

PODÁVÁNÍ ZPRÁV O MINIMÁLNÍM POŽADAVKU NA KAPITÁL A ZPŮSOBILÉ ZÁVAZKY

ŠABLONY PRO MREL A TLAC			
Číslo šablony	Kód šablony	Název šablony / skupiny šablon	Krátký název
		ČÁSTKY: KLÍČOVÉ UKAZATELE MREL A TLAC	
1	M 01.00	Klíčové ukazatele MREL a TLAC (skupiny/subjekty řešící krizi)	KM2
		SLOŽENÍ A SPLATNOST	
2	M 02.00	Kapacita a složení MREL a TLAC (skupiny/subjekty řešící krizi)	TLAC1
3	M 03.00	Interní MREL a interní TLAC	ILAC
4	M 04.00	Struktura financování způsobilých závazků	LIAB-MREL
		POŘADÍ VĚŘITELŮ	
5	M 05.00	Pořadí věřitelů (subjekt, který není subjektem řešícím krizi)	TLAC2
6	M 06.00	Pořadí věřitelů (subjekty řešící krizi)	TLAC3
		INFORMACE TÝKAJÍCÍ SE SMLOUVY	
7	M 07.00	Nástroje, které se řídí právem třetí země	MTCI

CS
PŘÍLOHA I

M 01.00 – Klíčové ukazatele MREL a TLAC (skupiny/subjekty řešící krizi) (KM2)

		Minimální požadavek na kapitál a způsobilé závazky (MREL)	Požadavek na kapitál a způsobilé závazky institucí G-SVI (TLAC)
		0010	0020
	Celkový objem rizikové expozice a celková míra expozic		
0100	CELKOVÝ OBJEM RIZIKOVÉ EXPOZICE		
0110	CELKOVÁ MÍRA EXPOZIC		
	Kapitál a způsobilé závazky		
0200	KAPITÁL A ZPŮSOBILÉ ZÁVAZKY		
0210	z toho: kapitál a podřízené závazky		
0220	z toho se řídí právem třetí země		
0230	z toho obsahující ustanovení o odpisu a konverzi uvedené v článku 55 směrnice 2014/59/EU		
	Jiné závazky použitelné k rekapitalizaci z vnitřních zdrojů		
0250	JINÉ ZÁVAZKY POUŽITELNÉ K REKAPITALIZACI Z VNITŘNÍCH ZDROJŮ		
0260	z toho se řídí právem třetí země		
0270	z toho obsahující ustanovení o odpisu a konverzi uvedené v článku 55 směrnice 2014/59/EU		
0280	zbytková splatnost < 1 rok		
0285	zbytková splatnost >= 1 rok a < 2 roky		
0290	zbytková splatnost >= 2 roky		
	Poměry a výjimky z podřízenosti		
0300	KAPITÁL A ZPŮSOBILÉ ZÁVAZKY JAKO PROCENTNÍ PODÍL CELKOVÉHO OBJEMU RIZIKOVÉ EXPOZICE		
0310	z toho: kapitál a podřízené závazky		
0320	KAPITÁL A ZPŮSOBILÉ ZÁVAZKY JAKO PROCENTNÍ PODÍL CELKOVÉ MÍRY EXPOZIC		
0330	z toho: kapitál a podřízené závazky		
0340	Platí výjimka z podřízenosti stanovená v čl. 72b odst. 4 nařízení (EU) č. 575/2013? (5% výjimka)		
0350	Souhrnná hodnota povolených nepodřízených nástrojů způsobilých závazků, pokud je využita možnost týkající se podřízenosti stanovená v čl. 72b odst. 3 nařízení (EU) č. 575/2013 (maximálně 3,5% výjimka)		
0360	Podíl celkových nepodřízených závazků, který je zahrnut do kapitálu a způsobilých závazků		

CS
PŘÍLOHA I

M 02.00 – Kapacita a složení MREL a TLAC (skupiny/subjekty řešící krizi) (TLAC1)

		Minimální požadavek na kapitál a způsobilé závazky (MREL)	Požadavek na kapitál a způsobilé závazky G-SVI (TLAC)	Doplňková položka: částky způsobilé pro účely MREL, nikoli TLAC
		0010	0020	0030
0010	KAPITÁL A ZPŮSOBILÉ ZÁVAZKY			
0020	(Způsobilý) kapitál			
0030	Kmenový kapitál tier 1			
0040	(Způsobilý) vedlejší kapitál tier 1			
0050	(Způsobilý) kapitál tier 2			
0060	Způsobilé závazky			
0070	Položky způsobilých závazků před úpravami			
0080	z toho: způsobilé závazky považované za strukturálně podřízené			
0090	Způsobilé závazky podřízené vyloučeným závazkům			
0100	Nástroje způsobilých závazků vydané přímo subjektem řešícím krizi (bez zachování právních účinků)			
0110	Nástroje způsobilých závazků vydané jinými subjekty v rámci skupiny řešící krizi (bez zachování právních účinků)			
0120	Nástroje způsobilých závazků vydané před 27. červnem 2019			
0130	Nástroje zahrnované do kapitálu tier 2 se zbytkovou splatností nejméně jeden rok, pokud nejsou považovány za položky kapitálu tier 2			
0132	(–) Vlastní nástroje způsobilých závazků podřízené vyloučeným závazkům			
0135	(–) z toho: nevyužité částky, pro něž bylo uděleno předběžné svolení			
0140	Způsobilé závazky nepodřízené vyloučeným závazkům			
0150	Způsobilé závazky, které nejsou podřízené vyloučeným závazkům (bez zachování právních účinků, před uplatněním horní hranice)			
0160	Způsobilé závazky, které nejsou podřízené vyloučeným závazkům, vydané před 27. červnem 2019 (před uplatněním horní hranice)			
0162	(–) Vlastní nástroje způsobilých závazků nepodřízené vyloučeným závazkům			
0165	(–) z toho: nevyužité částky, pro něž bylo uděleno předběžné svolení			
0170	Částky způsobilé po uplatnění horní hranice uvedené v čl. 72b odst. 3 nařízení (EU) č. 575/2013 (bez zachování právních účinků)			
0180	Částky způsobilé po uplatnění horní hranice uvedené v čl. 72b odst. 3 nařízení (EU) č. 575/2013, které se skládají z položek vydaných před 27. červnem 2019			
0190	(–) Odpočty			
0200	(–) Expozice mezi skupinami řešícími krizi ve více subjektech			
0211	(–) Investice do jiných nástrojů způsobilých závazků			
0220	Odpočty od způsobilých závazků, které přesahují výši způsobilých závazků (odečtené od kapitálu tier 2)			
DOPLŇKOVÉ POLOŽKY				
0400	Kmenový kapitál tier 1 (%) dostupný po splnění požadavků subjektem			
0410	Požadavek kombinovaných kapitálových rezerv (%)			
0420	z toho: požadavek na bezpečnostní kapitálovou rezervu			
0430	z toho: požadavek na proticyklickou kapitálovou rezervu			
0440	z toho: požadavek na kapitálovou rezervu pro krytí systémového rizika			
0450	z toho: kapitálová rezerva pro globální systémově významnou instituci (G-SVI) nebo jinou systémově významnou instituci (J-SVI)			
0460	Investice do podřízených způsobilých závazků jiných institucí			
0470	Investice do podřízených způsobilých závazků institucí G-SVI			
0480	Investice do podřízených způsobilých závazků institucí J-SVI			
0490	Investice do podřízených způsobilých závazků jiných institucí			
0500	Vyloučené závazky			

CS
PŘÍLOHA I

M 03.00 – Interní MREL a interní TLAC (ILAC)

		Interní MREL	Interní TLAC
		0010	0020
0010	Úroveň uplatňování		
	Celkový objem rizikové expozice a celková míra expozic		
0100	Celkový objem rizikové expozice		
0110	Celková míra expozic		
	Způsobilý kapitál a způsobilé závazky		
0200	Způsobilý kapitál a způsobilé závazky		
0210	Způsobilý kapitál		
0220	Kmenový kapitál tier 1		
0230	Způsobilý vedlejší kapitál tier 1		
0240	Způsobilý kapitál tier 2		
0250	Způsobilé závazky a záruky		
0260	Způsobilé závazky (bez záruk)		
0265	(–) Vlastní nástroje způsobilých závazků: nevyužité částky, pro něž bylo uděleno předběžné svolení		
0270	Záruky poskytované subjektem řešícím krizi a povolené orgánem příslušným k řešení krize		
0280	Doplňková položka: zajištěná část záruky		
0290	(–) Kapitálové nástroje a nástroje způsobilých závazků vydané subjekty neřešícími krizi v rámci stejné skupiny řešící krizi		
0293	(–) z toho: kapitálové nástroje vydané subjekty v likvidaci		
0295	Odpočty od způsobilých závazků, které přesahují výši způsobilých závazků		
	Poměry způsobilého kapitálu a způsobilých závazků		
0400	Kapitál a způsobilé závazky jako procentní podíl celkového objemu rizikové expozice		
0410	z toho povolené záruky		
0420	Kapitál a způsobilé závazky jako procentní podíl celkové míry expozic		
0430	z toho: povolené záruky		
0440	Kmenový kapitál tier 1 (%) dostupný po splnění požadavků subjektem		
	Doplňkové položky		
0500	Požadavek kombinovaných kapitálových rezerv (%)		
0510	z toho: požadavek na bezpečnostní kapitálovou rezervu		
0520	z toho: požadavek na proticyklickou kapitálovou rezervu		
0530	z toho: požadavek na kapitálovou rezervu pro krytí systémového rizika		
0540	z toho: kapitálová rezerva pro globální systémově významnou instituci (G-SVI) nebo jinou systémově významnou instituci (J-SVI)		
0550	Jiné závazky použitelné k rekapitalizaci z vnitřních zdrojů		
0560	z toho se řídí právem třetí země		
0570	z toho obsahující ustanovení o odpisu a konverzi uvedené v článku 55 směrnice 2014/59/EU		
0580	zbytková splatnost < 1 rok		
0590	zbytková splatnost >= 1 rok a < 2 roky		
0600	zbytková splatnost >= 2 roky		
0610	Vyloučené závazky		
0620	(–) Kapitálové nástroje vydané subjekty v likvidaci v rámci stejné skupiny řešící krizi		
0630	Poměr držených kapitálových nástrojů vydaných subjekty v likvidaci ke způsobilému kapitálu a způsobilým závazkům		

CS
PŘÍLOHA I

M 04.00 – Struktura financování způsobilých závazků (LIAB MREL)		
		Částka způsobilá pro MREL/interní MREL
		0010
0100	ZPŮSOBILÉ ZÁVAZKY	
0200	Vklady, které nejsou pojištěné a nejsou přednostní >= 1 rok	
0210	z toho: zbytková splatnost >= 1 rok a < 2 roky	
0220	z toho: zbytková splatnost >= 2 roky	
0230	z toho: vydané dceřinými podniky	
0300	Nekolateralizované zajištěné závazky >= 1 rok	
0310	z toho: zbytková splatnost >= 1 rok a < 2 roky	
0320	z toho: zbytková splatnost >= 2 roky	
0330	z toho: vydané dceřinými podniky	
0400	Strukturované dluhopisy >= 1 rok	
0410	z toho: zbytková splatnost >= 1 rok a < 2 roky	
0420	zbytková splatnost toho: zbytková splatnost >= 2 roky	
0430	z toho: vydané dceřinými podniky	
0500	Prioritní nezajištěné závazky >= 1 rok	
0510	z toho: zbytková splatnost >= 1 rok a < 2 roky	
0520	z toho: zbytková splatnost >= 2 roky	
0530	z toho: vydané dceřinými podniky	
0600	Prioritní nepreferenční závazky >= 1 rok	
0610	z toho: zbytková splatnost >= 1 rok a < 2 roky	
0620	z toho: zbytková splatnost >= 2 roky	
0630	z toho: vydané dceřinými podniky	
0700	Podřízené závazky (nevykazované jako kapitál) >= 1 rok	
0710	z toho: zbytková splatnost >= 1 rok a < 2 roky	
0720	z toho: zbytková splatnost >= 2 roky	
0730	z toho: vydané dceřinými podniky	
0800	Jiné způsobilé závazky podle minimálních požadavků na kapitál >= 1 rok	
0810	z toho: zbytková splatnost >= 1 rok a < 2 roky	
0820	z toho: zbytková splatnost >= 2 roky	
0830	z toho: vydané dceřinými podniky	

CS
PŘÍLOHA I

M 05.00 – Pořadí věřitelů (subjekt, který není subjektem řešícím krizi) (TLAC2)

Pořadí v úpadkov ém řízení	Druh věřitele	Popis pořadí v úpadkové m řízení	Závazky a kapitál		Závazky a kapitál bez vyloučených závazků						
				z toho: vyloučené závazky	z toho: kapitál a způsobilé závazky pro účely interního MREL	z toho: se zbytkovou splatností				z toho: věčné cenné papíry	
						≥ 1 rok < 2 roky	≥ 2 roky < 5 let	≥ 5 let < 10 let	≥ 10 let		
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120

CS
PŘÍLOHA I

M 06.00 – Pořadí věřitelů (subjekty řešící krizi) (TLAC3)

Pořadí v úpadkové m řízení	Popis pořadí v úpadkové m řízení	Závazky a kapitál		Závazky a kapitál bez vyloučených závazků						
		z toho: vyloučené závazky	z toho: kapitál a způsobilé závazky potenciálně způsobilé ke splnění MREL	z toho: se zbytkovou splatností				z toho: věčné cenné papíry		
				≥ 1 rok < 2 roky	≥ 2 roky < 5 let	≥ 5 let < 10 let	≥ 10 let			
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110

M 07.00 – Nástroje, které se řídí právem třetí země (MTCI)

Emitent			Identifikační kód smlouvy	Rozhodné právo (třetí země)	Smluvní uznání pravomocí k odpisu nebo konverzi	Regulační zacházení		Částka	Pořadí v běžném úpadkovém řízení		Splatnost	(První) vypověditelná lhůta	Regulační opce (A/N)
Název	Kód	Typ kódu				Druh kapitálu nebo způsobilých závazků	Druh nástroje		Rozhodné právo	Pořadí v úpadkovém řízení			
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120	0130	0140