoD wara l-event ta' inadempjenza jkun qed jiġi kkunsidrat (simulazzjoni b'lura). |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0250 | RWA- | | L-istituzzjonijiet għandhom jikkalkulaw u jirrapportaw l-RWA- għal portafolli li huma msemmija fl-Anness I, il-mudell 103 bl-IDs tal-portafoll li ġejjin:<br><br>CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL<br>SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL<br>MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL<br>SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL<br>RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL<br>RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL<br>RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL<br><br>L-RWA- għandu jkun l-RWA ipotetiku, wara l-fatturi ta' sostenn, li jirriżulta mill-applikazzjoni tal-valuri tal-PD- minflok il-valuri tal-PD tal-istituzzjoni, għal kull skopertura. Il-parametri li jifdal meħtieġa fil-kalkolu m'għandhomx ikunu soġġetti għal bidliet.<br><br>Il-PD- għandha tkun ibbażata fuq kalkolu mwettaq separatament għal kull grad ta' obbligant. Għandhom jintużaw il-gradi ta' obbligant kif irrapportati fil-kolonna 0005 tal-mudell C 08.02 tal-Anness I tar-Regolament ta' Implimentazzjoni tal-Kummissjoni (UE) Nru 2021/451 (Għal struzzjonijiet ara l-mudell C 08.01, il-kolonna 0010, u l-mudell C 08.02 tal-Anness II ta' dak ir-Regolament).<br><br>Għal kull grad ta' obbligant, $p^{-}$ għandu jkun l-iżgħar valur pożittiv li jissodisfa l-ekwazzjoni<br><br>$$p^{-} + \Phi^{-1}(q) \cdot \sqrt{\frac{p^{-} \cdot (1 - p^{-})}{n}} \geq DR_{1y}$$<br>where $DR_{1y} > 0$, u $p^{-} := 0$ fejn $DR_{1y} = 0$.<br>Hawnhekk,<br><br>$\Phi^{-1}$ = il-funzjoni inversa tad-distribuzzjoni (kumulattiva) normali standard;<br><br>q = il-livell ta' fiduċja stabbilit għal 90%;<br><br>$DR_{1y}$ = ir-rata ta' inadempjenza ponderata skont il-każ tas-sena qabel id-data ta' referenza, jiġifieri l-għadd ta' obbliganti li ma kienux inadempjenti u assenjati l-grad ta' obbligant ikkunsidrat eżattament sena qabel id-data ta' referenza u li saru inadempjenti matul l-aħħar sena, diviż bl-għadd ta' obbliganti li ma kienux inadempjenti u assenjati l-grad ta' obbligant ikkunsidrat eżattament sena qabel id-data ta' referenza;<br><br>n = l-għadd ta' obbliganti li ma kienux inadempjenti u assenjati l-grad ta' obbligant taħt konsiderazzjoni eżattament sena qabel id-data ta' referenza.<br><br>Għal kull obbligant, il-PD- għandha tkun daqs $p^{-}$, fejn $p^{-}$ għandha tiġi kkalkolata f'konformità mal-formula stabbilita fir-raba' subparagrafu għall-grad ta' obbligant assenjat lill-obbligant. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0260 | RWA+ | | L-istituzzjonijiet għandhom jikkalkolaw u jirrapportaw l-RWA+ għall-portafolli li huma msemmija fil-Mudell 103 tal-Anness I bl-ID tal-portafoll li ġejja:<br><br>CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL<br>SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL<br>MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL<br>SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL<br>RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL<br>RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL<br>RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL<br><br>L-RWA+ għandu jkun l-RWA ipotetiku, wara l-fatturi ta' sostenn, li jirriżulta mill-applikazzjoni tal-valuri tal-PD+ minflok il-valuri tal-PD tal-istituzzjoni, għal kull skopertura. Il-parametri li jifdal meħtieġa fil-kalkolu m'għandhomx ikunu soġġetti għal bidliet.<br><br>Il-PD+ għandha tkun ibbażata fuq kalkolu mwettaq separatament għal kull grad ta' obbligant. Għandhom jintużaw il-gradi ta' obbligant kif irrapportati fil-kolonna 0005 tal-mudell C 08.02 tal-Anness I tar-Regolament ta' Implimentazzjoni tal-Kummissjoni (UE) Nru 2021/451 (Għal struzzjonijiet ara l-mudell C 08.01, il-kolonna 0010, u l-mudell C 08.02 tal-Anness II ta' dak ir-Regolament).<br><br>Għal kull grad ta' obbligant, $p^{+}$ għandu jkun l-ikbar valur pożittiv li jissodisfa l-ekwazzjoni<br><br>$$p^{+} - \Phi^{-1}(q) \bullet \sqrt{\frac{p^{+} \bullet (1 - p^{+})}{n}} \leq DR_{1y}$$<br><br>F'din l-ekwazzjoni,<br><br>$\Phi^{-1}$ = il-funzjoni inversa tad-distribuzzjoni (kumulattiva) normali standard;<br><br>q = il-livell ta' fiduċja stabbilit għal 90%;<br><br>$DR_{1y}$ = ir-rata ta' inadempjenza ponderata skont il-każ tas-sena qabel id-data ta' referenza, jiġifieri l-għadd ta' obbliganti li ma kienux inadempjenti u assenjati l-grad ta' obbligant ikkunsidrat eżattament sena qabel id-data ta' referenza u li saru inadempjenti matul l-aħħar sena, diviż bl-għadd ta' obbliganti li ma kienux inadempjenti u assenjati l-grad ta' obbligant ikkunsidrat eżattament sena qabel id-data ta' referenza;<br><br>n = l-għadd ta' obbliganti li ma kienux inadempjenti u assenjati l-grad ta' obbligant taħt konsiderazzjoni eżattament sena qabel id-data ta' referenza.<br><br>Għal kull obbligant, il-PD+ għandha tkun daqs $p^{+}$, fejn $p^{+}$ għandha tiġi kkalkolata f'konformità mal-formula stabbilita fir-raba' subparagrafu għall-grad ta' obbligant assenjat lill-obbligant. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0270 | RWA– | | L-istituzzjonijiet għandhom jikkalkulaw u jirrapportaw RWA—għall-portafolli li huma msemmija fl-Anness I, il-mudell 103 bl-Identifikatur tal-portafoll (ID) li ġej:<br><br>CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL<br>SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL<br>MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL<br>SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL<br>RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL<br>RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL<br>RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL<br><br>L-RWA– għandu jkun l-RWA ipotetiku, wara l-fatturi ta' sostenn, li jirriżulta mill-applikazzjoni tal-valuri tal-PD– minflok il-valuri tal-PD tal-istituzzjoni, għal kull skopertura. Il-parametri li jifdal meħtieġa fil-kalkolu m'għandhomx ikunu soġġetti għal bidliet.<br><br>Il-PD– għandha tkun ibbażata fuq kalkolu mwettaq separatament għal kull grad ta' obbligant. Għandhom jintużaw il-gradi ta' obbligant kif irrapportati fil-kolonna 0005 tal-mudell C 08.02 tal-Anness I tar-Regolament ta' Implimentazzjoni tal-Kummissjoni (UE) Nru 2021/451 (Għal struzzjonijiet ara l-mudell C 08.01, il-kolonna 0010, u l-mudell C 08.02 tal-Anness II ta' dak ir-Regolament).<br><br>Għal kull grad ta' obbligant, $p^{--}$ għandu jkun l-iżgħar valur pożittiv li jissodisfa l-ekwazzjoni<br><br>$$p^{--} + \Phi^{-1}(q) \cdot \sqrt{\frac{p^{--} \cdot (1 - p^{--})}{n}} \geq DR_{5y}$$<br>where $DR_{5y} > 0$, u $p^{--} := 0$ fejn $DR_{5y} = 0$<br>Hawnhekk,<br><br>$\Phi^{-1}$ = il-funzjoni inversa tad-distribuzzjoni (kumulattiva) normali standard;<br><br>q = il-livell ta' fiduċja stabbilit għal 90%;<br><br>$DR_{5y}$ = ir-rata ta' inadempjenza tal-aħħar 5 snin għall-grad ta' obbligant, ikkalkolata bħala medja sempliċi ta' ħames rati ta' inadempjenza ta' sena (1) ponderati skont il-każ;<br><br>n = l-għadd ta' obbliganti li ma kienux inadempjenti u assenjati l-grad ta' obbligant taħt konsiderazzjoni eżattament sena qabel id-data ta' referenza.<br><br>Għal kull obbligant, il-PD– għandha tkun daqs $p^{--}$, fejn $p^{--}$ għandha tiġi kkalkolata f'konformità mal-formula stabbilita fir-raba' subparagrafu għall-grad ta' obbligant assenjat lill-obbligant. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0280 | RWA++ | | L-istituzzjonijiet għandhom jikkalkolaw u jirrapportaw l-RWA++ għall-portafolli li huma msemmija fil-mudell 103 tal-Anness I bl-ID tal-portafoll li ġejja:<br><br>CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL<br>SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL<br>MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL<br>SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL<br>RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL<br>RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL<br>RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL<br><br>L-RWA++ għandu jkun l-RWA ipotetiku, wara l-fatturi ta' sostenn, li jirriżulta mill-applikazzjoni tal-valuri tal-PD++ minflok il-valuri tal-PD tal-istituzzjoni, għal kull skopertura. Il-parametri li jifdal meħtieġa fil-kalkolu m'għandhomx ikunu soġġetti għal bidliet.<br><br>Il-PD++ għandha tkun ibbażata fuq kalkolu mwettaq separatament għal kull grad ta' obbligant. Għandhom jintużaw il-gradi ta' obbligant kif irrapportati fil-kolonna 0005 tal-mudell C 08.02 tal-Anness I tar-Regolament ta' Implimentazzjoni tal-Kummissjoni (UE) Nru 2021/451 (Għal struzzjonijiet ara l-mudell C 08.01, il-kolonna 0010, u l-mudell C 08.02 tal-Anness II ta' dak ir-Regolament).<br><br>Għal kull grad ta' obbligant, $p^{++}$ għandu jkun l-ikbar valur pożittiv li jissodisfa l-ekwazzjoni<br><br>$$p^{++} - \Phi^{-1}(q) \cdot \sqrt{\frac{p^{++} \cdot (1 - p^{++})}{n}} \leq DR_{5y}$$<br><br>fejn,<br><br>$\Phi^{-1}$ = il-funzjoni inversa tad-distribuzzjoni (kumulattiva) normali standard;<br><br>q = il-livell ta' fiduċja stabbilit għal 90%;<br><br>$DR_{5y}$ = ir-rata ta' inadempjenza tal-aħħar 5 snin għall-grad ta' obbligant, ikkalkolata bħala medja sempliċi ta' ħames rati ta' inadempjenza ta' sena (1) ponderati skont il-każ;<br><br>n = l-għadd ta' obbliganti li ma kienux inadempjenti u assenjati l-grad ta' obbligant taħt konsiderazzjoni eżattament sena qabel id-data ta' referenza.<br><br>Għal kull obbligant, il-PD++ għandha tkun daqs $p^{++}$, fejn $p^{++}$ għandha tiġi kkalkolata f'konformità mal-formula stabbilita fir-raba' subparagrafu għall-grad ta' obbligant assenjat lill-obbligant. |

**C 105.01 — Definizzjoni ta' mudelli interni**

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0010 | ID tal-mudell intern | | L-istituzzjoni għandha tirrapporta l-ID tal-mudell intern assenjat mill-awtorità kompetenti. F'każ li dan ma jkunx disponibbli, l-istituzzjoni għandha tirrapporta l-ID tal-mudell intern assenjat minnha stess. L-ID tal-mudell intern għandha tirreferi b'mod uniku għal mudell intern approvat mill-awtorità kompetenti u użat għall-kalkolu tal-RWA. Għandu jkun identifikatur tar-ringiela u għandu jkun uniku għal kull ringiela fil-mudell. |
| 0020 | Isem il-mudell | | Għandu jiġi rrapportat isem il-mudell assenjat lill-mudell intern mill-istituzzjoni li tirrapporta. |
| 0030 | Parametru tar-riskju tal-IRBA | | Il-parametru tar-riskju tal-approċċ IRB għandu jkun wieħed minn dawn li ġejjin:<br>(a) PD;<br>(b) LGD;<br>(c) CCF.<br>Għal mudell intern għal skoperturi fuq Għoti ta' Self Korporattiv – Speċjalizzat skont l-Artikolu 153(5) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 ("Kriterji ta' klassifikazzjoni ta' self speċjalizzat"), il-valur għandu jitħalla vojt jew għandha tiddaħħal l-indikazzjoni "NULL". |
| 0040 | EAD | Il-mudell C08.01, il-kolonna 0110 tal-Anness I tar-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) Nru 2021/451 | Għandu jiġi rrapportat il-valur aggregat tal-iskoperturi fl-ambitu ta' applikazzjoni tal-mudell ta' klassifikazzjoni. |
| 0050 | Rata medja ponderata ta' inadempjenza għall-EAD għall-kalibrazzjoni | | Għandha tiġi rrapportata l-medja ponderata skont l-EAD tar-rati ta' inadempjenza annwali, fejn użati fil-kalibrazzjoni tal-mudelli tal-PD. Din l-informazzjoni għandha timtela biss għal mudelli PD. Għandha tintuża d-data użata fil-kalibrazzjoni tal-parametri tal-mudell. Jekk ma teżisti l-ebda data interna u l-kalibrazzjoni hija bbażata fuq data esterna, allura għandha tiġi rrapportata d-data esterna. |
| 0060 | Rata medja ponderata ta' inadempjenza għall-każ għall-kalibrazzjoni | | Għandha tiġi rrapportata l-medja ponderata skont il-każ tar-rati ta' inadempjenza annwali użati fil-kalibrazzjoni tal-mudelli tal-PD. Din l-informazzjoni għandha timtela biss għal mudelli PD.<br>Għandha tintuża d-data użata fil-kalibrazzjoni tal-parametri tal-mudell. Jekk ma teżisti l-ebda data interna u l-kalibrazzjoni hija bbażata fuq data esterna, allura għandha tiġi rrapportata d-data esterna. |
| 0070 | PD fuq medda twila ta' żmien | | Għandha tiġi rrapportata t-tendenza ċentrali użata mill-istituzzjoni fil-kalibrazzjoni tal-mudelli li tinkorpora kull aġġustament prudenti fil-medja ponderata skont il-każ tar-rati ta' inadempjenza annwali użati fil-kalibrazzjoni tal-mudelli PD. Din l-informazzjoni għandha timtela biss għal mudelli PD. |
| 0080 | Rata ta' rimedju ta' assi inadempjenti | | Ir-rata ta' rimedju tal-assi inadempjenti għandha tkun il-perċentwal ta' pendenti inadempjenti li jirritorna fi status "mhux inadempjenti" fuq perjodu ta' 12-il xahar.<br>Istituzzjoni li ma tikkalkulax ir-rati ta' rimedju ta' assi inadempjenti għal mudell partikolari għandha tikkalkula indikatur għal rati ta' rimedju, skont id-definizzjoni fornuta. L-istituzzjoni għandha tirrapporta l-użu ta' indikatur lill-awtorità kompetenti. Din l-informazzjoni għandha timtela biss għal mudelli LGD. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0090 | Rata ta' rkupru ta' assi prekluż mhux rimedjati | | Għandha tkun irrapportata r-rata ta' rkupru medja ponderata ta' rkupru skont il-każ għal inadempjenzi mhux rimedjati inklużi fis-serje ta' żmien użata mill-istituzzjoni għall-kalibrazzjoni tal-mudelli LGD fuq assi mhux inadempjenti.<br>Għandha tintuża d-data użata fil-kalibrazzjoni tal-parametri tal-mudell. Jekk ma teżisti l-ebda data interna u l-kalibrazzjoni hija bbażata fuq data esterna, allura għandha tiġi rrapportata d-data esterna. Istituzzjoni li ma jkollhiex rata ta' rkupru speċifika għal inadempjenzi mhux rimedjati minħabba proċedura ta' rkupru mhux kompluta, għandha tikkalkula indikatur filwaqt li tqis l-irkupri osservati kif ukoll l-istimi tal-irkupri għal ħidma mhux kompluta. L-istituzzjoni għandha tirrapporta l-użu ta' indikatur lill-awtorità kompetenti. Din l-informazzjoni għandha timtela biss għal mudelli LGD. |
| 0100 | Tul tal-perjodu ta' rkupru mhux rimedjat tal-assi prekluż | | Għandu jkun irrapportat it-tul medju ponderat skont il-każ tal-perjodu ta' rkupru (mill-bidu tal-istatus ta' inadempjenza sad-data tat-tlestija tal-proċeduri ta' rkupru) għall-inadempjenza mhux rimedjati inklużi fis-serje ta' żmien użata mill-istituzzjoni għall-kalibrazzjoni tal-mudelli LGD fuq assi mhux inadempjenti. It-tul medju ponderat skont il-każ għandu jiġi espress f'numru ta' jiem.<br>Għandha tintuża d-data użata fil-kalibrazzjoni tal-parametri tal-mudell. Jekk ma teżisti l-ebda data interna u l-kalibrazzjoni hija bbażata fuq data esterna, allura għandha tiġi rrapportata d-data esterna.<br>Istituzzjoni li ma jkollhiex tul ta' perjodu ta' rkupru speċifiku għal inadempjenzi mhux rimedjati, minħabba proċedura ta' rkupru mhux kompluta, għandha tikkalkula indikatur filwaqt li tqis id-definizzjoni pprovduta. L-istituzzjoni għandha tirrapporta l-użu ta' indikatur lill-awtorità kompetenti. Din l-informazzjoni għandha timtela biss għal mudelli LGD. |
| 0110 | Deċiżjoni konġunta | L-Artikolu 20(2), il-punt (a); tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | L-istituzzjoni għandha tirrapporta jekk teżistix jew le deċiżjoni konġunta dwar ir-rekwiżiti prudenzjali bejn l-awtorità kompetenti konsolidanti u dik ospitanti rigward il-permess li jintuża l-approċċ IRB għall-kalkolu tar-rekwiżiti prudenzjali għall-iskoperturi miżmuma mis-sussidjarji tal-istituzzjonijiet fil-portafolli ta' parametraġġ referenzjarju rrapportati. |
| 0120 | Superviżur konsolidanti | L-Artikolu 20 ta' Regolament (UE) Nru 575/2013 | Il-kodiċi ISO tal-pajjiż tal-oriġini tal-awtorità kompetenti responsabbli għas-superviżjoni konsolidata tal-istituzzjoni li tuża approċċ IRB għandu jiġi rrapportat. |
| 0130 | RWA | Il-mudell C08.01, il-Kolonna 0260 tal-Anness I tar-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) Nru 2021/451 | Għandu jiġi rrapportat l-RWA aggregat wara fatturi ta' sostenn (fatturi ta' sostenn għall-SMEs u għall-infrastruttura) tal-iskoperturi fl-ambitu ta' applikazzjoni tal-mudell ta' klassifikazzjoni. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0140 | Żidiet ta' RWA | | Iż-żidiet tal-RWA għandhom ikunu subpożizzjoni ("li minnhom") tal-RWA (Mudell C105.01, kolonna 0130) u għandhom jinkludu<br>a) l-RWA li jiżdied mal-RWA li jirriżulta mill-applikazzjoni tal-parametru/i tar-riskju tal-mudell minħabba miżuri interni addizzjonali ta' konservatiżmu applikati direttament għall-RWA, jekk ikun hemm;<br>b) l-RWA li jiżdied mal-RWA li jirriżulta mill-applikazzjoni tal-parametru/i tar-riskju tal-mudell minħabba miżuri superviżorji applikati direttament għall-RWA, jekk ikun hemm.<br><br>L-ammonti taħt il-punti (a) u (b) ma għandhomx jinkludu miżuri li huma diġà riflessi fil-PD (il-mudelli C102, il-kolonna 0060 u C103, il-kolonna 0060 ta'), is-CCF (il-kolonna 0100 tal-mudelli C102 u C103) jew l-LGD (il-mudelli C102 u C103, il-kolonna 0130), iżda għandhom ikunu ristretti għal miżuri li huma applikati direttament fuq l-RWA u, jekk rilevanti, minbarra l-marġnijiet tal-konservattiviżmu u l-miżuri superviżorji (multiplikaturi, żidiet, minimi jew miżuri simili) li jżidu l-parametri tar-riskju.<br><br>Iż-żidiet tal-RWA ma għandhomx jinkludu l-effett tal-miżuri potenzjali skont l-Artikolu 458 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.<br><br>F'każ li l-istituzzjoni ma tkunx tista' tiżola l-aġġustamenti konservattivi rilevanti, għandha tapplika l-Parti I, il-punt 3. |

**C 105.02 — Immappjar ta' mudelli interni għal portafolli**

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0010 | ID tal-Portafoll | Il-mudelli C102, il-kolonna 0010 u C103, il-kolonna 0010 | Għandha tiġi rrapportata l-ID tal-portafoll li tidentifika b'mod uniku l-portafoll f'konformità mal-mudelli C102 u C103 tal-Anness I.<br><br>Il-kolonni 0010 u 0020 huma identifikatur kompost tar-ringieli u flimkien għandhom ikunu uniċi għal kull ringiela f'din il-formula. |
| 0020 | ID tal-mudell intern | Il-mudell C 105.01, il-kolonna 0010 | Għandu jiġi rrapportat l-ID tal-mudell intern assenjat mill-istituzzjoni li tirrapporta.<br>Il-kolonni 0010 u 0020 huma identifikatur kompost tar-ringiela u flimkien għandhom ikunu uniċi għal kull ringiela fil-mudell C105.02. |
| 0030 | EAD | Il-mudell C08.01, il-kolonna 0110 tal-Anness I tar-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) Nru 2021/451 | Għandu jiġi rrapportat il-valur aggregat tal-iskopertura għall-iskoperturi li huma inklużi fil-portafoll definit fil-kolonna 0010 u fl-ambitu tal-applikazzjoni tal-mudell ta' klassifikazzjoni definit fil-kolonna 0020. Meta l-iskoperturi kollha ta' portafoll partikolari jiġu ttrattati b'mudell speċifiku wieħed, il-valur tal-iskopertura jkun identiku għall-ammont irrapportat għall-istess portafoll fil-kolonna 0110 tal-mudelli C 102 jew C 103, kif applikabbli. |
| 0040 | RWA | Il-mudell C08.01, il-kolonna 0260 tal-Anness I tar-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) Nru 2021/451 | Għandu jiġi rrapportat l-RWA aggregat wara l-fatturi ta' sostenn għall-iskoperturi li huma inklużi fil-portafoll definit mill-kolonna 0010 u fl-ambitu tal-applikazzjoni tal-mudell ta' klassifikazzjoni definit fil-kolonna 0020. Meta l-iskoperturi kollha ta' portafoll partikolari jiġu ttrattati b'mudell speċifiku wieħed, l-RWA għandu jkun identiku għall-ammont irrapportat għall-istess portafoll fil-kolonna 0170 tal-mudelli C 102 jew C 103, kif applikabbli. |

**C 105.03 – Immappjar ta' mudelli interni għal pajjiżi**

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0005 | ID tar-ringiela | | Dan il-kodiċi huwa identifikatur tar-ringiela u għandu jkun uniku għal kull ringiela fil-mudell. Għandu jsegwi l-ordni numerika 1, 2, 3, eċċ. |
| 0010 | ID tal-mudell intern | Il-mudell C105.01, il-kolonna 0010 | Għandu jiġi rrapportat l-ID tal-mudell intern assenjat mill-istituzzjoni li tirrapporta. Meta ID ta' mudell intern partikolari jkun assoċjat ma' diversi pajjiżi, għandhom jiġu rrapportati ringieli separati għal kull kombinazzjoni ta' "ID tal-mudell intern" u "Post tal-istituzzjoni". Il-kolonni 0010 u 0020 huma identifikatur kompost tar-ringieli u flimkien għandhom ikunu uniċi għal kull ringiela fit-tabella. |
| 0020 | Lokalità tal-istituzzjoni | L-Artikolu 20 ta' Regolament (UE) Nru 575/2013 | Il-kodiċi ISO tal-pajjiż tar-residenza legali ta' kull sussidjarja fejn l-iskoperturi IRB irrapportati għal kull portafoll ta' parametraġġ referenzjarju jkunu rreġistrati għandu jiġi rrapportat, irrispettivament mill-eżistenza ta' kwalunkwe permess mogħti mis-superviżur ospitanti sabiex jiġi applikat approċċ IRB." |

*ANNESS II*

*"ANNESS V*

**STRUMENTI U PORTAFOLLI TA' RIFERIMENT GĦAR-RISKJU TAS-SUQ**

Taqsima 1: Struzzjonijiet

Taqsima 2: Strumenti

Taqsima 3: Portafolli individwali - Strument uniku

Taqsima 4: Portafolli individwali - Multi strumenti

Taqsima 5: Portafolli aggregati

Taqsima 6: Speċifikazzjonijiet addizzjonali għall-istrumenti

Taqsima 7: Portafolli ta' validazzjoni tal-SBM

**Taqsima 1: Struzzjonijiet**

(a) Għall-finijiet ta' dan l-Anness, japplika dan li ġej:

(i) "Data ta' reġistrazzjoni" tfisser id-data u l-ħin li fihom l-istituzzjonijiet jirreġistraw it-tranżazzjonijiet għall-finijiet tal-eżerċizzju ta' parametraġġ referenzjarju;

(ii) "Valwazzjoni tas-Suq Inizjali (IMV, Initial Market Valuation)" tfisser il-valur valwat skont is-suq tal-istrumenti msemmijin fit-Taqsima 2 ta' dan l-Anness, fid-data u l-ħin ta' referenza tal-IMV;

(iii) "Data ta' referenza tal-IMV" tfisser id-data u l-ħin li b'referenza għalihom l-istituzzjonijiet għandhom jiddeterminaw l-IMV tat-tranżazzjonijiet fil-portafoll ta' parametraġġ referenzjarju;

(iv) "Data ta' rimessa tal-IMV" tfisser id-data sa meta l-istituzzjonijiet għandhom jissottomettu r-riżultati tal-IMV tat-tranżazzjonijiet fil-portafoll ta' parametraġġ referenzjarju;

(v) "VaR" (Value at Risk) tfisser il-valur fir-riskju;

(vi) "sVaR" (Stressed Value at Risk) tfisser il-valur fir-riskju taħt stress;

(vii) "IRC" (Incremental Risk Charge) tfisser l-imposta inkrimentali għar-riskju;

(viii) "CTP" (Correlation Trading Portfolio) tfisser il-portafoll ta' negozjar ta' korrelazzjoni;

(ix) "APR" (All Price Risk) tfisser ir-riskju tal-prezz kollu kkalkulat f'konformità mal-Artikolu 377(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013;

(x) "Miżuri ta' Riskju" (RM, Risk Measures) tfisser il-valur tal-VaR, sVaR, u meta meħtieġ IRC u APR għall-portafolli, kif stabbilit fit-Taqsimiet 3, 4 u 5 ta' dan l-Anness, bejn id-data ta' referenza inizjali tal-RM u d-data ta' referenza finali tal-RM;

(xi) "Data ta' referenza inizjali tal-RM" tfisser id-data li fiha l-istituzzjonijiet għandhom jibdew jikkalkulaw il-valuri tal-RM;

(xii) "Data ta' referenza finali tal-RM" tfisser id-data li fiha l-istituzzjonijiet għandhom jispiċċaw jikkalkulaw il-valuri tal-RM;

(xiii) "Data ta' rimessa tal-RM" tfisser id-data sa meta l-istituzzjonijiet għandhom jissottomettu r-riżultati tal-RM tat-tranżazzjonijiet fil-portafoll ta' parametraġġ referenzjarju;

(xiv) "Valur Preżenti (PV, Present Value)" tfisser il-valur valwat skont is-suq tal-portafolli, stabbilit fit-Taqsima 3 ta' dan l-Anness, fid-data ta' referenza finali tal-RM;

(xv) "ATM" tfisser "Bl-Istess Valur (At The Money)", f'termini tal-pożizzjoni relattiva tal-prezz kurrenti jew futur tal-assi sottostanti ta' derivattiv fir-rigward tal-prezz tal-eżerċitar ta' dan id-derivattiv;

(xvi) "OTM" tfisser "Sfavorevoli (Out of The Money)", f'termini tal-pożizzjoni relattiva tal-prezz kurrenti jew futur tal-assi sottostanti ta' derivattiv apparagun tal-prezz tal-eżerċitar ta' dan id-derivattiv;

(xvii) "ITM" tfisser "Favorevoli (In The Money)", f'termini tal-pożizzjoni relattiva tal-prezz kurrenti jew futur tal-assi sottostanti ta' derivattiv apparagun tal-prezz tal-eżerċitar ta' dan id-derivattiv;

(xviii) "pożizzjoni twila" tfisser "mixtrija" u "pożizzjoni qasira" tfisser "mibjugħa";

(xix) "CDS" (Credit Default Swaps) tfisser swaps ta' inadempjenza ta' kreditu;

(xx) għas-CDS, "pożizzjoni twila" tfisser "protezzjoni mixtrija" u "pożizzjoni qasira" tfisser "protezzjoni mibjugħa";

(xxi) "MLN" tfisser miljuni;

(xxii) "OTC" tfisser barra l-borża (Over-The-Counter);

(xxiii) "ASA" tfisser l-approċċ standardizzat alternattiv kif imsemmi fil-Parti Tlieta, it-Titolu IV, il-Kapitolu 1a, it-Taqsima 1 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013;

(xxiv) "SBM" (Sensitivities-Based Method) tfisser il-metodu bbażat fuq is-sensittivitajiet kif imsemmi fil-Parti Tlieta, it-Titolu IV, il-Kapitolu 1a, it-Taqsima 2 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013;

(xxv) "DRC" tfisser ir-rekwiżit għar-Riskju ta' Inadempjenza kif imsemmi fil-Parti Tlieta, it-Titolu IV, il-Kapitolu 1a, it-Taqsima 5 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013;

(xxvi) "RRAO" (Residual Risk Add-On) tfisser iż-żieda tar-riskji residwi kif imsemmi fil-Parti Tlieta, it-Titolu IV, il-Kapitolu 1a, it-Taqsima 4 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.

(b) Id-dati li ġejjin għandhom japplikaw għall-eżerċizzju ta' "parametraġġ referenzjarju":

(i) id-data tal-kontabilità għandha tkun it-30 ta' Jannar 2025;

(ii) id-data ta' referenza tal-IMV (u tal-SBM inizjali) għandha tkun is-6 ta' Frar 2025 (fil-5:30 pm CET);

(iii) id-data ta' rimessa tal-IMV (u tal-SBM inizjali u tal-validazzjoni tal-SBM) għandha tkun it-28 ta' Frar 2025;

(iv) id-data ta' referenza inizjali tal-RM għandha tkun it-2 ta' Ġunju 2025;

(v) id-data ta' referenza finali tal-RM (u tal-ASA finali) għandha tkun it-13 ta' Ġunju 2025;

(vi) id-data ta' rimessa tal-RM (u tal-ASA finali) għandha tkun it-18 ta' Lulju 2025.

(c) Sakemm ma jkunx speċifikat espliċitament mod ieħor fit-Taqsima 2 ta' dan l-Anness, il-pożizzjonijiet kollha għandhom jiġu rreġistrati fid-data tal-kontabilità msemmija fil-punt (b)(i) ta' din it-Taqsima. Ladarba l-pożizzjonijiet ikunu ġew irreġistrati, kull portafoll għandu jimmatura għat-tul tal-eżerċizzju ta' parametraġġ referenzjarju u għandu jiġi kkalkulat bis-suppożizzjoni li l-istituzzjoni ma tieħu l-ebda azzjoni biex b'xi mod timmaniġġja l-portafoll matul il-perjodu kollu tal-eżerċizzju ta' parametraġġ referenzjarju. Sakemm ma jkunx stipulat espliċitament mod ieħor fl-ispeċifikazzjonijiet ta' strument partikolari, il-prezzijiet tal-eżerċitar għall-pożizzjonijiet tal-opzjonijiet għandhom jiġu ddeterminati skont il-prezz tal-assi sottostanti osservat f'għeluq is-suq fid-data tal-kontabilità.

(d) Għall-finijiet ta' valwazzjoni tas-suq inizjali, il-valwazzjoni ta' kull strument għandha tiġi sottomessa lill-awtorità kompetenti tal-istituzzjoni sad-data ta' rimessa tal-IMV. Sa din id-data, l-istituzzjoni għandha tissottometti nota ta' spjegazzjoni li takkumpanja r-riżultati, f'konformità mal-punt (e). Meta possibbli, l-IMV għandha tingħata f'konformità mal-valwazzjoni tal-uffiċċju tan-negozjar tal-istituzzjoni. Jekk l-IMVs ma jingħatawx mill-uffiċċju tan-negozjar tal-istituzzjoni, l-istituzzjoni għandha tispeċifika fin-nota ta' spjegazzjoni min huwa l-fornitur tas-sors tad-data tal-IMV.

(e) In-nota ta' spjegazzjoni li l-istituzzjonijiet għandhom jissottomettu flimkien mal-IMV għandha tinkludi dan kollu li ġej għal kull strument:

(i) il-fatturi ta' riskju użati għall-kalkolu tal-IMV tal-istrument;

(ii) il-mudell tal-ipprezzar użat għall-kalkolu tal-IMV tal-istrument u deskrizzjoni ta' dan il-mudell tal-ipprezzar;

(iii) il-fatturi ta' riskju inklużi fil-mudell tal-VaR għall-istrument;

(iv) il-fatturi ta' riskju inklużi fil-mudell tal-VaR li huma wkoll inputs ta' valwazzjoni għall-IMV tal-istrument;

(v) l-ispeċifiċitajiet tal-mudell tal-VaR fir-rigward tal-istrument;

(vi) id-data ta' referenza disponibbli għall-istrument fil-format tal-istituzzjoni nnifisha;

(vii) l-aspetti msemmija fil-punti (h), (i), (k), (m), (n), (o), (v), (w), (y), (gg) u (kk) ta' din it-Taqsima.

(f) Għall-finijiet tal-punt (e), is-sottopunt (v), għandu jiġi rrapportat dan kollu li ġej:

(i) deskrizzjonijiet konċiżi tal-mudell tal-VaR;

(ii) il-metodi ta' rivalwazzjoni applikati;

(iii) il-forma funzjonali applikata għall-iżvilupp ta' mudelli tar-rendiment (bħall-metodu assolut, metodu relativ, metodi oħra;

(iv) informazzjoni kwalitattiva dwar is-serje kronoloġika użata biex jiġi kkalibrat il-mudell tal-VaR fir-rigward tal-istrument (bħas-sors, il-metodoloġija għan-normalizzazzjoni, il-buckets applikati, informazzjoni oħra meqjusa rilevanti mill-istituzzjonijiet biex jispjegaw ir-riżultati pprovduti).

(g) In-nota ta' spjegazzjoni msemmija fil-punt (d) għandha tiġi aġġornata ma' kull sottomissjoni mill-ġdid ta' xi valur, filwaqt li tirrifletti l-bidliet bejn is-sottomissjonijiet. In-nota ta' spjegazzjoni għandu jkun fiha taqsima waħda li telenka d-dati kollha ta' sottomissjonijiet kollha u r-raġunijiet tas-sottomissjonijiet mill-ġdid.

(h) Ir-riskji tal-pożizzjonijiet għandhom ikunu kkalkulati mingħajr ma jitqiesu l-ispejjeż għall-finanzjament. Fejn applikabbli, l-istituzzjonijiet għandhom jużaw ir-rata mil-lum għall-għada tal-munita tal-istrument bħala r-rata ta' skont. Il-ftehim kollaterali għandu jiġi kkunsidrat fis-seħħ għall-istrumenti derivattivi msemmijin fit-Taqsima 2 ta' dan l-Anness. Meta dan ma jkunx possibbli, għandhom jingħataw raġunijiet fin-nota ta' spjegazzjoni msemmija fil-punt (d).

(i) Ir-riskju ta' kreditu tal-kontroparti u l-aġġustament tal-valwazzjoni tal-kreditu ("CVA, credit valuation adjustment") ma għandhomx jitqiesu fil-valwazzjoni tar-riskji tal-portafolli. Meta dan ma jkunx possibbli, għandhom jingħataw raġunijiet fin-nota ta' spjegazzjoni msemmija fil-punt (d) ta' din it-Taqsima. L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw il-każijiet fejn tipoloġiji oħra tal-Aġġustamenti tal-Valwazzjoni jkunu inklużi fl-IMV u jispjegaw għal kull strument finanzjarju l-metodoloġija u l-impatt fin-nota ta' spjegazzjoni msemmija fil-punt (d) ta' din it-Taqsima.

(j) Għal tranżazzjonijiet li jinkludu pożizzjonijiet twal fis-CDSs, l-istituzzjonijiet għandhom jippresupponu li tħallset tariffa immedjata bil-quddiem biex il-pożizzjoni tagħhom tkun skont l-istandards u l-konvenzjonijiet tas-suq. Id-data ta' maturità għas-CDSs kollha għandha tikkorrispondi mad-dati konvenzjonali ta' terminazzjoni trimestrali.

(k) L-ispeċifikazzjonijiet addizzjonali meħtieġa sabiex jitwettqu l-kalkoli tal-ipprezzar meħtieġa għall-pożizzjonijiet tas-CDSs għandhom ikunu konsistenti mal-istandards u l-konvenzjonijiet tas-suq użati komunement u għandhom jiġu spjegati fin-nota ta' spjegazzjoni msemmija fil-punt (d) ta' din it-Taqsima.

(l) Id-data tal-maturità għandha tiżgura li t-tranżazzjoni tkun l-eqreb għall-perjodu ta' maturità speċifikat, f'konformità mal-istandards u l-konvenzjonijiet tas-suq.

(m) Fir-rigward tad-dettalji tal-istrumenti mhux imsemmijin fit-Taqsima 2 ta' dan l-Anness, l-istituzzjonijiet għandhom jipprovdu s-suppożizzjonijiet li ntużaw, inkluż il-metodu tal-għadd tal-jiem u l-għażla għal strument kummerċjabbli u likwidu, fejn ikun permess, flimkien mar-riżultati fin-nota ta' spjegazzjoni msemmija fil-punt (d) ta' din it-Taqsima.

(n) L-istituzzjonijiet li jkunu tal-fehma li s-suppożizzjonijiet, apparti dawk speċifikati f'din it-Taqsima, ikunu rilevanti għall-interpretazzjoni tar-riżultati tal-eżerċizzju tagħhom, inkluż pereżempju t-twaqqit ta' għeluq in-negozju, l-operazzjonijiet tat-tip coupon rolls, l-immappjar apparagun ta' indiċijiet u oħrajn, għandhom jissottomettu deskrizzjoni ta' dawn is-suppożizzjonijiet fin-nota ta' spjegazzjoni msemmija fil-punt (d) ta' din it-Taqsima.

(o) In-nota ta' spjegazzjoni msemmija fil-punt (d) ta' din it-Taqsima għandha tinkludi spjegazzjonijiet għar-riskji mhux koperti mill-mudell għall-istrumenti msemmija fit-Taqsima 2 ta' dan l-Anness.

(p) L-opzjonijiet kollha għandhom jiġu ttrattati daqslikieku huma nnegozjati OTC, sakemm ma jkunx speċifikat espliċitament mod ieħor.

(q) Għandhom jiġu segwiti l-konvenzjonijiet standard dwar it-twaqqit għall-opzjonijiet OTC. It-tul ta' żmien ta' maturità għal opzjoni "n xhur" għandha tkun n xhur. Meta l-opzjonijiet jiskadu f'jum mhux tan-negozju, l-istituzzjonijiet għandhom jaġġustaw id-data ta' skadenza skont il-jum tan-negozju, f'konformità mal-istandards u l-konvenzjonijiet tas-suq.

(r) Kull opzjoni OTC għandha tiġi ttrattata kif ġej:

  (i) bħala Amerikana għal ekwitajiet u komoditajiet b'isem wieħed;

  (ii) bħala Ewropea għal indiċi tal-ekwità, opzjonijiet fuq muniti u swapzjonijiet.

(s) L-opzjonijiet OTC kollha għandhom jitqiesu "skoperti" sabiex il-primjum jiġi eskluż mill-valwazzjoni tas-suq inizjali.

(t) Fir-rigward tas-CTPs, l-istituzzjonijiet li għandhom permess jużaw il-mudell tal-APR għas-CTPs għandhom jipprovdu dettalji dwar l-aktar suppożizzjonijiet, standards tas-suq u konvenzjonijiet rilevanti tagħhom rigward l-istrumenti tas-CTP imsemmijin fit-Taqsima 2 ta' dan l-Anness, inkluż id-deltas li jkunu kkalkulaw biex jagħmlu l-istrumenti tas-CTP newtrali għas-CS01 fid-data ta' reġistrazzjoni.

(u) L-IMV għal kull strument għandha tiġi pprovduta fil-munita tal-istrument tal-EBA speċifikata fit-Taqsima 2 ta' dan l-Anness għal dak l-istrument.

(v) Għall-portafolli magħmula minn strument wieħed jew aktar denominati f'muniti tal-istrument tal-EBA li huma differenti mill-munita tal-portafoll tal-EBA, ir-riżultat għandu jinqaleb fil-munita tal-portafoll tal-EBA bl-użu tar-rata tal-kambju spot tal-BĊE tad-data rilevanti. Ir-riżultat konvertit għandu jiġi spjegat fin-nota ta' spjegazzjoni msemmija fil-punt (d) ta' din it-Taqsima.

(w) Meta jirreġistraw il-pożizzjonijiet, l-istituzzjonijiet għandhom isegwu l-konvenzjonijiet xierqa tas-suq dment li ma jkunx speċifikat mod ieħor f'dawn l-istruzzjonijiet fid-deskrizzjonijiet tal-Istrumenti (it-Taqsima 2 ta' dan l-Anness).

(x) Meta strument jew strument sottostanti ta' derivattiv ikun soġġett għal azzjoni korporattiva li taffettwa l-eżerċizzju ta' parametrażġ referenzjarju bħal pereżempju sejħa mill-emittent, inadempjenza jew azzjoni simili, l-istituzzjonijiet għandhom jeskludu dan l-istrument mill-eżerċizzju flimkien ma' kwalunkwe CDS jew opzjoni li jkunu relatati.

(y) Fir-rigward ta' serje ta' indiċi, "on-the-run" għandha tirreferi għas-serje l-aktar likwida u negozjabbli ta' dak l-indiċi disponibbli fis-suq. L-istituzzjonijiet għandhom jispjegaw l-għażla tagħhom tas-serje "on-the-run" flimkien mar-riżultati relatati fin-nota ta' spjegazzjoni msemmija fil-punt (d) ta' din it-Taqsima.

(z) Meta ma jkunx speċifikat mod ieħor, l-istituzzjonijiet għandhom japplikaw ir-Regolament dwar il-Parametri Referenzjarji tal-UE għar-rata tal-imgħax sabiex jirreġistraw l-istrumenti speċifikati fit-Taqsima 2 ta' dan l-Anness. L-istituzzjonijiet għandhom jispeċifikaw ir-rata applikata, minbarra dawk speċifikati fit-Taqsima 2 ta' dan l-Anness, fin-nota ta' spjegazzjoni msemmija fil-punt (d) ta' dawn l-istruzzjonijiet.

(aa) Il-kejl tar-riskju għall-portafolli msemmija fit-Taqsimiet 3, 4 u 5, flimkien mal-Valur Preżenti, għandhom jiġu kkalkolati mid-"data ta' referenza inizjali tal-RM" għad-"data ta' referenza finali tal-RM". Il-Miżuri tar-Riskju tal-ASA FRTB (SBM, DRC u RRAO) għandhom jiġu kkalkolati għad-"data ta' referenza finali tal-RM". L-istituzzjonijiet għandhom jissottomettu r-riżultati ta' dawk il-kalkoli lill-awtorità kompetenti tagħhom sad-data ta' rimessa tal-RM. L-IMV u l-SBM għandhom jiġu rrapportati għal kull strument. Il-miżuri tar-riskju, l-SBM, id-DRC, l-RRAO u l-Valur Attwali, fejn applikabbli, għandhom jiġu rrapportati għal kull portafoll, kemm individwali kif ukoll aggregat. L-SBM, id-DRC u l-RRAO, fejn applikabbli, għandhom jiġu rrapportati mill-inqas għall-istess portafolli li għalihom jiġu rrapportati miżuri tar-riskju.

(bb) Għall-portafolli msemmija fit-Taqsima 7, l-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw ir-riżultati tal-SBM u jissottomettuhom f'konformità mad-dati tar-rapportar tas-sottomissjoni tal-IMV.

(cc) Dawk l-istituzzjonijiet li ngħataw permess għall-iżvilupp ta' mudell ta' riskju speċifiku ta' strumenti tad-dejn biss għandhom jirrapportaw dwar il-portafolli tal-firxa tal-kreditu. Għall-portafolli tar-rati tal-imgħax li jinkludu r-riskju bħala parti minn ċerti strumenti, il-portafolli individwali u aggregati għandu jkollhom il-mudell tagħhom żviluppat minn istituzzjonijiet li ngħataw il-permess biex jiżviluppaw mudell għar-riskju ta' interess ġenerali kif ukoll minn istituzzjonijiet li ngħataw il-permess biex jiżviluppaw mudell għar-riskju ġenerali u speċifiku tal-imgħax.

(dd) Ir-riżultati għall-portafolli individwali u aggregati għandhom jiġu sottomessi biss meta jkunu qed jiġu sottomessi wkoll ir-riżultati tal-istrumenti li jkunu parti minnhom.

(ee) Fit-Taqsima 2 ta' dan l-Anness (Strumenti) "Sena T" għandha tfisser "2025" u Sena T + X għandha tfisser 2025 + X, b'X tkun kif speċifikat fit-Taqsima 2.

(ff) Fit-Taqsima 2 ta' dan l-Anness (Strumenti), l-istituzzjonijiet għandhom jiddeterminaw il-jum tal-iskadenza/ta' maturità f'konformità mal-istruzzjonijiet li ġejjin:

(i) Meta tkun speċifikata d-data, għandha tintuża din id-data speċifika;

(ii) Meta l-ebda data ma tkun speċifikata, għandha tintuża l-konvenzjoni tas-suq meta disponibbli. Jekk pereżempju jkun hemm konvenzjoni tas-suq li l-jum tal-iskadenza/tal-maturità jkun it-3 Ġimgħa tax-xahar, allura "Ġunju tas-Sena T" għandu jfisser it-3 Ġimgħa tax-xahar tas-sena T;

(iii) Fl-aħħar tax-xahar, meta jkun speċifikat "Tmiem ta'", dan għandu jfisser l-aħħar jum kalendarju tax-xahar;

(iv) Għal perjodu ta' żmien fiss wara d-"data ta' reġistrazzjoni", jekk il-perjodu jkun definit bħala għadd ta' jiem, dan ikun l-aħħar jum tal-perjodu. Jekk il-perjodu huwa definit f'ġimgħat, xhur jew snin, huwa l-istess jum tal-ġimgħa, ix-xahar jew is-sena ta' wara fir-rigward tad-data ta' reġistrazzjoni, jew, jekk l-aħħar xahar jew is-sena tal-perjodu tkun iqsar, l-aħħar jum ta' dak ix-xahar jew dik is-sena; jekk id-"data ta' reġistrazzjoni + il-perjodu x" tinzerta jum ta' btala, agħżel il-jum tax-xogħol li jkun jmiss;

(v) F'każ li ma jkunx speċifikat mod ieħor għandhom jintużaw is-suppożizzjonijiet li ġejjin: Konvenzjoni għall-għadd tal-jiem: Att/360, Kalendarju tal-vaganzi: Target2.

(gg) Fit-Taqsima 2 ta' dan l-Anness (Strumenti), għas-CDSs kollha, dment li ma jkunx speċifikat espliċitament mod ieħor, għandhom japplikaw ir-rekwiżiti li ġejjin:

(i) Frekwenza tal-kupun: Kull tliet xhur;

(ii) Kupun (bps, basic payment scheme): 100;

(iii) Għadd ta' jiem: ATT/360;

(iv) Sena tad-Definizzjonijiet tal-ISDA: 2014;

(v) Klawżola ta' ristrutturar: Ristrutturar Modifikat-Modifikat (MMR, Modified-Modified Restructuring);

(vi) Maturità: Diċembru tas-Sena T+4;

(vii) Tip ta' dejn: Matur;

(viii) Terminu: 5 Snin;

(ix) Id-data effettiva bħala d-data ta' reġistrazzjoni;

(x) Il-kurva tal-iskont u r-rata ta' rkupru użati għandhom jiġu indikati fin-nota ta' spjegazzjoni msemmija fil-punt (d) ta' dan l-Anness.

(hh) L-IMV tal-istrumenti tal-bonds għandha tinkludi l-imgħax akkumulat.

(ii) L-istituzzjonijiet għandhom jipprovdu l-informazzjoni relatata mal-ħin tal-valwazzjoni tal-PV filwaqt li jsemmu l-ħin fin-nota ta' spjegazzjoni msemmija fil-punt (d) ta' din it-Taqsima. Fejn possibbli, il-valwazzjoni tal-PV għandha tiġi kkalkolata fi tmiem il-jum tan-negozju.

(jj) Il-kejl tar-riskju tal-portafolli għandu jiġi kkalkulat fl-istess munita tal-munita tal-portafoll, mingħajr ma jiġi inkluż ebda riskju tal-kambju (FX), relatat ukoll mal-munita tar-rapportar tal-istituzzjonijiet. Ir-riskju tal-kambju (FX) għandu jiġi kkunsidrat biss meta jkun intrinsikament inkluż fl-istrumenti. Meta kemm ir-riżultati tar-rapportar kif ukoll dawk tal-munita tal-portafoll jiġu rrapportati bħala parti mill-eżerċizzju, għaċ-ċifri tal-ASA, ir-riżultati kkalkolati fil-munita tar-rapportar tal-istituzzjoni għandhom jinqalbu fil-munita tal-portafoll tal-EBA permezz ta' konverżjoni spot bl-użu tar-rata tal-kambju spot tal-BĊE assoċjata mad-data tal-kalkolu. Il-qlib fil-munita tal-portafoll tal-EBA ma jimplikax bidla fil-fatturi ta' riskju tal-FX.

(kk) Meta japplika l-Artikolu 325q(7) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 ("approċċ tal-munita bażi"), meta jwettqu kalkoli tal-SBM u jiġu rapportati sensittivitajiet tal-SBM, l-istituzzjonijiet għandhom jikkunsidraw il-fatturi tar-riskju tal-FX li jirriżultaw mill-applikazzjoni tal-approċċ tal-munita bażi. Il-valuri rrapportati ma għandhomx jiġu espressi fil-munita bażi magħżula iżda pjuttost fil-munita tar-rapportar tal-istituzzjonijiet billi tiġi applikata konverżjoni spot bl-użu tar-rata tal-kambju spot tal-BĊE assoċjata mad-data rilevanti.

**Taqsima 2: Strumenti**

L-istituzzjonijiet għandhom jipprovdu IMV, skont l-istruzzjonijiet stabbiliti fit-Taqsima 1 ta' dan l-Anness, għall-istrumenti finanzjarji li ġejjin, fejn l-Istituzzjonijiet għandhom jipprovdu miżuri ta' riskju u l-Valur Preżenti tal-portafolli speċifikati fit-Taqsima 3 u t-Taqsima 4:

**EKWITÀ**

101. Pożizzjoni twila għall-futuri bbażati fuq l-indiċi EURO STOXX 50 (Ticker: FESX).

Nozzjonali: ekwivalenti għall-valur tal-indiċi mmultiplikat b'EUR 1 000

Kambju: Eurex

Data ta' skadenza: Ġunju tas-Sena T

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

102. Pożizzjoni twila għal 10 000 sehem, BAYER (Ticker: BAYN GR).

Kambju: Xetra

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

103. Pożizzjoni qasira għall-futuri, BAYER (Ticker: BAYN GR).

Nozzjonali: ekwivalenti għall-valur ta' 10 000 sehem tal-assi sottostanti

Kambju: Eurex

Id-data tal-iskadenza: Ġunju tas-Sena T

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

104. Pożizzjoni qasira għall-futuri, STELLANTIS (Ticker: STLA FP).

Nozzjonali: ekwivalenti għall-valur ta' 10 000 sehem tal-assi sottostanti

Kambju: Euronext

Id-data tal-iskadenza: Ġunju tas-Sena T

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

105. Pożizzjoni qasira għall-futuri, ALLIANZ (Ticker: ALV GR).

Nozzjonali: ekwivalenti għall-valur ta' 10 000 sehem tal-assi sottostanti

Kambju: Eurex

Id-data tal-iskadenza: Ġunju tas-Sena T

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

106. Pożizzjoni qasira għall-futuri, BARCLAYS (Ticker: BARC LN).

Nozzjonali: ekwivalenti għall-valur ta' 10 000 sehem tal-assi sottostanti

Kambju: Eurex

Id-data tal-iskadenza: Ġunju tas-Sena T

Munita tal-istrument tal-EBA: GBP

107. Pożizzjoni qasira għall-futuri, DEUTSCHE BANK (Ticker: DBK GR).

Nozzjonali: ekwivalenti għall-valur ta' 10 000 sehem tal-assi sottostanti

Kambju: Eurex

Id-data tal-iskadenza: Ġunju tas-Sena T

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

108. Pożizzjoni qasira għall-futuri, CRÉDIT AGRICOLE (Ticker: ACA FP).

Nozzjonali: ekwivalenti għall-valur ta' 10 000 sehem tal-assi sottostanti

Kambju: Euronext

Data ta' skadenza: Ġunju tas-Sena T

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

109. Opzjonijiet call ta' pożizzjoni twila. Assi sottostanti BAYER (Ticker: BAYN GR), ATM (kuntratt 1 = 100 sehem).

Nozzjonali: ekwivalenti għall-valur ta' 10 000 sehem tal-assi sottostanti

Data ta' skadenza: Ġunju tas-Sena T

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

110. Opzjonijiet call ta' pożizzjoni qasira. Assi sottostanti BAYER (Ticker: BAYN GR), ATM (kuntratt 1 = 100 sehem).

Nozzjonali: ekwivalenti għall-valur ta' 10 000 sehem tal-assi sottostanti

Data ta' skadenza: Diċembru tas-Sena T

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

111. Opzjonijiet call ta' pożizzjoni twila. Assi sottostanti PFIZER (Ticker PFE US) 10 % OTM, (kuntratt 1 = 100 sehem).

Nozzjonali: ekwivalenti għall-valur ta' 10 000 sehem tal-assi sottostanti

Data ta' skadenza: Ġunju tas-Sena T

Munita tal-istrument tal-EBA: USD

112. Opzjonijiet put ta' pożizzjonijiet twal. Assi sottostanti PFIZER (Ticker PFE US) 10 % OTM, (kuntratt 1 = 100 sehem).

Nozzjonali: ekwivalenti għall-valur ta' 10 000 sehem tal-assi sottostanti

Data ta' skadenza: Ġunju tas-Sena T

Munita tal-istrument tal-EBA: USD

113. Opzjonijiet call ta' pożizzjoni twila. Assi sottostanti BAYER (Ticker: BAYN GR), 10 % OTM (kuntratt 1 = 100 sehem).

Nozzjonali: ekwivalenti għall-valur ta' 10 000 sehem tal-assi sottostanti

Data ta' skadenza: Diċembru tas-Sena T

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

114. Opzjonijiet call ta' pożizzjoni qasira. Assi sottostanti BAYER (Ticker: BAYN GR), 10 % OTM (kuntratt 1 = 100 sehem).

Nozzjonali: ekwivalenti għall-valur ta' 10 000 sehem tal-assi sottostanti

Id-data tal-iskadenza: Ġunju tas-Sena T

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

115. Opzjonijiet call fit-tul. Assi sottostanti, AVIVA (Ticker: AV/LN), 10 % OTM (kuntratt (1) = 100 sehem).

Nozzjonali: ekwivalenti għall-valur ta' 10 000 sehem tal-assi sottostanti

Id-data tal-iskadenza: Diċembru tas-Sena T

Munita tal-istrument tal-EBA: GBP

116. Opzjonijiet put fit-tul. Assi sottostanti, AVIVA (Ticker: AV/LN), 10 % OTM (kuntratt (1) = 100 sehem).

Nozzjonali: ekwivalenti għall-valur ta' 10 000 sehem tal-assi sottostanti

Id-data tal-iskadenza: Diċembru tas-Sena T

Munita tal-istrument tal-EBA: GBP

117. Pożizzjoni qasira għall-futuri, NIKKEI 225 (Ticker NKY).

Nozzjonali: ekwivalenti għall-valur tal-indiċi mmultiplikat b'20 000 JPY

Kambju: CME

Id-data tal-iskadenza: Ġunju tas-Sena T

Munita tal-istrument tal-EBA: JPY

118. Prodott tal-ekwità eżerċitabbli awtomatikament (auto-callable).

Pożizzjoni fit-tul

Il-kontabilità fid-"data tal-kontabilità"

Ammont nozzjonali ("kapital"): EUR 1 000 000

Sottostanti: Indiċi EURO STOXX 50 (Ticker: SX5E

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

Maturità: 5 snin

Żborż Annwali u osservazzjoni annwali ("Data tal-kontabilità + sena (1)", "Data tal-kontabilità + sentejn", "Data tal-kontabilità + 3 snin", "Data tal-kontabilità + 4 snin", "Data tal-kontabilità + 5 snin"). L-iżborż iseħħ 10 ijiem wara d-data ta' referenza.

Kupun: 6 %

Livell ta' awtoeżerċitar ("Valur inizjali"): Tmiem il-jum fid-Data ta' reġistrazzjoni + xahar (1)

Il-pagament tal-kupun barriera huwa 60 % tal-livell ta' opzjoni ta' awtoeżerċitar

Barriera ta' protezzjoni: 55 % tal-livell ta' opzjoni ta' awtoeżerċitar

— Il-kapital ma jkunx garantit jekk l-indiċi jkun inqas mill-barriera ta' protezzjoni (il-kapital rimborżat fil-5 sena jkun *prorata* meta l-livell ikun taħt il-barriera ta' protezzjoni: pereżempju, jekk l-SX5E = 40 % tal-livell inizjali tagħha, il-kapital irritornat ikun ta' 40 %);

— Jekk l-SX5E ≥ 60 % (il-kupun barriera) tal-valur inizjali fi tmiem kwalunkwe sena, mela l-kupun imħallas ikun ta' 6 %;

— Jekk SX5E ≥ 100 % tal-valur inizjali fi tmiem kwalunkwe sena, il-prodott jiġi eżerċitat u l-iżborż ikun il-kupun flimkien mal-kapital (100 %);

— Jekk l-SX5E < 60% (il-kupun barriera) tal-valur inizjali fi tmiem kwalunkwe sena, ma jitħallas l-ebda kupun;

— Jekk l-SX5E < 55% (il-barriera ta' protezzjoni) tal-valur inizjali fi tmiem is-sena 5, il-kapital jitħallas biss *prorata*. Inkella jekk l-SX5E > = 55 % (il-barriera tal-protezzjoni) tal-valur inizjali fi tmiem il-5 sena, mela l-kapital jitħallas kollu kemm hu.

119. Opzjonijiet call ta' pożizzjoni twila. Indiċi sottostanti EURO STOXX 50 (Ticker: SX5E), ATM.

Nozzjonali: ekwivalenti għall-valur tal-indiċi mmultiplikat b'EUR 1 000

Data ta' skadenza: Ġunju tas-Sena T

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

120. Opzjonijiet call ta' pożizzjoni twila. Indiċi sottostanti EURO STOXX 600 (Ticker: SXXP), ATM.

Nozzjonali: ekwivalenti għall-valur tal-indiċi mmultiplikat b'EUR 10 000

Data ta' skadenza: Ġunju tas-Sena T

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

121. Opzjonijiet call ta' pożizzjoni twila. VIX (CBOE) sottostanti, ATM.

Nozzjonali: ekwivalenti għall-valur tal-indiċi mmultiplikat b'USD 100 000

Data ta' skadenza: Ġunju tas-Sena T

Munita tal-istrument tal-EBA: USD

**IR**

201. Swap ta' rata tal-imgħax (IRS, interest-rate swap) għal 5 snin f'EUR – tirċievi b'rata fissa u tħallas b'rata varjabbli.

Parti fissa: tirċievi kull sena

Rata varjabbli: EURIBOR ta' 6 xhur, tħallas kull sitt xhur. Għadd ta' jiem: ATT/360

Nozzjonali: EUR 10 000 000

Konvenzjoni tar-riskedar tad-dati u l-kalendarju: standard

Id-data effettiva bħala d-data ta' reġistrazzjoni (jiġifieri r-rati li għandhom jintużaw jkunu dawk f'għeluq is-suq fid-data ta' reġistrazzjoni)

Maturità: Settembru tas-Sena T+4.

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

202. Swapzjoni ta' sentejn f'EUR għal IRS għal 5 snin f'EUR – tħallas b'rata fissa u tirċievi b'rata varjabbli.

Nozzjonali: EUR 10 000 000.

L-istituzzjoni hija l-bejjiegħ tal-opzjoni fuq l-iswap. Il-kontroparti tal-istituzzjoni tixtri d-dritt li ddaħħal swap mal-istituzzjoni; jekk il-kontroparti teżerċita d-dritt tagħha, il-kontroparti għandha tirċievi b'rata fissa filwaqt li l-istituzzjoni tirċievi b'rata varjabbli.

Swapzjoni b'maturità ta' sentejn (Data ta' reġistrazzjoni + sentejn (2)) fuq l-IRS definita kif ġej: Parti fissa - tħallas kull sena; Rata varjabbli: EURIBOR ta' 6 xhur, tirċievi kull sitt xhur; Nozzjonali: EUR 10 000 000; Konvenzjoni tar-riskedar tad-dati u l-kalendarju: standard; Data effettiva tal-iswap sottostanti: Data ta' reġistrazzjoni + sentejn (2).

Maturità tal-iswap sottostanti: Data ta' reġistrazzjoni + 7 snin.

Primjum imħallas fid-data ta' reġistrazzjoni (Data ta' reġistrazzjoni). Flus saldati

Il-prezz tal-eżerċitar huwa bbażat fuq ir-rata tal-ATM tal-iswap forward starting definita f'dan l-istrument

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

203. IRS għal 5 snin f'USD. Tirċievi b'rata fissa u tħallas b'rata varjabbli.

Rata fissa: tirċievi kull sena

Rata varjabbli: Rata SOFR f'USD fuq 3 xhur, tħallas kull tliet xhur

Nozzjonali: USD 1 000 000

Konvenzjoni tar-riskedar tad-dati u l-kalendarju: standard

Id-data effettiva bħala d-data ta' reġistrazzjoni (jiġifieri r-rati li għandhom jintużaw jkunu dawk f'għeluq is-suq fid-data ta' reġistrazzjoni)

Data ta' maturità: Settembru tas-Sena T+4.

Munita tal-istrument tal-EBA: USD

204. IRS għal sentejn f'GBP. Tirċievi b'rata fissa u tħallas b'rata varjabbli.

Rata fissa: tirċievi kull sena

Rata varjabbli: Ir-rata SONIA (mil-lum għall-għada) komposta u mħallsa kull 3 xhur. Għadd ta' jiem: ATT/365

Nozzjonali: GBP 10 000 000

Konvenzjoni tar-riskedar tad-dati u l-kalendarju: standard

Id-data effettiva bħala d-data ta' reġistrazzjoni (jiġifieri r-rati li għandhom jintużaw jkunu dawk f'għeluq is-suq fid-data ta' reġistrazzjoni)

Maturità: Data ta' reġistrazzjoni + sentejn.

Munita tal-istrument tal-EBA GBP

205. Nota b'rata varjabbli ta' 10 snin collared mibjugħa minn UBS.

Ammont Nozzjonali (Kapital): USD 1 000 000.

Noti b'rata varjabbli (in-"Noti") huma obbligi prijoritarji mhux garantiti ta' UBS AG ("UBS").

Munita tal-istrument EBA USD

— In-noti għandu jkollhom imgħax b'rata annwali ta' SOFR ta' 3 xhur f'USD flimkien ma' 1,5 % fis-sena (ir-"Rata tal-Imgħax Varjabbli"), soġġetti għal rata tal-imgħax massima ta' 7,5 % fis-sena (il-"Limitu Massimu tar-Rata tal-Imgħax") u rata tal-imgħax minima ta' 2,5 % fis-sena (il-"Limitu Minimu tar-Rata tal-Imgħax").

— Kwalunkwe pagament fuq in-Noti, inkluż l-imgħax u l-kapital fil-maturità, għandu jkun soġġett għall-affidabbiltà kreditizja tal-UBS AG. L-istituzzjonijiet huma mitluba jużaw kurva ta' skontar xierqa, li għandhom jiġġustifikawha fin-nota ta' spjegazzjoni.

— Dħul: In-Noti jagħtu mgħax fuq bażi trimestrali b'rata li hija daqs ir-Rata tal-Imgħax Varjabbli, dment li jekk fi kwalunkwe Data tad-Determinazzjoni tal-Kupun (i) ir-Rata tal-Imgħax Varjabbli tkun inqas mil-Limitu Minimu tar-Rata tal-Imgħax, mela r-rata tal-imgħax applikabbli għall-Perjodu tal-Imgħax relatat tkun ugwali għal-Limitu Minimu tar-Rata tal-Imgħax, jew (ii) ir-Rata tal-Imgħax Varjabbli tkun akbar mil-Limitu Massimu tar-Rata tal-Imgħax, mela r-rata tal-imgħax applikabbli għall-perjodu tal-imgħax relatat tkun daqs il-Limitu Massimu tar-Rata tal-Imgħax.

| | |
|---|---|
| Ammont tal-Pagament tal-Imgħax | L-ammont tal-imgħax li għandu jitħallas fuq in-Noti għal Perjodu tal-Imgħax għandu jkun daqs il-prodott ta' (a) l-ammont ta' kapital tan-Noti, (b) ir-Rata tal-Imgħax Applikabbli għal dak il-Perjodu tal-Imgħax u (c) frazzjoni, li n-numeratur tagħha jkun l-għadd ta' jiem fil-Perjodu tal-Imgħax (ikkalkulat abbażi ta' sena ta' 360 jum bi tnax-il xahar ta' 30 jum) u li d-denominatur tagħha jkun 360. |
| Data tan-Negozjar u tas-Saldu | "Data ta' reġistrazzjoni" |
| Data tal-Pagament tal-Imgħax | Kull trimestru, fid-Data ta' reġistrazzjoni +3 xhur, fid-Data ta' reġistrazzjoni +6 xhur, fid-Data ta' reġistrazzjoni + 9 xhur u fid-Data ta' reġistrazzjoni + sena (1), li jibdew mid-Data ta' reġistrazzjoni + 3 xhur, tul ħajjet in-Noti (soġġetti għall-aġġustamenti, kif deskritt hawnhekk). |
| Data ta' Maturità | Data ta' reġistrazzjoni + 10 snin. |
| Munita | USD |
| Bażi tal-għadd tal-jiem | 30/360 |
| Konvenzjoni dwar il-Ġurnata tax-Xogħol | Sussegwentement Mingħajr Aġġustamenti |
| Determinazzjoni tal-Kupun | Għal kull Perjodu tal-Imgħax, it-tieni jum ta' ftuħ il-banek f'Londra li tkun immedjatament qabel id-data tal-imgħax rilevanti. |
| Data | "Jum ta' ftuħ il-banek f'Londra" tfisser kwalunkwe jum li fih il-banek kummerċjali jkunu miftuħin għan-negozju ġenerali (inkluż il-kummerċ f'muniti barranin u f'depożiti ta' munita barranija) f'Londra u li fih jitwettqu tranżazzjonijiet f'dollari Amerikani fis-suq interbankarju ta' Londra. |

206. Pożizzjoni twila tal-GVERN tal-ĠERMANJA (Inflazzjoni) EUR 1 000 000 (ISIN DE0001030583).

Maturità: il-15 ta' April 2033

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

207. Pożizzjoni qasira tal-GVERN tal-ĠERMANJA ta' EUR 1 000 000 (ISIN DE0001030708).

Maturità: il-15 ta' Awwissu 2030

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

208. Pożizzjoni twila tal-GVERN tal-ITALJA (Inflazzjoni) EUR 1 000 000 (ISIN IT0005138828).

Maturità: il-15 ta' Settembru 2032

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

209. Pożizzjoni twila tal-GVERN tal-ITALJA ta' EUR 1 000 000 (ISIN IT0005340929).

Maturità: l-1 ra' Diċembru 2028

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

210. Pożizzjoni twila tal-GVERN ta' SPANJA ta' EUR 1 000 000 (ISIN ES00000127A2).

Maturità: it-30 ta' Lulju 2030

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

211. Pożizzjoni qasira tal-GVERN ta' FRANZA ta' EUR 1 000 000 (ISIN FR0012993103).

Maturità: il-25 ta' Mejju 2031

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

212. Pożizzjoni qasira tal-GVERN tal-ĠERMANJA ta' EUR 1 000 000 (ISIN DE0001135176).

Maturità: it-4 ta' Jannar 2031

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

213. Pożizzjoni twila tal-GVERN tar-RENJU UNIT GBP 1 000 000 (ISIN GB0004893086).

Maturità: il-7 ta' Ġunju 2032

Munita tal-istrument tal-EBA: GBP

214. Pożizzjoni twila tal-GVERN tal-PORTUGALL EUR 1 000 000 (ISIN PTOTEXOE0024).

Maturità: il-15 ta' Ġunju 2029

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

215. Pożizzjoni qasira tal-GVERN TAL-ISTATI UNITI ta' USD 1 000 000 (ISIN US91282CAV37).

Maturità: il-15 ta' Novembru 2030

Munita tal-istrument EBA USD

216. Pożizzjoni twila tal-GVERN tal-BRAZIL (eżerċitabbli) ta' USD 1 000 000 (ISIN US105756BZ27).

Maturità: it-13 ta' Jannar 2028

Munita tal-istrument tal-EBA: USD

217. Pożizzjoni twila tal-GVERN tal-MESSIKU (eżerċitabbli) ta' USD 1 000 000 (ISIN US91087BAT70).

Maturità: id-19 ta' Mejju 2033

Munita tal-istrument EBA USD

218. Swap ta' rata tal-imgħax (IRS) għal 10 snin f'EURO – tirċievi b'rata varjabbli u tħallas b'rata fissa.

Parti fissa: tħallas kull sena

Rata varjabbli: EURIBOR ta' 3 xhur, tirċievi kull 3 xhur. Għadd ta' jiem: ATT/360

Nozzjonali: EUR 10 000 000

Konvenzjoni tar-riskedar tad-dati u l-kalendarju: standard

Data effettiva bħala d-data ta' reġistrazzjoni (jiġifieri r-rati li għandhom jintużaw huma dawk f'għeluq is-suq fid-data ta' reġistrazzjoni)

Maturità: Data ta' reġistrazzjoni + 10 snin.

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

219. Swap ta' rata tal-imgħax (IRS) għal 5 snin f'EURO – tirċievi b'rata varjabbli u tħallas b'rata fissa.

Parti fissa: tħallas kull sena

Rata varjabbli: EURIBOR ta' 6 xhur, tirċievi kull 6 xhur. Għadd ta' jiem: ATT/360

Nozzjonali: EUR 10 000 000

Konvenzjoni tar-riskedar tad-dati u l-kalendarju: standard

Data effettiva bħala d-data ta' reġistrazzjoni (jiġifieri r-rati li għandhom jintużaw huma dawk f'għeluq is-suq fid-data ta' reġistrazzjoni)

Maturità: Data ta' reġistrazzjoni + 5 snin.

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

220. SWAP tal-imgħax bejn il-muniti f'EUR/USD għal 5 snin bil-metodu ta' valwazzjoni skont is-suq (MtM, Mark to Market). Tirċievi f'USD u tħallas f'EUR.

EUR: ESTER ta' 3 xhur, ħlas kull 3 xhur kompost b'dewmien fil-pagament ta' jumejn (2). Għadd ta' jiem: ATT/360

USD: SOFR ta' 3 xhur, tirċievi kull 3 xhur kompost b'dewmien fil-pagament ta' jumejn (2). Għadd ta' jiem: ATT/360

Parti 1 – USD: Ammont nozzjonali ekwivalenti għal EUR 10 000 000 aġġustat fuq bażi trimestrali

Parti 2 – EUR: Nozzjonali EUR 10 000 000

Konvenzjoni tar-riskedar tad-dati u l-kalendarju: standard

Data effettiva bħala d-data ta' reġistrazzjoni + 6 xhur

Maturità: Data ta' reġistrazzjoni + 5.5 snin.

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

Ara wkoll it-Taqsima 6 ta' dan l-Anness – Speċifikazzjonijiet addizzjonali tal-Istrument

221. IRS għal 10 snin f'EURO – tirċievi b'ESTER u tħallas b'rata EURIBOR.

Komponent ESTER: tirċievi kull sena. Għadd ta' jiem: ATT/360

Komponent EURIBOR: EURIBOR + Bażi ta' 3 xhur, ħlas kull 3 xhur. Għadd ta' jiem: ATT/360

Nozzjonali: EUR 10 000 000

Konvenzjoni tar-riskedar tad-dati u l-kalendarju: standard

Id-data effettiva bħala d-data ta' reġistrazzjoni (jiġifieri r-rati li għandhom jintużaw jkunu dawk f'għeluq is-suq fid-data ta' reġistrazzjoni)

Maturità: Settembru tas-Sena T + 9 snin

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

222. Pożizzjoni twila tal-GVERN tal-ITALJA (Inflazzjoni) EUR 1 000 000 (ISIN IT0005387052).

Maturità: 15 ta' Mejju 2030

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

223. Swap ta' inflazzjoni b'kupun żero għal 5 snin f'EUR – tirċievi redditu marbut mal-inflazzjoni u tħallas b'rata fissa (r).

Indiċi tal-inflazzjoni: CPI (HICPxT)

Komponent fiss (Ħlas fiss):$[(1 + r)^5 - 1]$

Tirċievi redditu marbut mal-inflazzjoni: $\left[\left(\frac{CPI \text{ at the end (maturity) date}}{CPI \text{ at the start date}}\right) - 1\right]$

Nozzjonali: EUR 10 000 000

Data tal-iffissar tal-bażi: Ġunju tas-sena T-1

Iffissar finali: Awwissu tas-Sena T+4

Maturità: Settembru tas-sena T+4

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

224. Opzjonijiet fuq swaps ta' sentejn f'EUR għal swap tar-rata tal-imgħax (IRS) għal 5 snin f'EURO – tirċievi b'rata fissa u tħallas b'rata varjabbli.

Nozzjonali: EUR 10 000 000.

L-istituzzjoni hija l-bejjiegħ tal-opzjoni fuq l-iswap. Il-kontroparti tal-istituzzjoni tixtri d-dritt li ddaħħal swap mal-istituzzjoni; jekk il-kontroparti teżerċita d-dritt tagħha, il-kontroparti għandha tirċievi r-rata varjabbli filwaqt li l-istituzzjoni tirċievi r-rata fissa.

Swapzjoni b'maturità ta' sentejn (Data ta' reġistrazzjoni + sentejn (2)) fuq l-IRS definita kif ġej: Il-komponent fiss: tirċievi annwalment; Rata varjabbli: EURIBOR ta' sitt xhur, tħallas kull sitt xhur; Nozzjonali: EUR 10 000 000; Konvenzjoni tar-riskedar tad-dati u l-kalendarju: standard; Data effettiva tal-iswap sottostanti: Data ta' reġistrazzjoni + sentejn (2).

Maturità tal-iswap sottostanti: Data ta' reġistrazzjoni + 7 snin.

Primjum imħallas fid-data ta' reġistrazzjoni (Data ta' reġistrazzjoni). Flus saldati

Il-prezz tal-eżerċitar huwa bbażat fuq ir-rata tal-ATM tal-iswap forward starting definita f'dan l-istrument + 100 bps

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

**FX**

301. Kuntratt forward f'USD/EUR għal 6 xhur. Flus saldati. Pożizzjoni twila f'USD – pożizzjoni qasira f'EUR; Ammont nozzjonali ta' USD 10 000 000; Eżerċitar bil-quddiem: ugwali għal 100 % tar-rata ta' referenza spot rilevanti tal-BĊE fi tmiem id-data ta' reġistrazzjoni.

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

302. Kuntratt forward f'EUR/GBP għal 6 xhur. Flus saldati. Pożizzjoni twila f'EUR – pożizzjoni qasira f'GBP; GBP 10 000 000 nozzjonali; Eżerċitar bil-quddiem: ugwali għal 100 % tar-rata ta' referenza spot rilevanti tal-BĊE fi tmiem id-data ta' reġistrazzjoni.

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

303. Pożizzjoni twila fi flus USD 10 000 000.

Il-pożizzjoni tal-likwidità. Għandhom jitqiesu li għandhom riskju FX intrinsiku kif deskritt fil-paragrafu (kk)

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

304. Opzjoni call ta' pożizzjoni twila f'EUR/USD (pożizzjoni twila f'EUR, pożizzjoni qasira f'USD). Flus saldati. Nozzjonali: EUR 10 000 000. Ammont ekwivalenti bbażat fuq rata spot ta' referenza f'EUR/USD tal-BĊE, fl-aħħar tad-data ta' reġistrazzjoni.

Prezz tal-eżerċitar: 110 % tar-rata ta' referenza f'EUR/USD tal-BĊE, fl-aħħar tad-data ta' reġistrazzjoni

Data ta' skadenza: Data tar-reġistrazzjoni + sena (1)

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

305. Opzjoni call ta' pożizzjoni twila f'EUR/USD (pożizzjoni twila f'EUR, pożizzjoni qasira f'USD). Flus saldati. Nozzjonali: EUR 10 000 000. Ammont ekwivalenti bbażat fuq rata spot ta' referenza f'EUR/USD tal-BĊE, fl-aħħar tad-data ta' reġistrazzjoni.

Prezz tal-eżerċitar: 90 % tar-rata ta' referenza f'EUR/USD tal-BĊE, fl-aħħar tad-data ta' reġistrazzjoni

Data ta' skadenza: Data tar-reġistrazzjoni + sena (1)

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

306. Opzjoni call ta' pożizzjoni qasira f'EUR/USD (pożizzjoni qasira f'EUR, pożizzjoni twila f'USD). Flus saldati. Nozzjonali: EUR 10 000 000. Ammont ekwivalenti bbażat fuq rata spot ta' referenza f'EUR/USD tal-BĊE, fl-aħħar tad-data ta' reġistrazzjoni.

Prezz tal-eżerċitar: 100 % tar-rata ta' referenza f'EUR/USD tal-BĊE, fl-aħħar tad-data ta' reġistrazzjoni

Data ta' skadenza: Data tar-reġistrazzjoni + sena (1)

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

307. Opzjoni call ta' pożizzjoni qasira f'EUR/GBP (pożizzjoni qasira f'EUR, pożizzjoni twila f'GBP). Flus saldati. Nozzjonali: EUR 10 000 000. Ammont ekwivalenti bbażat fuq rata spot ta' referenza f'EUR/GBP tal-BĊE, fl-aħħar tad-data ta' reġistrazzjoni.

Prezz tal-eżerċitar: 110 % tar-rata ta' referenza f'EUR/GBP tal-BĊE, fl-aħħar tad-data ta' reġistrazzjoni

Data ta' skadenza: Data tar-reġistrazzjoni + sena (1)

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

308. Opzjoni put ta' pożizzjoni twila EUR/JPY (pożizzjoni qasira EUR, pożizzjoni twila JPY). Flus saldati. Nozzjonali: EUR 10 000 000. Ammont ekwivalenti bbażat fuq rata spot ta' referenza f'EUR/JPY tal-BĊE, fl-aħħar tad-data ta' reġistrazzjoni.

Prezz tal-eżerċitar: 110 % tar-rata ta' referenza f'EUR/JPY tal-BĊE, fl-aħħar tad-data ta' reġistrazzjoni

Data ta' skadenza: Data tar-reġistrazzjoni + sena (1)

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

309. Opzjoni put ta' pożizzjoni qasira EUR/AUD (pożizzjoni twila EUR, pożizzjoni qasira AUD). Flus saldati. Nozzjonali: EUR 10 000 000. Ammont ekwivalenti bbażat fuq rata spot ta' referenza f'EUR/AUD tal-BĊE, fl-aħħar tad-data ta' reġistrazzjoni.

Prezz tal-eżerċitar: 110 % tar-rata ta' referenza f'EUR/AUD tal-BĊE, fl-aħħar tad-data ta' reġistrazzjoni

Data ta' skadenza: Data tar-reġistrazzjoni + sena (1)

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

310. Kuntratt forward EUR/DKK ta' 6 xhur (pożizzjoni twila EUR, pożizzjoni qasira DKK). Flus saldati; Ammont nozzjonali ta' EUR 10 000 000; Rata spot ta' referenza f'EUR/DKK tal-BĊE fl-aħħar tad-data ta' reġistrazzjoni biex tiġi ddeterminata r-rata forward.

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

311. Kuntratt forward EUR/BRL mhux konsenjabbli ta' 6 xhur (pożizzjoni twila EUR, pożizzjoni qasira BRL); Ammont nozzjonali ta' EUR 10 000 000; Rata spot ta' referenza f'EUR/BRL tal-BĊE fl-aħħar tad-data ta' reġistrazzjoni biex tiġi ddeterminata r-rata forward.

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

**KOMODITAJIET**

401. Pożizzjoni twila forward ta' 6 xhur ta' 3 500 uqija troy tal-prezz tad-Deheb ġewwa Londra (pożizzjoni twila f'Deheb, pożizzjoni qasira f'USD). Flus Saldati. Prezz tal-eżerċitar: Prezz forward ta' 6 xhur fi tmiem il-jum fid-data ta' reġistrazzjoni

Munita tal-istrument tal-EBA: USD

402. Pożizzjoni qasira forward ta' 12-il xahar ta' 3 500 uqija troy tal-prezz tad-Deheb ġewwa Londra (pożizzjoni qasira f'Deheb, pożizzjoni twila f'USD). Flus Saldati. Prezz tal-eżerċitar: Prezz forward ta' 12 xhur fi tmiem il-jum fid-data ta' reġistrazzjoni

Munita tal-istrument tal-EBA: USD

403. Opzjoni call ta' pożizzjoni twila 30 000 bettija Żejt mhux maħdum Brent (pożizzjoni twila f'WTI, pożizzjoni qasira f'USD). Flus saldati. Prezz tal-eżerċitar: Prezz forward ta' 12-il xahar fi tmiem il-jum fid-data ta' reġistrazzjoni. Data ta' skadenza: Data ta' reġistrazzjoni + 6 xhur

Munita tal-istrument EBA USD

404. Opzjoni put ta' pożizzjoni qasira 30 000 bettija Żejt mhux maħdum Brent (pożizzjoni twila f'WTI, pożizzjoni qasira f'USD). Flus saldati. Prezz tal-eżerċitar: Prezz forward ta' 12-il xahar fi tmiem il-jum fid-data ta' reġistrazzjoni. Data ta' skadenza: Data ta' reġistrazzjoni + 6 xhur

Munita tal-istrument EBA USD

405. Opzjoni call ta' pożizzjoni twila 5 000 uqija troy tal-prezz tad-Deheb ġewwa Londra (pożizzjoni twila f'Deheb, pożizzjoni qasira f'USD). Flus saldati. Prezz tal-eżerċitar: Prezz forward ta' 18-il xahar fi tmiem il-jum fid-data ta' reġistrazzjoni. Data ta' skadenza: Data ta' reġistrazzjoni + 18-il xahar

Munita tal-istrument tal-EBA: USD

**FIRXA TA' KREDITU**

501. Pożizzjoni twila (jiġifieri x-xiri ta' protezzjoni) ta' USD 1 000 000 f'CDS fuq il-PORTUGALL.

Klawżola ta' ristrutturar: SĦIĦA

Munita tal-istrument tal-EBA: USD

502. Pożizzjoni twila (jiġifieri x-xiri ta' protezzjoni) ta' USD 1 000 000 f'CDS fuq l-ITALJA..

Klawżola ta' ristrutturar: SĦIĦA
Munita tal-istrument tal-EBA: USD

503. Pożizzjoni qasira (jiġifieri l-bejgħ ta' protezzjoni) ta' USD 1 000 000 f'CDS fuq SPANJA.

Klawżola ta' ristrutturar: SĦIĦA
Munita tal-istrument tal-EBA: USD

504. Pożizzjoni twila (jiġifieri x-xiri ta' protezzjoni) ta' USD 1 000 000 f'CDS fuq il-MESSIKU.

Klawżola ta' ristrutturar: SĦIĦA
Munita tal-istrument tal-EBA: USD

505. Pożizzjoni twila (jiġifieri x-xiri ta' protezzjoni) ta' USD 1 000 000 f'CDS fuq il-BRAŻIL.

Klawżola ta' ristrutturar: SĦIĦA
Munita tal-istrument tal-EBA: USD

506. Pożizzjoni twila (jiġifieri x-xiri ta' protezzjoni) ta' USD 1 000 000 f'CDS fuq ir-RENJU UNIT.

Klawżola ta' ristrutturar: SĦIĦA
Munita tal-istrument tal-EBA: USD

507. Pożizzjoni qasira (jiġifieri l-bejgħ ta' protezzjoni) ta' EUR 1 000 000 f'CDS fuq Telefonica (Ticker TEF SM).

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

508. Pożizzjoni twila (jiġifieri x-xiri ta' protezzjoni) ta' EUR 1 000 000 f'CDS fuq Telefonica (Ticker TEF SM).

Maturità: Diċembru tas-Sena T+2;
Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

509. Pożizzjoni qasira (jiġifieri l-bejgħ ta' protezzjoni) ta' EUR 1 000 000 f'CDS fuq Aviva (Ticker AV LN).

Sena tad-Definizzjonijiet tal-ISDA, 2003
Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

510. Pożizzjoni twila (jiġifieri x-xiri ta' protezzjoni) ta' EUR 1 000 000 f'CDS fuq Aviva (Ticker AV LN).

Sena tad-Definizzjonijiet tal-ISDA, 2003
Maturità: Diċembru tas-Sena T+2;
Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

511. Pożizzjoni qasira (jiġifieri l-bejgħ ta' protezzjoni) ta' EUR 1 000 000 f'CDS fuq Vodafone (Ticker VOD LN).

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

512. Pożizzjoni qasira (jiġifieri l-bejgħ ta' protezzjoni) ta' EUR 1 000 000 f'CDS fuq ENI SpA (Ticker ENI IM).

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

513. Pożizzjoni qasira (jiġifieri l-bejgħ ta' protezzjoni) ta' USD 1 000 000 f'CDS fuq Eli Lilly (Ticker LLY US).

Klawżola ta' ristrutturar: L-ebda ristrutturar (XR14)
Munita tal-istrument tal-EBA: USD

514. Pożizzjoni qasira (jiġifieri l-bejgħ ta' protezzjoni) ta' EUR 1 000 000 f'CDS fuq Unilever (Ticker UNA NA).

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

515. Pożizzjoni twila (jiġifieri x-xiri ta' protezzjoni) ta' EUR 1 000 000 f'CDS fuq Total SA (Ticker FP FP).

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

516. Pożizzjoni twila (jiġifieri x-xiri ta' protezzjoni) ta' EUR 1 000 000 f'CDS fuq il-Volkswagen Group (Ticker VOW GR).

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

517. Pożizzjoni twila fuq noti tal-gvern tat-TURKIJA ta' USD 1 000 000 (ISIN US900123CT57).

Maturità: is-26 ta' April 2029

Munita tal-istrument tal-EBA: USD

518. Pożizzjoni twila (jiġifieri x-xiri ta' protezzjoni) ta' USD 1 000 000 f'CDS fuq it-TURKIJA. Data effettiva bħala d-data ta' reġistrazzjoni;

Klawżola ta' ristrutturar: SĦIĦA

Munita tal-istrument tal-EBA: USD

519. Pożizzjoni twila ta' EUR 1 000 000 fuq in-Noti ta' Telefonica (ISIN XS1681521081).

Maturità: it-12 ta' Jannar 2028

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

520. Pożizzjoni twila ta' EUR 1 000 000 fuq in-Noti tal-Volkswagen Group (ISIN XS2234567233).

Maturità: 22 ta' Settembru 2028

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

521. Pożizzjoni qasira ta' EUR 1 000 000 fuq in-noti tal-Volkswagen Group (ISIN XS1167667283).

Maturità: 16 ta' Jannar 2030

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

522. Pożizzjoni twila ta' EUR 1 000 000 fuq in-Noti ta' Total SA (ISIN XS1856281834).

Maturità: il-11 ta' Lulju 2033

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

523. Pożizzjoni twila tal-GVERN tal-AWSTRIJA ta' EUR 1 000 000 (ISIN AT0000A04967).

Maturità: il-15 ta' Marzu 2037

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

524. Pożizzjoni twila (jiġifieri x-xiri ta' protezzjoni) ta' USD 1 000 000 f'CDS fuq l-AWSTRIJA.

Maturità: Ġunju tas-Sena T +15

Munita tal-istrument tal-EBA: USD

525. Pożizzjoni twila tan-NETHERLANDS ta' EUR 1 000 000 (ISIN NL0013552060).

Maturità: il-15 ta' Jannar 2040

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

526. Pożizzjoni twila (jiġifieri x-xiri ta' protezzjoni) ta' USD 1 000 000 f'CDS fuq in-NETHERLANDS.

Maturità: Ġunju tas-Sena T +20

Munita tal-istrument tal-EBA: USD

527. Pożizzjoni twila tal-GVERN tal-BELĠJU ta' EUR 1 000 000 (ISIN BE0000348574).

Maturità: it-22 ta' Ġunju 2050

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

528. Pożizzjoni twila (jiġifieri x-xiri ta' protezzjoni) ta' USD 1 000 000 CDS fuq il-BELĠJU.

Maturità: Ġunju tas-Sena T +30

Munita tal-istrument tal-EBA: USD

529. Pożizzjoni twila (ix-xiri ta' protezzjoni) ta' EUR 10 000 000 f'CDS fuq is-serje on-the-run tal-indiċi iTraxx Europe.

Maturità: Ġunju tas-Sena T +4

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

530. Opzjoni put ta' pożizzjoni qasira EUR 10 000 000. Is-serje on-the-run tal-indiċi iTraxx Europe sottostanti (l-istess strument bħal 529).

Prezz tal-eżerċitar: ATM

Data ta' skadenza: Data ta' reġistrazzjoni + 6 xhur

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

531. Pożizzjoni twila ta' AXA SA (eżerċitabbli) ta' EUR 1 000 000 (ISIN XS1799611642).

Maturità: it-28 ta' Mejju 2049

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

532. Pożizzjoni twila (eżerċitabbli) tal-Bond AT&T ta' USD 1 000 000 (ISIN US00206RFW79).

Maturità: il-15 ta' Awwissu 2037

Munita tal-istrument tal-EBA: USD

533. Pożizzjoni twila ta' BAYER AG (eżerċitabbli) ta' EUR 1 000 000 (ISIN XS2199266268).

Maturità: is-6 ta' Jannar 2030

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

534. Pożizzjoni twila (eżerċitabbli) tal-Bond ORANGE ta' EUR 1 000 000 (ISIN FR0013323870).

Maturità: l-20 ta' Marzu 2028

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

**CTP**

601. Pożizzjoni qasira (jiġifieri l-bejgħ ta' protezzjoni) fuq is-serje on-the-run tal-indiċi iTraxx Europe.

Punt ta' konnessjoni: 3 %

Punt ta' distakkament: 6 %

Nozzjonali: EUR 5 000 000

Maturità: 5 snin

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

602. Pożizzjoni twila (jiġifieri x-xiri ta' protezzjoni) ta' EUR 5 000 000 f'CDS fuq is-serje l-iktar riċenti on-the-run tal-indiċi iTraxx Europe.

Maturità: Ġunju tas-Sena T +4

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

Ammont nozzjonali aġġustat għall-iħħeġġjar sħiħ ta' CS01 ta' 601 mingħajr il-ħtieġa ta' ħħeġġjar mill-ġdid

603. Pożizzjoni twila (jiġifieri x-xiri ta' protezzjoni) fuq is-serje on-the-run tal-indiċi iTraxx Europe.

Punt ta' konnessjoni: 3 %

Punt ta' distakkament: 6 %

Nozzjonali: EUR 5 000 000

Maturità: 5 snin

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

604. Pożizzjoni qasira (jiġifieri l-bejgħ ta' protezzjoni) ta' EUR 5 000 000 f'CDS fuq is-serje l-iktar riċenti on-the-run tal-indiċi iTraxx Europe.

Maturità: Ġunju tas-Sena T +4

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

Ammont nozzjonali aġġustat għall-iħħeġġjar sħiħ ta' CS01 ta' 603 mingħajr il-ħtieġa ta' ħħeġġjar mill-ġdid

605. Pożizzjoni qasira (jiġifieri l-bejgħ ta' protezzjoni) fuq is-serje on-the-run tal-indiċi iTraxx Europe.

Punt ta' konnessjoni: 12 %

Punt ta' distakkament: 100 %

Nozzjonali: EUR 5 000 000

Maturità: 5 snin

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

606. Pożizzjoni twila (jiġifieri x-xiri ta' protezzjoni) ta' EUR 5 000 000 f'CDS fuq is-serje l-iktar riċenti on-the-run tal-indiċi iTraxx Europe.

Maturità: Ġunju tas-Sena T +4

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

Ammont nozzjonali aġġustat għall-iħħeġġjar sħiħ ta' CS01 ta' 605 mingħajr il-ħtieġa ta' ħħeġġjar mill-ġdid

607. Pożizzjoni twila (jiġifieri x-xiri ta' protezzjoni) fuq is-serje on-the-run tal-indiċi iTraxx Europe.

Punt ta' konnessjoni: 12 %

Punt ta' distakkament: 100 %

Nozzjonali: EUR 5 000 000

Maturità: 5 snin

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

608. Pożizzjoni qasira (jiġifieri l-bejgħ ta' protezzjoni) ta' EUR 5 000 000 f'CDS fuq is-serje l-iktar riċenti on-the-run tal-indiċi iTraxx Europe.

Maturità: Ġunju tas-Sena T +4

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

Ammont nozzjonali aġġustat għall-iħħeġġjar sħiħ ta' CS01 ta' 607 mingħajr il-ħtieġa ta' ħħeġġjar mill-ġdid

609. Pożizzjoni qasira (jiġifieri l-bejgħ ta' protezzjoni) fuq is-serje on-the-run tal-indiċi iTraxx Europe.

Punt ta' konnessjoni: 3 %

Punt ta' distakkament: 6 %

Nozzjonali: EUR 5 000 000

Maturità: 5 snin

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

Rata tal-irkupru: Rata fissa ta' 40%.

610. Pożizzjoni twila (jiġifieri x-xiri ta' protezzjoni) ta' EUR 5 000 000 f'CDS fuq is-serje l-iktar riċenti on-the-run tal-indiċi iTraxx Europe.

Maturità: Ġunju tas-Sena T +4

Munita tal-istrument tal-EBA: EUR

Ammont nozzjonali aġġustat għall-iħħeġġjar sħiħ ta' CS01 ta' 609 mingħajr il-ħtieġa ta' ħħeġġjar mill-ġdid

**Taqsima 3: Portafolli individwali - Strument uniku**

L-istituzzjonijiet għandhom jipprovdu l-miżuri tar-riskju meħtieġa, flimkien mal-valur attwali, tal-portafolli individwali li ġejjin:

| Portafoll | *Kombinazzjoni ta' strumenti:*<br>L-ewwel ċifra tirrappreżenta l-istrument (kif imsemmi fit-Taqsima 2 ta' dan l-Anness).<br>It-tieni ċifra tirrappreżenta l-kwantità ta' kull strument jew l-għadd ta' kuntratti, kif applikabbli. | Munita tal-portafoll tal-EBA | Il-miżuri tar-riskju meħtieġa |
|---|---|---|---|
| 1001 | 101 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 1002 | 102– strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 1003 | 103 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 1004 | 104 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 1005 | 105– strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 1006 | 106 – strument 1 | GBP | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 1007 | 107 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 1008 | 108 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 1009 | 109 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 1010 | 110 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 1011 | 111 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 1012 | 112 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 1013 | 113 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 1014 | 114 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 1015 | 115 – strument 1 | GBP | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 1016 | 116 – strument 1 | GBP | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 1017 | 117 – strument 1 | JPY | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 1018 | 118 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 1019 | 119 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 1020 | 120 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 1021 | 121 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 2001 | 201 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 2002 | 202 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 2003 | 203 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 2004 | 204 – strument 1 | GBP | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 2005 | 205 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 2006 | 206 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 2007 | 207 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 2008 | 208– strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 2009 | 209 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 2010 | 210 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 2011 | 211 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 2012 | 212 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 2013 | 213 – strument 1 | GBP | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 2014 | 214 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 2015 | 215 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 2016 | 216 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 2017 | 217 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 2018 | 218 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 2019 | 219 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 2020 | 220 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 2021 | 221 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 2022 | 222 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 2023 | 223 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 2024 | 224 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 3001 | 301 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 3002 | 302 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 3003 | 303 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 3004 | 304 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 3005 | 305 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 3006 | 306 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 3007 | 307 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 3008 | 308 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 3009 | 309 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 3010 | 310 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 3011 | 311 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 4001 | 401 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 4002 | 402 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 4003 | 403 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 4004 | 404 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 4005 | 405 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 5001 | 501 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5002 | 502 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5003 | 503 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5004 | 504 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5005 | 505 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5006 | 506 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5007 | 507 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 5008 | 508 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5009 | 509 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5010 | 510 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5011 | 511 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5012 | 512 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5013 | 513 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5014 | 514 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5015 | 515 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5016 | 516 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5017 | 517 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5018 | 518 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5019 | 519 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5020 | 520 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5021 | 521 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5022 | 522 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5023 | 523 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5024 | 524 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5025 | 525 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5026 | 526 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5027 | 527 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5028 | 528 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5029 | 529 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5030 | 530 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5031 | 531 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5032 | 532 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 5033 | 533 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5034 | 534 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 6001 | 601 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; APR; SBM; DRC; RRAO |
| 6002 | 602 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; APR; SBM; DRC; RRAO |
| 6003 | 603 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; APR; SBM; DRC; RRAO |
| 6004 | 604 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; APR; SBM; DRC; RRAO |
| 6005 | 605 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; APR; SBM; DRC; RRAO |
| 6006 | 606 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; APR; SBM; DRC; RRAO |
| 6007 | 607 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; APR; SBM; DRC; RRAO |
| 6008 | 608 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; APR; SBM; DRC; RRAO |
| 6009 | 609 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; APR; SBM; DRC; RRAO |
| 6010 | 610 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; APR; SBM; DRC; RRAO |

**Taqsima 4: Portafolli individwali - Multi strumenti**

L-istituzzjonijiet għandhom jipprovdu l-miżuri tar-riskju meħtieġa, flimkien mal-valur attwali, tal-portafolli individwali li ġejjin:

| Portafoll | *Kombinazzjoni ta' strumenti:*<br>L-ewwel ċifra tirrappreżenta l-istrument (kif imsemmi fit-Taqsima 2 ta' dan l-Anness).<br>It-tieni ċifra tirrappreżenta l-kwantità ta' kull strument jew l-għadd ta' kuntratti, kif applikabbli. | Munita tal-portafoll tal-EBA | Il-miżuri tar-riskju meħtieġa |
|---|---|---|---|
| 1101 | 103 – strument 1<br>104 – strument 1<br>105 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 1102 | 113 – strument 1<br>110 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 1103 | 115 – strument 1<br>116 – strument 1 | GBP | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 1104 | 109 – strument 1<br>110 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 1105 | 111 – strument 1<br>112 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 1106 | 102 – strument 1<br>114 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 1107 | 106 – strument 1<br>107 – strument 1<br>108 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 1108 | 101 – strument 1<br>103 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 1109 | 101 – strument 1<br>103 – strument 1<br>104 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 1110 | 102– strument 1<br>104 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 2201 | 206 – strument 1<br>207 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 2202 | 206 – strument 1<br>207 – strument 1<br>208 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 2203 | 206 – strument 1<br>207 – strument 1<br>208 – strument 1<br>209 – strument 1<br>210 – strument 1<br>211 – strument 1<br>212 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 2204 | 201 – strument 1<br>218 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 2205 | 201 – strument 1<br>219 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 2206 | 218 – strument 1<br>219 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 2207 | 201 – strument 1<br>202 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 2208 | 215 – strument 1<br>216 – strument 1<br>217 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 2209 | 203 – strument 1<br>215 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 2210 | 208 – strument 1<br>209 – strument 1<br>210 – strument 1<br>214 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 2211 | 209 – strument 1<br>219 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 2212 | 201 – strument 1<br>223 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 3301 | 301 – strument 1<br>302 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 3302 | 303 – strument 1<br>304 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 3303 | 304 – strument 1<br>305 – strument 1<br>306 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 3304 | 307 – strument 1<br>308 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 4401 | 401 – strument 1<br>402 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 4402 | 403 – strument 1<br>404 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 4403 | 401 – strument 1<br>404 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 5501 | 501 – strument 1<br>502 – strument 1<br>503 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5502 | 504 – strument 1<br>505 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5503 | 507 – strument 1<br>508 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5504 | 503 – strument 1<br>504 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5505 | 509 – strument 1<br>510 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5506 | 511 – strument 1<br>512 – strument 1<br>514 – strument 1<br>515 – strument 1<br>516 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 5507 | 517 – strument 1<br>518 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5508 | 519 – strument 1<br>520 – strument 1<br>522 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5509 | 520 – strument 1<br>521 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5510 | 519 – strument 1<br>508 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5511 | 515 – strument 1<br>522 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5512 | 520 – strument 1<br>521 – strument 1<br>516 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5513 | 506 – strument 1<br>503 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5514 | 502 – strument 1<br>209 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5515 | 504 – strument 1<br>217 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5516 | 505 – strument 1<br>216 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5517 | 504 – strument 1<br>217 – strument 1<br>505 – strument 1<br>216 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5518 | 502 – strument 1<br>209 – strument 1<br>219 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5519 | 523 – strument 1<br>525 – strument 1<br>527 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5520 | 524 – strument 1<br>526 – strument 1<br>528 – strument 1 | USD | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 5521 | 523 – strument 1<br>524 – strument 1<br>525 – strument 1<br>526 – strument 1<br>527 – strument 1<br>528 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 5522 | 529 – strument 1<br>530 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 6601 | 601 – strument 1<br>602 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; APR; SBM; DRC; RRAO |
| 6602 | 603 – strument 1<br>604 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; APR; SBM; DRC; RRAO |
| 6603 | 605 – strument 1<br>606 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; APR; SBM; DRC; RRAO |
| 6604 | 607 – strument 1<br>608 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; APR; SBM; DRC; RRAO |
| 6605 | 609 – strument 1<br>610 – strument 1 | EUR | VaR; VaR taħt stress; APR; SBM; DRC; RRAO |

**Taqsima 5: Portafolli aggregati**

L-istituzzjonijiet għandhom jipprovdu l-miżuri tar-riskju meħtieġa, flimkien mal-valur attwali, tal-portafolli aggregati finanzjarji li ġejjin:

| Aggreg. Portafoll | Deskrizzjoni | *Kombinazzjoni ta' Portafolli Individwali* (portafolli individwali kif iddikjarat min-numri tagħhom kif imsemmi fit-Taqsimiet 3 u 4 ta' dan l-Anness) | Munita tal-portafoll tal-EBA | Il-miżuri tar-riskju meħtieġa |
|---|---|---|---|---|
| 10000 | Ebda CTP ALL-IN | 1001, 1101, 1104, 1106, 2001, 2002, 2203, 2206, 3301, 3303, 3304, 4401, 4402, 5503, 5506, 5508, 5521 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 11000 | Ekwità KUMULATTIVA | 1001, 1101, 1104, 1106 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 12000 | IR Kumulattiv | 2001, 2002, 2203, 2206 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 13000 | FX Kumulattiv | 3301, 3303, 3304 | EUR | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 14000 | Komodità Kumulattiva | 4401, 4402 | USD | VaR; VaR taħt stress; SBM; DRC; RRAO |
| 15000 | Firxa ta' Kreditu kumulattiva | 5503, 5506, 5508, 5521 | EUR | VaR; VaR taħt stress; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 16000 | CTP kumulattiva EUR | 6601, 6602 | EUR | VaR; VaR taħt stress; APR; SBM; DRC; RRAO |

**Taqsima 6: Speċifikazzjonijiet addizzjonali għall-istrumenti**

L-istituzzjonijiet għandhom japplikaw l-ispeċifikazzjonijiet addizzjonali li ġejjin għall-istrumenti finanzjarji deskritti fit-Taqsima 2 ta' dan l-Anness:

| | |
|---|---|
| j. Strument: | k. 220 |
| l. Deskrizzjoni: | m. SWAP tal-imgħax bejn il-muniti f'EUR/USD għal 5 snin bil-metodu ta' valwazzjoni skont is-suq (MtM).<br>n. Tirċievi f'USD u tħallas f'EUR<br>o. Nozzjonali: EUR 10 000 000, USD (EUR 10 000 000 * FX USD/EUR) |
| p. Ħlas: | q. Komponent varjabbli 2 |
| r. Tirċievi: | s. Komponent varjabbli 1 |
| t. Skambju nozzjonali u risettjar: | u. Fid-data effettiva u d-data tal-maturità. Barra minn hekk, f'kull data tal-pagament tal-kupun, isir pagament addizzjonali li jikkorrispondi għall-aġġustament tal-ammont nozzjonali f'USD fuq il-komponent varjabbli 2. L-ammont nozzjonali f'USD huwa aġġustat biex ikun ugwali għal EUR 10 000 000, bir-rata spot, jumejn (2) ta' negozju qabel kull data tal-iżborż. |
| v. Bilanċ ta' flus kontanti | w. Inklużi |
| *x. Komponent varjabbli 1* | |
| y. Nozzjonali: | z. L-ekwivalenti ta' EUR 10 000 000 konvertiti f'USD bir-rata spot fid-data effettiva, l-ekwivalenti aġġustat fuq bażi trimestrali |
| aa. Data Effettiva: | bb. Data ta' reġistrazzjoni + 6 xhur |
| cc. Data ta' Maturità: | dd. Data ta' reġistrazzjoni + 5.5 snin. |
| ee. Determinazzjoni tad-data tal-pagament: | ff. 'Il quddiem mid-Data Effettiva |
| gg. Frekwenza tal-Pagament tal-Kupuni: | hh. Trimestrali |
| ii. Rata tal-Kupun: | jj. SOFR ta' 3 xhur + 0bps. |
| kk. Risettjar tal-Frek. tar-Rata tal-Kupuni: | ll. Trimestrali |
| mm. Konvenzjoni dwar l-iffissar tar-rata tal-kupun: | nn. Kompost kuljum matul il-perjodu ta' 3 xhur |
| oo. Frekwenza tal-kombinament tar-rata tal-kupun: | pp. Mgħax sempliċi |
| qq. Għadd ta' Jiem: | rr. ATT/360 |
| ss. Jum tan-Negozju tal-Iżborż: | tt. LON, NYC, TARGET |
| uu. Konvenzjoni dwar il-Ġurnata tax-Xogħol tal-Iżborż: | vv. Immodifikat wara |
| ww. Jum tan-Negozju għar-Risettjar tal-Ammont Nozzjonali: | xx. LON, NYC, TARGET |
| yy. Konvenzjoni tal-Ġurnata tax-Xogħol għar-Risettjar tal-Ammont Nozzjonali: | zz. Preċedenti |
| aaa. Jum tan-Negozju għar-Risettjar tar-Rata tal-Kupun: | bbb. LON, NYC, TARGET |
| ccc. Konvenzjoni tal-Ġurnata tax-Xogħol għar-Risettjar tar-Rata tal-Kupun: | ddd. Preċedenti |
| | |

| | |
|---|---|
| *eee. Komponent varjabbli 2* | |
| fff. Nozzjonali: | ggg. EUR 10 000 000 |
| hhh. Data Effettiva: | iii. Data ta' reġistrazzjoni + 6 xhur |
| jjj. Data ta' Maturità: | kkk. Data ta' reġistrazzjoni + 5.5 snin. |
| lll. Determinazzjoni tad-data tal-pagament: | mmm. 'Il quddiem mid-Data Effettiva |
| nnn. Frekwenza tal-Pagament tal-Kupuni: | ooo. Trimestrali |
| ppp. Rata tal-Kupun: | qqq. ESTER ta' 3 xhur + 0 bps. |
| rrr. Frekwenza tar-Risettjar tar-Rata tal-Kupuni: | sss. Trimestrali |
| ttt. Konvenzjoni dwar l-iffissar tar-rata tal-kupun: | uuu. Kompost kuljum matul il-perjodu ta' 3 xhur |
| vvv. Frekwenza tal-kombinament tar-rata tal-kupun: | www. Mgħax sempliċi |
| xxx. Għadd ta' Jiem: | yyy. ATT/360 |
| zzz. Jum tan-Negozju tal-Iżborż: | aaaa. LON, NYC, TARGET |
| bbbb. Jum tan-Negozju tal-Iżborż | cccc. Immodifikat wara |
| dddd. Jum tan-Negozju għar-Risettjar tal-Ammont Nozzjonali: | eeee. LON, NYC, TARGET |
| ffff. Konvenzjoni tal-Ġurnata tax-Xogħol għar-Risettjar tal-Ammont Nozzjonali: | gggg. Preċedenti |
| hhhh. Jum tan-Negozju għar-Risettjar tar-Rata tal-Kupun: | iiii. LON, NYC, TARGET |
| jjjj. Konvenzjoni tal-Ġurnata tax-Xogħol għar-Risettjar tar-Rata tal-Kupun: | kkkk. Preċedenti" |

**Taqsima 7: Portafolli ta' validazzjoni tal-SBM**

(a) L-istituzzjonijiet għandhom jipprovdu l-kejl tar-riskju tal-SBM tal-portafolli definiti fl-Anness X (portafolli ta' validazzjoni tal-SBM) bħala parti mis-sottomissjoni tal-IMV u jissottomettuhom f'konformità mad-dati ta' rapportar tas-sottomissjoni tal-IMV.

(b) Dan li ġej għandu japplika għas-sottomissjoni tar-riżultati li jikkorrispondu għall-portafolli ta' validazzjoni tal-SBM:

i. L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw biss il-mudell C120.02 u jillimitaw ir-rapportar f'din il-mudell għar-riżultati tal-munita tar-rapportar (jiġifieri l-kolonna 0060 tal-mudell C120.02 ma għandhiex timtela u l-mudelli C 106.00 u C 106.01 ma għandhomx jiġu rrapportati għall-portafolli ta' validazzjoni tal-SBM);

ii. L-istituzzjonijiet għandhom jassumu li s-sensittivitajiet għar-riskju u l-pożizzjonijiet tar-riskju ta' kurvatura definiti mill-istrumenti speċifikati fl-Anness X huma espressi fil-munita tar-rapportar tal-istituzzjoni u li l-informazzjoni hija pprovduta fil-format speċifikat fl-istruzzjonijiet ta' rapportar għall-mudelli C 106.01/C 120.01 u fit-tabella korrispondenti bi gwida għar-rapportar ta' dawn il-mudelli fl-Anness VI (Struzzjonijiet tal-mudell)."

*ANNESS III*

*"ANNESS VI*

**RIŻULTATI TAL-PORTAFOLLI TA' PARAMETRAĠĠ REFERENZJARJU SUPERVIŻORJU**

**STRUZZJONIJIET RELATATI MAL-MUDELL**

C 106.00 – Valwazzjoni tas-Suq Inizjali u ġustifikazzjoni għall-esklużjoni .....57
C 106.01 – SBM. Sensittivitajiet għar-riskju skont l-Istrument .....57
C 107.01 – VaR & sVaR Mhux CTP. Dettalji. .....61
C 107.02 – VaR, sVaR u PV - Mhux CTP. Ir-riżultati tal-munita tal-portafoll tal-EBA. .....63
C 108.00 – Serje Kronoloġika tal-Profitt u t-Telf .....64
C 109.01 – IRC. Dettalji tal-Mudell .....65
C 109.02 – IRC. Dettalji skont il-Portafoll .....65
C 109.03 – IRC. Ammont skont il-Portafoll/Data. .....66
C 110.01 – CT. Dettalji tal-Mudell. .....67
C 110.02 – CT. Dettalji skont il-Portafoll. .....68
C 110.03 – CT. APR skont il-Portafoll/id-Data .....69
C 120.01 - SBM. SENSITTIVITAJIET GĦAR-RISKJU SKONT L-ISTRUMENT/PORTAFOLL .....69
C 120.02 – SBM. KOMPOŻIZZJONI TAL-OFR SKONT IL-PORTAFOLL .....72
C 120.04 – DRC. VALURI TAS-SUQ U AMMONTI GROSSI TA' JTD SKONT L-ISTRUMENT/PORTAFOLL .....74
C 120.05 – DRC. KOMPOŻIZZJONI TAL-OFR SKONT IL-PORTAFOLL .....80
C 120.06 – ASA. OFR .....82

**STRUZZJONIJIET RELATATI MAL-MUDELL**

**C 106.00 — Valwazzjoni tas-Suq Inizjali u ġustifikazzjoni għall-esklużjoni**

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0010 | Numru tal-istrument | Taqsima 2 tal-Anness V | Għandu jiġi rrapportat in-numru tal-istrument meħud mill-Anness V. |
| 0020 | Strument immudellat għal VaR (Value at Risk) u għal sVaR (Stressed Value at Risk) (VERU/FALZ) | | Għandu jiġi rrapportat VERU jew FALZ. |
| 0030 | Strument immudellat għal IRC (VERU/FALZ) | | Għandu jiġi rrapportat VERU jew FALZ. |
| 0040 | Strument immudellat għal negozjar ta' korrelaz-zjoni (VERU/FALZ) | | Għandu jiġi rrapportat VERU jew FALZ. |
| 0050 | Raġunament għall-esklużjoni | Artikolu 3(2) | Għandha tiġi rrapportata waħda mill-possibilitajiet li ġejjin:<br>(a) Il-mudell mhuwiex awtorizzat mir-regolatur;<br>(b) L-istrument jew l-assi sottostanti mhumiex awtorizzati internament;<br>(c) L-assi sottostanti jew il-karatteristika għall-mudelli mhumiex ikkunsidrati internament;<br>(d) Raġunament ieħor għall-esklużjoni. Spjega dak ir-raġunament fil-kolonna 0060. |
| 0060 | Kaxxa għat-test liberu | | Istituzzjoni tista' tagħti kwalunkwe informazzjoni addizzjonali f'din il-kolonna. |
| 0070 | Valwazzjoni tas-Suq Inizjali ("IMV") | | Il-valur tal-valwazzjoni skont is-suq ta' kull strument fid-data ta' referenza, fil-5:30 pm CET (kif imsemmi fit-Taqsima 1, il-punt (b), tal-Anness V.<br>Din il-kaxxa għandha titħalla vojta meta l-istituzzjoni ma tixtieqx tipprovdi l-IMV għal portafoll partikolari (jiġifieri l-valuri żero għandhom jiġu rrapportati biss meta r-riżultat tal-kalkolu jkun żero). |

**C 106.01 – SBM. Sensittivitajiet għar-riskju skont l-Istrument**

L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw is-sensittivitajiet lejn il-fatturi ta' riskju li l-istrument ikun espost għalihom. Għandha tiġi rrapportata ringiela waħda għal kull fattur ta' riskju/sensittività għar-riskju. Ir-riskju 'l fuq għall-pożizzjonijiet ta' kurvatura nnettjat ta' dak il-fattur ta' riskju (CVRk+) jew ir-riskju 'l isfel għall-pożizzjonijiet ta' kurvatura nnettjat ta' dak il-fattur ta' riskju (CVRk-) kif speċifikat fl-Artikolu 325g tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 għandhom jiġu rrapportati f'ringieli individwali. Il-valuri kollha għandhom jirreferu għad-"data ta' referenza tal-IMV (u tal-SBM inizjali)" kif speċifikat fit-Taqsima 1, il-punt (b)(ii), tal-Anness V ta' dan ir-Regolament. L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw kull kombinament ta' Numru tal-istrument, Identifikatur tar-riskju (il-kolonna 0010), Bucket (il-kolonna 0020) u Identifikatur addizzjonali (il-kolonna 0030) darba biss.

Struzzjonijiet rigward il-folji (sheets) (assi-z)

| Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|
| Numru tal-istrument | It-Taqsima 2 tal-Anness V | Għandu jiġi rrapportat in-numru tal-istrument meħud mill-Anness V. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0010 | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | L-Artikoli 325l, 325m, 325n, 325o, 325p u 325q tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Għandu jiġi rrapportat l-identifikatur tal-fattur ta' riskju kif speċifikat fit-tabella fl-aħħar ta' dan l-Anness. |
| 0020 | Bucket | L-Artikolu 325d(3) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Il-bucket għandu jiġi rapportat meta l-identifikatur tal-fattur ta' riskju magħżul fil-kolonna 0010 jikkorrispondi għall-klassi ta' riskju:<br>— Riskju ġenerali taċ-ċaqliq fir-rata tal-imgħax, it-tweġiba għandha tkun l-isem tal-munita tar-rata rilevanti mingħajr riskju, tal-inflazzjoni jew tal-fattur ta' riskju bażi ta' bejn il-muniti (skont id-dežinjazzjoni tal-munita ISO 4217, eż. "EUR").<br>— Riskju ta' firxiet tal-kreditu għal nontitolizzazzjoni, it-tweġiba għandha tkun in-numru tal-bucket fl-Artikolu 325ah (1), Tabella 4, tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.<br>— Riskju ta' firxiet tal-kreditu għal titolizzazzjoni mhux inkluża fil-portafoll kummerċjali ta' korrelazzjoni alternattiv (CSR mhux ACTP, credit spread risk for securitisation not included in the alternative correlation trading portfolio), it-tweġiba għandha tkun in-numru tal-bucket fl-Artikolu 325am (1), Tabella 7, ta' dak ir-Regolament.<br>— Riskju ta' firxiet tal-kreditu għal titolizzazzjoni inkluża fil-portafoll kummerċjali ta' korrelazzjoni alternattiv (CSR ACTP, credit spread risk for securitisation included in the alternative correlation trading portfolio), it-tweġiba għandha tkun in-numru tal-bucket fl-Artikolu 325ak, it-Tabella 6, ta' dak ir-Regolament.<br>— Riskju ta' ekwità, it-tweġiba għandha tkun in-numru tal-bucket fl-Artikolu 325ap (1), it-Tabella 8, ta' dak ir-Regolament.<br>— Riskju tal-komoditajiet, it-tweġiba għandha tkun in-numru tal-bucket fl-Artikolu 325as, it-Tabella 9, ta' dak ir-Regolament.<br>— Riskju FX u l-komponenti Delta jew Kurvatura, it-tweġiba għandha tkun l-isem tal-munita (eż. "USD", il-kodiċijiet tal-munita rrapportati għandhom isegwu d-dežinjazzjoni tal-munita ISO 4217).<br>— Riskju FX u l-komponent Vega, it-tweġiba għandha tkun l-isem tal-par ta' muniti (eż. "EUR USD", il-kodiċijiet tal-munita rrapportati għandhom isegwu d-dežinjazzjoni tal-munita ISO 4217). |
| 0030 | Identifikatur addizzjonali1 | L-Artikoli 325l sa 325q u l-Artikolu 325ai tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Għandha tiġi rrapportata l-informazzjoni li ġejja li tiddistingwi l-fattur ta' riskju fil-livell intra-bucket. Meta l-identifikatur tal-fattur ta' riskju magħżul fil-kolonna 0010 jikkorrispondi għall-klassi ta' riskju:<br>— Riskju ġenerali tar-rata tal-imgħax u l-komponent Delta, it-tweġiba għandha tkun l-isem tal-kurva mingħajr riskju jew identifikatur uniku korrispondenti ieħor.<br>— Riskju ta' firxiet tal-kreditu għal nontitolizzazzjoni jew ir-riskju ta' firxiet tal-kreditu tal-klassi ta' riskju għal titolizzazzjoni inkluża fil-portafoll kummerċjali ta' korrelazzjoni alternattiva (CSR ACTP), it-tweġiba għandha tkun l-isem tal-emittent jew |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| | | | identifikatur uniku korrispondenti ieħor u għandha tkun identika għal kwalunkwe żewġ sensittivitajiet irrapportati lejn żewġ fatturi ta' riskju li jirċievu parametru ta' korrelazzjoni $\rho_{kl}^{(isem)}$ ugwali għal 1 f'konformità mal-Artikolu 325ai (1) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.<br>— Riskju ta' firxiet tal-kreditu għal titolizzazzjoni mhux inkluża fil-portafoll kummerċjali ta' korrelazzjoni alternattiva (CSR mhux ACTP), it-tweġiba għandha tkun l-isem tas-segment jew identifikatur uniku korrispondenti ieħor.<br>— Riskju ta' ekwità, it-tweġiba għandha tkun l-isem tal-emittent tal-ekwità jew identifikatur uniku korrispondenti.<br>— Riskju tal-komoditajiet, it-tweġiba għandha tkun l-isem tal-komodità jew identifikatur uniku korrispondenti ieħor.<br>Meta ma japplika l-ebda wieħed minn dawk il-każijiet, l-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw valur espliċitu (NULL) bħala mhux applikabbli. |
| 0050 | Sensittività għar-riskju (Riżultati tal-munita tar-rapportar) | L-Artikolu 325d(2) u l-Artikoli 325g, 325r, 325s, 325t u 325ax tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Is-sensittivitajiet għar-riskju (is-sensittivitajiet delta/vega u l-pożizzjonijiet tar-riskju tal-kurvatura) għandhom jiġu rrapportati fil-livell ta' kull strument għall-fatturi ta' riskju rilevanti kollha kif speċifikat fil-kolonni 0010 sa 0030. Il-valuri għandhom jiġu rrapportati fil-munita tar-rapportar tal-istituzzjoni. Meta l-identifikatur tal-fattur ta' riskju magħżul fil-kolonna 0010 jikkorrispondi għal:<br>— Il-komponent tar-riskju delta tal-metodu bbażat fuq is-sensittivitajiet, għandha tiġi rrapportata s-sensittività netta għall-fattur ta' riskju ($S_k$) kif speċifikat fl-Artikolu 325r tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. Meta l-istituzzjonijiet ikunu kisbu permess mill-awtorità kompetenti tagħhom biex jużaw definizzjonijiet alternattivi ta' sensittivitajiet għar-riskju delta f'konformità mal-Artikolu 325t(5) ta' dak ir-Regolament, huma għandhom jirreferu għal dawk id-definizzjonijiet alternattivi għar-rapportar.<br>— Il-komponent tar-riskju vega tal-metodu bbażat fuq is-sensittivitajiet, għandha tiġi rrapportata s-sensittività għar-riskju vega ta' opzjoni għal fattur ta' riskju partikolari ($S_k$) kif speċifikat fl-Artikolu 325s tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. Meta l-istituzzjonijiet ikunu kisbu permess mill-awtorità kompetenti tagħhom biex jużaw kalkoli alternattivi tas-sensittivitajiet għar-riskju vega f'konformità mal-Artikolu 325t(6) ta' dak ir-Regolament, huma għandhom jirreferu għal dawk il-kalkoli alternattivi għar-rapportar. Irrispettivament minn jekk l-istituzzjoni tużax id-definizzjoni tal-Artikolu 325s jew kalkolu alternattiv f'konformità mal-Artikolu 325t(6) ta' dak ir-Regolament, is-sensittività għandha tiġi rrapportata wara li tiġi ponderata bil-volatilità implikata korrispondenti.<br>— Għandu jiġi rrapportat il-komponent tar-riskju tal-kurvatura tal-metodu bbażat fuq is-sensittivitajiet, ir-riskju 'l fuq għall-pożizzjoni ta' kurvatura nnettjat ta' dak il-fattur ta' riskju ($CVR_k^+$) jew ir-riskju 'l isfel għall-pożizzjonijiet ta' kurvatura nnettjat ta' dak il-fattur ta' riskju ($CVR_k^-$) kif speċifikat fl-Artikolu 325g tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.<br>Iċ-ċifra rrapportata għandha tiġi espressa bħala deċimali bi preċiżjoni minima ta' żewġ pożizzjonijiet deċimali.<br>Il-valuri żero għandhom jiġu rrapportati biss meta r-riżultat tal-kalkolu jkun fil-fatt żero. |
| 0060 | Munita tar-rapportar | | L-isem tal-munita tar-rapportar tal-istituzzjoni għandu jiġi rrapportat (il-valur irrapportat għandu jsegwi d-dežinjazzjoni tal-munita ISO 4217, eż. "EUR"). |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0070 | Sensittività għar-riskju (riżultati fil-munita tal-istrument tal-EBA) | Taqsima 2 tal-Anness V ta' dan ir-Regolament u L-Artikolu 325d(2) u l-Artikoli 325g, 325r u 325s tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Il-valuri għandhom jiġu rrapportati skont l-istruzzjonijiet għall-kolonna 0050 iżda tradotti bir-rata tal-kambju spot tal-BĊE assoċjata mal-munita tal-istrument kif definita fit-Taqsima 2 tal-Anness V ta' dan ir-Regolament. |
| 0080 | Mudell tal-ipprezzar | Artikolu 325t tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | L-istituzzjoni għandha tispeċifika liema mudell tal-ipprezzar japplika sabiex jiġu dderivati s-sensittivitajiet. Għandha tiġi rrapportata waħda mill-possibilitajiet li ġejjin:<br>(a) "mudelli tal-ipprezzar tal-istituzzjoni li jservu bħala bażi għar-rapportar tal-profitt u t-telf lill-maniġment superjuri" (fir-rigward tal-ewwel subparagrafu tal-Artikolu 325t(1) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013);<br>(b) "Approċċ mudell intern tal-istituzzjoni" (fir-rigward tal-Artikolu 325t(1), it-tieni subparagrafu ta' dak ir-Regolament); |
| 0090 | Definizzjoni tas-sensittivitajiet | L-Artikoli 325r, 325s u 325t tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | L-istituzzjoni għandha tispeċifika liema definizzjoni tas-sensittivitajiet tiġi applikata fil-kalkolu tar-rekwiżiti ta' fondi proprji.<br>Għandha tiġi rrapportata waħda mill-possibilitajiet li ġejjin:<br>(a) "Id-definizzjoni tas-sensittivitajiet fl-Artikoli 325r u 325s tar-Regolament (UE) Nru 575/2013";<br>(b) "Definizzjoni tas-sensittivitajiet f'konformità mal-Artikolu 325t(5) u (6) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013";<br>Meta l-identifikatur tal-fattur ta' riskju magħżul fil-kolonna 0010 jikkorrispondi għall-komponent tar-riskju ta' kurvatura tal-metodu bbażat fuq is-sensittivitajiet, il-valur indikat fil-punt (b) għandu jiġi rrapportat jekk kwalunkwe waħda mis-sensittivitajiet użati fil-kalkolu tal-pożizzjoni tar-riskju ta' kurvatura rrapportata tkun ibbażata fuq definizzjoni tas-sensittività f'konformità mal-Artikolu 325t(5) u (6) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, u l-valur indikat fil-punt (a) għandu jiġi rrapportat mod ieħor. |
| 0100 | Kaxxa għal test liberu | | Istituzzjoni tista' tipprovdi informazzjoni addizzjonali f'din il-kolonna dwar il-mudell tal-ipprezzar u d-definizzjoni tas-sensittivitajiet applikati. |
| 0110 | Identifikatur addizzjonali2 | L-Artikolu 325p(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Meta l-identifikatur tal-fattur tar-riskji magħżul fil-kolonna 0010 jikkorrispondi għall-klassi ta' riskju Riskju ta' komodità u l-komponent tar-riskju Delta tal-metodu bbażat fuq is-sensittivitajiet, it-tweġiba għandha tkun is-sett ta' termini ġuridiċi rigward il-post ta' kunsinna jew identifikatur uniku korrispondenti ieħor.<br>Meta ma japplika l-ebda wieħed minn dawk il-każijiet, l-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw valur espliċitu (NULL) bħala mhux applikabbli. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0120 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | L-Artikolu 325m(1) u l-Artikolu 325ah (1) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Meta l-identifikatur tal-fattur tar-riskji magħżul fil-kolonna 0010 jikkorrispondi għall-klassi ta' riskju Riskju ta' firxiet tal-kreditu għan-nontitolizzazzjoni u l-komponent tar-riskju Delta tal-metodu bbażat fuq is-sensittivitajiet, it-tweġiba għandha tkun waħda mill-possibbiltajiet li ġejjin:<br>(a) "CQS 1";<br>(b) "CQS 2";<br>(c) "CQS 3";<br>(d) "CQS 4";<br>(e) "CQS 5";<br>(f) "CQS 6";<br>(g) "L-ebda CQS assenjat (mhux ikklassifikat)".<br>Meta ma japplika l-ebda wieħed minn dawk il-każijiet, l-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw valur espliċitu (NULL) bħala mhux applikabbli. |

**C 107.01 – VaR & sVaR Mhux CTP. Dettalji.**

| Ringiela | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0010 - 0060 | VaR | | |
| 0010 | Metodoloġija | | Għandha tiġi rrapportata waħda minn dawn li ġejjin fil-kolonna 0010:<br>(a) Simulazzjoni storika;<br>(b) Simulazzjoni Monte Carlo;<br>(c) Metodoloġija parametrika;<br>(d) Kombinament / metodoloġija oħra (jekk jogħġbok speċifika).<br>L-istituzzjoni għandha tuża l-kolonna 0020 biex tiċċara t-tweġiba mogħtija fil-kolonna 0010. F'każ li tintgħażel l-opzjoni (d) fil-kolonna 0010, l-istituzzjoni għandha tipprovdi d-dettalji fil-kolonna 0020. |
| 0020 | Komputazzjoni tal-orizzont ta' 10 ijiem | L-Artikolu 365(1) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Għandha tiġi rrapportata waħda minn dawn li ġejjin fil-kolonna 0010:<br>(a) Ġurnata (1) estiża għal 10 ijiem;<br>(b) 10 jum b'perjodi li jitrikkbu;<br>(c) 10 ijiem b'metodoloġija oħra.<br>L-istituzzjoni għandha tuża l-kolonna 0020 biex tiċċara t-tweġiba mogħtija fil-kolonna 0010. |
| 0030 | Tul tal-perjodu ta' osservazzjoni | L-Artikolu 365(1) il-punt (d) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Għandha tiġi rrapportata waħda minn dawn li ġejjin fil-kolonna 0010:<br>(a) Sa sena (1);<br>(b) Aktar minn sena (1) u sa sentejn (2);<br>(c) Aktar minn sena (2) u sa sentejn (3);<br>(d) Aktar minn 3 snin.<br>L-istituzzjoni għandha tuża l-kolonna 0020 biex tiċċara t-tweġiba mogħtija fil-kolonna 0010. |

| Ringiela | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0040 | Ponderazzjoni tad-Data | L-Artikolu 365(1), il-punt (d), tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Għandha tiġi rrapportata waħda minn dawn li ġejjin fil-kolonna 0010:<br>(a) Mingħajr ponderazzjoni (ponderazzjoni tad-data tal-VaR);<br>(b) B'ponderazzjoni (ponderazzjoni tad-data tal-VaR);<br>(c) L-ogħla valur bejn dak ponderat u dak mhux ponderat (ponderazzjoni tad-data tal-VaR) fil-punti (a) u (b).<br>L-istituzzjoni għandha tuża l-kolonna 0020 biex tiċċara t-tweġiba mogħtija fil-kolonna 0010. |
| 0050 | Żieda għall-ittestjar retrospettiv | L-Artikolu 366(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Żieda għall-ittestjar retrospettiv tfisser iż-żieda bejn 0 u 1 f'konformità mal-Artikolu 366(2), it-Tabella 1, tar-Regolament (UE) Nru 575/2013<br>L-istituzzjoni għandha tuża l-kolonna 0020 biex tiċċara t-tweġiba mogħtija fil-kolonna 0010. |
| 0060 | Żieda Regolatorja għall-VaR | L-Artikolu 366(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 ("mill-inqas 3") | Żieda Regolatorju għall-VaR tfisser l-imposta addizzjonali mitluba mill-awtorità kompetenti fir-rigward tal-fattur ta' multiplikazzjoni għall-VaR (mill-inqas 3) f'konformità mal-Artikolu 366(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. Iż-Żieda Regolatorja għall-VaR hija t-total taż-żieda tal-ittestjar retrospettiv u taż-żieda kwalitattiva, fejn applikabbli, ta' aktar minn 3.<br>L-istituzzjoni għandha tuża l-kolonna 0020 biex tiċċara t-tweġiba mogħtija fil-kolonna 0010. |
| 0070 - 0100 | SVaR (jiġifieri VaR taħt Stress) | | |
| 0070 | Metodoloġija | | Għandha tiġi rrapportata waħda minn dawn li ġejjin fil-kolonna 0010:<br>(a) Simulazzjoni storika;<br>(b) Simulazzjoni Monte Carlo;<br>(c) Metodoloġija parametrika;<br>(d) Kombinament / metodoloġija oħra (jekk jogħġbok speċifika).<br>L-istituzzjoni għandha tuża l-kolonna 0020 biex tiċċara t-tweġiba mogħtija fil-kolonna 0010. F'każ li tintgħażel l-opzjoni (d) fil-kolonna 0010, l-istituzzjoni għandha tipprovdi d-dettalji fil-kolonna 0020. |
| 0080 | Komputazzjoni tal-Orizzont ta' 10 ijiem | L-Artikolu 365(1) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Għandha tiġi rrapportata waħda minn dawn li ġejjin fil-kolonna 0010:<br>(a) Ġurnata (1) estiża għal 10 ijiem;<br>(b) 10 jum b'perjodi li jitrikkbu;<br>(c) 10 ijiem b'metodoloġija oħra.<br>L-istituzzjoni għandha tuża l-kolonna 0020 biex tiċċara t-tweġiba mogħtija fil-kolonna 0010. |
| 0090 | Żieda Regolatorja għall-SVaR | L-Artikolu 366(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Żieda regolatorja tfisser l-imposta addizzjonali mitluba mill-awtorità kompetenti fir-rigward tal-fattur ta' multiplikazzjoni għall-sVaR (mill-inqas 3) f'konformità mal-Artikolu 366(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. Iż-żieda regolatorja għall-VaR hija t-total tas-somma ta' 3, iż-żieda tal-ittestjar retrospettiv u taż-żieda kwalitattiva (fejn applikabbli). |

| Ringiela | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| | | | L-istituzzjoni għandha tuża l-kolonna 0020 biex tiċċara t-tweġiba mogħtija fil-kolonna 0010. |
| 0100 | Perjodu ta' SVaR | Artikolu 365(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Għandha tiġi rrapportata waħda minn dawn li ġejjin fil-kolonna 0010:<br>(a) Komputazzjoni ta' kuljum tal-VaR taħt stress ikkalibrat għal perjodu wieħed kontinwu ta' 12-il xahar li jibda mid-data speċifikata fil-kolonna 0020;<br>(b) Komputazzjoni ta' kull ġimgħa tal-VaR taħt stress ikkalibrat għal perjodu wieħed kontinwu ta' 12-il xahar li jibda mid-data speċifikata fil-kolonna 0020;<br>(c) Komputazzjoni ta' kuljum tal-VaR taħt stress ikkalibrat għal perjodi ta' 12-il xahar kontinwi differenti matul id-dati ta' rapportar tal-VaR taħt stress mogħtija fil-kolonna 0010 ta' C107.02 li jibdew mid-dati speċifikati fil-kolonna 0020;<br>(d) Komputazzjoni ta' kull ġimgħa tal-VaR taħt stress ikkalibrat għal perjodi ta' 12-il xahar kontinwi differenti matul id-dati ta' rapportar tal-VaR taħt stress mogħtija fil-kolonna 0010 ta' C107.02 li jibdew mid-dati speċifikati fil-kolonna 0020;<br>(e) Massimu ta' komputazzjoni ta' kuljum tal-VaR taħt stress ikkalibrat għal aktar minn perjodu wieħed ta' 12-il xahar;<br>(f) Massimu ta' komputazzjoni ta' ġimgħa tal-VaR taħt stress ikkalibrat għal aktar minn perjodu wieħed ta' 12-il xahar;<br>(g) Għażliet oħrajn għall-ikkalibrar tal-VaR taħt stress (jekk jogħġbok speċifika).<br>L-istituzzjoni għandha tuża l-kolonna 0020 sabiex tipprovdi d-data tal-bidu fil-format ta' "jj/xx/ssss" fil-każ tal-opzjonijiet (a) jew (b) mogħtija fil-kolonna 0010 u d-dati tal-bidu fil-format "jj/xx/ssss" użati għal kull komputazzjoni tal-VaR taħt stress fil-każ tal-opzjonijiet (c) jew (d) mogħtija fil-kolonna 0010. L-istituzzjoni għandha tuża wkoll il-kolonna 0020 sabiex jiġi ċċarat il-perjodu ta' 12-il xahar użat għal kull komputazzjoni tal-VaR taħt stress fil-każ tal-opzjonijiet (e), (f) u (g) mogħtija fil-kolonna 0010. |

**C 107.02 – VaR, sVaR u PV - Mhux CTP. Ir-riżultati tal-munita tal-portafoll tal-EBA.**

Struzzjonijiet rigward il-folji (sheets) (assi-z)

| Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|
| Portafoll | It-Taqsimiet 3, 4 u 5 tal-Anness V | Għandu jiġi rrapportat in-numru tal-portafoll meħud mill-Anness V. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0010 | Data | | Ir-riżultati tal-VaR, tal-sVaR u tal-Valur Preżenti (PV, Present Valure) għandhom jiġu rrapportati għall-10 ijiem kollha ta' negozju bejn id-"data ta' referenza inizjali tal-RM" u d-"data ta' referenza finali tal-RM (u tal-ASA finali)" kif speċifikat fit-Taqsima 1, il-punt (b) tal-Anness V. L-istruttura "jj/xx/ssss" għandha tiġi adottata fir-rapportar tad-dati. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0020 | VaR | L-Artikolu 365 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Għandu jiġi rrapportat il-VaR regolatorju fuq 10 ijiem miksub għal kull portafoll, mingħajr ma jiġi applikat il-fattur ta' multiplikazzjoni regolatorju ta' "mill-inqas 3".<br>Għandhom jiġu rrapportati ċ-ċifri għal kull waħda mid-dati pprovduti fil-kolonna 0010. Il-kaxxa għandha titħalla vojta meta l-istituzzjoni ma tikkalkulax VaR fid-data pprovduta fil-kolonna 0010 (jiġifieri l-valuri żero għandhom jiġu rrapportati biss meta r-riżultat tal-kalkolu jkun żero). |
| 0030 | sVaR | L-Artikolu 365 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Għandu jiġi rrapportat l-sVaR regolatorju fuq 10 ijiem miksub għal kull portafoll mingħajr ma jiġi applikat il-fattur ta' multiplikazzjoni regolatorju ta' "mill-inqas 3".<br>Għandhom jiġu rrapportati ċ-ċifri għal kull waħda mid-dati pprovduti fil-kolonna 0010. Il-kaxxa għandha titħalla vojta meta l-istituzzjoni ma tikkalkulax sVaR fid-data pprovduta fil-kolonna 0010 (jiġifieri l-valuri żero għandhom jiġu rrapportati biss meta r-riżultat tal-kalkolu jkun żero). |
| 0040 | PV | | Għandu jiġi rrapportat il-valur preżenti (PV) għal kull portafoll.<br>Għandhom jiġu rrapportati ċ-ċifri għal kull waħda mid-dati pprovduti fil-kolonna 0010. Il-kaxxa għandha titħalla vojta meta l-istituzzjoni ma tikkalkulax PV fid-data pprovduta fil-kolonna 0010 (jiġifieri l-valuri żero għandhom jiġu rrapportati biss meta r-riżultat tal-kalkolu jkun żero). |

**C 108.00 – Serje Kronoloġika tal-Profitt u t-Telf**

Il-mudell C 108.00 ("Serje Kronoloġika tal-Profitt u t-Telf") għandha timtela biss mill-istituzzjonijiet li jikkalkulaw il-VaR bl-użu ta' simulazzjoni storika.

Struzzjonijiet rigward il-folji (sheets) (assi-z)

| Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|
| Portafoll | It-Taqsimiet 3, 4 u 5 tal-Anness V | Għandu jiġi rrapportat in-numru tal-portafoll meħud mill-Anness V. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0010 | Data | L-Artikolu 365(1), il-punt (d), tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | F'kull jum ta' negozju, iddeterminat f'konformità mal-kalendarju fil-ġuriżdizzjoni tal-istituzzjoni, l-istituzzjonijiet għandhom jipprovdu s-serje P&L użata għall-kalkolu tal-VaR fil-kolonna 0010 ta' C107.02 b'minimu ta' 250 osservazzjoni li jibdew mid-"data ta' referenza finali tal-RM (u tal-ASA finali)", kif speċifikat fit-Taqsima 1, il-punt (b)(v), tal-Anness V, u li jmorru lura. |
| 0020 | P&L ta' kuljum | | L-istituzzjonijiet li jikkalkulaw il-VaR bl-użu ta' simulazzjoni storika għandhom jimlew is-serje storika kollha użata mill-istituzzjoni, b'minimu ta' serje ta' data ta' sena, bil-bidla fil-valwazzjoni tal-portafoll (jiġifieri P&L ta' kuljum) prodotta bl-użu ta' bidliet ta' kuljum fil-fattur ta' riskju simulati storikament (jiġifieri s-serje P&L ta' kuljum użata biex jiġi derivat il-VaR regolatorju ta' jum (1)). |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| | | | Fil-każ li dak il-jum ikun festa pubblika fil-ġuriżdizzjoni relevanti, din il-kaxxa titħalla vojta (jiġifieri P&L ta' żero għandu jiġi rrapportat biss jekk ma kien hemm l-ebda bidla fil-valur ipotetiku tal-portafoll f'jum ta' negozju partikolari). |

**C 109.01 – IRC. Dettalji tal-Mudell**

| Ringiela | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0010 | Għadd ta' fatturi ta' mmudellar | | EBA/GL/2012/3<br>Għandu jiġi rrapportat l-għadd ta' fatturi ta' mmudellar fil-livell kumplessiv tal-mudell IRC. It-tweġiba għandha tkun waħda minn dawn li ġejjin:<br>(a) Fattur 1 ta' mmudellar;<br>(b) 2 fatturi ta' mmudellar;<br>(c) Aktar minn 2 fatturi ta' mmudellar.<br>L-istituzzjoni għandha tuża l-kolonna 0020 biex tiċċara t-tweġiba mogħtija fil-kolonna 0010. |
| 0020 | Sors tal-LGDs | | EBA/GL/2012/3<br>Għandu jiġi rrapportat is-sors ta' LGDs fil-livell kumplessiv tal-mudell IRC. It-tweġiba għandha tkun waħda minn dawn li ġejjin:<br>(a) Konvenzjoni tas-suq;<br>(b) LGD użat fl-IRB;<br>(c) Sors ieħor ta' LGD (jekk jogħġbok speċifika).<br>L-istituzzjoni għandha tuża l-kolonna 0020 biex tiċċara t-tweġiba mogħtija fil-kolonna 0010. F'każ li l-opzjoni (c) tkun ġiet magħżula fil-kolonna 0010, l-istituzzjoni għandha tipprovdi d-dettalji f'din il-kolonna. |

**C 109.02 – IRC. Dettalji skont il-Portafoll**

Struzzjonijiet rigward il-folji (sheets) (assi-z)

| Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|
| Portafoll | It-Taqsimiet 3, 4 u 5 tal-Anness V | Għandu jiġi rrapportat in-numru tal-portafoll meħud mill-Anness V, għal dawk il-portafolli fejn jintalab l-IRC biss. |

| Ringiela | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0010 | Perjodu ta' Likwidità | L-Artikolu 374(5) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | EBA/GL/2012/3<br>Il-perjodu ta' likwidità applikat fil-livell ta' portafoll għandu jiġi rrapportat. It-tweġiba għandha tkun waħda minn dawn li ġejjin:<br>(a) Sa 3 xhur;<br>(b) Aktar minn 3 xhur u sa 6 xhur;<br>(c) Aktar minn 6 xhur u sa 9 xhur;<br>(d) Aktar minn 9 xhur u sa 12-il xahar; |
| 0020 | Sors ta' PDs | | EBA/GL/2012/3<br>Għandu jiġi rrapportat is-sors tal-PDs applikati fil-livell ta' portafoll. It-tweġiba għandha tkun waħda minn dawn li ġejjin:<br>(a) Aġenziji tal-klassifikazzjoni;<br>(b) IRB;<br>(c) PDs implikati mis-suq;<br>(d) Sors ieħor ta' PDs (jekk jogħġbok speċifika).<br>L-istituzzjoni għandha tuża l-kolonna 0020 biex tiċċara t-tweġiba mogħtija fil-kolonna 0010. F'każ li tintgħażel l-opzjoni (d) fil-kolonna 0010, l-istituzzjoni għandha tipprovdi d-dettalji f'din il-kolonna 0020. |
| 0030 | Sors tal-matriċi ta' tranżizzjoni | | EBA/GL/2012/3<br>Għandu jiġi rrapportat is-sors tal-matriċi ta' tranżizzjoni applikati fil-livell ta' portafoll. It-tweġiba għandha tkun waħda minn dawn li ġejjin:<br>(a) Aġenziji tal-klassifikazzjoni;<br>(b) IRB;<br>(c) Matriċijiet ta' tranżizzjoni implikati mis-suq;<br>(d) Sorsi oħrajn ta' matriċijiet ta' tranżizzjoni (jekk jogħġbok speċifika).<br>L-istituzzjoni għandha tuża l-kolonna 0020 biex tiċċara t-tweġiba mogħtija fil-kolonna 0010. F'każ li tintgħażel l-opzjoni (d) fil-kolonna 0010, l-istituzzjoni għandha tipprovdi d-dettalji f'din il-kolonna 0020. |

**C 109.03 – IRC. Ammont skont il-Portafoll/Data.**

Struzzjonijiet rigward il-folji (sheets) (assi-z)

| Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|
| Portafoll | It-Taqsimiet 3, 4 u 5 tal-Anness V | Għandu jiġi rrapportat in-numru tal-portafoll meħud mill-Anness V, għal dawk il-portafolli fejn jintalab l-IRC biss. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0010 | Data | | L-IRC għandha tiġi rrapportata għall-10 ijiem kollha ta' negozju bejn id-"data ta' referenza inizjali tal-RM" u d-"data ta' referenza finali tal-RM (u tal-ASA finali)" kif speċifikat fit-Taqsima 1, il-punt (b) tal-Anness V. L-istruttura "jj/xx/ssss" għandha tiġi adottata fir-rapportar tad-dati. |
| 0020 | IRC | L-Artikoli minn 372 sa 376 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | EBA/GL/2012/3<br>Għandha tiġi rrapportata l-IRC regolatorja miksuba għal kull portafoll.<br>Għandhom jiġu rrapportati ċ-ċifri għal kull waħda mid-dati pprovduti fil-kolonna 0010. Il-kaxxa għandha titħalla vojta meta l-istituzzjoni ma tikkalkulax IRC fid-data rrapportata fil-kolonna 0010 (jiġifieri l-valuri żero għandhom jiġu rrapportati biss meta r-riżultat tal-kalkolu jkun żero). |

**C 110.01 – CT. Dettalji tal-Mudell.**

| Ringiela | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0010 | Għadd ta' fatturi ta' mmudellar | L-Artikolu 377 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Għandu jiġi rrapportat l-għadd ta' fatturi ta' mmudellar fil-livell kumplessiv tal-mudell tan-negozjar ta' korrelazzjoni. It-tweġiba għandha tkun waħda minn dawn li ġejjin:<br>(a) Fattur 1 ta' mmudellar;<br>(b) 2 fatturi ta' mmudellar;<br>(c) Aktar minn 2 fatturi ta' mmudellar.<br>L-istituzzjoni għandha tuża l-kolonna 0020 fejn tixtieq tiċċara t-tweġiba mogħtija fil-kolonna 0010. |
| 0020 | Sors tal-LGDs | L-Artikolu 377 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Għandu jiġi rrapportat is-sors tal-LGDs fil-livell kumplessiv tal-mudell tan-negozjar ta' korrelazzjoni. It-tweġiba għandha tkun waħda minn dawn li ġejjin:<br>(a) Konvenzjoni tas-suq;<br>(b) LGD użat fl-IRB;<br>(c) Sorsi oħrajn ta' LGD (jekk jogħġbok speċifika).<br>L-istituzzjoni għandha tuża l-kolonna 0020 biex tiċċara t-tweġiba mogħtija fil-kolonna 0010. F'każ li l-opzjoni (c) tkun ġiet magħżula fil-kolonna 0010, l-istituzzjoni għandha tipprovdi d-dettalji f'din il-kolonna. |

**C 110.02 – CT. Dettalji skont il-Portafoll.**

Struzzjonijiet rigward il-folji (sheets) (assi-z)

| Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|
| Portafoll | It-Taqsimiet 3, 4 u 5 tal-Anness V | Għandu jiġi rrapportat in-numru tal-portafoll meħud mill-Anness V, għal dawk il-portafolli fejn jintalab l-APR biss. |

| Ringiela | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0010 | Perjodu ta' likwidità | L-Artikolu 377(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Il-perjodu ta' likwidità applikat fil-livell ta' portafoll għandu jiġi rrapportat. It-tweġiba għandha tkun waħda minn dawn li ġejjin:<br>(a) Sa 3 xhur;<br>(b) Aktar minn 3 xhur u sa 6 xhur;<br>(c) Aktar minn 6 xhur u sa 9 xhur;<br>(d) Aktar minn 9 xhur u sa 12-il xahar; |
| 0020 | Sors ta' PDs | L-Artikolu 377 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Għandu jiġi rrapportat is-sors tal-PDs applikati fil-livell ta' portafoll. It-tweġiba għandha tkun waħda minn dawn li ġejjin:<br>(a) Aġenziji tal-klassifikazzjoni;<br>(b) IRB;<br>(c) PDs implikati mis-suq;<br>(d) Sors ieħor ta' PDs (jekk jogħġbok speċifika).<br>L-istituzzjoni għandha tuża l-kolonna 0020 biex tiċċara t-tweġiba mogħtija fil-kolonna 0010. F'każ li tintgħażel l-opzjoni (d) fil-kolonna 0010, l-istituzzjoni għandha tipprovdi d-dettalji fil-kolonna 0020. |
| 0030 | Sors tal-matriċi ta' tranżizzjoni | L-Artikolu 377 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Għandu jiġi rraportat is-sors tal-matriċi ta' tranżizzjoni applikati fil-livell ta' portafoll. It-tweġiba għandha tkun waħda minn dawn li ġejjin:<br>(a) Aġenziji tal-klassifikazzjoni;<br>(b) IRB;<br>(c) Matriċijiet ta' tranżizzjoni implikati mis-suq;<br>(d) Sorsi oħrajn ta' matriċi ta' tranżizzjoni (jekk jogħġbok speċifika).<br>L-istituzzjoni għandha tuża l-kolonna 0020 biex tiċċara t-tweġiba mogħtija fil-kolonna 0010. F'każ li tintgħażel l-opzjoni (d) fil-kolonna 0010, l-istituzzjoni għandha tipprovdi d-dettalji fil-kolonna 0020. |

**C 110.03 – CT. APR skont il-Portafoll/id-Data**

Struzzjonijiet rigward il-folji (sheets) (assi-z)

| Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|
| Portafoll | It-Taqsima 3, 4 u 5 tal-Anness V | In-numru tal-portafoll meħud mill-Anness V, għal dawk il-portafolli biss fejn jintalab l-APR, għandu jiġi rrapportat |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0010 | Data | L-Artikolu 377 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Ir-riskju tal-prezz kollu ("APR") għandu jiġi rrapportat għall-10 ijiem kollha ta' negozju bejn id-"data ta' referenza inizjali tal-RM" u d-"data ta' referenza finali tal-RM (u tal-ASA finali)" kif imsemmi fit-Taqsima 1, il-punt (b) tal-Anness V. L-istruttura konvenzjonali "jj/xx/ssss" għandha tiġi adottata fir-rapportar tad-dati. |
| 0060 | APR | L-Artikolu 377 tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Għandhom jiġu rrapportati r-riżultati miksuba bl-applikazzjoni tal-mudell regolatorju tan-negozjar ta' korrelazzjoni għal kull portafoll.<br>Għandhom jiġu rrapportati ċ-ċifri għal kull waħda mid-dati pprovduti fil-kolonna 0010. Il-kaxxa għandha titħalla vojta meta l-istituzzjoni ma tużax il-mudell tan-negozjar ta' korrelazzjoni fid-data pprovduta fil-kolonna 0010 (jiġifieri l-valuri żero għandhom jiġu rrapportati biss meta r-riżultat tal-kalkolu jkun żero). |

**C 120.01 - SBM. SENSITTIVITAJIET GĦAR-RISKJU SKONT L-ISTRUMENT/PORTAFOLL**

L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw, skont l-istrument, is-sensittivitajiet lejn il-fatturi ta' riskju li l-istrument ikun espost għalihom. Għandha tiġi rrapportata ringiela waħda għal kull fattur ta' riskju/sensittività għar-riskju. Ir-riskju 'l fuq għall-pożizzjonijiet ta' kurvatura nnettjat ta' dak il-fattur ta' riskju (CVRk +) jew ir-riskju 'l isfel għall-pożizzjonijiet ta' kurvatura nnettjat ta' dak il-fattur ta' riskju (CVRk-) kif speċifikat fl-Artikolu 325g tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 għandhom jiġu rrapportati f'ringieli individwali. Il-valuri kollha għandhom jirreferu għad-"data ta' referenza finali tal-RM (u tal-ASA finali)" (kif definit fit-Taqsima 1, il-punt (b)(v), tal-Anness V ta' dan ir-Regolament). L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw kull kombinament ta' Portafoll, Numru tal-istrument (il-kolonna 0010), Identifikatur tar-riskju (il-kolonna 0020), Bucket (il-kolonna 0030) u Identifikatur addizzjonali (il-kolonna 0040) darba biss.

Struzzjonijiet rigward il-folji (sheets) (assi-z)

| Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|
| Portafoll | It-Taqsimiet 3, 4 u 5 tal-Anness V | Għandu jiġi rrapportat in-numru tal-portafoll meħud mill-Anness V. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0010 | Numru tal-istrument | It-Taqsima 2 tal-Anness V | Għandu jiġi rrapportat in-numru tal-istrument meħud mill-Anness V. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0020 | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | L-Artikoli 325l, 325m, 325n, 325o, 325p, 325q tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Għandu jiġi rrapportat l-identifikatur tal-fattur ta' riskju kif speċifikat fit-tabella fl-aħħar ta' dan l-Anness. |
| 0030 | Bucket | L-Artikolu 325d(3) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Il-bucket għandu jiġi rapportat meta l-identifikatur tal-fattur ta' riskju magħżul fil-kolonna 0020 jikkorrispondi għall-klassi ta' riskju:<br>— Riskju ġenerali taċ-ċaqliq fir-rata tal-imgħax. It-tweġiba għandha tkun l-isem tal-munita tar-rata rilevanti mingħajr riskju, tal-inflazzjoni jew tal-fattur ta' riskju bażi ta' bejn il-muniti (skont id-dežinjazzjoni tal-munita ISO 4217, eż. "EUR").<br>— Riskju ta' firxiet tal-kreditu għal nontitolizzazzjoni. It-tweġiba għandha tkun in-numru tal-bucket fl-Artikolu 325ah(1), it-Tabella 4, tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.<br>— Riskju ta' firxiet tal-kreditu għal titolizzazzjoni mhux inkluż fil-portafoll kummerċjali ta' korrelazzjoni alternattiva (CSR mhux ACTP). It-tweġiba għandha tkun in-numru tal-bucket fl-Artikolu 325am(1), it-Tabella 7, ta' dak ir-Regolament.<br>— Riskju ta' firxiet tal-kreditu għal titolizzazzjoni inkluż fil-portafoll kummerċjali ta' korrelazzjoni alternattiva (CSR ACTP). It-tweġiba għandha tkun in-numru tal-bucket fl-Artikolu 325ak, it-Tabella 6, ta' dak ir-Regolament.<br>— Riskju ta' ekwità. It-tweġiba għandha tkun in-numru tal-bucket fl-Artikolu 325ap(1), it-Tabella 8, ta' dak ir-Regolament.<br>— Riskju tal-komoditajiet. It-tweġiba għandha tkun in-numru tal-bucket fl-Artikolu 325as, it-Tabella 9, ta' dak ir-Regolament.<br>— Riskju FX u l-komponent Delta jew il-komponent tal-Kurvatura. It-tweġiba għandha tkun l-isem tal-munita (eż. "USD", il-kodiċijiet tal-muniti rrapportati għandhom isegwu d-dežinjazzjoni tal-munita ISO 4217),<br>— Riskju FX u l-komponent Vega. It-tweġiba għandha tkun l-isem tal-par ta' muniti (eż. "EUR_USD", il-kodiċijiet tal-muniti rrapportati għandhom isegwu d-dežinjazzjoni tal-munita ISO 4217). |
| 0040 | Identifikatur addizzjonali1 | L-Artikoli 325l sa 325q u 325ai tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Għandha tiġi rrapportata l-informazzjoni li ġejja li tiddistingwi l-fattur ta' riskju fil-livell intra-bucket. Meta l-identifikatur tal-fattur ta' riskju magħżul fil-kolonna 0020 jikkorrispondi għall-klassi ta' riskju:<br>— Riskju ġenerali tar-rata tal-imgħax u l-komponent Delta, it-tweġiba għandha tkun l-isem tal-kurva mingħajr riskju jew identifikatur uniku korrispondenti ieħor.<br>— Riskju ta' firxiet tal-kreditu għal nontitolizzazzjoni jew ir-riskju ta' firxiet tal-kreditu tal-klassi ta' riskju għal titolizzazzjoni inkluża fil-portafoll kummerċjali ta' korrelazzjoni alternattiva (CSR ACTP), it-tweġiba għandha tkun l-isem tal-emittent jew identifikatur uniku korrispondenti ieħor u għandha tkun identika għal kwalunkwe żewġ sensittivitajiet irrapportati lejn żewġ fatturi ta' riskju li jirċievu parametru ta' korrelazzjoni $\rho_{kl}^{(isem)}$ ugwali għal 1 f'konformità mal-Artikolu 325ai(1) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.<br>— Riskju ta' firxiet tal-kreditu għal titolizzazzjoni mhux inkluż fil-portafoll tan-negozjar ta' korrelazzjoni alternattiv (CSR mhux ACTP), it-tweġiba għandha tkun l-isem tas-segment jew identifikatur uniku korrispondenti ieħor.<br>— Riskju ta' ekwità, it-tweġiba għandha tkun l-isem tal-emittent tal-ekwità jew identifikatur uniku korrispondenti. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| | | | — Riskju tal-komoditajiet, it-tweġiba għandha tkun l-isem tal-komodità jew identifikatur uniku korrispondenti ieħor.<br>Meta ma japplika l-ebda wieħed minn dawk il-każijiet, l-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw valur espliċitu (NULL) bħala mhux applikabbli. |
| 0060 | Sensittività għar-riskju (Riżultati tal-munita tar-rapportar) | L-Artikolu 325d(2) u l-Artikoli 325g, 325r, 325s, 325t u 325ax tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Is-sensittivitajiet għar-riskju (is-sensittivitajiet delta/vega u l-pożizzjonijiet tar-riskju tal-kurvatura) għandhom jiġu rrapportati fil-livell ta' kull strument għall-fatturi ta' riskju rilevanti kollha kif speċifikat fil-kolonni 0020 sa 0040. Il-valuri għandhom jiġu rrapportati fil-munita tar-rapportar tal-istituzzjoni. Meta l-identifikatur tal-fattur ta' riskju magħżul fil-kolonna 0020 jikkorrispondi għal:<br>— Il-komponent tar-riskju delta tal-metodu bbażat fuq is-sensittivitajiet, għandha tiġi rrapportata s-sensittività netta għall-fattur ta' riskju ($S_k$) kif speċifikat fl-Artikolu 325r tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. Meta l-istituzzjonijiet ikunu kisbu permess mill-awtorità kompetenti tagħhom biex jużaw kalkoli alternattivi ta' sensittivitajiet għar-riskju delta f'konformità mal-Artikolu 325t(5) ta' dak ir-Regolament, dawn għandhom jirreferu għal dawn id-definizzjonijiet alternattivi għar-rapportar.<br>— Il-komponent tar-riskju vega tal-metodu bbażat fuq is-sensittivitajiet, għandha tiġi rrapportata s-sensittività għar-riskju vega ta' opzjoni għal fattur ta' riskju partikolari ($S_k$) kif speċifikat fl-Artikolu 325s tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. Meta l-istituzzjonijiet ikunu kisbu permess mill-awtorità kompetenti tagħhom biex jużaw kalkoli alternattivi tas-sensittivitajiet għar-riskju vega f'konformità mal-Artikolu 325t(6) ta' dak ir-Regolament, huma għandhom jirreferu għal dawk il-kalkoli alternattivi għar-rapportar. Irrispettivament minn jekk l-istituzzjoni tużax il-kalkolu tal-Artikolu 325s jew kalkolu alternattiv f'konformità mal-Artikolu 325t(6) ta' dak ir-Regolament, is-sensittività għandha tiġi rrapportata wara li tiġi ponderata bil-volatilità implikata korrispondenti.<br>— Għandu jiġi rrapportat il-komponent tar-riskju tal-kurvatura tal-metodu bbażat fuq is-sensittivitajiet, ir-riskju 'l fuq għall-pożizzjoni ta' kurvatura nnettjat ta' dak il-fattur ta' riskju ($CVR_k^+$) jew ir-riskju 'l isfel għall-pożizzjonijiet ta' kurvatura nnettjat ta' dak il-fattur ta' riskju ($CVR_k^-$) kif speċifikat fl-Artikolu 325g tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.<br>Iċ-ċifra rrapportata għandha tiġi espressa bħala deċimali bi preċiżjoni minima ta' żewġ pożizzjonijiet deċimali.<br>Il-valuri żero għandhom jiġu rrapportati biss meta r-riżultat tal-kalkolu jkun fil-fatt żero. |
| 0070 | Munita tar-rapportar | | L-isem tal-munita tar-rapportar tal-istituzzjoni għandu jiġi rrapportat (il-valur irrapportat għandu jsegwi d-dežinjazzjoni tal-munita ISO 4217, eż. "EUR"). |
| 0080 | Sensittività għar-riskju (riżultati fil-munita tal-portafoll tal-EBA) | It-Taqsimiet 3 u 4 tal-Anness V ta' dan ir-Regolament u l-Artikolu 325d(2) u l-Artikoli 325g, 325r, 325s, 325t u 325ax tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Il-valuri għandhom jiġu rrapportati skont l-istruzzjonijiet għall-kolonna 0060 iżda tradotti bir-rata tal-kambju spot tal-BĊE assoċjata mal-munita tal-portafoll kif definita fit-Taqsimiet 3 u 4 tal-Anness V ta' dan ir-Regolament. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0090 | Piż tar-riskju | Il-Parti Tlieta, it-Titolu IV, il-Kapitolu 1a, it-Taqsima 6, tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Għandha tiġi rrapportata l-ponderazzjoni tar-riskju li tikkorrispondi għall-fattur ta' riskju kif speċifikat fil-kolonni minn 0020 sa 0040. Meta l-identifikatur tal-fattur ta' riskju magħżul fil-kolonna 0020 jikkorrispondi għall-komponent tar-Riskju tal-kurvatura, għandha tiġi rrapportata l-ponderazzjoni tar-riskju użat biex tiġi ddeterminata l-bidla relattiva applikabbli.<br>Iċ-ċifra rrapportata għandha tiġi espressa bħala deċimali bi preċiżjoni minima ta' erba' pożizzjonijiet deċimali. |
| 0110 | Identifikatur addizzjonali2 | L-Artikolu 325p(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Meta l-identifikatur tal-fattur tar-riskji magħżul fil-kolonna 0010 jikkorrispondi għall-klassi ta' riskju Riskju ta' komodità u l-komponent tar-riskju Delta tal-metodu bbażat fuq is-sensittivitajiet, it-tweġiba għandha tkun is-sett ta' termini ġuridiċi rigward il-post ta' kunsinna jew identifikatur uniku korrispondenti ieħor.<br>Meta ma japplika l-ebda wieħed minn dawk il-każijiet, l-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw valur espliċitu (NULL) bħala mhux applikabbli. |
| 0120 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | L-Artikolu 325m(1) u l-Artikolu 325ah (1) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Meta l-identifikatur tal-fattur tar-riskji magħżul fil-kolonna 0010 jikkorrispondi għall-klassi ta' riskju Riskju ta' firxiet tal-kreditu għan-nontitolizzazzjoni u l-komponent tar-riskju Delta tal-metodu bbażat fuq is-sensittivitajiet, it-tweġiba għandha tkun waħda mill-possibbiltajiet li ġejjin:<br>(a) "CQS 1";<br>(b) "CQS 2";<br>(c) "CQS 3";<br>(d) "CQS 4";<br>(e) "CQS 5";<br>(f) "CQS 6";<br>(g) "L-ebda CQS assenjat (mhux ikklassifikat)".<br>Meta ma japplika l-ebda wieħed minn dawk il-każijiet, l-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw valur espliċitu (NULL) bħala mhux applikabbli. |

**C 120.02 – SBM. KOMPOŻIZZJONI TAL-OFR SKONT IL-PORTAFOLL**

Struzzjonijiet rigward il-folji (sheets) (assi-z)

| Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|
| Portafoll | It-Taqsimiet 3, 4 u 5 tal-Anness V | Għandu jiġi rrapportat in-numru tal-portafoll meħud mill-Anness V. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0010 | Klassi ta' riskju | L-Artikolu 325d(1) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Il-klassi ta' riskju għandha tiġi rrapportata. It-tweġiba għandha tkun waħda minn dawn li ġejjin:<br>(a) "Riskju ġenerali taċ-ċaqliq fir-rata tal-imgħax (GIRR)";<br>(b) "Riskju ta' firxiet ta' kreditu. CSR għal nontitolizzazzjoni" (riskju ta' firxiet tal-kreditu (CSR) għal nontitolizzazzjoni);<br>(c) "Riskju ta' firxiet ta' kreditu. CSR Mhux ACTP" (riskju ta' firxiet tal-kreditu għal titolizzazzjoni mhux inkluża fil-portafoll kummerċjali ta' korrelazzjoni alternattiva (CSR mhux ACTP));<br>(d) "Riskju ta' firxiet ta' kreditu. CSR ACTP" (riskju ta' firxiet tal-kreditu għal titolizzazzjoni inkluża fil-portafoll kummerċjali ta' korrelazzjoni alternattiva (CSR ACTP));<br>(e) "Riskju ta' ekwità";<br>(f) "Riskju tal-komoditajiet";<br>(g) "Riskju tal-kambju". |
| 0020 | Komponent | L-Artikolu 325e(1) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Għandu jiġi rrapportat il-komponent tal-metodu bbażat fuq is-sensittivitajiet. It-tweġiba għandha tkun waħda minn dawn li ġejjin:<br>(a) "Riskju delta";<br>(b) "Riskju vega";<br>(c) "Riskju ta' kurvatura"; |
| 0030 | Xenarju tal-korrelazzjonijiet | L-Artikolu 325h tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Ix-xenarju tal-korrelazzjonijiet għandu jiġi rrapportat. It-tweġiba għandha tkun waħda minn dawn li ġejjin:<br>(a) "Xenarju ta' korrelazzjoni medja";<br>(b) "Xenarju ta' korrelazzjoni għolja";<br>(c) "Xenarju ta' korrelazzjoni baxxa". |
| 0040 | Rekwiżiti ta' fondi proprji (Riżultati tal-munita tar-rapportar) | L-Artikolu 325h tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Il-valuri tar-rekwiżiti ta' fondi proprji għandhom jiġu rrapportati għad-"data ta' referenza finali tal-RM (u l-ASA finali)" (kif speċifikat fit-Taqsima 1, il-punt (b), tal-Anness V ta' dan ir-Regolament) għal kull portafoll għall-kombinazzjonijiet rilevanti kollha tal-klassi tar-riskju, il-komponent u x-xenarju ta' korrelazzjoni. Il-valuri għandhom jiġu rrapportati fil-munita tar-rapportar tal-istituzzjoni u għandhom jiġu espressi bi preċiżjoni minima ta' żewġ punti deċimali. |
| 0050 | Munita tar-rapportar | | Il-munita tar-rapportar tal-istituzzjoni għandha tiġi rrapportata (il-valur irrapportat għandu jsegwi d-dežinjazzjoni tal-munita ISO 4217). |
| 0060 | Rekwiżiti ta' fondi proprji (Riżultati tal-munita tal-portafoll tal-EBA) | It-Taqsimiet 3 u 4 tal-Anness V ta' dan ir-Regolament u l-Artikolu 325h tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Il-valuri għandhom jiġu rrapportati skont l-istruzzjonijiet għall-kolonna 0040 iżda tradotti bir-rata tal-kambju spot tal-BĊE assoċjata mal-munita tal-portafoll kif definita fit-Taqsimiet 3 u 4 tal-Anness V ta' dan ir-Regolament. |
| 0070 | Pożizzjonijiet minghajr opzjonalità soġġetti għal rekwiżiti ta' fondi proprji ta' riskju ta' kurvatura | L-Artikolu 325e(3) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Meta l-komponent fil-kolonna 0020 jikkorrispondi għar-riskju ta' kurvatura:<br>(a) "VERU" għandha tiġi rrapportata jekk l-istituzzjoni tapplika l-approċċ stabbilit fl-Artikolu 325e(3), l-ewwel subparagrafu tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 fil-kalkolu tar-riżultat irrapportat fil-kolonni 0040 u 0060.<br>(b) Inkella għandha tiġi rrapportata "FALSE".<br>"FALZ" għandu jiġi rrapportat ukoll fejn ma japplika l-ebda wieħed minn dawk il-każijiet. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0080 | Approċċ ta' munita bażi applikat għar-riskju delta u ta' kurvatura tal-kambju | L-Artikolu 325q(7) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Meta l-klassi ta' riskju fil-kolonna 0010 tikkorrispondi għal riskju tal-kambju u l-komponent fil-kolonna 0020 jikkorrispondi għal riskju delta jew riskju tal-kurvatura:<br>(a) "VERU" għandha tiġi rrapportata jekk l-istituzzjoni tapplika l-approċċ stabbilit fl-Artikolu 325q(7) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 fil-kalkolu tar-riżultat irrapportat fil-kolonni 0040 u 0060.<br>(b) Inkella għandha tiġi rrapportata "FALZ".<br>"FALZ" għandu jiġi rrapportat ukoll fejn ma japplika l-ebda wieħed minn dawk il-każijiet. |
| 0090 | Diviżjoni tal-komponenti tar-riskju ta' kurvatura għar-riskju tal-kambju skont l-iskalar | L-Artikolu 325q(6) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Meta l-klassi ta' riskju fil-kolonna 0010 tikkorrispondi għal riskju tal-kambju u l-komponent fil-kolonna 0020 jikkorrispondi għal riskju tal-kurvatura:<br>(a) "VERU" għandha tiġi rrapportata jekk l-istituzzjoni tapplika l-approċċ stabbilit fl-Artikolu 325q(6) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 fil-kalkolu tar-riżultat irrapportat fil-kolonni 0040 u 0060.<br>(b) Inkella għandha tiġi rrapportata "FALZ".<br>"FALZ" għandu jiġi rrapportat ukoll fejn ma japplika l-ebda wieħed minn dawk il-każijiet. |
| 0095 | Sottomissjoni tar-riżultati tal-portafoll ta' validazzjoni tal-SBM | L-Artikolu 325e(1) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Meta l-portafoll li għalih tiġi rrapportata l-informazzjoni jkun portafoll ta' validazzjoni tal-SBM kif imsemmi fit-Taqsima 7 tal-Anness V:<br>(a) "Sottomessi" għandha tiġi rrapportata jekk l-istituzzjoni tissottometti riżultati li jikkorrispondu għal dan il-portafoll;<br>(b) "Mhux sottomessi - l-ebda skopertura għall-fattur tar-riskju" għandha tiġi rrapportata jekk l-istituzzjoni tagħżel li ma tissottomettix riżultati għall-portafoll ta' validazzjoni tal-SBM rilevanti, peress li ma hemm l-ebda approvazzjoni interna mill-maniġment ta' dik l-istituzzjoni sabiex topera fi strumenti li jiġġeneraw skopertura lejn il-fattur ta' riskju rilevanti.<br>"Mhux applikabbli" għandha tiġi rrapportata meta l-portafoll li għalih tiġi rrapportata l-informazzjoni jkun portafoll kif imsemmi fit-Taqsimiet 3, 4 jew 5 tal-Anness V. |
| 0100 | Kaxxa għal test liberu | | Istituzzjoni tista' tagħti kwalunkwe informazzjoni addizzjonali f'din il-kolonna. |

**C 120.04 — DRC. VALURI TAS-SUQ U AMMONTI GROSSI TA' JTD SKONT L-ISTRUMENT/PORTAFOLL**

L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw, strument bi strument, l-iskoperturi li jikkorrispondu għall-istrument. Għandha tiġi rrapportata ringiela waħda għal kull skopertura. Il-valuri kollha għandhom jirreferu għad-"data ta' referenza finali tal-RM (u tal-ASA finali)" (kif definit fit-Taqsima 1, il-punt (b)(v), tal-Anness V ta' dan ir-Regolament). L-iskoperturi għandhom jiġu rrapportati qabel ma tkun seħħet kwalunkwe tpaċija iżda wara l-passi tar-replikazzjoni jew tat-tqassim (kif definit fl-Artikoli 325z u 325ac tar-Regolament (UE) Nru 575/2013), fejn applikabbli.

Struzzjonijiet rigward il-folji (sheets) (assi-z)

| Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|
| Portafoll | It-Taqsimiet 3, 4 u 5 tal-Anness V | Għandu jiġi rrapportat in-numru tal-portafoll meħud mill-Anness V. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0010 | Numru tal-istrument | It-Taqsima 2 tal-Anness V | Għandu jiġi rrapportat in-numru tal-istrument meħud mill-Anness V. |
| 0020 | Klassi ta' riskju | L-Artikolu 325v(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Għandha tiġi rrapportata l-klassi ta' riskju li għaliha r-rekwiżit tar-riskju ta' inadempjenza (DRC, Default Risk Requirement) huwa rrapportat fil-kolonni 0030 u 0040. It-tweġiba għandha tkun waħda minn dawn it-tipi ta' strumenti li ġejjin:<br>(a) "Strumenti għajr pożizzjonijiet ta' titolizzazzjoni";<br>(b) "Pożizzjonijiet ta' titolizzazzjoni li mhumiex inklużi fl-ACTP";<br>(c) "Pożizzjonijiet ta' Titolizzazzjoni li huma inklużi fl-ACTP'. |
| 0030 | Bucket1 | Artikolu 325y(3), Artikolu 325aa(4) u Artikolu 325ad(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Għandu jiġi rrapportat il-bucket.<br>Meta l-klassi ta' riskju rrapportata fil-kolonna 0020 tikkorrispondi għal "nontitolizzazzjonijiet", it-tweġiba għandha tkun waħda minn dawn li ġejjin:<br>(a) "Korporazzjonijiet";<br>(b) "Sovrani";<br>(c) "Gvernijiet lokali/muniċipalitajiet".<br>Minflok, meta l-klassi ta' riskju rrapportata fil-kolonna 0020 tikkorrispondi għal "titolizzazzjonijiet li mhumiex inklużi fl-ACTP", it-tweġiba għandha tkun (a) hawn jew waħda minn dawn li ġejjin:<br>(d) "ABCP - L-Asja";<br>(e) "ABCP - L-Ewropa";<br>(f) "ABCP - L-Amerka ta' Fuq";<br>(g) "ABCP - Il-bqija tad-dinja";<br>(h) "Self/lokazzjonijiet għal karozzi - L-Asja";<br>(i) "Self/lokazzjonijiet għal karozzi - L-Ewropa";<br>(j) "Self/lokazzjonijiet għal karozzi - L-Amerka ta' Fuq";<br>(k) "Self/lokazzjonijiet għal karozzi - Il-bqija tad-dinja";<br>(l) "Obbligi kollateralizzati ta' dejn kwadrati (CDO kwadrati) - L-Asja";<br>(m) "Obbligi ta' dejn kollateralizzat kwadrati (CDO kwadrati) - l-Ewropa";<br>(n) "Obbligi ta' dejn kollateralizzat kwadrati (CDO kwadrati) - l-Amerka ta' Fuq";<br>(o) "Obbligi ta' dejn kollateralizzat kwadrati (CDO kwadrati) - Il-bqija tad-dinja";<br>(p) "Obbligi ta' self kollateralizzat - l-Asja";<br>(q) "Obbligi ta' self kollateralizzat - l-Ewropa";<br>(r) "Obbligi ta' self kollateralizzat - l-Amerka ta' Fuq";<br>(s) "Obbligi ta' self kollateralizzat - Il-bqija tad-dinja";<br>(t) "Titoli abbażi ta' ipoteki kummerċjali (CMBS, commercial mortgage-backed securities) - l-Asja";<br>(u) "Titoli abbażi ta' ipoteki kummerċjali (CMBS) - Ewropa";<br>(v) "Titoli abbażi ta' ipoteki kummerċjali (CMBS) - l-Amerka ta' Fuq";<br>(w) "Titoli abbażi ta' ipoteki kummerċjali (CMBS) - Il-bqija tad-dinja";<br>(x) "Karti ta' kreditu - l-Asja";<br>(y) "Karti ta' kreditu - l-Ewropa";<br>(z) "Karti ta' kreditu - l-Amerka ta' Fuq";<br>(aa) "Karti ta' kreditu - Il-bqija tad-dinja";<br>(bb) "Bejgħ bl-imnut ieħor - l-Asja";<br>(cc) "Bejgħ bl-imnut ieħor - l-Ewropa";<br>(dd) "Bejgħ bl-imnut ieħor - l-Amerka ta' Fuq"; |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| | | | (ee) "Bejgħ bl-imnut ieħor - Il-bqija tad-dinja";<br>(ff) "Bejgħ bl-ingrossa ieħor - l-Asja";<br>(gg) "Bejgħ bl-ingrossa ieħor - l-Ewropa";<br>(hh) "Bejgħ bl-ingrossa ieħor - l-Amerka ta' Fuq";<br>(ii) "Bejgħ bl-ingrossa ieħor - Il-bqija tad-dinja";<br>(jj) "Titoli abbażi ta' ipoteki residenzjali (RMBS, residential mortgage-backed securities) - l-Asja";<br>(kk) "Titoli abbażi ta' ipoteki residenzjali (RMBS) - l-Ewropa";<br>(ll) "Titoli abbażi ta' ipoteki residenzjali (RMBS) - l-Amerka ta' Fuq";<br>(mm) "Titoli abbażi ta' ipoteki residenzjali (RMBS) - Il-bqija tad-dinja";<br>(nn) "Intrapriżi żgħar u ta' daqs medju (SMEs, small and medium-sized enterprises) - l-Asja";<br>(oo) "Intrapriżi żgħar u ta' daqs medju (SMEs) - l-Ewropa";<br>(pp) "Intrapriżi żgħar u ta' daqs medju (SMEs) - l-Amerka ta' Fuq";<br>(qq) "Intrapriżi żgħar u ta' daqs medju (SMEs) - Il-bqija tad-dinja";<br>(rr) "Self lill-istudenti - l-Asja";<br>(ss) "Self lill-istudenti - l-Ewropa";<br>(tt) "Self lill-istudenti - l-Amerka ta' Fuq";<br>(uu) "Self lill-istudenti - Il-bqija tad-dinja".<br><br>Minflok, meta l-klassi ta' riskju rrapportata fil-kolonna 0020 tikkorrispondi għal "titolizzazzjonijiet li huma inklużi fl-ACTP", it-tweġiba għandha tkun "titolizzazzjonijiet li huma inklużi fl-ACTP" |
| 0040 | Bucket2 | L-Artikolu 325ad(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Meta l-klassi ta' riskju rrapportata fil-kolonna 0020 tikkorrispondi għal "titolizzazzjonijiet li huma inklużi fl-ACTP", it-tweġiba għandha tkun l-isem tal-indiċi, inkella għandu jiġi rapportat (NUL). |
| 0050 | Obbligant | L-Artikolu 325v(2), l-Artikolu 325x(1), u l-Artikoli 325z u 325ac tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw informazzjoni relatata mal-obbligant. Meta l-klassi ta' riskju rrapportata fil-kolonna 0020 tikkorrispondi għal:<br>— "Strumenti għajr pożizzjonijiet ta' titolizzazzjoni", it-tweġiba għandha tkun isem l-obbligant;<br>— "pożizzjonijiet ta' titolizzazzjoni li mhumiex inklużi fl-ACTP", it-tweġiba għandha tkun isem l-obbligant jew identifikatur uniku li jindika l-aggregazzjoni tal-assi sottostanti u s-segment;<br>— "pożizzjonijiet ta' titolizzazzjoni li huma inklużi fl-ACTP", it-tweġiba għandha tkun identifikatur uniku li jindika l-familja, is-serje u s-segment tal-indiċi. |
| 0060 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | L-Artikolu 325y(1) u (2), l-Artikolu 325aa(1) u l-Artikolu 325ad(1) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw il-kwalità tal-kreditu. It-tweġiba għandha tkun waħda minn dawn li ġejjin:<br>(a) "CQS 1";<br>(b) "CQS 2";<br>(c) "CQS 3";<br>(d) "CQS 4";<br>(e) "CQS 5";<br>(f) "CQS 6";<br>(g) "L-ebda CQS assenjat (mhux ikklassifikat)"; |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| | | | (h) “L-ebda CQS assenjat (inadempjenti)”;<br>(i) “L-ebda CQS assenjata (ponderazzjoni tar-riskju ta’ 0 %”).<br><br>Meta l-klassi ta’ riskju rrapportata fil-kolonna 0020 tikkorrispondi għal “titolizzazzjonijiet li huma inklużi fl-ACTP” jew “Titolizzazzjonijiet li mhumiex inklużi fl-ACTP”, it-tweġiba għandha tkun waħda minn dawn li ġejjin:<br><br>(j) “CQS 7”;<br>(k) “CQS 8”;<br>(l) “CQS 9”;<br>(m) “CQS 10”;<br>(n) “CQS 11”;<br>(o) “CQS 12”;<br>(p) “CQS 13”;<br>(q) “CQS 14”;<br>(r) “CQS 15”;<br>(s) “CQS 16”;<br>(t) “CQS 17”;<br>(u) “CQS l-Oħrajn Kollha”; |
| 0070 | Piż tar-riskju ta’ inadempjenza | L-Artikolu 325v(1), il-punt (f), l-Artikolu 325y(1) u (2), l-Artikolu 325aa(1) u l-Artikolu 325ad(1) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw il-ponderazzjoni tar-riskju rilevanti. Il-piżijiet tar-riskju applikati għal skoperturi ta’ titolizzazzjoni għandhom jiġu rrapportati wara l-multiplikazzjoni bi 8 % f’konformità mal-Artikolu 325aa(1) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. |
| 0080 | Maturazzjoni | L-Artikolu 325w(3) u (6) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Għandha tiġi rrapportata s-superjorità tal-iskopertura. Meta l-klassi ta’ riskju rrapportata fil-kolonna 0020 tikkorrispondi għal “Strumenti għajr pożizzjonijiet ta’ titolizzazzjoni” jew “pożizzjonijiet ta’ titolizzazzjoni li mhumiex inklużi fl-ACTP”, it-tweġiba għandha tkun waħda minn dawn li ġejjin:<br><br>(a) “Strumenti ta’ ekwità”;<br>(b) “Strumenti ta’ dejn mhux superjuri”;<br>(c) “Strumenti ta’ dejn superjuri”;<br>(d) “Bonds koperti”.<br><br>Il-kaxxa għandha titħalla vojta fejn ma japplika l-ebda wieħed minn dawk il-każijiet. |
| 0090 | Maturità | L-Artikoli 325x, 325z u 325ac tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Għandha tiġi rrapportata d-data ta’ maturità tal-iskopertura. L-istruttura “jj/xx/ssss” għandha tiġi adottata fir-rapportar tad-data. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0100 | Rata ta' rkupru | L-Artikolu 325v(1), il-punt (e), tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw ir-rata ta' rkupru. Ir-rata ta' rkupru għandha tiġi kkalkolata bl-użu tat-telf fil-każ ta' inadempjenza (LGD, loss given default) applikabbli bħala rata ta' rkupru = 1 - LGD.<br>Ir-rata ta' rkupru rrapportata għandha tiġi espressa bħala valur deċimali, bejn 0 u 1, bi preċiżjoni minima ta' erba' pożizzjonijiet deċimali. |
| 0110 | Direzzjoni | L-Artikolu 325v(1), il-punti (a) u (b), tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw id-direzzjoni tal-iskopertura f'konformità mad-definizzjonijiet tal-Artikolu325v(1), il-punti (a) u (b), tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. It-tweġiba għandha tkun waħda minn dawn li ġejjin:<br>(a) "Skopertura qasira";<br>(b) "Skopertura twila". |
| 0120 | Punt ta' attakkament (%) | L-Artikoli 325aa u 325ad tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Meta l-iskopertura rrapportata tirreferi għal segment, l-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw il-punt ta' attakkament tas-segment.<br>Iċ-ċifra rrapportata għandha tiġi espressa bħala deċimali bi preċiżjoni minima ta' erba' pożizzjonijiet deċimali. |
| 0130 | Punt ta' distakkament (%) | L-Artikoli 325aa u 325ad tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Meta l-iskopertura rrapportata tirreferi għal segment, l-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw il-punt ta' distakkament tas-segment.<br>Iċ-ċifra rrapportata għandha tiġi espressa bħala deċimali bi preċiżjoni minima ta' erba' pożizzjonijiet deċimali. |
| 0140-0170 | Rapportar tar-riżultati tal-munita | | Il-valuri għandhom jiġu rrapportati b'referenza għall-munita tar-rapportar tal-istituzzjoni u għandhom jiġu espressi bi preċiżjoni minima ta' żewġ punti deċimali fejn applikabbli. |
| 0140 | Nozzjonali | L-Artikolu 325w(1), (2) u (5) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Meta l-klassi ta' riskju rapportata fil-kolonna 0020 tikkorrispondi għal "Strumenti għajr pożizzjonijiet ta' titolizzazzjoni", l-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw l-ammont nozzjonali tal-istrument. Il-valur għandu jikkorrispondi għat-terminu $V_{nozzjonali}$ fl-Artikolu 325w(1) u (2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 jew it-terminu V fl-Artikolu 325w(5) ta' dak ir-Regolament, skont it-tip ta' skopertura.<br>Din iċ-ċellola għandha titħalla vojta meta ma japplika l-ebda wieħed minn dawk il-każijiet jew meta l-istituzzjoni ma tikkalkulax jew ma tużax b'mod espliċitu l-ammont li għandu jiġi rrapportat f'din il-kolonna sabiex jiġi stmat l-ammont gross ta' inadempjenza immedjata u mhux mistennija (JTD, jump-to-default). |
| 0150 | P&L + Aġġustament | L-Artikolu 325w(1), (2) u (5) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw it-total tal-P&L u l-Aġġustament għal kull skopertura:<br>— Meta l-klassi ta' riskju rrapportata fil-kolonna 0020 tikkorrispondi għal "Strumenti għajr pożizzjonijiet ta' titolizzazzjoni" u l-iskopertura rrapportata tkun skopertura twila, l-istituzzjonijiet jirrapportaw is-somma ta' $P\&L_{twil}$ u $Aġġustament_{twil}$ skont l-Artikolu 325w(1) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.<br>— Meta l-klassi ta' riskju rrapportata fil-kolonna 0020 tikkorrispondi għal "Strumenti għajr pożizzjonijiet ta' titolizzazzjoni" u l-iskopertura rrapportata tkun skopertura qasira, l-istituzzjonijiet jirrapportaw is-somma ta'$P\&L_{qasir}$ and $Aġġustament_{qasir}$ skont l-Artikolu 325w(2) ta' dak ir-Regolament. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| | | | Din iċ-ċellola għandha titħalla vojta meta ma japplika l-ebda wieħed minn dawk il-każijiet jew meta l-istituzzjoni ma tikkalkulax jew ma tużax b'mod espliċitu l-ammont li għandu jiġi rrapportat f'din il-kolonna sabiex jiġi stmat l-ammont gross ta' JTD. |
| 0160 | Ammont gross ta' JTD | L-Artikolu 325v(1), il-punt (c), l-Artikolu 325w(1), (2) u (5), l-Artikolu 325z(1) u l-Artikolu 325ac(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw l-ammont gross ta' JTD għall-iskopertura speċifika. |
| 0170 | Munita | | Il-munita tar-rapportar tal-istituzzjoni għandha tiġi rrapportata (il-valur irrapportat għandu jsegwi d-dežinjazzjoni tal-munita ISO 4217). |
| 0180-0200 | Ir-riżultati tal-munita tal-portafoll tal-EBA | It-Taqsimiet 3 u 4 tal-Anness V ta' dan ir-Regolament u l-Artikoli 325y, 325aa u 325ad tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Il-valuri għandhom jiġu rrapportati skont l-istruzzjonijiet għall-kolonna 0030 iżda tradotti bir-rata tal-kambju spot tal-BĊE assoċjata mal-munita tal-portafoll kif definita fit-Taqsimiet 3 u 4 tal-Anness V ta' dan ir-Regolament. |
| 0180 | Nozzjonali | L-Artikolu 325w(1), (2) u (5) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Meta l-klassi ta' riskju rapportata fil-kolonna 0020 tikkorrispondi għal "Strumenti għajr pożizzjonijiet ta' titolizzazzjoni", l-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw l-ammont nozzjonali tal-istrument. Il-valur għandu jikkorrispondi għat-terminu $V_{nozzjonali}$ fl-Artikolu 325w(1) u (2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 jew it-terminu V fl-Artikolu 325w(5) ta' dak ir-Regolament, skont it-tip ta' skopertura.<br>Din iċ-ċellola għandha titħalla vojta meta ma japplika l-ebda wieħed minn dawk il-każijiet jew meta l-istituzzjoni ma tikkalkulax jew ma tużax b'mod espliċitu l-ammont li għandu jiġi rrapportat f'din il-kolonna sabiex jiġi stmat l-ammont gross ta' JTD. |
| 0190 | P&L + Aġġustament | L-Artikolu 325w(1), (2) u (5) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw it-total tal-P&L u l-Aġġustament għal kull skopertura:<br>— Meta l-klassi ta' riskju rrapportata fil-kolonna 0020 tikkorrispondi għal "Strumenti għajr pożizzjonijiet ta' titolizzazzjoni" u l-iskopertura rrapportata tkun skopertura twila, l-istituzzjonijiet jirrapportaw is-somma ta' $P\&L_{twil}$ u $Aġġustament_{twil}$ skont l-Artikolu 325w(1) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013.<br>— Meta l-klassi ta' riskju rrapportata fil-kolonna 0020 tikkorrispondi għal "Strumenti għajr pożizzjonijiet ta' titolizzazzjoni" u l-iskopertura rrapportata tkun skopertura qasira, l-istituzzjonijiet jirrapportaw is-somma ta'$P\&L_{qasir}$ and $Aġġustament_{qasir}$ skont l-Artikolu 325w(2) ta' dak ir-Regolament. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| | | | Din iċ-ċellola għandha titħalla vojta meta ma japplika l-ebda wieħed minn dawk il-każijiet jew meta l-istituzzjoni ma tikkalkulax jew ma tużax b'mod espliċitu l-ammont li għandu jiġi rrapportat f'din il-kolonna sabiex jiġi stmat l-ammont gross ta' JTD. |
| 0200 | Ammont Gross ta' JTD | L-Artikolu 325v(1), il-punt (c), l-Artikolu 325w(1), (2) u (5), l-Artikolu 325z(1) u l-Artikolu 325ac(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | L-istituzzjonijiet għandhom jirrapportaw l-ammont gross ta' inadempjenza immedjata u mhux mistennija (JTD) għall-iskopertura speċifika. |

**C 120.05 — DRC. KOMPOŻIZZJONI TAL-OFR SKONT IL-PORTAFOLL**

Struzzjonijiet rigward il-folji (sheets) (assi-z)

| Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|
| Portafoll | It-Taqsimiet 3, 4 u 5 tal-Anness V | Għandu jiġi rrapportat in-numru tal-portafoll meħud mill-Anness V. |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0010 | Klassi ta' riskju | L-Artikolu 325v(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Għandha tiġi rrapportata l-klassi ta' riskju li għaliha r-rekwiżit tar-riskju ta' inadempjenza huwa rrapportat fil-kolonni 0030 u 0040. It-tweġiba għandha tkun waħda minn dawn it-tipi ta' strumenti li ġejjin:<br>(a) "strumenti għajr pożizzjonijiet ta' titolizzazzjoni";<br>(b) "pożizzjonijiet ta' titolizzazzjoni li mhumiex inklużi fl-ACTP";<br>(c) "pożizzjoni ta' titolizzazzjoni li huma inklużi fl-ACTP'. |
| 0020 | Bucket1 | L-Artikolu 325y(3), l-Artikolu 325aa(4) u l-Artikolu 325ad(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Għandu jiġi rrapportat il-bucket.<br>Meta l-klassi ta' riskju rrapportata fil-kolonna 0010 tikkorrispondi għal "Strumenti għajr pożizzjonijiet ta' titolizzazzjoni", it-tweġiba għandha tkun waħda minn dawn li ġejjin:<br>(a) "korporazzjonijiet";<br>(b) "sovrani";<br>(c) "gvernijiet lokali/muniċipalitajiet". |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| | | | Minflok, meta l-klassi ta' riskju rrapportata fil-kolonna 0010 tikkorrispondi għal "pożizzjonijiet ta' titolizzazzjoni li mhumiex inklużi fl-ACTP", it-tweġiba għandha tkun waħda minn dawn li ġejjin:<br>(d) "ABCP - l-Asja";<br>(e) "ABCP - l-Ewropa";<br>(f) "ABCP - l-Amerka ta' Fuq";<br>(g) "ABCP - Il-bqija tad-dinja";<br>(h) "Self/lokazzjonijiet għal karozzi - l-Asja";<br>(i) "Self/lokazzjonijiet għal karozzi - l-Ewropa";<br>(j) "Self/lokazzjonijiet għal karozzi - l-Amerka ta' Fuq";<br>(k) "Self/lokazzjonijiet għal karozzi - Il-bqija tad-dinja";<br>(l) "Obbligi ta' dejn kollateralizzat kwadrati (CDO kwadrat) - l-Asja";<br>(m) "Obbligi ta' dejn kollateralizzat kwadrati (CDO kwadrati) - l-Ewropa";<br>(n) "Obbligi ta' dejn kollateralizzat kwadrati (CDO kwadrati) - l-Amerka ta' Fuq";<br>(o) "Obbligi ta' dejn kollateralizzat kwadrati (CDO kwadrati) - Il-bqija tad-dinja";<br>(p) "Obbligi ta' self kollateralizzat - l-Asja";<br>(q) "Obbligi kollateralizzati ta' self - L-Ewropa";<br>(r) "Obbligi kollateralizzati ta' self - L-Amerka ta' Fuq";<br>(s) "Obbligi kollateralizzati ta' self - Il-bqija tad-dinja";<br>(t) "Titoli abbażi ta' ipoteki kummerċjali (CMBS) - L-Asja";<br>(u) "Titoli abbażi ta' ipoteki kummerċjali (CMBS) - L-Ewropa";<br>(v) "Titoli abbażi ta' ipoteki kummerċjali (CMBS) - L-Amerka ta' Fuq";<br>(w) "Titoli abbażi ta' ipoteki kummerċjali (CMBS) - Il-bqija tad-dinja";<br>(x) "Karti ta' kreditu - L-Asja";<br>(y) "Karti ta' kreditu - L-Ewropa";<br>(z) "Karti ta' kreditu - l-Amerka ta' Fuq";<br>(aa) "Karti ta' kreditu - Il-bqija tad-dinja";<br>(bb) "Bejgħ bl-imnut ieħor - l-Asja";<br>(cc) "Bejgħ bl-imnut ieħor - l-Ewropa";<br>(dd) "Bejgħ bl-imnut ieħor - l-Amerka ta' Fuq";<br>(ee) "Bejgħ bl-imnut ieħor - Il-bqija tad-dinja";<br>(ff) "Bejgħ bl-ingrossa ieħor - l-Asja";<br>(gg) "Bejgħ bl-ingrossa ieħor - l-Ewropa";<br>(hh) "Bejgħ bl-ingrossa ieħor - l-Amerka ta' Fuq";<br>(ii) "Bejgħ bl-ingrossa ieħor - Il-bqija tad-dinja";<br>(jj) "Titoli abbażi ta' ipoteki residenzjali (RMBS) - L-Asja";<br>(kk) "Titoli abbażi ta' ipoteki residenzjali (RMBS) - L-Ewropa";<br>(ll) "Titoli abbażi ta' ipoteki residenzjali (RMBS) - L-Amerka ta' Fuq";<br>(mm) "Titoli abbażi ta' ipoteki residenzjali (RMBS) - Il-bqija tad-dinja";<br>(nn) "Intrapriżi żgħar u ta' daqs medju (SMEs) - l-Asja";<br>(oo) "Intrapriżi żgħar u ta' daqs medju (SMEs) - l-Ewropa";<br>(pp) "Intrapriżi żgħar u ta' daqs medju (SMEs) - l-Amerka ta' Fuq";<br>(qq) "Intrapriżi żgħar u ta' daqs medju (SMEs) - Il-bqija tad-dinja";<br>(rr) "Self lill-istudenti - l-Asja"; |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| | | | (ss) "Self lill-istudenti - l-Ewropa";<br>(tt) "Self lill-istudenti - l-Amerka ta' Fuq";<br>(uu) "Self lill-istudenti - Il-bqija tad-dinja".<br>Minflok, meta l-klassi ta' riskju rrapportata fil-kolonna 0010 tikkorrispondi għal "pożizzjonijiet ta' titolizzazzjoni li huma inklużi fl-ACTP", it-tweġiba għandha tkun "titolizzazzjonijiet li huma inklużi fl-ACTP" |
| 0030 | Bucket2 | L-Artikolu 325ad(2) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Meta l-klassi ta' riskju rrapportata fil-kolonna 0010 tikkorrispondi għal "pożizzjonijiet ta' titolizzazzjoni li huma inklużi fl-ACTP", it-tweġiba għandha tkun l-isem tal-indiċi, inkella għandu jitħalla (NUL). |
| 0040 | Rekwiżiti ta' fondi proprji (Riżultati tal-munita tar-rapportar) | L-Artikoli 325y, 325aa u 325ad tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Ir-rekwiżiti ta' fondi proprji għar-riskju ta' inadempjenza għandhom jiġu rrapportati għad-"data ta' referenza finali tal-RM (u l-ASA finali)" (kif speċifikat fit-Taqsima 1, il-punt (b), tal-Anness V ta' dan ir-Regolament). Il-valuri għandhom jiġu rrapportati fil-munita tar-rapportar tal-istituzzjoni u għandhom jiġu espressi bi preċiżjoni minima ta' żewġ punti deċimali. |
| 0050 | Munita tar-rapportar | | Il-munita tar-rapportar tal-istituzzjoni għandha tiġi rrapportata (il-valur irrapportat għandu jsegwi d-dežinjazzjoni tal-munita ISO 4217). |
| 0060 | Rekwiżiti ta' fondi proprji (Riżultati tal-munita tal-portafoll tal-EBA) | It-Taqsimiet 3 u 4 tal-Anness V ta' dan ir-Regolament u l-Artikoli 325y, 325aa u 325ad tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Il-valuri għandhom jiġu rrapportati skont l-istruzzjonijiet għall-kolonna 0030 iżda tradotti bir-rata tal-kambju spot tal-BĊE assoċjata mal-munita tal-portafoll kif definita fit-Taqsimiet 3 u 4 tal-Anness V ta' dan ir-Regolament. |

**C 120.06 – ASA. OFR**

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0010 | Numru tal-portafoll | It-Taqsimiet 3, 4 u 5 tal-Anness V | Għandu jiġi rrapportat in-numru tal-portafoll meħud mill-Anness V. |
| 0020-0040 | Rapportar tar-riżultati tal-munita | It-Taqsimiet 3 u 4 tal-Anness V | |

| Kolonna | Tikketta | Referenza legali | Struzzjonijiet |
|---|---|---|---|
| 0020 | SBM OFR | L-Artikolu 325h tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Ir-rekwiżiti ta' fondi proprji għall-metodu bbażat fuq is-sensittivitajiet tal-approċċ standardizzat alternattiv għandhom jiġu rrapportati għad-"data ta' referenza finali tal-RM (u l-ASA finali)" (kif speċifikat fit-Taqsima 1, il-punt (b), tal-Anness V ta' dan ir-Regolament) għal kull portafoll. |
| 0030 | DRC OFR | L-Artikolu 325v tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Ir-rekwiżiti ta' fondi proprji għar-rekwiżit tar-riskju ta' inadempjenza tal-approċċ standardizzat alternattiv għandhom jiġu rrapportati għad-"data ta' referenza finali tal-RM (u l-ASA finali)" (kif speċifikat fit-Taqsima 1, il-punt (b), tal-Anness V ta' dan ir-Regolament) għal kull portafoll. |
| 0040 | RRAO OFR | L-Artikolu 325u tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Ir-rekwiżiti ta' fondi proprji għaż-żieda tar-riskju residwu tal-approċċ standardizzat alternattiv għandhom jiġu rrapportati għad-"data ta' referenza finali tal-RM (u l-ASA finali)" (kif speċifikat fit-Taqsima 1, il-punt (b), tal-Anness V ta' dan ir-Regolament) għal kull portafoll. |
| 0050-0070 | Ir-riżultati tal-munita tal-portafoll tal-EBA | It-Taqsimiet 3 u 4 tal-Anness V | Meta l-munita tar-rapportar tal-istituzzjoni tkun differenti mill-muniti tal-portafoll tal-EBA speċifikati fit-Taqsimiet 3 u 4 tal-Anness V, l-istituzzjonijiet għandhom jikkonvertu l-munita tar-rapportar bir-rata tal-kambju spot applikabbli tal-BĊE. |
| 0050 | SBM OFR | L-Artikolu 325h tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Ir-rekwiżiti ta' fondi proprji għall-metodu bbażat fuq is-sensittivitajiet tal-approċċ standardizzat alternattiv għandhom jiġu rrapportati għad-"data ta' referenza finali tal-RM (u l-ASA finali)" (kif speċifikat fit-Taqsima 1, il-punt (b), tal-Anness V ta' dan ir-Regolament) għal kull portafoll. |
| 0060 | DRC OFR | L-Artikolu 325v tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Ir-rekwiżiti ta' fondi proprji għar-rekwiżit tar-riskju ta' inadempjenza tal-approċċ standardizzat alternattiv għandhom jiġu rrapportati għad-"data ta' referenza finali tal-RM (u l-ASA finali)" (kif speċifikat fit-Taqsima 1, il-punt (b), tal-Anness V ta' dan ir-Regolament) għal kull portafoll. |
| 0070 | RRAO OFR | Artikolu 325u tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 | Ir-rekwiżiti ta' fondi proprji għaż-żieda tar-riskju residwu tal-approċċ standardizzat alternattiv għandhom jiġu rrapportati għad-"data ta' referenza finali tal-RM (u l-ASA finali)" (kif speċifikat fit-Taqsima 1, il-punt (b), tal-Anness V ta' dan ir-Regolament) għal kull portafoll. |

**Tabella: gwida għar-rapportar tal-Formoli 106.01 (il-kolonna 0010) u 120.01 (il-kolonna 0020)**

— Il-kolonna "klassi ta' riskju" tirreferi għall-Artikolu 325d(1) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. L-akronimi li ġejjin jintużaw sabiex jindikaw il-klassijiet ta' riskju:

(a) "GIRR" (riskju ġenerali taċ-ċaqliq fir-rata tal-imgħax);

(b) "CSR_NON_SEC" (riskju ta' firxiet tal-kreditu (CSR) għal nontitolizzazzjoni);

(c) "CSR_SEC_NON_ACTP" (riskju ta' firxiet tal-kreditu għal titolizzazzjoni mhux inkluża fil-portafoll tan-negozjar ta' korrelazzjoni alternattiva (non-ACTP CSR));

(d) "CSR_SEC_ACTP" (riskju ta' firxiet tal-kreditu għal titolizzazzjoni inkluża fil-portafoll tan-negozjar ta' korrelazzjoni alternattiva (ACTP CSR));

(e) "EQ" (riskju ta' ekwità, equity risk);

(f) "CM" (riskju tal-komoditajiet, commodity risk);

(g) "FX" (riskju tal-kambju).

— Il-kolonna "komponent" tirreferi għall-Artikolu 325e(1) tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. L-akronimi li ġejjin jintużaw sabiex jindikaw il-komponenti tal-metodu bbażat fuq is-sensittivitajiet:

(a) "DELTA" (riskju delta);

(b) "VEGA" (riskju vega);

(c) "KURVATURA" (riskju ta' kurvatura).

— Il-kolonna "maturità" tirreferi għall-maturità tal-fattur ta' riskju, fejn il-fatturi ta' riskju huma definiti skont il-punti speċifikati skont l-Artikoli 325l, 325m, 325n, 325o, 325p u 325q tar-Regolament (UE) Nru 575/2013. Għall-fatturi ta' riskju ġenerali taċ-ċaqliq fir-rata tal-imgħax vega kif speċifikat fl-Artikolu 325l(7) ta' dak ir-Regolament jingħataw żewġ maturitajiet u jiġu separati permezz ta' sing (eż. "0.5 snin - 0.5 snin"), l-ewwel waħda tirreferi għall-maturità tal-opzjoni u t-tieni għall-maturità residwa tal-assi sottostanti tal-opzjoni fid-data ta' skadenza tal-opzjoni.

— Il-kolonna "speċifikazzjonijiet addizzjonali" tispeċifika wkoll il-fattur tar-riskju rispettiv fir-rigward tad-distinzjoni bejn ir-riskju tal-inflazzjoni u l-fatturi tar-riskju bażi bejn il-muniti skont l-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013, id-distinzjoni bejn il-fatturi tar-riskju relatati mal-istrumenti tad-dejn u l-fatturi tar-riskju relatati ma' swaps ta' inadempjenza tal-kreditu skont l-Artikoli 325m u 325n ta' dak ir-Regolament, id-distinzjoni bejn il-prezz spot tal-ekwità u l-fatturi tar-riskju għar-rata repo tal-ekwità skont l-Artikolu 325o ta' dak ir-Regolament u d-distinzjoni bejn ir-riskju 'l fuq għall-pożizzjoni ta' kurvatura nnettjat ta' dak il-fattur ta' riskju (CVRk+) jew ir-riskju 'l isfel għall-pożizzjoni ta' kurvatura nnettjat ta' dak il-fattur ta' riskju (CVRk-) kif speċifikat fl-Artikolu 325g ta' dak ir-Regolament.

| Klassi ta' riskju | Komponent | Maturità | Speċifikazzjoni addizzjonali | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Referenza legali |
|---|---|---|---|---|---|
| CM | DELTA | 0 snin | | CM_D_00.00 | L-Artikolu 325p tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CM | DELTA | 0,25 snin | | CM_D_00.25 | L-Artikolu 325p tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CM | DELTA | 0,5 snin | | CM_D_00.50 | L-Artikolu 325p tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CM | DELTA | Sena (1) | | CM_D_01.00 | L-Artikolu 325p tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CM | DELTA | Sentejn | | CM_D_02.00 | L-Artikolu 325p tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CM | DELTA | 3 snin | | CM_D_03.00 | L-Artikolu 325p tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CM | DELTA | 5 snin | | CM_D_05.00 | L-Artikolu 325p tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CM | DELTA | 10 snin | | CM_D_10.00 | L-Artikolu 325p tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CM | DELTA | 15 snin | | CM_D_15.00 | L-Artikolu 325p tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CM | DELTA | 20 snin | | CM_D_20.00 | L-Artikolu 325p tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CM | DELTA | 30 snin | | CM_D_30.00 | L-Artikolu 325p tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CM | VEGA | 0,5 snin | | CM_V_00.50 | L-Artikolu 325p tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CM | VEGA | Sena (1) | | CM_V_01.00 | L-Artikolu 325p tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CM | VEGA | 3 snin | | CM_V_03.00 | L-Artikolu 325p tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CM | VEGA | 5 snin | | CM_V_05.00 | L-Artikolu 325p tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CM | VEGA | 10 snin | | CM_V_10.00 | L-Artikolu 325p tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CM | KURVATURA | | Ċaqliq 'il fuq | CM_CU | L-Artikoli 325p, 325g tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |

| Klassi ta' riskju | Komponent | Maturità | Speċifikazzjoni addizzjonali | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Referenza legali |
|---|---|---|---|---|---|
| CM | KURVATURA | | Ċaqliq 'l isfel | CM_CD | L-Artikoli 325p, 325g tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | DELTA | 0,5 snin | Strument ta' dejn | CSR_NON_SEC_D_00.50_DEBT | L-Artikolu 325m tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | DELTA | Sena (1) | Strument ta' dejn | CSR_NON_SEC_D_01.00_DEBT | L-Artikolu 325m tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | DELTA | 3 snin | Strument ta' dejn | CSR_NON_SEC_D_03.00_DEBT | L-Artikolu 325m tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | DELTA | 5 snin | Strument ta' dejn | CSR_NON_SEC_D_05.00_DEBT | L-Artikolu 325m tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | DELTA | 10 snin | Strument ta' dejn | CSR_NON_SEC_D_10.00_DEBT | L-Artikolu 325m tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | DELTA | 0,5 snin | Swap ta' Inadempjenza ta' Kreditu | CSR_NON_SEC_D_00.50_CDS | L-Artikolu 325m tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | DELTA | Sena (1) | Swap ta' Inadempjenza ta' Kreditu | CSR_NON_SEC_D_01.00_CDS | L-Artikolu 325m tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | DELTA | 3 snin | Swap ta' Inadempjenza ta' Kreditu | CSR_NON_SEC_D_03.00_CDS | L-Artikolu 325m tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | DELTA | 5 snin | Swap ta' Inadempjenza ta' Kreditu | CSR_NON_SEC_D_05.00_CDS | L-Artikolu 325m tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | DELTA | 10 snin | Swap ta' Inadempjenza ta' Kreditu | CSR_NON_SEC_D_10.00_CDS | L-Artikolu 325m tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | VEGA | 0,5 snin | | CSR_NON_SEC_V_00.50 | L-Artikolu 325m tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | VEGA | Sena (1) | | CSR_NON_SEC_V_01.00 | L-Artikolu 325m tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | VEGA | 3 snin | | CSR_NON_SEC_V_03.00 | L-Artikolu 325m tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | VEGA | 5 snin | | CSR_NON_SEC_V_05.00 | L-Artikolu 325m tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | VEGA | 10 snin | | CSR_NON_SEC_V_10.00 | L-Artikolu 325m tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | KURVATURA | | Ċaqliq 'il fuq | CSR_NON_SEC_CU | L-Artikoli 325m, 325g tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |

| Klassi ta' riskju | Komponent | Maturità | Speċifikazzjoni addizzjonali | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Referenza legali |
|---|---|---|---|---|---|
| CSR_NON_SEC | KURVATURA | | Ċaqliq 'l isfel | CSR_NON_SEC_CD | L-Artikoli 325m, 325g tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | DELTA | 0,5 snin | Strument ta' dejn | CSR_SEC_ACTP_D_00.50_DEBT | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | DELTA | Sena (1) | Strument ta' dejn | CSR_SEC_ACTP_D_01.00_DEBT | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | DELTA | 3 snin | Strument ta' dejn | CSR_SEC_ACTP_D_03.00_DEBT | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | DELTA | 5 snin | Strument ta' dejn | CSR_SEC_ACTP_D_05.00_DEBT | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | DELTA | 10 snin | Strument ta' dejn | CSR_SEC_ACTP_D_10.00_DEBT | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | DELTA | 0,5 snin | Swap ta' Inadempjenza ta' Kreditu | CSR_SEC_ACTP_D_00.50_CDS | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | DELTA | Sena (1) | Swap ta' Inadempjenza ta' Kreditu | CSR_SEC_ACTP_D_01.00_CDS | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | DELTA | 3 snin | Swap ta' Inadempjenza ta' Kreditu | CSR_SEC_ACTP_D_03.00_CDS | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | DELTA | 5 snin | Swap ta' Inadempjenza ta' Kreditu | CSR_SEC_ACTP_D_05.00_CDS | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | DELTA | 10 snin | Swap ta' Inadempjenza ta' Kreditu | CSR_SEC_ACTP_D_10.00_CDS | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | VEGA | 0,5 snin | | CSR_SEC_ACTP_V_00.50 | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | VEGA | Sena (1) | | CSR_SEC_ACTP_V_01.00 | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | VEGA | 3 snin | | CSR_SEC_ACTP_V_03.00 | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | VEGA | 5 snin | | CSR_SEC_ACTP_V_05.00 | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | VEGA | 10 snin | | CSR_SEC_ACTP_V_10.00 | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | KURVATURA | | Ċaqliq 'il fuq | CSR_SEC_ACTP_CU | L-Artikoli 325n, 325g tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |

| Klassi ta' riskju | Komponent | Maturità | Speċifikazzjoni addizzjonali | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Referenza legali |
|---|---|---|---|---|---|
| CSR_SEC_ACTP | KURVATURA | | Ċaqliq 'l isfel | CSR_SEC_ACTP_CD | L-Artikoli 325n, 325g tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_NON_ACTP | DELTA | 0,5 snin | Strument ta' dejn | CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_00.50_DEBT | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_NON_ACTP | DELTA | Sena (1) | Strument ta' dejn | CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_01.00_DEBT | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_NON_ACTP | DELTA | 3 snin | Strument ta' dejn | CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_03.00_DEBT | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_NON_ACTP | DELTA | 5 snin | Strument ta' dejn | CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_05.00_DEBT | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_NON_ACTP | DELTA | 10 snin | Strument ta' dejn | CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_10.00_DEBT | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_NON_ACTP | DELTA | 0,5 snin | Swap ta' Inadempjenza ta' Kreditu | CSR_SEC_NON_ACTP_D_00.50_CDS | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_NON_ACTP | DELTA | Sena (1) | Swap ta' Inadempjenza ta' Kreditu | CSR_SEC_NON_ACTP_D_01.00_CDS | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_NON_ACTP | DELTA | 3 snin | Swap ta' Inadempjenza ta' Kreditu | CSR_SEC_NON_ACTP_D_03.00_CDS | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_NON_ACTP | DELTA | 5 snin | Swap ta' Inadempjenza ta' Kreditu | CSR_SEC_NON_ACTP_D_05.00_CDS | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_NON_ACTP | DELTA | 10 snin | Swap ta' Inadempjenza ta' Kreditu | CSR_SEC_NON_ACTP_D_10.00_CDS | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_NON_ACTP | VEGA | 0,5 snin | | CSR_SEC_NON_ACTP_V_00.50 | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_NON_ACTP | VEGA | Sena (1) | | CSR_SEC_NON_ACTP_V_01.00 | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_NON_ACTP | VEGA | 3 snin | | CSR_SEC_NON_ACTP_V_03.00 | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_NON_ACTP | VEGA | 5 snin | | CSR_SEC_NON_ACTP_V_05.00 | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_NON_ACTP | VEGA | 10 snin | | CSR_SEC_NON_ACTP_V_10.00 | L-Artikolu 325n tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| CSR_SEC_NON_ACTP | KURVATURA | | Ċaqliq 'il fuq | CSR_SEC_NON_ACTP_CU | L-Artikoli 325n, 325g tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |

| Klassi ta' riskju | Komponent | Maturità | Speċifikazzjoni addizzjonali | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Referenza legali |
|---|---|---|---|---|---|
| CSR_SEC_NON_ACTP | KURVATURA | | Ċaqliq 'l isfel | CSR_SEC_NON_ACTP_CD | L-Artikoli 325n, 325g tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| EQ | DELTA | | Prezz spot | EQ_D_SPOT | L-Artikolu 325o tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| EQ | DELTA | | Rata ta' repo | EQ_D_REPO | L-Artikolu 325o tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| EQ | VEGA | 0,5 snin | | EQ_V_00.50 | L-Artikolu 325o tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| EQ | VEGA | Sena (1) | | EQ_V_01.00 | L-Artikolu 325o tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| EQ | VEGA | 3 snin | | EQ_V_03.00 | L-Artikolu 325o tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| EQ | VEGA | 5 snin | | EQ_V_05.00 | L-Artikolu 325o tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| EQ | VEGA | 10 snin | | EQ_V_10.00 | L-Artikolu 325o tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| EQ | KURVATURA | | Ċaqliq 'il fuq | EQ_CU | L-Artikoli 325o, 325g tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| EQ | KURVATURA | | Ċaqliq 'l isfel | EQ_CD | L-Artikoli 325o, 325g tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| FX | DELTA | | | FX_D | L-Artikolu 325q tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| FX | VEGA | 0,5 snin | | FX_V_00.50 | L-Artikolu 325q tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| FX | VEGA | Sena (1) | | FX_V_01.00 | L-Artikolu 325q tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| FX | VEGA | 3 snin | | FX_V_03.00 | L-Artikolu 325q tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| FX | VEGA | 5 snin | | FX_V_05.00 | L-Artikolu 325q tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| FX | VEGA | 10 snin | | FX_V_10.00 | L-Artikolu 325q tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| FX | KURVATURA | | Ċaqliq 'il fuq | FX_CU | L-Artikoli 325q, 325g tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |

| Klassi ta' riskju | Komponent | Maturità | Speċifikazzjoni addizzjonali | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Referenza legali |
|---|---|---|---|---|---|
| FX | KURVATURA | | Ċaqliq 'l isfel | FX_CD | L-Artikoli 325q, 325g tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | DELTA | 0,25 snin | | GIRR_D_00.25 | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | DELTA | 0,5 snin | | GIRR_D_00.50 | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | DELTA | Sena (1) | | GIRR_D_01.00 | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | DELTA | Sentejn | | GIRR_D_02.00 | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | DELTA | 3 snin | | GIRR_D_03.00 | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | DELTA | 5 snin | | GIRR_D_05.00 | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | DELTA | 10 snin | | GIRR_D_10.00 | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | DELTA | 15 snin | | GIRR_D_15.00 | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | DELTA | 20 snin | | GIRR_D_20.00 | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | DELTA | 30 snin | | GIRR_D_30.00 | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | DELTA | | Inflazzjoni | GIRR_D_INF | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | DELTA | | Bażi ta' bejn il-muniti (meta mqabbla mal-EUR) | GIRR_D_CRO_EUR | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | DELTA | | Bażi ta' bejn il-muniti (meta mqabbla mal-USD) | GIRR_D_CRO_USD | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 0,5 snin - 0,5 snin | | GIRR_V_00.50_00.50 | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | Sena (1) - 0,5 snin | | GIRR_V_01.00_00.50 | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 3 snin - 0,5 snin | | GIRR_V_03.00_00.50 | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |

| Klassi ta' riskju | Komponent | Maturità | Speċifikazzjoni addizzjonali | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Referenza legali |
|---|---|---|---|---|---|
| GIRR | VEGA | 5 snin - 0,5 snin | | GIRR_V_05.00_00.50 | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 10 snin - 0,5 snin | | GIRR_V_10.00_00.50 | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 0,5 snin - sena (1) | | GIRR_V_00.50_1.00 | Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | sena waħda (1) - sena waħda (1) | | GIRR_V_01.00_1.00 | Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 3 snin - sena waħda (1) | | GIRR_V_03.00_1.00 | Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 5 snin - sena waħda (1) | | GIRR_V_05.00_1.00 | Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 10 snin - sena waħda (1) | | GIRR_V_10.00_1.00 | Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 0,5 snin - 3 snin | | GIRR_V_00.50_05.00 | Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | sena waħda (1) - 3 snin | | GIRR_V_01.00_05.00 | Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 3 snin - 3 snin | | GIRR_V_03.00_05.00 | Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 5 snin - 3 snin | | GIRR_V_05.00_05.00 | Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 10 snin - 3 snin | | GIRR_V_10.00_05.00 | Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 0,5 snin - 5 snin | | GIRR_V_00.50_05.00 | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | Sena (1) - 5 snin | | GIRR_V_01.00_05.00 | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 3 snin - 5 snin | | GIRR_V_03.00_05.00 | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 5 snin - 5 snin | | GIRR_V_05.00_05.00 | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 10 snin - 5 snin | | GIRR_V_10.00_05.00 | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |

| Klassi ta' riskju | Komponent | Maturità | Speċifikazzjoni addizzjonali | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Referenza legali |
|---|---|---|---|---|---|
| GIRR | VEGA | 0,5 snin - 10 snin | | GIRR_V_00.50_10.00 | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | Sena (1) - 10 snin | | GIRR_V_01.00_10.00 | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 3 snin - 10 snin | | GIRR_V_03.00_10.00 | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 5 snin - 10 snin | | GIRR_V_05.00_10.00 | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 10 snin - 10 snin | | GIRR_V_10.00_10.00 | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 0,5 snin | Inflazzjoni | GIRR_V_00.50_INF | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | Sena (1) | Inflazzjoni | GIRR_V_01.00_INF | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 3 snin | Inflazzjoni | GIRR_V_03.00_INF | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 5 snin | Inflazzjoni | GIRR_V_05.00_INF | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 10 snin | Inflazzjoni | GIRR_V_10.00_INF | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 0,5 snin | Bażi ta' bejn il-muniti (meta mqabbla mal-EUR) | GIRR_V_00.50_CRO_EUR | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | Sena waħda(1) | Bażi ta' bejn il-muniti (fuq EUR) | GIRR_V_01.00_CRO_EUR | Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 3 snin | Bażi ta' bejn il-muniti (fuq EUR) | GIRR_V_03.00_CRO_EUR | Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 5 sena | Bażi ta' bejn il-muniti (fuq EUR) | GIRR_V_05.00_CRO_EUR | Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 10 snin | Bażi ta' bejn il-muniti (fuq EUR) | GIRR_V_10.00_CRO_EUR | Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 0,5 snin | Bażi ta' bejn il-muniti (meta mqabbla mal-USD) | GIRR_V_00.50_CRO_USD | Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | Sena waħda(1) | Bażi ta' bejn il-muniti (meta mqabbla mal-USD) | GIRR_V_01.00_CRO_USD | Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |

| Klassi ta' riskju | Komponent | Maturità | Speċifikazzjoni addizzjonali | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Referenza legali |
|---|---|---|---|---|---|
| GIRR | VEGA | 3 snin | Bażi ta' bejn il-muniti (meta mqabbla mal-USD) | GIRR_V_03.00_CRO_USD | Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 5 snin | Bażi ta' bejn il-muniti (meta mqabbla mal-USD) | GIRR_V_05.00_CRO_USD | Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 10 snin | Bażi ta' bejn il-muniti (meta mqabbla mal-USD) | GIRR_V_10.00_CRO_USD | L-Artikolu 325l tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | KURVATURA | | Ċaqliq 'il fuq | GIRR_CU | L-Artikoli 325l, 325g tar-Regolament (UE) Nru 575/2013 |
| GIRR | KURVATURA | | Ċaqliq 'l isfel | GIRR_CD | L-Artikoli 325l, 325g tar-Regolament (UE) Nru 575/2013" |

*ANNESS IV*

*"ANNESS VII –*

**Riżultati tal-Portafolli ta' Riferiment għal finijiet ta' superviżjoni RISKJU TAS-SUQ**

| RIŻULTATI TAL-PORTAFOLLI TA' RIFERIMENT. RISKJU TAS-SUQ | | | |
|---|---|---|---|
| **Numru tal-mudell** | **Kodiċi tal-mudell** | **Isem il-mudell/grupp ta' mudelli** | **Isem qasir** |
| | | **VALWAZZJONI INIZJALI TAS-SUQ** | |
| 106,1 | C 106.00 | VALWAZZJONI INIZJALI TAS-SUQ INIZJALI U ĠUSTIFIKAZZJONI TAL-ESKLUŻJONI | IMV |
| 106,2 | C 106.01 | SENSITTIVITAJIET GĦAR-RISKJU SKONT L-ISTRUMENT | SENSITTIVITAJIET |
| | | **VaR, sVaR u PV** | |
| 107,1 | C 107.01 | DETTALJI | VaR &SVaR 1 |
| 107,2 | C 107.02 | RIŻULTATI FIL-MUNITA TAL-**PORTAFOLL TAL-EBA** | VaR &SVaR 2 |
| | | **SERJE KRONOLOĠIKA TAL-PROFITT U T-TELF** | |
| 108 | C 108.00 | SERJE KRONOLOĠIKA TAL-PROFITT U T-TELF | PuT |
| | | **REKWIŻIT GĦAR-RISKJU INKRIMENTALI (IRC)** | |
| 109,1 | C 109.01 | IRC. DETTALJI TAL-MUDELL | IRC 1 |
| 109,2 | C 109.02 | IRC. DETTALJI SKONT IL-PORTAFOLL | IRC 2 |
| 109,3 | C 109.03 | IRC. AMMONT SKONT IL-PORTAFOLL/DATA | IRC 3 |
| | | **NEGOZJAR TA' KORRELAZZJONI (CT)** | |
| 110,1 | C 110.01 | CT. DETTALJI TAL-FORMOLA | CT 1 |
| 110,2 | C 110.02 | CT. DETTALJI SKONT IL-PORTAFOLL | CT 2 |
| 110,3 | C 110.03 | CT. AMMONT SKONT IL-PORTAFOLL/DATA | CT 3 |
| | | **ASA (SBM U DRC)** | |
| 120,1 | C 120.01 | SBM. SENSITTIVITAJIET GĦAR-RISKJU SKONT L-ISTRUMENT/IL-PORTAFOLL | SBM 1 |
| 120,2 | C 120.02 | SBM. KOMPOŻIZZJONI TAL-OFR SKONT IL-PORTAFOLL | SBM 2 |
| 120,4 | C 120.04 | DRC. VALURI TAS-SUQ U AMMONTI GROSSI TA' JTD SKONT L-ISTRUMENT/PORTAFOLL | DRC 1 |
| 120,5 | C 120.05 | DRC. KOMPOŻIZZJONI TAL-OFR SKONT IL-PORTAFOLL | DRC 2 |
| 120,6 | C 120.06 | ASA. OFR SKONT IL-PORTAFOLL | ASA OFR |

## C 106.00 - VALWAZZJONI INIZJALI TAS-SUQ U ĠUSTIFIKAZZJONI TAL-ESKLUŻJONI

| Numru tal-istrument | Strument ta' Mmudellar għall-VaR + SVaR (Veru/Falz) | Strument ta' Mmudellar għall-IRC (Veru/Falz) | Strument ta' Mmudellar għan-Negozjar ta' Korrelazzjoni (Veru/Falz) | Raġunament għall-Esklużjoni | Kaxxa għal test liberu | Valwazzjoni tas-Suq Inizjali |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 0010 | 0020 | 0030 | 0040 | 0050 | 0060 | 0070 |
| | | | | | | |

## C 106.01 - SENSITTIVITAJIET GĦAR-RISKJU SKONT L-ISTRUMENT

**Numru tal-istrument**

| Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Barmil | Identifikatur addizzjonali | Sensittività għar-riskju (Riżultati tal-munita tar-rapportar) | Munita tar-rapportar | Sensittività għar-riskju (Riżultati tal-munita tal-istrument tal-EBA) | Mudell tal-ipprezzar | Definizzjoni tas-sensittivitajiet | Kaxxa għal test liberu | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 0010 | 0020 | 0030 | 0050 | 0060 | 0070 | 0080 | 0090 | 0100 | 110 | 120 |
| | | | | | | | | | | |

## C 107.01 - VaR, sVaR u PV. DETTALJI

| | | Opzjoni | Kaxxa għal test liberu |
|---|---|---|---|
| | | 0010 | 0020 |
| **VaR** | | | |
| 0010 | **Metodoloġija** | | |
| 0020 | **Komputazzjoni tal-perjodu ta' 10 ijiem** | | |

| | | Opzjoni | Kaxxa għal test liberu |
|---|---|---|---|
| | | 0010 | 0020 |
| 0030 | **Tul tal-perjodu ta' osservazzjoni** | | |
| 0040 | **Ponderazzjoni tad-data** | | |
| 0050 | **Addend tal-ittestjar retrospettiv** | | |
| 0060 | **Addend regolatorju għall-VaR** | | |
| **SVaR** | | | |
| 0070 | **Metodoloġija** | | |
| 0080 | **Komputazzjoni tal-perjodu ta' 10 ijiem** | | |
| 0090 | **Addend regolatorju sVaR** | | |
| 0100 | **Perjodu sVaR** | | |

**C 107.02 - VaR u SVaR mhux CTP. RIŻULTATI FIL-MUNITA TAL-PORTAFOLL TAL-EBA**

**Portafoll**

| Data | VaR | sVaR | PV |
|---|---|---|---|
| 0010 | 0020 | 0030 | 0040 |
| | | | |

## C 108.00 - SERJE KRONOLOĠIKA TAL-PROFITT U T-TELF

**Portafoll**

| Data | **P&L ta' kuljum** |
|---|---|
| 0010 | 0020 |
| | |

## C 109.01 – IRC. DETTALJI TAL-MUDELL

| | | **Opzjoni** | **Kaxxa għal test liberu** |
|---|---|---|---|
| **Rin-giela** | **Entrata** | 0010 | 0020 |
| 0010 | **Għadd ta' fatturi ta' mmudellar** | | |
| 0020 | **Sors tal-LGDs** | | |

## C 109.02 – IRC. DETTALJI SKONT IL-PORTAFOLL

**Portafoll**

| | | Opzjoni | Kaxxa għal test liberu |
|---|---|---|---|
| **Ringiela** | **Entrata** | 0010 | 0020 |
| 0010 | **Perjodu ta' likwidità** | | |
| 0020 | **Sors tal-PDs** | | |
| 0030 | **Sors tal-matriċijiet ta' tranżizzjoni** | | |

## C 109.03 – IRC. AMMONT SKONT IL-PORTAFOLL/DATA

**Portafoll**

| Data | IRC |
|---|---|
| 0010 | 0020 |
| | |





ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

**C 110.01 - CT. DETTALJI TAL-FORMOLA**

| | | Opzjoni | Kaxxa għal test liberu |
|---|---|---|---|
| **Ringiela** | **Entrata** | 0010 | 0020 |
| 0010 | **Għadd ta' fatturi ta' mmudellar** | | |
| 0020 | **Sors tal-LGDs** | | |

**C 110.02 – CT. DETTALJI SKONT IL-PORTAFOLL**

**Portafoll**

| | | Opzjoni | Kaxxa għal test liberu |
|---|---|---|---|
| **Ringiela** | **Entrata** | 0010 | 0020 |
| 0010 | **Perjodu ta' likwidità** | | |
| 0020 | **Sors tal-PDs** | | |
| 0030 | **Sors tal-matriċijiet ta' tranżizzjoni** | | |

**C 110.03 – CT. APR SKONT IL-PORTAFOLL/DATA**

**Portafoll**

| Data | **APR** |
|---|---|
| 0010 | 0060 |
| | |

**C 120.01 - SBM. SENSITTIVITAJIET GĦAR-RISKJU SKONT L-ISTRUMENT/IL-PORTAFOLL**

**Portafoll**

| **Numru tal-istrument** | **Identifikatur tal-fattur ta' riskju** | **Barmil** | **Identifikatur addizzjonali** | **Sensittività għar-riskju (Riżultati fil-munita tar-rapportar)** | **Munita tar-rapportar** | **Sensittività għar-riskju (Riżultati fil-munita tal-portafoll tal-EBA)** | **Ponderazzjoni tar-riskju** | **Identifikatur addizzjonali2** | **Kategorija tal-kwalità tal-kreditu** |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 0010 | 0020 | 0030 | 0040 | 0060 | 0070 | 0080 | 0090 | 110 | 120 |
| | | | | | | | | | |



ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

## C 120.02 - SBM. KOMPOŻIZZJONI TAL-OFR SKONT IL-PORTAFOLL

**Portafoll**

| Klassi tar-riskju | Komponenti ta' riskju | Xenarju tal-korrelazzjonijiet | Rekwiżiti ta' fondi proprji (Riżultati tal-munita tar-rapportar) | Munita tar-rapportar | Rekwiżiti ta' fondi proprji (Riżultati tal-munita tal-portafoll tal-EBA) | Pożizzjonijiet mingħajr opzjonalità soġġetti għal rekwiżiti ta' fondi proprji ta' riskju ta' kurvatura | Approċċ tal-munita bażi applikat għar-riskju tal-kambju delta u tal-kurvatura | Diviżjoni tal-komponenti tar-riskju tal-kurvatura għar-riskju tal-kambju skont l-iskalar | Sottomissjoni tar-riżultati tal-portafoll ta' validazzjoni tal-SBM | Kaxxa għal test liberu |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 0010 | 0020 | 0030 | 0040 | 0050 | 0060 | 0070 | 0080 | 0090 | 0950 | 0100 |
| | | | | | | | | | | |

## C 120.04 – IRC. Valuri tas-suq u ammonti grossi ta' JTD skont l-Istrument/Portafoll

**Portafoll**

*Numru sħiħ*

| Numru tal-istrument | Klassi tar-riskju | Bucket1 | Bucket2 | Obbligant | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Ponderazzjoni tar-riskju ta' inadempjenza | Superjorità | Maturità | Rata ta' rkupru | Direzzjoni | Punt ta' attakkament (%) | Punt ta' distakkament (%) | Riżultati tal-munita tar-rapportar | | | | Riżultati tal-munita tal-portafoll tal-EBA | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | | | | | | | | | Nozzjonali | P&L + Aġġustament | Ammont gross ta' JTD | Munita | Nozzjonali | P&L + Aġġustament | Ammont gross ta' JTD |
| 0010 | 0020 | 0030 | 0040 | 0050 | 0060 | 0070 | 0080 | 0090 | 0100 | 0110 | 0120 | 0130 | 0140 | 0150 | 0160 | 0170 | 0180 | 0190 | 0200 |
| | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

**C 120.05 – IRC. KOMPOŻIZZJONI TAL-OFR SKONT IL-PORTAFOLL**

**Portafoll**

*Numru shih*

| Klassi tar-riskju | Bucket1 | Bucket2 | Rekwiżiti ta' fondi proprji (Riżultati tal-munita tar-rapportar) | Munita tar-rapportar | Rekwiżiti ta' fondi proprji (Riżultati tal-munita tal-portafoll tal-EBA) |
|---|---|---|---|---|---|
| 0010 | 0020 | 0030 | 0040 | 0050 | 0060 |
| | | | | | |

**C 120.06 - ASA. OFR**

| Numru tal-portafoll | Riżultati tal-munita tar-rapportar | | | Riżultati tal-munita tal-portafoll tal-EBA | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | SMB OFR | RDK OFR | RRAO OFR | SMB OFR | RDK OFR | RRAO OFR |
| 0010 | 0020 | 0030 | 0040 | 0050 | 0060 | 0070" |
| | | | | | | |



ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

*ANNESS V*

*"ANNESS X*

**Portafolli ta' validazzjoni tal-SBM**

| Isem il-folja | Deskrizzjoni |
|---|---|
| Strumenti | Strumenti (sensittivitajiet u pożizzjonijiet ta' riskju ta' kurvatura) għal finijiet ta' validazzjoni tal-SBM |
| Portafolli | Portafolli ta' validazzjoni tal-SBM definiti bħala kombinazzjonijiet tal-istrumenti definiti f'dan l-Anness |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_IRV_b25# | GIRR_V_10.00_10.00 | USD | | | | 400,00 |
| S_IRV_b24# | GIRR_V_10.00_05.00 | USD | | | | 200,00 |
| S_IRV_b23# | GIRR_V_10.00_03.00 | USD | | | | – 900,00 |
| S_IRV_b22# | GIRR_V_10.00_01.00 | USD | | | | 950,00 |
| S_IRV_b21# | GIRR_V_10.00_00.50 | USD | | | | – 350,00 |
| S_IRV_b20# | GIRR_V_05.00_10.00 | USD | | | | 1 000,00 |
| S_IRV_b19# | GIRR_V_05.00_05.00 | USD | | | | – 300,00 |
| S_IRV_b18# | GIRR_V_05.00_03.00 | USD | | | | 50,00 |
| S_IRV_b17# | GIRR_V_05.00_01.00 | USD | | | | 300,00 |
| S_IRV_b16# | GIRR_V_05.00_00.50 | USD | | | | – 50,00 |
| S_IRV_e3# | GIRR_V_03.00_CRO_USD | BRL | | | | 500,00 |
| S_IRV_b15# | GIRR_V_03.00_10.00 | USD | | | | – 400,00 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_IRV_b14# | GIRR_V_03.00_05.00 | USD | | | | 700,00 |
| S_IRV_b13# | GIRR_V_03.00_03.00 | USD | | | | – 800,00 |
| S_IRV_b12# | GIRR_V_03.00_01.00 | USD | | | | 700,00 |
| S_IRV_b11# | GIRR_V_03.00_00.50 | USD | | | | – 100,00 |
| S_IRV_e2# | GIRR_V_01.00_INF | BRL | | | | 750,00 |
| S_IRV_b10# | GIRR_V_01.00_10.00 | USD | | | | 500,00 |
| S_IRV_b9# | GIRR_V_01.00_05.00 | USD | | | | 50,00 |
| S_IRV_b8# | GIRR_V_01.00_03.00 | USD | | | | – 500,00 |
| S_IRV_b7# | GIRR_V_01.00_01.00 | USD | | | | 200,00 |
| S_IRV_b6# | GIRR_V_01.00_00.50 | USD | | | | 900,00 |
| S_IRV_b5# | GIRR_V_00.50_10.00 | USD | | | | 100,00 |
| S_IRV_c5# | GIRR_V_00.50_10.00 | CLP | | | | – 100,00 |
| S_IRV_d5# | GIRR_V_00.50_10.00 | EUR | | | | – 2 000,00 |
| S_IRV_b4# | GIRR_V_00.50_05.00 | USD | | | | 100,00 |
| S_IRV_c4# | GIRR_V_00.50_05.00 | CLP | | | | 100,00 |
| S_IRV_d4# | GIRR_V_00.50_05.00 | EUR | | | | 1 500,00 |
| S_IRV_b3# | GIRR_V_00.50_03.00 | USD | | | | – 500,00 |
| S_IRV_c3# | GIRR_V_00.50_03.00 | CLP | | | | – 300,00 |
| S_IRV_d3# | GIRR_V_00.50_03.00 | EUR | | | | 1 000,00 |
| S_IRV_b2# | GIRR_V_00.50_01.00 | USD | | | | 400,00 |
| S_IRV_c2# | GIRR_V_00.50_01.00 | CLP | | | | 150,00 |
| S_IRV_d2# | GIRR_V_00.50_01.00 | EUR | | | | 3 750,00 |
| S_IRV_a1# | GIRR_V_00.50_00.50 | USD | | | | – 100,00 |
| S_IRV_b1# | GIRR_V_00.50_00.50 | USD | | | | 700,00 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_IRV_c1# | GIRR_V_00.50_00.50 | CLP | | | | 300,00 |
| S_IRV_d1# | GIRR_V_00.50_00.50 | EUR | | | | – 4 750,00 |
| S_IRV_e1# | GIRR_V_00.50_00.50 | BRL | | | | – 500,00 |
| S_IRD_b11# | GIRR_D_INF | USD | | | | – 50 000,00 |
| S_IRD_d11# | GIRR_D_INF | CLP | | | | 95 000,00 |
| S_IRD_e11# | GIRR_D_INF | EUR | DE | | | – 65 000,00 |
| S_IRD_e13# | GIRR_D_INF | EUR | FR | | | – 100 000,00 |
| S_IRD_d12# | GIRR_D_CRO_USD | CLP | | | | 10 500,00 |
| S_IRD_e12# | GIRR_D_CRO_USD | EUR | | | | – 85 000,00 |
| S_IRD_b12# | GIRR_D_CRO_EUR | USD | | | | – 65 000,00 |
| S_IRD_b10# | GIRR_D_30.00 | USD | OIS | | | – 50 000,00 |
| S_IRD_c10# | GIRR_D_30.00 | USD | Libor3m | | | 10 000,00 |
| S_IRD_d10# | GIRR_D_30.00 | CLP | OIS | | | 15 000,00 |
| S_IRD_e10# | GIRR_D_30.00 | EUR | OIS | | | – 120 000,00 |
| S_IRD_b9# | GIRR_D_20.00 | USD | OIS | | | 200 000,00 |
| S_IRD_c9# | GIRR_D_20.00 | USD | Libor3m | | | – 30 000,00 |
| S_IRD_d9# | GIRR_D_20.00 | CLP | OIS | | | 90 000,00 |
| S_IRD_e9# | GIRR_D_20.00 | EUR | OIS | | | 100,00 |
| S_IRD_b8# | GIRR_D_15.00 | USD | OIS | | | 30 000,00 |
| S_IRD_c8# | GIRR_D_15.00 | USD | Libor3m | | | 10 000,00 |
| S_IRD_d8# | GIRR_D_15.00 | CLP | OIS | | | 70 000,00 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_IRD_e8# | GIRR_D_15.00 | EUR | OIS | | | 100,00 |
| S_IRD_b7# | GIRR_D_10.00 | USD | OIS | | | 2 000,00 |
| S_IRD_c7# | GIRR_D_10.00 | USD | Libor3m | | | – 100 000,00 |
| S_IRD_d7# | GIRR_D_10.00 | CLP | OIS | | | – 25 000,00 |
| S_IRD_e7# | GIRR_D_10.00 | EUR | OIS | | | 100,00 |
| S_IRD_b6# | GIRR_D_05.00 | USD | OIS | | | – 90 000,00 |
| S_IRD_c6# | GIRR_D_05.00 | USD | Libor3m | | | – 35 000,00 |
| S_IRD_d6# | GIRR_D_05.00 | CLP | OIS | | | – 5 000,00 |
| S_IRD_e6# | GIRR_D_05.00 | EUR | OIS | | | 100,00 |
| S_IRD_b5# | GIRR_D_03.00 | USD | OIS | | | 85 000,00 |
| S_IRD_c5# | GIRR_D_03.00 | USD | Libor3m | | | 55 000,00 |
| S_IRD_d5# | GIRR_D_03.00 | CLP | OIS | | | – 100 000,00 |
| S_IRD_e5# | GIRR_D_03.00 | EUR | OIS | | | 100,00 |
| S_IRD_b4# | GIRR_D_02.00 | USD | OIS | | | – 10 000,00 |
| S_IRD_c4# | GIRR_D_02.00 | USD | Libor3m | | | 10 000,00 |
| S_IRD_d4# | GIRR_D_02.00 | CLP | OIS | | | 5 000,00 |
| S_IRD_e4# | GIRR_D_02.00 | EUR | OIS | | | 100,00 |
| S_IRD_b3# | GIRR_D_01.00 | USD | OIS | | | – 65 000,00 |
| S_IRD_c3# | GIRR_D_01.00 | USD | Libor3m | | | 70 000,00 |
| S_IRD_d3# | GIRR_D_01.00 | CLP | OIS | | | 10 000,00 |
| S_IRD_e3# | GIRR_D_01.00 | EUR | OIS | | | – 50 000,00 |
| S_IRD_b2# | GIRR_D_00.50 | USD | OIS | | | 15 000,00 |
| S_IRD_c2# | GIRR_D_00.50 | USD | Libor3m | | | – 40 000,00 |
| S_IRD_d2# | GIRR_D_00.50 | CLP | OIS | | | 45 000,00 |
| S_IRD_e2# | GIRR_D_00.50 | EUR | OIS | | | 100,00 |
| S_IRD_a1# | GIRR_D_00.25 | USD | OIS | | | 30 000,00 |
| S_IRD_b1# | GIRR_D_00.25 | USD | OIS | | | 20 000,00 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_IRD_c1# | GIRR_D_00.25 | USD | Libor3m | | | – 30 000,00 |
| S_IRD_d1# | GIRR_D_00.25 | CLP | OIS | | | – 30 000,00 |
| S_IRD_e1# | GIRR_D_00.25 | EUR | OIS | | | 100,00 |
| S_IRD_f1# | GIRR_D_00.25 | DKK | OIS | | | 100,00 |
| S_IRC_a1# | GIRR_CU | USD | | | | – 18 466,83 |
| S_IRC_b1# | GIRR_CU | USD | | | | 92 233,09 |
| S_IRC_c1# | GIRR_CU | CLP | | | | – 1 270,00 |
| S_IRC_d1# | GIRR_CU | EUR | | | | – 253,12 |
| S_IRC_e1# | GIRR_CU | VND | | | | – 11 950,00 |
| S_IRC_a1# | GIRR_CD | USD | | | | 18 647,66 |
| S_IRC_b1# | GIRR_CD | USD | | | | – 93 178,71 |
| S_IRC_c1# | GIRR_CD | CLP | | | | 450,00 |
| S_IRC_d1# | GIRR_CD | EUR | | | | – 3 237,08 |
| S_IRC_e1# | GIRR_CD | VND | | | | – 4 030,00 |
| S_FXV_b4# | FX_V_5.00 | EUR_CLP | | | | 200,00 |
| S_FXV_d4# | FX_V_5.00 | CHF_VND | | | | 1 500,00 |
| S_FXV_b3# | FX_V_3.00 | EUR_CLP | | | | – 400,00 |
| S_FXV_d3# | FX_V_3.00 | CHF_VND | | | | 1 000,00 |
| S_FXV_b5# | FX_V_10.00 | EUR_CLP | | | | 150,00 |
| S_FXV_d5# | FX_V_10.00 | CHF_VND | | | | – 2 000,00 |
| S_FXV_b2# | FX_V_1.00 | EUR_CLP | | | | 300,00 |
| S_FXV_d2# | FX_V_1.00 | CHF_VND | | | | 3 750,00 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_FXV_a1# | FX_V_0.50 | EUR_CLP | | | | – 100,00 |
| S_FXV_b1# | FX_V_0.50 | EUR_CLP | | | | 700,00 |
| S_FXV_c1# | FX_V_0.50 | AUD_JPY | | | | 450,00 |
| S_FXV_d1# | FX_V_0.50 | CHF_VND | | | | – 4 800,00 |
| S_FXD_a1# | FX_D | GBP | | | | 5 000,00 |
| S_FXD_b1# | FX_D | GBP | | | | – 8 000,00 |
| S_FXD_c1# | FX_D | CLP | | | | 3 000,00 |
| S_FXD_d1# | FX_D | DKK | | | | 1 000,00 |
| S_FXD_f1# | FX_D | BGN | | | | 1 000,00 |
| S_FXC_a1# | FX_CU | EUR | | | | – 16 037,91 |
| S_FXC_b1# | FX_CU | EUR | | | | 80 159,24 |
| S_FXC_c1# | FX_CU | CLP | | | | – 800,00 |
| S_FXC_d1# | FX_CU | JPY | | | | – 1 472,88 |
| S_FXC_e1# | FX_CU | VND | | | | – 3 400,00 |
| S_FXC_f1# | FX_CU | DKK | | | | – 48,61 |
| S_FXC_a1# | FX_CD | EUR | | | | 16 162,18 |
| S_FXC_b1# | FX_CD | EUR | | | | – 80 723,02 |
| S_FXC_c1# | FX_CD | CLP | | | | 700,00 |
| S_FXC_d1# | FX_CD | JPY | | | | – 1 324,35 |
| S_FXC_e1# | FX_CD | VND | | | | – 2 100,00 |
| S_FXC_f1# | FX_CD | DKK | | | | 48,61 |
| S_EQV_a5# | EQ_V_5.00 | 1 | EMITTENT A | | | 100,00 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_EQV_aa4# | EQ_V_5.00 | 5 | EMITTENT AA | | | 1 200,00 |
| S_EQV_ac1# | EQ_V_5.00 | 7 | EMITTENT AC | | | – 50,00 |
| S_EQV_ae4# | EQ_V_5.00 | 9 | EMITTENT AE | | | 600,00 |
| S_EQV_af4# | EQ_V_5.00 | 10 | EMITTENT AF | | | 375,00 |
| S_EQV_b4# | EQ_V_5.00 | 1 | EMITTENT B | | | 50,00 |
| S_EQV_f4# | EQ_V_5.00 | 5 | EMITTENT F | | | 450,00 |
| S_EQV_j4# | EQ_V_5.00 | 9 | EMITTENT J | | | – 200,00 |
| S_EQV_k4# | EQ_V_5.00 | 10 | EMITTENT K | | | – 825,00 |
| S_EQV_m1# | EQ_V_5.00 | 11 | EMITTENT M | | | – 700,00 |
| S_EQV_n4# | EQ_V_5.00 | 12 | INDIĊI N | | | 850,00 |
| S_EQV_o4# | EQ_V_5.00 | 12 | INDIĊI O | | | 150,00 |
| S_EQV_y1# | EQ_V_5.00 | 3 | EMITTENT Y | | | 700,00 |
| S_EQV_a4# | EQ_V_3.00 | 1 | EMITTENT A | | | – 500,00 |
| S_EQV_aa3# | EQ_V_3.00 | 5 | EMITTENT AA | | | – 850,00 |
| S_EQV_ad1# | EQ_V_3.00 | 8 | EMITTENT AD | | | 300,00 |
| S_EQV_ae3# | EQ_V_3.00 | 9 | EMITTENT AE | | | – 450,00 |
| S_EQV_af3# | EQ_V_3.00 | 10 | EMITTENT AF | | | – 725,00 |
| S_EQV_b3# | EQ_V_3.00 | 1 | EMITTENT B | | | – 500,00 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_EQV_f3# | EQ_V_3.00 | 5 | EMITTENT F | | | 250,00 |
| S_EQV_j3# | EQ_V_3.00 | 9 | EMITTENT J | | | – 900,00 |
| S_EQV_k3# | EQ_V_3.00 | 10 | EMITTENT K | | | – 975,00 |
| S_EQV_n3# | EQ_V_3.00 | 12 | INDIĊI N | | | – 1 250,00 |
| S_EQV_o3# | EQ_V_3.00 | 12 | INDIĊI O | | | 100,00 |
| S_EQV_x1# | EQ_V_3.00 | 2 | EMITTENT X | | | – 200,00 |
| S_EQV_z1# | EQ_V_3.00 | 4 | EMITTENT Z | | | – 800,00 |
| S_EQV_a6# | EQ_V_10.00 | 1 | EMITTENT A | | | 100,00 |
| S_EQV_aa5# | EQ_V_10.00 | 5 | EMITTENT AA | | | – 300,00 |
| S_EQV_ab1# | EQ_V_10.00 | 6 | EMITTENT AB | | | – 400,00 |
| S_EQV_ae5# | EQ_V_10.00 | 9 | EMITTENT AE | | | – 850,00 |
| S_EQV_af5# | EQ_V_10.00 | 10 | EMITTENT AF | | | 525,00 |
| S_EQV_b5# | EQ_V_10.00 | 1 | EMITTENT B | | | 500,00 |
| S_EQV_f5# | EQ_V_10.00 | 5 | EMITTENT F | | | 600,00 |
| S_EQV_j5# | EQ_V_10.00 | 9 | EMITTENT J | | | 150,00 |
| S_EQV_k5# | EQ_V_10.00 | 10 | EMITTENT K | | | 300,00 |
| S_EQV_n5# | EQ_V_10.00 | 12 | INDIĊI N | | | 225,00 |
| S_EQV_o5# | EQ_V_10.00 | 12 | INDIĊI O | | | – 200,00 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_EQV_q1# | EQ_V_10.00 | 13 | INDIĊI Q | | | – 800,00 |
| S_EQV_a3# | EQ_V_1.00 | 1 | EMITTENT A | | | 400,00 |
| S_EQV_aa2# | EQ_V_1.00 | 5 | EMITTENT AA | | | – 400,00 |
| S_EQV_ae2# | EQ_V_1.00 | 9 | EMITTENT AE | | | – 250,00 |
| S_EQV_af2# | EQ_V_1.00 | 10 | EMITTENT AF | | | – 1 150,00 |
| S_EQV_b2# | EQ_V_1.00 | 1 | EMITTENT B | | | 200,00 |
| S_EQV_f2# | EQ_V_1.00 | 5 | EMITTENT F | | | – 750,00 |
| S_EQV_j2# | EQ_V_1.00 | 9 | EMITTENT J | | | 350,00 |
| S_EQV_k2# | EQ_V_1.00 | 10 | EMITTENT K | | | 1 050,00 |
| S_EQV_n2# | EQ_V_1.00 | 12 | INDIĊI N | | | – 800,00 |
| S_EQV_o2# | EQ_V_1.00 | 12 | INDIĊI O | | | 400,00 |
| S_EQV_a1# | EQ_V_0.50 | 1 | EMITTENT A | | | – 100,00 |
| S_EQV_a2# | EQ_V_0.50 | 1 | EMITTENT A | | | 700,00 |
| S_EQV_aa1# | EQ_V_0.50 | 5 | EMITTENT AA | | | 950,00 |
| S_EQV_ae1# | EQ_V_0.50 | 9 | EMITTENT AE | | | 50,00 |
| S_EQV_af1# | EQ_V_0.50 | 10 | EMITTENT AF | | | – 300,00 |
| S_EQV_b1# | EQ_V_0.50 | 1 | EMITTENT B | | | 900,00 |
| S_EQV_c1# | EQ_V_0.50 | 2 | EMITTENT C | | | – 500,00 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_EQV_d1# | EQ_V_0.50 | 3 | EMITTENT D | | | 600,00 |
| S_EQV_e1# | EQ_V_0.50 | 4 | EMITTENT E | | | – 800,00 |
| S_EQV_f1# | EQ_V_0.50 | 5 | EMITTENT F | | | 1 000,00 |
| S_EQV_g1# | EQ_V_0.50 | 6 | EMITTENT G | | | – 400,00 |
| S_EQV_h1# | EQ_V_0.50 | 7 | EMITTENT H | | | – 50,00 |
| S_EQV_i1# | EQ_V_0.50 | 8 | EMITTENT I | | | 300,00 |
| S_EQV_j1# | EQ_V_0.50 | 9 | EMITTENT J | | | 50,00 |
| S_EQV_k1# | EQ_V_0.50 | 10 | EMITTENT K | | | – 300,00 |
| S_EQV_l1# | EQ_V_0.50 | 11 | EMITTENT L | | | 1 000,00 |
| S_EQV_n1# | EQ_V_0.50 | 12 | INDIĊI N | | | 750,00 |
| S_EQV_o1# | EQ_V_0.50 | 12 | INDIĊI O | | | – 500,00 |
| S_EQV_p1# | EQ_V_0.50 | 13 | INDIĊI P | | | 40,00 |
| S_EQD_a1# | EQ_D_SPOT | 1 | EMITTENT A | | | 16 500,00 |
| S_EQD_a2# | EQ_D_SPOT | 1 | EMITTENT A | | | – 35 000,00 |
| S_EQD_b1# | EQ_D_SPOT | 1 | EMITTENT B | | | 20 000,00 |
| S_EQD_c1# | EQ_D_SPOT | 2 | EMITTENT C | | | 66 000,00 |
| S_EQD_d1# | EQ_D_SPOT | 3 | EMITTENT D | | | 1 700,00 |
| S_EQD_e1# | EQ_D_SPOT | 4 | EMITTENT E | | | 1 100,00 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_EQD_f1# | EQ_D_SPOT | 5 | EMITTENT F | | | 25 000,00 |
| S_EQD_g1# | EQ_D_SPOT | 5 | EMITTENT G | | | 8 400,00 |
| S_EQD_h1# | EQ_D_SPOT | 6 | EMITTENT H | | | 22 500,00 |
| S_EQD_i1# | EQ_D_SPOT | 7 | EMITTENT I | | | – 12 300,00 |
| S_EQD_j1# | EQ_D_SPOT | 8 | EMITTENT J | | | – 450,00 |
| S_EQD_k1# | EQ_D_SPOT | 9 | EMITTENT K | | | – 143,00 |
| S_EQD_l1# | EQ_D_SPOT | 9 | EMITTENT L | | | – 143,00 |
| S_EQD_m1# | EQ_D_SPOT | 10 | EMITTENT M | | | – 100,00 |
| S_EQD_n1# | EQ_D_SPOT | 10 | EMITTENT N | | | – 100,00 |
| S_EQD_o1# | EQ_D_SPOT | 11 | EMITTENT O | | | – 19 600,00 |
| S_EQD_q1# | EQ_D_SPOT | 12 | INDIĊI Q | | | 1 100,00 |
| S_EQD_r1# | EQ_D_SPOT | 12 | INDIĊI R | | | – 40 000,00 |
| S_EQD_s1# | EQ_D_SPOT | 13 | INDIĊI S | | | – 1 950,00 |
| S_EQD_s2# | EQ_D_SPOT | 13 | INDIĊI S | | | 280,00 |
| S_EQD_t2# | EQ_D_SPOT | 13 | INDIĊI T | | | 3 150,00 |
| S_EQD_u1# | EQ_D_SPOT | 9 | EMITTENT U | | | – 57,00 |
| S_EQD_v1# | EQ_D_SPOT | 10 | EMITTENT V | | | – 100,00 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_EQD_a3# | EQ_D_REPO | 1 | EMITTENT A | | | 50 000,00 |
| S_EQD_aa1# | EQ_D_REPO | 6 | EMITTENT AA | | | 79 000,00 |
| S_EQD_ab1# | EQ_D_REPO | 7 | EMITTENT AB | | | 31 000,00 |
| S_EQD_ac1# | EQ_D_REPO | 8 | EMITTENT AC | | | – 10 000,00 |
| S_EQD_b2# | EQ_D_REPO | 1 | EMITTENT B | | | – 39 000,00 |
| S_EQD_f2# | EQ_D_REPO | 5 | EMITTENT F | | | 90 000,00 |
| S_EQD_g2# | EQ_D_REPO | 5 | EMITTENT G | | | 60 000,00 |
| S_EQD_k2# | EQ_D_REPO | 9 | EMITTENT K | | | – 14 250,00 |
| S_EQD_l2# | EQ_D_REPO | 9 | EMITTENT L | | | – 150 000,00 |
| S_EQD_m2# | EQ_D_REPO | 10 | EMITTENT M | | | – 85 000,00 |
| S_EQD_n2# | EQ_D_REPO | 10 | EMITTENT N | | | – 72 000,00 |
| S_EQD_p1# | EQ_D_REPO | 11 | EMITTENT P | | | 48 000,00 |
| S_EQD_q2# | EQ_D_REPO | 12 | INDIĊI Q | | | 85 000,00 |
| S_EQD_r2# | EQ_D_REPO | 12 | INDIĊI R | | | – 40 000,00 |
| S_EQD_t1# | EQ_D_REPO | 13 | INDIĊI T | | | – 125 000,00 |
| S_EQD_x1# | EQ_D_REPO | 2 | EMITTENT X | | | 75 000,00 |
| S_EQD_y1# | EQ_D_REPO | 3 | EMITTENT Y | | | 4 800,00 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_EQD_z1# | EQ_D_REPO | 4 | EMITTENT Z | | | – 15 000,00 |
| S_EQC_a1# | EQ_CU | 1 | EMITTENT A | | | – 37 820,00 |
| S_EQC_a2# | EQ_CU | 1 | EMITTENT A | | | 77 655,00 |
| S_EQC_aa1# | EQ_CU | 2 | EMITTENT AA | | | 39 300,00 |
| S_EQC_ab1# | EQ_CU | 4 | EMITTENT AB | | | 17 262,00 |
| S_EQC_ac1# | EQ_CU | 5 | EMITTENT AC | | | 7 139,60 |
| S_EQC_ad1# | EQ_CU | 6 | EMITTENT AD | | | – 3 642,50 |
| S_EQC_ae1# | EQ_CU | 7 | EMITTENT AE | | | 3 900,00 |
| S_EQC_af1# | EQ_CU | 8 | EMITTENT AF | | | 41 550,00 |
| S_EQC_ag1# | EQ_CU | 9 | EMITTENT AG | | | 36 860,00 |
| S_EQC_ah1# | EQ_CU | 10 | EMITTENT AH | | | 22 150,00 |
| S_EQC_b1# | EQ_CU | 1 | EMITTENT B | | | 20 677,50 |
| S_EQC_c1# | EQ_CU | 2 | EMITTENT C | | | – 31 440,00 |
| S_EQC_d1# | EQ_CU | 3 | EMITTENT D | | | 6 238,00 |
| S_EQC_e1# | EQ_CU | 4 | EMITTENT E | | | – 21 605,00 |
| S_EQC_f1# | EQ_CU | 5 | EMITTENT F | | | – 2 850,00 |
| S_EQC_g1# | EQ_CU | 6 | EMITTENT G | | | – 3 642,50 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_EQC_h1# | EQ_CU | 7 | EMITTENT H | | | – 7 800,00 |
| S_EQC_i1# | EQ_CU | 8 | EMITTENT I | | | – 29 550,00 |
| S_EQC_j1# | EQ_CU | 9 | EMITTENT J | | | – 216 320,00 |
| S_EQC_k1# | EQ_CU | 10 | EMITTENT K | | | 1 950,00 |
| S_EQC_q1# | EQ_CU | 11 | EMITTENT Q | | | – 19 142,00 |
| S_EQC_r1# | EQ_CU | 11 | EMITTENT R | | | 28 713,00 |
| S_EQC_s1# | EQ_CU | 3 | EMITTENT S | | | – 17 025,00 |
| S_EQC_t1# | EQ_CU | 12 | EMITTENT T | | | 7 466,67 |
| S_EQC_u1# | EQ_CU | 13 | EMITTENT U | | | 11 160,00 |
| S_EQC_v1# | EQ_CU | 12 | EMITTENT V | | | – 39 200,00 |
| S_EQC_w1# | EQ_CU | 13 | EMITTENT W | | | – 58 590,00 |
| S_EQC_y1# | EQ_CU | 1 | EMITTENT Y | | | – 23 930,00 |
| S_EQC_z1# | EQ_CU | 1 | EMITTENT Z | | | – 47 860,00 |
| S_EQC_a1# | EQ_CD | 1 | EMITTENT A | | | 39 157,50 |
| S_EQC_a2# | EQ_CD | 1 | EMITTENT A | | | – 80 349,00 |
| S_EQC_aa1# | EQ_CD | 2 | EMITTENT AA | | | – 30 600,00 |
| S_EQC_ab1# | EQ_CD | 4 | EMITTENT AB | | | – 9 826,00 |
| S_EQC_ac1# | EQ_CD | 5 | EMITTENT AC | | | – 5 414,60 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_EQC_ad1# | EQ_CD | 6 | EMITTENT AD | | | 2 617,50 |
| S_EQC_ae1# | EQ_CD | 7 | EMITTENT AE | | | – 2 720,00 |
| S_EQC_af1# | EQ_CD | 8 | EMITTENT AF | | | – 28 250,00 |
| S_EQC_ag1# | EQ_CD | 9 | EMITTENT AG | | | – 30 935,00 |
| S_EQC_ah1# | EQ_CD | 10 | EMITTENT AH | | | – 15 025,00 |
| S_EQC_b1# | EQ_CD | 1 | EMITTENT B | | | – 238 910,00 |
| S_EQC_c1# | EQ_CD | 2 | EMITTENT C | | | 24 480,00 |
| S_EQC_d1# | EQ_CD | 3 | EMITTENT D | | | – 6 068,00 |
| S_EQC_e1# | EQ_CD | 4 | EMITTENT E | | | 12 310,00 |
| S_EQC_f1# | EQ_CD | 5 | EMITTENT F | | | 2 160,00 |
| S_EQC_g1# | EQ_CD | 6 | EMITTENT G | | | 2 617,50 |
| S_EQC_h1# | EQ_CD | 7 | EMITTENT H | | | 5 440,00 |
| S_EQC_i1# | EQ_CD | 8 | EMITTENT I | | | 20 050,00 |
| S_EQC_j1# | EQ_CD | 9 | EMITTENT J | | | 181 560,00 |
| S_EQC_k1# | EQ_CD | 10 | EMITTENT K | | | – 2 900,00 |
| S_EQC_q1# | EQ_CD | 11 | EMITTENT Q | | | 20 052,00 |
| S_EQC_r1# | EQ_CD | 11 | EMITTENT R | | | – 30 078,00 |
| S_EQC_s1# | EQ_CD | 3 | EMITTENT S | | | – 9 435,00 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_EQC_t1# | EQ_CD | 12 | EMITTENT T | | | – 7 400,00 |
| S_EQC_u1# | EQ_CD | 13 | EMITTENT U | | | – 11 040,00 |
| S_EQC_v1# | EQ_CD | 12 | EMITTENT V | | | 38 850,00 |
| S_EQC_w1# | EQ_CD | 13 | EMITTENT W | | | 57 960,00 |
| S_EQC_y1# | EQ_CD | 1 | EMITTENT Y | | | 13 590,00 |
| S_EQC_z1# | EQ_CD | 1 | EMITTENT Z | | | 27 180,00 |
| S_CNV_a5# | CSR_NON_SEC_V_5.00 | 1 | EMITTENT A | | | 100,00 |
| S_CNV_b4# | CSR_NON_SEC_V_5.00 | 1 | EMITTENT B | | | 50,00 |
| S_CNV_c4# | CSR_NON_SEC_V_5.00 | 3 | EMITTENT C | | | 150,00 |
| S_CNV_hb1# | CSR_NON_SEC_V_5.00 | 9 | EMITTENT HA | | | – 750,00 |
| S_CNV_a4# | CSR_NON_SEC_V_3.00 | 1 | EMITTENT A | | | – 500,00 |
| S_CNV_ab1# | CSR_NON_SEC_V_3.00 | 2 | EMITTENT AB | | | 325,00 |
| S_CNV_b3# | CSR_NON_SEC_V_3.00 | 1 | EMITTENT B | | | – 500,00 |
| S_CNV_c3# | CSR_NON_SEC_V_3.00 | 3 | EMITTENT C | | | 100,00 |
| S_CNV_v1# | CSR_NON_SEC_V_3.00 | 20 | INDIĊI V | | | 500,00 |
| S_CNV_a6# | CSR_NON_SEC_V_10.00 | 1 | EMITTENT A | | | 100,00 |
| S_CNV_b5# | CSR_NON_SEC_V_10.00 | 1 | EMITTENT B | | | 500,00 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_CNV_c5# | CSR_NON_SEC_V_10.00 | 3 | EMITTENT C | | | – 200,00 |
| S_CNV_a3# | CSR_NON_SEC_V_1.00 | 1 | EMITTENT A | | | 400,00 |
| S_CNV_b2# | CSR_NON_SEC_V_1.00 | 1 | EMITTENT B | | | 200,00 |
| S_CNV_c2# | CSR_NON_SEC_V_1.00 | 3 | EMITTENT C | | | 400,00 |
| S_CNV_a1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 1 | EMITTENT A | | | – 100,00 |
| S_CNV_a2# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 1 | EMITTENT A | | | 700,00 |
| S_CNV_b1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 1 | EMITTENT B | | | 900,00 |
| S_CNV_c1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 3 | EMITTENT C | | | – 500,00 |
| S_CNV_d1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 4 | EMITTENT D | | | 700,00 |
| S_CNV_e1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 5 | EMITTENT E | | | – 800,00 |
| S_CNV_f1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 6 | EMITTENT F | | | 700,00 |
| S_CNV_g1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 7 | EMITTENT G | | | – 400,00 |
| S_CNV_h1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 8 | EMITTENT H | | | – 50,00 |
| S_CNV_i1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 10 | EMITTENT I | | | 300,00 |
| S_CNV_j1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 11 | EMITTENT J | | | 50,00 |
| S_CNV_k1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 12 | EMITTENT K | | | – 300,00 |
| S_CNV_l1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 13 | EMITTENT L | | | 1 000,00 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_CNV_m1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 14 | EMITTENT M | | | – 350,00 |
| S_CNV_n1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 15 | EMITTENT N | | | 950,00 |
| S_CNV_o1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 16 | EMITTENT O | | | – 900,00 |
| S_CNV_p1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 17 | EMITTENT P | | | 200,00 |
| S_CNV_q1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 18 | EMITTENT Q | | | 400,00 |
| S_CNV_r1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 18 | EMITTENT R | | | – 300,00 |
| S_CNV_s1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 19 | INDIĊI S | | | 850,00 |
| S_CNV_t1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 20 | INDIĊI T | | | – 650,00 |
| S_CNV_u1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 19 | INDIĊI U | | | – 350,00 |
| S_CND_hb2# | CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT | 9 | EMITTENT HB | | | – 17 000,00 |
| S_CND_t1# | CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT | 3 | EMITTENT T | | | – 6 000,00 |
| S_CND_y1# | CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT | 20 | INDIĊI Y | | | 9 000,00 |
| S_CND_ab2# | CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS | 2 | EMITTENT AC | | | 14 000,00 |
| S_CND_b2# | CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS | 1 | EMITTENT B | | | – 17 000,00 |
| S_CND_w1# | CSR_NON_-SEC_D_10.00_DEBT | 10 | EMITTENT W | | CQS 1 | 9 000,00 |
| S_CND_a4# | CSR_NON_-SEC_D_1.00_DEBT | 1 | EMITTENT A | | | – 10 000,00 |
| S_CND_s1# | CSR_NON_-SEC_D_1.00_DEBT | 3 | EMITTENT S | | | – 6 000,00 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_CND_x1# | CSR_NON_SEC_D_1.00_CDS | 19 | INDIĊI X | | | – 18 500,00 |
| S_CND_a1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 1 | EMITTENT A | | | 20 000,00 |
| S_CND_a2# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 1 | EMITTENT A | | | – 30 000,00 |
| S_CND_b1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 1 | EMITTENT B | | | 12 000,00 |
| S_CND_c1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 3 | EMITTENT C | | | – 6 000,00 |
| S_CND_d1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 4 | EMITTENT D | | | 25 000,00 |
| S_CND_e1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 5 | EMITTENT E | | | – 4 000,00 |
| S_CND_f1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 6 | EMITTENT F | | | – 8 000,00 |
| S_CND_g1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 7 | EMITTENT G | | | 8 000,00 |
| S_CND_h1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 8 | EMITTENT H | | | 3 000,00 |
| S_CND_hb1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 9 | EMITTENT HA | | | – 23 000,00 |
| S_CND_i1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 10 | EMITTENT I | | CQS 2 | – 5 000,00 |
| S_CND_j1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 11 | EMITTENT J | | | 2 000,00 |
| S_CND_k1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 12 | EMITTENT K | | | 7 000,00 |
| S_CND_l1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 13 | EMITTENT L | | | – 9 000,00 |
| S_CND_m1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 14 | EMITTENT M | | | 10 000,00 |
| S_CND_n1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 15 | EMITTENT N | | | – 20 000,00 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_CND_o1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 16 | EMITTENT O | | | 5 000,00 |
| S_CND_p1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 17 | EMITTENT P | | | – 3 000,00 |
| S_CND_q1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 18 | EMITTENT Q | | | 10 000,00 |
| S_CND_r1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 18 | EMITTENT R | | | – 5 000,00 |
| S_CND_a3# | CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS | 1 | EMITTENT A | | | 15 000,00 |
| S_CND_ab1# | CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS | 2 | EMITTENT AB | | | 21 000,00 |
| S_CND_u1# | CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS | 19 | INDIĊI U | | | – 32 000,00 |
| S_CND_v1# | CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS | 20 | INDIĊI V | | | – 13 000,00 |
| S_CND_x2# | CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS | 19 | INDIĊI X | | | 52 500,00 |
| S_CNC_a1# | CSR_NON_SEC_CU | 1 | EMITTENT A | | | – 2 338,64 |
| S_CNC_a2# | CSR_NON_SEC_CU | 1 | EMITTENT A | | | 35 116,67 |
| S_CNC_aa1# | CSR_NON_SEC_CU | 10 | EMITTENT AA | | CQS 1 | – 1 212,50 |
| S_CNC_ab1# | CSR_NON_SEC_CU | 2 | EMITTENT AB1 | | | – 247,47 |
| S_CNC_b1# | CSR_NON_SEC_CU | 1 | EMITTENT B | | | 890,91 |
| S_CNC_c1# | CSR_NON_SEC_CU | 3 | EMITTENT C | | | – 500,00 |
| S_CNC_d1# | CSR_NON_SEC_CU | 4 | EMITTENT D | | | 415,00 |
| S_CNC_e1# | CSR_NON_SEC_CU | 5 | EMITTENT E | | | – 1 050,00 |





ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_CNC_f1# | CSR_NON_SEC_CU | 6 | EMITTENT F | | | – 150,00 |
| S_CNC_g1# | CSR_NON_SEC_CU | 7 | EMITTENT G | | | – 318,75 |
| S_CNC_h1# | CSR_NON_SEC_CU | 8 | EMITTENT H | | | – 425,00 |
| S_CNC_hb1# | CSR_NON_SEC_CU | 9 | EMITTENT HB1 | | | – 500,00 |
| S_CNC_i1# | CSR_NON_SEC_CU | 10 | EMITTENT I | | CQS 2 | – 937,50 |
| S_CNC_j1# | CSR_NON_SEC_CU | 11 | EMITTENT J | | | – 4 650,00 |
| S_CNC_k1# | CSR_NON_SEC_CU | 12 | EMITTENT K | | | – 425,00 |
| S_CNC_l1# | CSR_NON_SEC_CU | 13 | EMITTENT L | | | – 27 660,00 |
| S_CNC_m1# | CSR_NON_SEC_CU | 14 | EMITTENT M | | | – 488,00 |
| S_CNC_n1# | CSR_NON_SEC_CU | 15 | EMITTENT N | | | 13 237,50 |
| S_CNC_o1# | CSR_NON_SEC_CU | 16 | EMITTENT O | | | – 1 127,50 |
| S_CNC_p1# | CSR_NON_SEC_CU | 17 | EMITTENT P | | | – 5 775,00 |
| S_CNC_q1# | CSR_NON_SEC_CU | 18 | EMITTENT Q | | | – 7 842,00 |
| S_CNC_r1# | CSR_NON_SEC_CU | 18 | EMITTENT R | | | 15 684,00 |
| S_CNC_s1# | CSR_NON_SEC_CU | 4 | EMITTENT S | | | – 750,00 |
| S_CNC_t1# | CSR_NON_SEC_CU | 19 | EMITTENT T | | | 3 550,00 |
| S_CNC_u1# | CSR_NON_SEC_CU | 20 | EMITTENT U | | | 1 660,00 |
| S_CNC_v1# | CSR_NON_SEC_CU | 19 | EMITTENT V | | | – 18 637,50 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_CNC_w1# | CSR_NON_SEC_CU | 20 | EMITTENT W | | | – 8 715,00 |
| S_CNC_x1# | CSR_NON_SEC_CU | 3 | EMITTENT X | | | – 500,00 |
| S_CNC_y1# | CSR_NON_SEC_CU | 1 | EMITTENT Y | | | – 249,95 |
| S_CNC_z1# | CSR_NON_SEC_CU | 1 | EMITTENT Z | | | – 249,95 |
| S_CNC_a1# | CSR_NON_SEC_CD | 1 | EMITTENT A | | | 2 363,38 |
| S_CNC_a2# | CSR_NON_SEC_CD | 1 | EMITTENT A | | | – 35 314,65 |
| S_CNC_aa1# | CSR_NON_SEC_CD | 10 | EMITTENT AA | | CQS 1 | 1 150,00 |
| S_CNC_ab1# | CSR_NON_SEC_CD | 2 | EMITTENT AB1 | | | 247,47 |
| S_CNC_b1# | CSR_NON_SEC_CD | 1 | EMITTENT B | | | – 5 543,43 |
| S_CNC_c1# | CSR_NON_SEC_CD | 3 | EMITTENT C | | | 500,00 |
| S_CNC_d1# | CSR_NON_SEC_CD | 4 | EMITTENT D | | | – 385,00 |
| S_CNC_e1# | CSR_NON_SEC_CD | 5 | EMITTENT E | | | 575,00 |
| S_CNC_f1# | CSR_NON_SEC_CD | 6 | EMITTENT F | | | 75,00 |
| S_CNC_g1# | CSR_NON_SEC_CD | 7 | EMITTENT G | | | 287,50 |
| S_CNC_h1# | CSR_NON_SEC_CD | 8 | EMITTENT H | | | 400,00 |
| S_CNC_hb1# | CSR_NON_SEC_CD | 9 | EMITTENT HB1 | | | 500,00 |
| S_CNC_i1# | CSR_NON_SEC_CD | 10 | EMITTENT I | | CQS 2 | 750,00 |
| S_CNC_j1# | CSR_NON_SEC_CD | 11 | EMITTENT J | | | 4 100,00 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_CNC_k1# | CSR_NON_SEC_CD | 12 | EMITTENT K | | | 387,50 |
| S_CNC_l1# | CSR_NON_SEC_CD | 13 | EMITTENT L | | | 22 130,00 |
| S_CNC_m1# | CSR_NON_SEC_CD | 14 | EMITTENT M | | | 160,00 |
| S_CNC_n1# | CSR_NON_SEC_CD | 15 | EMITTENT N | | | – 23 437,50 |
| S_CNC_o1# | CSR_NON_SEC_CD | 16 | EMITTENT O | | | 1 246,25 |
| S_CNC_p1# | CSR_NON_SEC_CD | 17 | EMITTENT P | | | 6 225,00 |
| S_CNC_q1# | CSR_NON_SEC_CD | 18 | EMITTENT Q | | | 8 752,00 |
| S_CNC_r1# | CSR_NON_SEC_CD | 18 | EMITTENT R | | | – 17 504,00 |
| S_CNC_s1# | CSR_NON_SEC_CD | 4 | EMITTENT S | | | – 250,00 |
| S_CNC_t1# | CSR_NON_SEC_CD | 19 | EMITTENT T | | | – 3 500,00 |
| S_CNC_u1# | CSR_NON_SEC_CD | 20 | EMITTENT U | | | – 1 540,00 |
| S_CNC_v1# | CSR_NON_SEC_CD | 19 | EMITTENT V | | | 18 375,00 |
| S_CNC_w1# | CSR_NON_SEC_CD | 20 | EMITTENT W | | | 8 085,00 |
| S_CNC_x1# | CSR_NON_SEC_CD | 3 | EMITTENT X | | | 500,00 |
| S_CNC_y1# | CSR_NON_SEC_CD | 1 | EMITTENT Y | | | – 226,77 |
| S_CNC_z1# | CSR_NON_SEC_CD | 1 | EMITTENT Z | | | – 226,77 |
| S_CMV_a5# | CM_V_5.00 | 1 | FAĦAM | | | – 300,00 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_CMV_b4# | CM_V_5.00 | 1 | URANJU | | | 450,00 |
| S_CMV_a4# | CM_V_3.00 | 1 | FAĦAM | | | 800,00 |
| S_CMV_b3# | CM_V_3.00 | 1 | URANJU | | | 800,00 |
| S_CMV_a6# | CM_V_10.00 | 1 | FAĦAM | | | 100,00 |
| S_CMV_b5# | CM_V_10.00 | 1 | URANJU | | | – 250,00 |
| S_CMV_a3# | CM_V_1.00 | 1 | FAĦAM | | | – 200,00 |
| S_CMV_b2# | CM_V_1.00 | 1 | URANJU | | | – 750,00 |
| S_CMV_d1# | CM_V_1.00 | 2 | WTI | | | – 175,00 |
| S_CMV_f1# | CM_V_1.00 | 3 | FWD ELETTRIKU NE | | | – 450,00 |
| S_CMV_h1# | CM_V_1.00 | 4 | PANAMAX | | | – 5 500,00 |
| S_CMV_j1# | CM_V_1.00 | 5 | RAM | | | – 200,00 |
| S_CMV_l1# | CM_V_1.00 | 6 | GASS NATURALI LIKWIFIKAT | | | 1 000,00 |
| S_CMV_n1# | CM_V_1.00 | 7 | FIDDA | | | 500,00 |
| S_CMV_p1# | CM_V_1.00 | 8 | QAMĦIRRUN | | | – 1 000,00 |
| S_CMV_r1# | CM_V_1.00 | 9 | XORROX | | | – 125,00 |
| S_CMV_t1# | CM_V_1.00 | 10 | LASKTU | | | – 50,00 |
| S_CMV_v1# | CM_V_1.00 | 11 | PUTASSA | | | – 1 800,00 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_CMV_a1# | CM_V_0.50 | 1 | FAĦAM | | | 1 000,00 |
| S_CMV_a2# | CM_V_0.50 | 1 | FAĦAM | | | – 350,00 |
| S_CMV_b1# | CM_V_0.50 | 1 | URANJU | | | 150,00 |
| S_CMV_c1# | CM_V_0.50 | 2 | BRENT | | | 200,00 |
| S_CMV_e1# | CM_V_0.50 | 3 | ELETTRIKU SPOT SE | | | – 300,00 |
| S_CMV_g1# | CM_V_0.50 | 4 | SUPRAMAX | | | – 5 000,00 |
| S_CMV_i1# | CM_V_0.50 | 5 | AZZAR | | | 550,00 |
| S_CMV_k1# | CM_V_0.50 | 6 | GASS NATURALI | | | 400,00 |
| S_CMV_m1# | CM_V_0.50 | 7 | DEHEB | | | – 200,00 |
| S_CMV_o1# | CM_V_0.50 | 8 | FAŻOLA TAS-SOJJA | | | – 750,00 |
| S_CMV_q1# | CM_V_0.50 | 9 | ĦUT | | | 250,00 |
| S_CMV_s1# | CM_V_0.50 | 10 | KAKAW | | | 350,00 |
| S_CMV_u1# | CM_V_0.50 | 11 | ĦĠIEĠ ĊATT | | | 3 000,00 |
| S_CMV_w1# | CM_V_0.50 | 4 | SUPRAMAX | | | – 5 000,00 |
| S_CMV_x1# | CM_V_0.50 | 4 | PANAMAX | | | 15 000,00 |
| S_CMD_p1# | CM_D_30.00 | 8 | QAMĦIRRUN | OKLAHOMA | | – 10 000,00 |
| S_CMD_f1# | CM_D_3.00 | 3 | FWD ELETTRIKU NE | TEXAS | | – 4 500,00 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_CMD_h1# | CM_D_3.00 | 4 | PANAMAX | NEW ORLEANS | | – 68 750,00 |
| S_CMD_n1# | CM_D_20.00 | 7 | FIDDA | EU1 | | 5 000,00 |
| S_CMD_r1# | CM_D_20.00 | 9 | XORROX | NEWCASTLE | | – 1 250,00 |
| S_CMD_d1# | CM_D_2.00 | 2 | WTI | OKLAHOMA | | – 1 750,00 |
| S_CMD_l1# | CM_D_15.00 | 6 | GASS NATURALI LIKWIFIKAT | OKLAHOMA | | 10 000,00 |
| S_CMD_t1# | CM_D_15.00 | 10 | LASKTU | NEWCASTLE | | – 500,00 |
| S_CMD_j1# | CM_D_10.00 | 5 | RAM | OKLAHOMA | | – 2 000,00 |
| S_CMD_v1# | CM_D_10.00 | 11 | PUTASSA | NEWCASTLE | | – 18 000,00 |
| S_CMD_b1# | CM_D_1.00 | 1 | URANJU | OKLAHOMA | | 1 500,00 |
| S_CMD_g1# | CM_D_1.00 | 4 | SUPRAMAX | SANTOS | | – 62 500,00 |
| S_CMD_w1# | CM_D_1.00 | 4 | SUPRAMAX | SANTOS | | – 62 500,00 |
| S_CMD_x1# | CM_D_1.00 | 4 | PANAMAX | NEW ORLEANS | | 187 500,00 |
| S_CMD_a4# | CM_D_0.50 | 1 | FAĦAM | NEWCASTLE | | 8 000,00 |
| S_CMD_a1# | CM_D_0.00 | 1 | FAĦAM | NEWCASTLE | | 10 000,00 |
| S_CMD_a2# | CM_D_0.00 | 1 | FAĦAM | NEWCASTLE | | – 3 500,00 |
| S_CMD_a3# | CM_D_0.00 | 1 | FAĦAM | LONDRA | | – 2 000,00 |
| S_CMD_c1# | CM_D_0.00 | 2 | BRENT | LE HAVRE | | 2 000,00 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_CMD_e1# | CM_D_0.00 | 3 | ELETTRIKU SPOT SE | LONDRA | | – 3 000,00 |
| S_CMD_i1# | CM_D_0.00 | 5 | AZZAR | LE HAVRE | | 5 500,00 |
| S_CMD_k1# | CM_D_0.00 | 6 | GASS NATURALI | LE HAVRE | | 4 000,00 |
| S_CMD_m1# | CM_D_0.00 | 7 | DEHEB | UK1 | | – 2 000,00 |
| S_CMD_o1# | CM_D_0.00 | 8 | FAŻOLA TAS-SOJJA | LE HAVRE | | – 7 500,00 |
| S_CMD_q1# | CM_D_0.00 | 9 | ĦUT | LONDRA | | 2 500,00 |
| S_CMD_s1# | CM_D_0.00 | 10 | KAKAW | LONDRA | | 3 500,00 |
| S_CMD_u1# | CM_D_0.00 | 11 | ĦĠIEĠ ĊATT | LONDRA | | 30 000,00 |
| S_CMC_a1# | CM_CU | 1 | FAĦAM | | | 17 335,00 |
| S_CMC_a2# | CM_CU | 1 | FAĦAM | | | 36 936,00 |
| S_CMC_b1# | CM_CU | 1 | URANJU | | | 6 635,00 |
| S_CMC_c1# | CM_CU | 2 | BRENT | | | – 11 600,00 |
| S_CMC_d1# | CM_CU | 2 | WTI | | | – 36 900,00 |
| S_CMC_e1# | CM_CU | 3 | ELETTRIKU SPOT SE | | | 8 563,00 |
| S_CMC_f1# | CM_CU | 3 | FWD ELETTRIKU NE | | | – 27 250,00 |
| S_CMC_g1# | CM_CU | 4 | SUPRAMAX | | | – 36 880,00 |
| S_CMC_h1# | CM_CU | 4 | PANAMAX | | | 29 472,00 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_CMC_i1# | CM_CU | 5 | AZZAR | | | – 5 850,00 |
| S_CMC_j1# | CM_CU | 5 | RAM | | | 14 644,80 |
| S_CMC_k1# | CM_CU | 6 | GASS NATURALI | | | – 6 147,50 |
| S_CMC_l1# | CM_CU | 6 | GASS NATURALI LIKWIFIKAT | | | – 6 147,50 |
| S_CMC_m1# | CM_CU | 7 | DEHEB | | | – 1 486,67 |
| S_CMC_n1# | CM_CU | 7 | FIDDA | | | 743,33 |
| S_CMC_o1# | CM_CU | 8 | FAŻOLA TAS-SOJJA | | | – 14 535,00 |
| S_CMC_p1# | CM_CU | 8 | QAMĦIRRUN | | | 20 475,00 |
| S_CMC_q1# | CM_CU | 9 | ĦUT | | | – 19 900,00 |
| S_CMC_r1# | CM_CU | 9 | XORROX | | | 3 387,00 |
| S_CMC_s1# | CM_CU | 10 | KAKAW | | | 1 005,00 |
| S_CMC_t1# | CM_CU | 10 | LASKTU | | | 10 892,20 |
| S_CMC_u1# | CM_CU | 11 | ĦĠIEĠ ĊATT | | | – 13 790,00 |
| S_CMC_v1# | CM_CU | 11 | PUTASSA | | | 20 685,00 |
| S_CMC_x1# | CM_CU | 9 | ĦALIB | | | – 6 300,00 |
| S_CMC_y1# | CM_CU | 1 | URANJU | | | – 65 864,00 |
| S_CMC_z1# | CM_CU | 4 | PANAMAX | | | 29 472,00 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_CMC_a1# | CM_CD | 1 | FAĦAM | | | – 18 260,00 |
| S_CMC_a2# | CM_CD | 1 | FAĦAM | | | – 37 630,00 |
| S_CMC_b1# | CM_CD | 1 | URANJU | | | – 70 460,00 |
| S_CMC_c1# | CM_CD | 2 | BRENT | | | 8 320,00 |
| S_CMC_d1# | CM_CD | 2 | WTI | | | 3 550,00 |
| S_CMC_e1# | CM_CD | 3 | ELETTRIKU SPOT SE | | | – 8 233,00 |
| S_CMC_f1# | CM_CD | 3 | FWD ELETTRIKU NE | | | 16 370,00 |
| S_CMC_g1# | CM_CD | 4 | SUPRAMAX | | | 29 110,00 |
| S_CMC_h1# | CM_CD | 4 | PANAMAX | | | – 15 256,00 |
| S_CMC_i1# | CM_CD | 5 | AZZAR | | | 4 080,00 |
| S_CMC_j1# | CM_CD | 5 | RAM | | | – 10 219,80 |
| S_CMC_k1# | CM_CD | 6 | GASS NATURALI | | | 4 222,50 |
| S_CMC_l1# | CM_CD | 6 | GASS NATURALI LIKWIFIKAT | | | 4 222,50 |
| S_CMC_m1# | CM_CD | 7 | DEHEB | | | 1 353,33 |
| S_CMC_n1# | CM_CD | 7 | FIDDA | | | – 676,67 |
| S_CMC_o1# | CM_CD | 8 | FAŻOLA TAS-SOJJA | | | 10 435,00 |
| S_CMC_p1# | CM_CD | 8 | QAMĦIRRUN | | | – 14 735,00 |

| Strument | Identifikatur tal-fattur ta' riskju | Bucket | Identifikatur addizzjonali | Identifikatur addizzjonali2 | Kategorija tal-kwalità tal-kreditu | Sensittività għar-riskju |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_CMC_q1# | CM_CD | 9 | ĦUT | | | 6 700,00 |
| S_CMC_r1# | CM_CD | 9 | XORROX | | | – 3 012,00 |
| S_CMC_s1# | CM_CD | 10 | KAKAW | | | – 1 415,00 |
| S_CMC_t1# | CM_CD | 10 | LASKTU | | | – 7 817,20 |
| S_CMC_u1# | CM_CD | 11 | ĦĠIEĠ ĊATT | | | 14 200,00 |
| S_CMC_v1# | CM_CD | 11 | PUTASSA | | | – 21 300,00 |
| S_CMC_x1# | CM_CD | 9 | ĦALIB | | | – 4 700,00 |
| S_CMC_y1# | CM_CD | 1 | URANJU | | | – 66 344,00 |
| S_CMC_z1# | CM_CD | 4 | PANAMAX | | | – 22 856,00 |

| Portafoll | Klassi ta' riskju | Komponent | Strumenti |
|---|---|---|---|
| G000 | GIRR | DELTA | S_IRD_a1# |
| G001 | GIRR | DELTA | S_IRD_b1# |
| G002 | GIRR | DELTA | S_IRD_b2# |
| G003 | GIRR | DELTA | S_IRD_b3# |
| G004 | GIRR | DELTA | S_IRD_b4# |
| G005 | GIRR | DELTA | S_IRD_b5# |
| G006 | GIRR | DELTA | S_IRD_b6# |
| G007 | GIRR | DELTA | S_IRD_b7# |
| G008 | GIRR | DELTA | S_IRD_b8# |
| G009 | GIRR | DELTA | S_IRD_b9# |
| G010 | GIRR | DELTA | S_IRD_b10# |
| G011 | GIRR | DELTA | S_IRD_b11# |
| G012 | GIRR | DELTA | S_IRD_b12# |
| G013 | GIRR | DELTA | S_IRD_d1# |
| G014 | GIRR | DELTA | S_IRD_d2# |
| G015 | GIRR | DELTA | S_IRD_d3# |
| G016 | GIRR | DELTA | S_IRD_d4# |
| G017 | GIRR | DELTA | S_IRD_d5# |
| G018 | GIRR | DELTA | S_IRD_d6# |
| G019 | GIRR | DELTA | S_IRD_d7# |
| G020 | GIRR | DELTA | S_IRD_d8# |
| G021 | GIRR | DELTA | S_IRD_d9# |
| G022 | GIRR | DELTA | S_IRD_d10# |
| G023 | GIRR | DELTA | S_IRD_d11# |
| G024 | GIRR | DELTA | S_IRD_d12# |
| G025 | GIRR | DELTA | S_IRD_a1# S_IRD_b1# |
| G026 | GIRR | DELTA | S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# |
| G027 | GIRR | DELTA | S_IRD_b1# S_IRD_c1# |
| G028 | GIRR | DELTA | S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10# |

| Portafoll | Klassi ta' riskju | Komponent | Strumenti |
|---|---|---|---|
| G029 | GIRR | DELTA | S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# |
| G030 | GIRR | DELTA | S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12# |
| G031 | GIRR | DELTA | S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c6# |
| G032 | GIRR | DELTA | S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10# S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12# |
| G033 | GIRR | DELTA | S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12# S_IRD_e1# S_IRD_e2# S_IRD_e3# S_IRD_e4# S_IRD_e5# S_IRD_e6# S_IRD_e7# S_IRD_e8# S_IRD_e9# S_IRD_e10# S_IRD_e11# S_IRD_e12# S_IRD_e13# |
| G034 | GIRR | DELTA | S_IRD_a1# S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10# S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12# S_IRD_e1# S_IRD_e2# S_IRD_e3# S_IRD_e4# S_IRD_e5# S_IRD_e6# S_IRD_e7# S_IRD_e8# S_IRD_e9# S_IRD_e10# S_IRD_e11# S_IRD_e12# S_IRD_e13# S_IRD_f1# |
| G035 | GIRR | VEGA | S_IRV_b1# |
| G036 | GIRR | VEGA | S_IRV_a1# S_IRV_b1# |
| G037 | GIRR | VEGA | S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# |
| G038 | GIRR | VEGA | S_IRV_b1# S_IRV_b6# S_IRV_b11# S_IRV_b16# S_IRV_b21# |

| Portafoll | Klassi ta' riskju | Komponent | Strumenti |
|---|---|---|---|
| G039 | GIRR | VEGA | S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25# |
| G040 | GIRR | VEGA | S_IRV_e1# S_IRV_e2# |
| G041 | GIRR | VEGA | S_IRV_e1# S_IRV_e3# |
| G042 | GIRR | VEGA | S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5# |
| G043 | GIRR | VEGA | S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25# S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5# |
| G044 | GIRR | VEGA | S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5# S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5# |
| G045 | GIRR | VEGA | S_IRV_a1# S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25# S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5# S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5# S_IRV_e1# S_IRV_e2# S_IRV_e3# |
| G046 | GIRR | KURVATURA | S_IRC_b1# |
| G047 | GIRR | KURVATURA | S_IRC_c1# |
| G048 | GIRR | KURVATURA | S_IRC_a1# S_IRC_b1# |
| G049 | GIRR | KURVATURA | S_IRC_d1# |
| G050 | GIRR | KURVATURA | S_IRC_b1# S_IRC_c1# |
| G051 | GIRR | KURVATURA | S_IRC_c1# S_IRC_e1# |
| G052 | GIRR | KURVATURA | S_IRC_d1# S_IRC_e1# |
| G053 | GIRR | KURVATURA | S_IRC_a1# S_IRC_a1# S_IRC_b1# S_IRC_b1# S_IRC_c1# S_IRC_c1# S_IRC_d1# S_IRC_d1# S_IRC_e1# S_IRC_e1# |

| Portafoll | Klassi ta' riskju | Komponent | Strumenti |
|---|---|---|---|
| G054 | GIRR | KOLLHA | S_IRD_a1# S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10# S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12# S_IRD_e1# S_IRD_e2# S_IRD_e3# S_IRD_e4# S_IRD_e5# S_IRD_e6# S_IRD_e7# S_IRD_e8# S_IRD_e9# S_IRD_e10# S_IRD_e11# S_IRD_e12# S_IRD_e13# S_IRD_f1# S_IRV_a1# S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25# S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5# S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5# S_IRV_e1# S_IRV_e2# S_IRV_e3# S_IRC_a1# S_IRC_a1# S_IRC_b1# S_IRC_b1# S_IRC_c1# S_IRC_c1# S_IRC_d1# S_IRC_d1# S_IRC_e1# S_IRC_e1# |
| G055 | GIRR | DELTA | S_IRD_e11# S_IRD_e13# |
| G056 | GIRR | DELTA | S_IRD_e1# S_IRD_f1# |
| E001 | EQ | DELTA | S_EQD_a2# |
| E002 | EQ | DELTA | S_EQD_c1# |
| E003 | EQ | DELTA | S_EQD_d1# |
| E004 | EQ | DELTA | S_EQD_e1# |
| E005 | EQ | DELTA | S_EQD_f1# |
| E006 | EQ | DELTA | S_EQD_h1# |
| E007 | EQ | DELTA | S_EQD_i1# |
| E008 | EQ | DELTA | S_EQD_j1# |
| E009 | EQ | DELTA | S_EQD_k1# |
| E010 | EQ | DELTA | S_EQD_m1# |
| E011 | EQ | DELTA | S_EQD_o1# |
| E012 | EQ | DELTA | S_EQD_q1# |
| E013 | EQ | DELTA | S_EQD_s1# |
| E014 | EQ | DELTA | S_EQD_a3# |

| Portafoll | Klassi ta' riskju | Komponent | Strumenti |
|---|---|---|---|
| E015 | EQ | DELTA | S_EQD_x1# |
| E016 | EQ | DELTA | S_EQD_y1# |
| E017 | EQ | DELTA | S_EQD_z1# |
| E018 | EQ | DELTA | S_EQD_f2# |
| E019 | EQ | DELTA | S_EQD_aa1# |
| E020 | EQ | DELTA | S_EQD_ab1# |
| E021 | EQ | DELTA | S_EQD_ac1# |
| E022 | EQ | DELTA | S_EQD_k2# |
| E023 | EQ | DELTA | S_EQD_m2# |
| E024 | EQ | DELTA | S_EQD_p1# |
| E025 | EQ | DELTA | S_EQD_q2# |
| E026 | EQ | DELTA | S_EQD_t1# |
| E027 | EQ | DELTA | S_EQD_a1# S_EQD_a2# |
| E028 | EQ | DELTA | S_EQD_a2# S_EQD_a3# |
| E029 | EQ | DELTA | S_EQD_a2# S_EQD_b1# |
| E030 | EQ | DELTA | S_EQD_a2# S_EQD_b2# |
| E031 | EQ | DELTA | S_EQD_f1# S_EQD_f2# |
| E032 | EQ | DELTA | S_EQD_f1# S_EQD_g1# |
| E033 | EQ | DELTA | S_EQD_f1# S_EQD_g2# |
| E034 | EQ | DELTA | S_EQD_k1# S_EQD_k2# |
| E035 | EQ | DELTA | S_EQD_k1# S_EQD_l1# |
| E036 | EQ | DELTA | S_EQD_k1# S_EQD_l2# |
| E037 | EQ | DELTA | S_EQD_m1# S_EQD_m2# |
| E038 | EQ | DELTA | S_EQD_m1# S_EQD_n1# |
| E039 | EQ | DELTA | S_EQD_m1# S_EQD_n2# |
| E040 | EQ | DELTA | S_EQD_o1# S_EQD_p1# |
| E041 | EQ | DELTA | S_EQD_q1# S_EQD_q2# |
| E042 | EQ | DELTA | S_EQD_q1# S_EQD_r1# |
| E043 | EQ | DELTA | S_EQD_s1# S_EQD_t1# |
| E044 | EQ | DELTA | S_EQD_s1# S_EQD_t1# S_EQD_t2# |

| Portafoll | Klassi ta' riskju | Komponent | Strumenti |
|---|---|---|---|
| E045 | EQ | DELTA | S_EQD_a2# S_EQD_c1# S_EQD_d1# S_EQD_e1# S_EQD_f1# S_EQD_h1# S_EQD_i1# S_EQD_j1# S_EQD_k1# S_EQD_m1# |
| E046 | EQ | DELTA | S_EQD_a2# S_EQD_o1# |
| E047 | EQ | DELTA | S_EQD_q1# S_EQD_s1# |
| E048 | EQ | DELTA | S_EQD_a2# S_EQD_q1# |
| E049 | EQ | DELTA | S_EQD_k1# S_EQD_l1# S_EQD_m1# S_EQD_n1# S_EQD_q1# S_EQD_s2# S_EQD_u1# S_EQD_v1# |
| E050 | EQ | DELTA | S_EQD_a1# S_EQD_a2# S_EQD_a3# S_EQD_b1# S_EQD_b2# S_EQD_c1# S_EQD_x1# S_EQD_d1# S_EQD_y1# S_EQD_e1# S_EQD_z1# S_EQD_f1# S_EQD_f2# S_EQD_g1# S_EQD_g2# S_EQD_h1# S_EQD_aa1# S_EQD_i1# S_EQD_ab1# S_EQD_j1# S_EQD_ac1# S_EQD_k1# S_EQD_k2# S_EQD_l1# S_EQD_l2# S_EQD_m1# S_EQD_m2# S_EQD_n1# S_EQD_n2# S_EQD_o1# S_EQD_p1# S_EQD_q1# S_EQD_q2# S_EQD_r1# S_EQD_r2# S_EQD_s1# S_EQD_s2# S_EQD_t1# S_EQD_t2# S_EQD_u1# S_EQD_v1# |
| E051 | EQ | VEGA | S_EQV_a2# |
| E052 | EQ | VEGA | S_EQV_c1# |
| E053 | EQ | VEGA | S_EQV_d1# |
| E054 | EQ | VEGA | S_EQV_e1# |
| E055 | EQ | VEGA | S_EQV_f1# |
| E056 | EQ | VEGA | S_EQV_g1# |
| E057 | EQ | VEGA | S_EQV_h1# |
| E058 | EQ | VEGA | S_EQV_i1# |
| E059 | EQ | VEGA | S_EQV_j1# |
| E060 | EQ | VEGA | S_EQV_k1# |
| E061 | EQ | VEGA | S_EQV_l1# |
| E062 | EQ | VEGA | S_EQV_n1# |
| E063 | EQ | VEGA | S_EQV_p1# |
| E064 | EQ | VEGA | S_EQV_a1# S_EQV_a2# |
| E065 | EQ | VEGA | S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6# |
| E066 | EQ | VEGA | S_EQV_a2# S_EQV_b1# |
| E067 | EQ | VEGA | S_EQV_a1# S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6# S_EQV_b1# S_EQV_b2# S_EQV_b3# S_EQV_b4# S_EQV_b5# |

| Portafoll | Klassi ta' riskju | Komponent | Strumenti |
|---|---|---|---|
| E068 | EQ | VEGA | S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5# |
| E069 | EQ | VEGA | S_EQV_f1# S_EQV_aa1# |
| E070 | EQ | VEGA | S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5# S_EQV_aa1# S_EQV_aa2# S_EQV_aa3# S_EQV_aa4# S_EQV_aa5# |
| E071 | EQ | VEGA | S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5# |
| E072 | EQ | VEGA | S_EQV_j1# S_EQV_ae1# |
| E073 | EQ | VEGA | S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5# S_EQV_ae1# S_EQV_ae2# S_EQV_ae3# S_EQV_ae4# S_EQV_ae5# |
| E074 | EQ | VEGA | S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5# |
| E075 | EQ | VEGA | S_EQV_k1# S_EQV_af1# |
| E076 | EQ | VEGA | S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5# S_EQV_af1# S_EQV_af2# S_EQV_af3# S_EQV_af4# S_EQV_af5# |
| E077 | EQ | VEGA | S_EQV_l1# S_EQV_m1# |
| E078 | EQ | VEGA | S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5# |
| E079 | EQ | VEGA | S_EQV_n1# S_EQV_o1# |
| E080 | EQ | VEGA | S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5# S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5# |
| E081 | EQ | VEGA | S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5# |
| E082 | EQ | VEGA | S_EQV_a2# S_EQV_c1# S_EQV_d1# S_EQV_e1# S_EQV_f1# S_EQV_g1# S_EQV_h1# S_EQV_i1# S_EQV_j1# S_EQV_k1# |
| E083 | EQ | VEGA | S_EQV_a2# S_EQV_m1# |
| E084 | EQ | VEGA | S_EQV_n1# S_EQV_p1# |
| E085 | EQ | VEGA | S_EQV_a2# S_EQV_n1# |
| E086 | EQ | VEGA | S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5# S_EQV_p1# |

| Portafoll | Klassi ta' riskju | Komponent | Strumenti |
|---|---|---|---|
| E087 | EQ | VEGA | S_EQV_a1# S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6# S_EQV_b1# S_EQV_b2# S_EQV_b3# S_EQV_b4# S_EQV_b5# S_EQV_c1# S_EQV_x1# S_EQV_d1# S_EQV_y1# S_EQV_e1# S_EQV_z1# S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5# S_EQV_aa1# S_EQV_aa2# S_EQV_aa3# S_EQV_aa4# S_EQV_aa5# S_EQV_g1# S_EQV_ab1# S_EQV_h1# S_EQV_ac1# S_EQV_i1# S_EQV_ad1# S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5# S_EQV_ae1# S_EQV_ae2# S_EQV_ae3# S_EQV_ae4# S_EQV_ae5# S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5# S_EQV_af1# S_EQV_af2# S_EQV_af3# S_EQV_af4# S_EQV_af5# S_EQV_l1# S_EQV_m1# S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5# S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5# S_EQV_p1# S_EQV_q1# |
| E088 | EQ | KURVATURA | S_EQC_b1# |
| E089 | EQ | KURVATURA | S_EQC_c1# |
| E090 | EQ | KURVATURA | S_EQC_d1# |
| E091 | EQ | KURVATURA | S_EQC_e1# |
| E092 | EQ | KURVATURA | S_EQC_f1# |
| E093 | EQ | KURVATURA | S_EQC_g1# |
| E094 | EQ | KURVATURA | S_EQC_h1# |
| E095 | EQ | KURVATURA | S_EQC_i1# |
| E096 | EQ | KURVATURA | S_EQC_j1# |
| E097 | EQ | KURVATURA | S_EQC_k1# |
| E098 | EQ | KURVATURA | S_EQC_q1# |
| E099 | EQ | KURVATURA | S_EQC_t1# |
| E100 | EQ | KURVATURA | S_EQC_u1# |
| E101 | EQ | KURVATURA | S_EQC_a1# S_EQC_a2# |
| E102 | EQ | KURVATURA | S_EQC_a1# S_EQC_b1# |
| E103 | EQ | KURVATURA | S_EQC_f1# S_EQC_ac1# |
| E104 | EQ | KURVATURA | S_EQC_j1# S_EQC_ag1# |
| E105 | EQ | KURVATURA | S_EQC_k1# S_EQC_ah1# |
| E106 | EQ | KURVATURA | S_EQC_q1# S_EQC_r1# |
| E107 | EQ | KURVATURA | S_EQC_t1# S_EQC_v1# |

| Portafoll | Klassi ta' riskju | Komponent | Strumenti |
|---|---|---|---|
| E108 | EQ | KURVATURA | S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_y1# S_EQC_z1# |
| E109 | EQ | KURVATURA | S_EQC_s1# |
| E110 | EQ | KURVATURA | S_EQC_a2# S_EQC_c1# S_EQC_d1# S_EQC_e1# S_EQC_f1# S_EQC_g1# S_EQC_h1# S_EQC_i1# S_EQC_j1# S_EQC_k1# |
| E111 | EQ | KURVATURA | S_EQC_a2# S_EQC_q1# |
| E112 | EQ | KURVATURA | S_EQC_t1# S_EQC_u1# |
| E113 | EQ | KURVATURA | S_EQC_a2# S_EQC_t1# |
| E114 | EQ | KURVATURA | S_EQC_a1# S_EQC_b1# S_EQC_d1# S_EQC_s1# |
| E115 | EQ | KURVATURA | S_EQC_a1# S_EQC_b1# S_EQC_t1# S_EQC_u1# |
| E116 | EQ | KURVATURA | S_EQC_a1# S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_b1# S_EQC_c1# S_EQC_c1# S_EQC_aa1# S_EQC_aa1# S_EQC_d1# S_EQC_d1# S_EQC_e1# S_EQC_e1# S_EQC_ab1# S_EQC_ab1# S_EQC_f1# S_EQC_f1# S_EQC_ac1# S_EQC_ac1# S_EQC_g1# S_EQC_g1# S_EQC_ad1# S_EQC_ad1# S_EQC_h1# S_EQC_h1# S_EQC_ae1# S_EQC_ae1# S_EQC_i1# S_EQC_i1# S_EQC_af1# S_EQC_af1# S_EQC_j1# S_EQC_j1# S_EQC_ag1# S_EQC_ag1# S_EQC_k1# S_EQC_k1# S_EQC_ah1# S_EQC_ah1# S_EQC_q1# S_EQC_q1# S_EQC_r1# S_EQC_r1# S_EQC_s1# S_EQC_s1# S_EQC_t1# S_EQC_t1# S_EQC_u1# S_EQC_u1# S_EQC_v1# S_EQC_v1# S_EQC_w1# S_EQC_w1# S_EQC_y1# S_EQC_y1# S_EQC_z1# S_EQC_z1# |
| E117 | EQ | KOLLHA | S_EQD_a1# S_EQD_a2# S_EQD_a3# S_EQD_b1# S_EQD_b2# S_EQD_c1# S_EQD_x1# S_EQD_d1# S_EQD_y1# S_EQD_e1# S_EQD_z1# S_EQD_f1# S_EQD_f2# S_EQD_g1# S_EQD_g2# S_EQD_h1# S_EQD_aa1# S_EQD_i1# S_EQD_ab1# S_EQD_j1# S_EQD_ac1# S_EQD_k1# S_EQD_k2# S_EQD_l1# S_EQD_l2# S_EQD_m1# S_EQD_m2# S_EQD_n1# S_EQD_n2# S_EQD_o1# S_EQD_p1# S_EQD_q1# S_EQD_q2# S_EQD_r1# S_EQD_r2# S_EQD_s1# S_EQD_s2# S_EQD_t1# S_EQD_t2# S_EQD_u1# S_EQD_v1# S_EQV_a1# S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6# S_EQV_b1# S_EQV_b2# S_EQV_b3# S_EQV_b4# S_EQV_b5# S_EQV_c1# S_EQV_x1# S_EQV_d1# S_EQV_y1# S_EQV_e1# S_EQV_z1# S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5# S_EQV_aa1# S_EQV_aa2# S_EQV_aa3# S_EQV_aa4# S_EQV_aa5# S_EQV_g1# S_EQV_ab1# S_EQV_h1# S_EQV_ac1# S_EQV_i1# S_EQV_ad1# S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5# |

| Portafoll | Klassi ta' riskju | Komponent | Strumenti |
|---|---|---|---|
| | | | S_EQV_ae1# S_EQV_ae2# S_EQV_ae3# S_EQV_ae4# S_EQV_ae5# S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5# S_EQV_af1# S_EQV_af2# S_EQV_af3# S_EQV_af4# S_EQV_af5# S_EQV_l1# S_EQV_m1# S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5# S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5# S_EQV_p1# S_EQV_q1# S_EQC_a1# S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_b1# S_EQC_c1# S_EQC_c1# S_EQC_aa1# S_EQC_aa1# S_EQC_d1# S_EQC_d1# S_EQC_e1# S_EQC_e1# S_EQC_ab1# S_EQC_ab1# S_EQC_f1# S_EQC_f1# S_EQC_ac1# S_EQC_ac1# S_EQC_g1# S_EQC_g1# S_EQC_ad1# S_EQC_ad1# S_EQC_h1# S_EQC_h1# S_EQC_ae1# S_EQC_ae1# S_EQC_i1# S_EQC_i1# S_EQC_af1# S_EQC_af1# S_EQC_j1# S_EQC_j1# S_EQC_ag1# S_EQC_ag1# S_EQC_k1# S_EQC_k1# S_EQC_ah1# S_EQC_ah1# S_EQC_q1# S_EQC_q1# S_EQC_r1# S_EQC_r1# S_EQC_s1# S_EQC_s1# S_EQC_t1# S_EQC_t1# S_EQC_u1# S_EQC_u1# S_EQC_v1# S_EQC_v1# S_EQC_w1# S_EQC_w1# S_EQC_y1# S_EQC_y1# S_EQC_z1# S_EQC_z1# |
| F001 | FX | DELTA | S_FXD_b1# |
| F002 | FX | DELTA | S_FXD_c1# |
| F003 | FX | DELTA | S_FXD_a1# S_FXD_b1# |
| F005 | FX | DELTA | S_FXD_b1# S_FXD_c1# |
| F007 | FX | DELTA | S_FXD_a1# S_FXD_b1# S_FXD_c1# S_FXD_d1# S_FXD_e1# S_FXD_f1# |
| F008 | FX | VEGA | S_FXV_b1# |
| F009 | FX | VEGA | S_FXV_a1# S_FXV_b1# |
| F010 | FX | VEGA | S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5# |
| F011 | FX | VEGA | S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5# |
| F012 | FX | VEGA | S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5# S_FXV_c1# |
| F013 | FX | VEGA | S_FXV_c1# S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5# |
| F014 | FX | VEGA | S_FXV_a1# S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5# S_FXV_c1# S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5# |

| Portafoll | Klassi ta' riskju | Komponent | Strumenti |
|---|---|---|---|
| F015 | FX | KURVATURA | S_FXC_b1# |
| F016 | FX | KURVATURA | S_FXC_c1# |
| F017 | FX | KURVATURA | S_FXC_a1# S_FXC_b1# |
| F018 | FX | KURVATURA | S_FXC_d1# |
| F019 | FX | KURVATURA | S_FXC_b1# S_FXC_c1# |
| F020 | FX | KURVATURA | S_FXC_c1# S_FXC_e1# |
| F021 | FX | KURVATURA | S_FXC_b1# S_FXC_d1# S_FXC_e1# |
| F022 | FX | KURVATURA | S_FXC_a1# S_FXC_a1# S_FXC_b1# S_FXC_b1# S_FXC_c1# S_FXC_c1# S_FXC_d1# S_FXC_d1# S_FXC_e1# S_FXC_e1# S_FXC_f1# S_FXC_f1# |
| F023 | FX | KOLLHA | S_FXD_a1# S_FXD_b1# S_FXD_c1# S_FXD_d1# S_FXD_e1# S_FXD_f1# S_FXV_a1# S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5# S_FXV_c1# S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5# S_FXC_a1# S_FXC_a1# S_FXC_b1# S_FXC_b1# S_FXC_c1# S_FXC_c1# S_FXC_d1# S_FXC_d1# S_FXC_e1# S_FXC_e1# S_FXC_f1# S_FXC_f1# |
| F024 | FX | DELTA | S_FXD_d1# |
| F026 | FX | DELTA | S_FXD_f1# |
| F028 | FX | KURVATURA | S_FXC_f1# |
| N001 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_a1# |
| N002 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_c1# |
| N003 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_d1# |
| N004 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_e1# |
| N005 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_f1# |
| N006 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_g1# |
| N007 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_h1# |
| N008 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_i1# |
| N009 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_w1# |
| N010 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_j1# |
| N011 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_k1# |
| N012 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_l1# |
| N013 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_m1# |
| N014 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_n1# |

| Portafoll | Klassi ta' riskju | Komponent | Strumenti |
|---|---|---|---|
| N015 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_o1# |
| N016 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_p1# |
| N017 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_q1# |
| N018 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_u1# |
| N019 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_v1# |
| N020 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_a1# S_CND_a2# |
| N021 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_a2# S_CND_a3# |
| N022 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_a2# S_CND_a4# |
| N023 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_a3# S_CND_a4# |
| N024 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_a1# S_CND_b1# |
| N025 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_a3# S_CND_b1# |
| N026 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_a4# S_CND_b1# |
| N027 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_a1# S_CND_b2# |
| N028 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_q1# S_CND_r1# |
| N029 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_u1# S_CND_x2# |
| N030 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_v1# S_CND_y1# |
| N031 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_u1# S_CND_x1# S_CND_x2# |
| N032 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1# |
| N033 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# |
| N034 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1# |
| N035 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1# |
| N036 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# |
| N037 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1# |
| N038 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1# |
| N039 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1# |
| N040 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1# |

| Portafoll | Klassi ta' riskju | Komponent | Strumenti |
|---|---|---|---|
| N041 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1# |
| N042 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_a3# S_CND_b1# S_CND_c1# S_CND_s1# S_CND_t1# |
| N043 | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_a1# S_CND_a2# S_CND_a3# S_CND_a4# S_CND_b1# S_CND_b2# S_CND_ab1# S_CND_ab2# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_hb1# S_CND_hb2# S_CND_i1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1# S_CND_q1# S_CND_r1# S_CND_s1# S_CND_t1# S_CND_u1# S_CND_v1# S_CND_w1# S_CND_x1# S_CND_x2# S_CND_y1# |
| N044 | CSR_NON_SEC | VEGA | S_CNV_a2# |
| N045 | CSR_NON_SEC | VEGA | S_CNV_a1# S_CNV_a2# |
| N046 | CSR_NON_SEC | VEGA | S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6# |
| N047 | CSR_NON_SEC | VEGA | S_CNV_a2# S_CNV_b1# |
| N048 | CSR_NON_SEC | VEGA | S_CNV_a1# S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6# S_CNV_b1# S_CNV_b2# S_CNV_b3# S_CNV_b4# S_CNV_b5# |
| N049 | CSR_NON_SEC | VEGA | S_CNV_q1# S_CNV_r1# |
| N050 | CSR_NON_SEC | VEGA | S_CNV_s1# S_CNV_u1# |
| N051 | CSR_NON_SEC | VEGA | S_CNV_t1# S_CNV_v1# |
| N052 | CSR_NON_SEC | VEGA | S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5# |
| N053 | CSR_NON_SEC | VEGA | S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1# |
| N054 | CSR_NON_SEC | VEGA | S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# |
| N055 | CSR_NON_SEC | VEGA | S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1# |
| N056 | CSR_NON_SEC | VEGA | S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1# |
| N057 | CSR_NON_SEC | VEGA | S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# |
| N058 | CSR_NON_SEC | VEGA | S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1# |
| N059 | CSR_NON_SEC | VEGA | S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1# |

| Portafoll | Klassi ta' riskju | Komponent | Strumenti |
|---|---|---|---|
| N060 | CSR_NON_SEC | VEGA | S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1# |
| N061 | CSR_NON_SEC | VEGA | S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1# |
| N062 | CSR_NON_SEC | VEGA | S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1# |
| N063 | CSR_NON_SEC | VEGA | S_CNV_b4# S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5# |
| N064 | CSR_NON_SEC | VEGA | S_CNV_a1# S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6# S_CNV_b1# S_CNV_b2# S_CNV_b3# S_CNV_b4# S_CNV_b5# S_CNV_ab1# S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_hb1# S_CNV_i1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1# S_CNV_q1# S_CNV_r1# S_CNV_s1# S_CNV_t1# S_CNV_u1# S_CNV_v1# |
| N065 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_b1# |
| N066 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_c1# |
| N067 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_d1# |
| N068 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_e1# |
| N069 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_f1# |
| N070 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_g1# |
| N071 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_h1# |
| N072 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_i1# |
| N073 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_aa1# |
| N074 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_j1# |
| N075 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_k1# |
| N076 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_l1# |
| N077 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_m1# |
| N078 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_n1# |
| N079 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_o1# |
| N080 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_p1# |

| Portafoll | Klassi ta' riskju | Komponent | Strumenti |
|---|---|---|---|
| N081 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_q1# |
| N082 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_t1# |
| N083 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_u1# |
| N084 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_a1# S_CNC_a2# |
| N085 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_a1# S_CNC_b1# |
| N086 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_q1# S_CNC_r1# |
| N087 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_t1# S_CNC_v1# |
| N088 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_u1# S_CNC_w1# |
| N089 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_y1# S_CNC_z1# |
| N090 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_s1# |
| N091 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1# |
| N092 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# |
| N093 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# |
| N094 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1# |
| N095 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# |
| N096 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# |
| N097 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1# |
| N098 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# |
| N099 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1# |
| N100 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1# |
| N101 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_c1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_z1# |
| N102 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_a1# S_CNC_b1# S_CNC_d1# S_CNC_s1# |

| Portafoll | Klassi ta' riskju | Komponent | Strumenti |
|---|---|---|---|
| N103 | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_a1# S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_b1# S_CNC_ab1# S_CNC_ab1# S_CNC_c1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_e1# S_CNC_f1# S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_h1# S_CNC_hb1# S_CNC_hb1# S_CNC_i1# S_CNC_i1# S_CNC_j1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_m1# S_CNC_n1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_q1# S_CNC_r1# S_CNC_r1# S_CNC_s1# S_CNC_s1# S_CNC_t1# S_CNC_t1# S_CNC_u1# S_CNC_u1# S_CNC_v1# S_CNC_v1# S_CNC_w1# S_CNC_w1# S_CNC_x1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_y1# S_CNC_z1# S_CNC_z1# S_CNC_aa1# S_CNC_aa1# |
| N104 | CSR_NON_SEC | KOLLHA | S_CND_a1# S_CND_a2# S_CND_a3# S_CND_a4# S_CND_b1# S_CND_b2# S_CND_ab1# S_CND_ab2# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_hb1# S_CND_hb2# S_CND_i1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1# S_CND_q1# S_CND_r1# S_CND_s1# S_CND_t1# S_CND_u1# S_CND_v1# S_CND_w1# S_CND_x1# S_CND_x2# S_CND_y1# S_CNV_a1# S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6# S_CNV_b1# S_CNV_b2# S_CNV_b3# S_CNV_b4# S_CNV_b5# S_CNV_ab1# S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_hb1# S_CNV_i1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1# S_CNV_q1# S_CNV_r1# S_CNV_s1# S_CNV_t1# S_CNV_u1# S_CNV_v1# S_CNC_a1# S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_b1# S_CNC_ab1# S_CNC_ab1# S_CNC_c1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_e1# S_CNC_f1# S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_h1# S_CNC_hb1# S_CNC_hb1# S_CNC_i1# S_CNC_i1# S_CNC_j1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_m1# S_CNC_n1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_q1# S_CNC_r1# S_CNC_r1# S_CNC_s1# S_CNC_s1# S_CNC_t1# S_CNC_t1# S_CNC_u1# S_CNC_u1# S_CNC_v1# S_CNC_v1# S_CNC_w1# S_CNC_w1# S_CNC_x1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_y1# S_CNC_z1# S_CNC_z1# S_CNC_aa1# S_CNC_aa1# |

| Portafoll | Klassi ta' riskju | Komponent | Strumenti |
|---|---|---|---|
| N104(CRR2/DA) | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_ab1# |
| N105(CRR2/DA) | CSR_NON_SEC | KURVATURA | S_CNC_hb1# |
| N106(CRR2/DA) | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_ab1# |
| N107(CRR2/DA) | CSR_NON_SEC | DELTA | S_CND_hb1# |
| C001 | CM | DELTA | S_CMD_a2# |
| C002 | CM | DELTA | S_CMD_c1# |
| C003 | CM | DELTA | S_CMD_e1# |
| C004 | CM | DELTA | S_CMD_g1# |
| C005 | CM | DELTA | S_CMD_i1# |
| C006 | CM | DELTA | S_CMD_k1# |
| C007 | CM | DELTA | S_CMD_m1# |
| C008 | CM | DELTA | S_CMD_o1# |
| C009 | CM | DELTA | S_CMD_q1# |
| C010 | CM | DELTA | S_CMD_s1# |
| C011 | CM | DELTA | S_CMD_u1# |
| C012 | CM | DELTA | S_CMD_a1# S_CMD_a2# |
| C013 | CM | DELTA | S_CMD_a2# S_CMD_a3# |
| C014 | CM | DELTA | S_CMD_a2# S_CMD_a4# |
| C015 | CM | DELTA | S_CMD_a3# S_CMD_a4# |
| C016 | CM | DELTA | S_CMD_a2# S_CMD_b1# |
| C017 | CM | DELTA | S_CMD_c1# S_CMD_d1# |
| C018 | CM | DELTA | S_CMD_e1# S_CMD_f1# |
| C019 | CM | DELTA | S_CMD_g1# S_CMD_h1# |
| C020 | CM | DELTA | S_CMD_i1# S_CMD_j1# |
| C021 | CM | DELTA | S_CMD_k1# S_CMD_l1# |
| C022 | CM | DELTA | S_CMD_m1# S_CMD_n1# |
| C023 | CM | DELTA | S_CMD_o1# S_CMD_p1# |
| C024 | CM | DELTA | S_CMD_q1# S_CMD_r1# |
| C025 | CM | DELTA | S_CMD_s1# S_CMD_t1# |
| C026 | CM | DELTA | S_CMD_u1# S_CMD_v1# |

| Portafoll | Klassi ta' riskju | Komponent | Strumenti |
|---|---|---|---|
| C027 | CM | DELTA | S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_w1# S_CMD_x1# |
| C028 | CM | DELTA | S_CMD_a2# S_CMD_c1# S_CMD_e1# S_CMD_g1# S_CMD_i1# S_CMD_k1# S_CMD_m1# S_CMD_o1# S_CMD_q1# S_CMD_s1# |
| C029 | CM | DELTA | S_CMD_a2# S_CMD_u1# |
| C030 | CM | DELTA | S_CMD_c1# S_CMD_d1# S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_w1# S_CMD_x1# |
| C031 | CM | DELTA | S_CMD_a1# S_CMD_a2# S_CMD_a3# S_CMD_a4# S_CMD_b1# S_CMD_c1# S_CMD_d1# S_CMD_e1# S_CMD_f1# S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_i1# S_CMD_j1# S_CMD_k1# S_CMD_l1# S_CMD_m1# S_CMD_n1# S_CMD_o1# S_CMD_p1# S_CMD_q1# S_CMD_r1# S_CMD_s1# S_CMD_t1# S_CMD_u1# S_CMD_v1# S_CMD_w1# S_CMD_x1# |
| C032 | CM | VEGA | S_CMV_a2# |
| C033 | CM | VEGA | S_CMV_a1# S_CMV_a2# |
| C034 | CM | VEGA | S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6# |
| C035 | CM | VEGA | S_CMV_a1# S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6# S_CMV_b1# S_CMV_b2# S_CMV_b3# S_CMV_b4# S_CMV_b5# |
| C036 | CM | VEGA | S_CMV_c1# S_CMV_d1# |
| C037 | CM | VEGA | S_CMV_e1# S_CMV_f1# |
| C038 | CM | VEGA | S_CMV_g1# S_CMV_h1# |
| C039 | CM | VEGA | S_CMV_i1# S_CMV_j1# |
| C040 | CM | VEGA | S_CMV_k1# S_CMV_l1# |
| C041 | CM | VEGA | S_CMV_m1# S_CMV_n1# |
| C042 | CM | VEGA | S_CMV_o1# S_CMV_p1# |
| C043 | CM | VEGA | S_CMV_q1# S_CMV_r1# |
| C044 | CM | VEGA | S_CMV_s1# S_CMV_t1# |
| C045 | CM | VEGA | S_CMV_u1# S_CMV_v1# |
| C046 | CM | VEGA | S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_w1# S_CMV_x1# |
| C047 | CM | VEGA | S_CMV_a2# S_CMV_c1# S_CMV_e1# S_CMV_g1# S_CMV_i1# S_CMV_k1# S_CMV_m1# S_CMV_o1# S_CMV_q1# S_CMV_s1# |
| C048 | CM | VEGA | S_CMV_a2# S_CMV_u1# |

| Portafoll | Klassi ta' riskju | Komponent | Strumenti |
|---|---|---|---|
| C049 | CM | VEGA | S_CMV_c1# S_CMV_d1# S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_w1# S_CMV_x1# |
| C050 | CM | VEGA | S_CMV_a1# S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6# S_CMV_b1# S_CMV_b2# S_CMV_b3# S_CMV_b4# S_CMV_b5# S_CMV_c1# S_CMV_d1# S_CMV_e1# S_CMV_f1# S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_i1# S_CMV_j1# S_CMV_k1# S_CMV_l1# S_CMV_m1# S_CMV_n1# S_CMV_o1# S_CMV_p1# S_CMV_q1# S_CMV_r1# S_CMV_s1# S_CMV_t1# S_CMV_u1# S_CMV_v1# S_CMV_w1# S_CMV_x1# |
| C051 | CM | KURVATURA | S_CMC_b1# |
| C052 | CM | KURVATURA | S_CMC_c1# |
| C053 | CM | KURVATURA | S_CMC_e1# |
| C054 | CM | KURVATURA | S_CMC_g1# |
| C055 | CM | KURVATURA | S_CMC_i1# |
| C056 | CM | KURVATURA | S_CMC_k1# |
| C057 | CM | KURVATURA | S_CMC_m1# |
| C058 | CM | KURVATURA | S_CMC_o1# |
| C059 | CM | KURVATURA | S_CMC_q1# |
| C060 | CM | KURVATURA | S_CMC_s1# |
| C061 | CM | KURVATURA | S_CMC_u1# |
| C062 | CM | KURVATURA | S_CMC_a1# S_CMC_a2# |
| C063 | CM | KURVATURA | S_CMC_a1# S_CMC_b1# |
| C064 | CM | KURVATURA | S_CMC_c1# S_CMC_d1# |
| C065 | CM | KURVATURA | S_CMC_e1# S_CMC_f1# |
| C066 | CM | KURVATURA | S_CMC_g1# S_CMC_h1# |
| C067 | CM | KURVATURA | S_CMC_i1# S_CMC_j1# |
| C068 | CM | KURVATURA | S_CMC_k1# S_CMC_l1# |
| C069 | CM | KURVATURA | S_CMC_m1# S_CMC_n1# |
| C070 | CM | KURVATURA | S_CMC_o1# S_CMC_p1# |
| C071 | CM | KURVATURA | S_CMC_q1# S_CMC_r1# |
| C072 | CM | KURVATURA | S_CMC_s1# S_CMC_t1# |
| C073 | CM | KURVATURA | S_CMC_u1# S_CMC_v1# |
| C074 | CM | KURVATURA | S_CMC_a2# S_CMC_b1# |
| C075 | CM | KURVATURA | S_CMC_g1# S_CMC_z1# |

| Portafoll | Klassi ta' riskju | Komponent | Strumenti |
|---|---|---|---|
| C076 | CM | KURVATURA | S_CMC_b1# S_CMC_c1# S_CMC_e1# S_CMC_g1# S_CMC_i1# S_CMC_k1# S_CMC_m1# S_CMC_o1# S_CMC_q1# S_CMC_s1# |
| C077 | CM | KURVATURA | S_CMC_a2# S_CMC_u1# |
| C078 | CM | KURVATURA | S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_y1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_x1# |
| C079 | CM | KURVATURA | S_CMC_x1# S_CMC_g1# S_CMC_z1# |
| C080 | CM | KURVATURA | S_CMC_a1# S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_b1# S_CMC_c1# S_CMC_c1# S_CMC_d1# S_CMC_d1# S_CMC_e1# S_CMC_e1# S_CMC_f1# S_CMC_f1# S_CMC_g1# S_CMC_g1# S_CMC_h1# S_CMC_h1# S_CMC_i1# S_CMC_i1# S_CMC_j1# S_CMC_j1# S_CMC_k1# S_CMC_k1# S_CMC_l1# S_CMC_l1# S_CMC_m1# S_CMC_m1# S_CMC_n1# S_CMC_n1# S_CMC_o1# S_CMC_o1# S_CMC_p1# S_CMC_p1# S_CMC_q1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_r1# S_CMC_s1# S_CMC_s1# S_CMC_t1# S_CMC_t1# S_CMC_u1# S_CMC_u1# S_CMC_v1# S_CMC_v1# S_CMC_x1# S_CMC_x1# S_CMC_y1# S_CMC_y1# S_CMC_z1# S_CMC_z1# |
| C081 | CM | KOLLHA | S_CMD_a1# S_CMD_a2# S_CMD_a3# S_CMD_a4# S_CMD_b1# S_CMD_c1# S_CMD_d1# S_CMD_e1# S_CMD_f1# S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_i1# S_CMD_j1# S_CMD_k1# S_CMD_l1# S_CMD_m1# S_CMD_n1# S_CMD_o1# S_CMD_p1# S_CMD_q1# S_CMD_r1# S_CMD_s1# S_CMD_t1# S_CMD_u1# S_CMD_v1# S_CMD_w1# S_CMD_x1# S_CMV_a1# S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6# S_CMV_b1# S_CMV_b2# S_CMV_b3# S_CMV_b4# S_CMV_b5# S_CMV_c1# S_CMV_d1# S_CMV_e1# S_CMV_f1# S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_i1# S_CMV_j1# S_CMV_k1# S_CMV_l1# S_CMV_m1# S_CMV_n1# S_CMV_o1# S_CMV_p1# S_CMV_q1# S_CMV_r1# S_CMV_s1# S_CMV_t1# S_CMV_u1# S_CMV_v1# S_CMV_w1# S_CMV_x1# S_CMC_a1# S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_b1# S_CMC_c1# S_CMC_c1# S_CMC_d1# S_CMC_d1# S_CMC_e1# S_CMC_e1# S_CMC_f1# S_CMC_f1# S_CMC_g1# S_CMC_g1# S_CMC_h1# S_CMC_h1# S_CMC_i1# S_CMC_i1# S_CMC_j1# S_CMC_j1# S_CMC_k1# S_CMC_k1# S_CMC_l1# S_CMC_l1# S_CMC_m1# S_CMC_m1# S_CMC_n1# S_CMC_n1# S_CMC_o1# S_CMC_o1# S_CMC_p1# S_CMC_p1# S_CMC_q1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_r1# S_CMC_s1# S_CMC_s1# S_CMC_t1# S_CMC_t1# S_CMC_u1# S_CMC_u1# S_CMC_v1# S_CMC_v1# S_CMC_x1# S_CMC_x1# S_CMC_y1# S_CMC_y1# S_CMC_z1# S_CMC_z1#" |