

RETIFICAÇÕES

Retificação do Regulamento de Execução (UE) 2016/322 da Comissão, de 10 de fevereiro de 2016, que altera o Regulamento de Execução (UE) n.º 680/2014 que estabelece normas técnicas de execução no que diz respeito ao relato para fins de supervisão das instituições relativamente ao requisito de cobertura de liquidez

(«Jornal Oficial da União Europeia» L 64 de 10 março de 2016)

— Na página 2, nos pontos 1 e 2 do artigo 1.º:

onde se lê: «1) O artigo 15.º passa a ter a seguinte redação:

“Artigo 15.º

Formato e periodicidade dos relatórios sobre os requisitos de cobertura de liquidez

1. Para efeitos do relato de informações sobre os requisitos de cobertura de liquidez de acordo com o artigo 415.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013 em base individual e em base consolidada, as instituições devem aplicar o seguinte:

- a) As instituições de crédito devem apresentar as informações especificadas no anexo XXII de acordo com as instruções constantes do anexo XXIII com uma periodicidade mensal;
- b) Todas as outras instituições, com exceção das especificadas na alínea a), devem apresentar as informações especificadas no anexo XII de acordo com as instruções constantes do anexo XIII com uma periodicidade mensal.

2. As informações estabelecidas nos anexos XII e XXII devem ter em conta as informações apresentadas para a data de referência e as informações sobre os fluxos de caixa da instituição ao longo dos 30 dias subsequentes.”

- 2) Os anexos XXII e XXIII são aditados como consta, respetivamente, nos anexos I e II do presente regulamento.».

deve ler-se: «1) O artigo 15.º passa a ter a seguinte redação:

“Artigo 15.º

Formato e periodicidade dos relatórios sobre os requisitos de cobertura de liquidez

1. Para efeitos do relato de informações sobre os requisitos de cobertura de liquidez de acordo com o artigo 415.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013 em base individual e em base consolidada, as instituições devem aplicar o seguinte:

- a) As instituições de crédito devem apresentar as informações especificadas no anexo XXIV de acordo com as instruções constantes do anexo XXV com uma periodicidade mensal;
- b) Todas as outras instituições, com exceção das especificadas na alínea a), devem apresentar as informações especificadas no anexo XII de acordo com as instruções constantes do anexo XIII com uma periodicidade mensal.

2. As informações estabelecidas nos anexos XII e XXIV devem ter em conta as informações apresentadas para a data de referência e as informações sobre os fluxos de caixa da instituição ao longo dos 30 dias subsequentes.”

- 2) Os anexos XXIV e XXV são aditados como consta, respetivamente, nos anexos I e II do presente regulamento.».

— Na página 4, no título do anexo I:

onde se lê:

«ANEXO I

“ANEXO XXII”»,

deve ler-se:

«ANEXO I

“ANEXO XXIV”».

— Na página 19, no anexo I, que introduz o anexo XXIV, no quadro, modelo «C 73.00 — COBERTURA DE LIQUIDEZ — SAIDAS», as linhas 1140 a 1280 passam a ter a seguinte redação:

			Montante	Valor de mercado das garantias concedidas	Valor das garantias concedidas de acordo com o artigo 9.º	Ponderador-padrão	Ponderador Aplicável	Saída
Linha	ID	Elemento	010	020	030	040	050	060
ELEMENTOS PARA MEMÓRIA								
1140	2	Obrigações de retalho com um prazo de vencimento residual inferior a 30 dias						
1150	3	Depósitos de retalho isentos do cálculo das saídas						
1160	4	Depósitos de retalho não avaliados						
1170	5	Saídas de liquidez a compensar por entradas interdependentes						
	6	Depósitos operacionais mantidos para serviços de compensação, custódia, gestão de tesouraria ou outros serviços comparáveis no contexto de uma relação operacional estável						
1180	6.1	fornecidos por instituições de crédito						
1190	6.2	fornecidos por clientes financeiros que não sejam instituições de crédito						
1200	6.3	fornecidos por entidades soberanas, bancos centrais, bancos multilaterais de desenvolvimento (BMD) e entidades do setor público (ESP)						
1210	6.4	fornecidos por outros clientes						
	7	Depósitos não operacionais mantidos por clientes financeiros e outros clientes						
1220	7.1	fornecidos por instituições de crédito						
1230	7.2	fornecidos por clientes financeiros que não sejam instituições de crédito						
1240	7.3	fornecidos por entidades soberanas, bancos centrais, bancos multilaterais de desenvolvimento (BMD) e entidades do setor público (ESP)						
1250	7.4	fornecidos por outros clientes						

			Montante	Valor de mercado das garantias concedidas	Valor das garantias concedidas de acordo com o artigo 9.º	Ponderador-padrão	Ponderador Aplicável	Saída
Linha	ID	Elemento	010	020	030	040	050	060
1260	8	Compromissos de financiamento a clientes não financeiros						
1270	9	Garantias que assumem a forma de ativos de Nível 1, excluindo obrigações cobertas de qualidade extremamente elevada, constituídas para derivados						
1280	10	Controlo das operações de financiamento através de valores mobiliários (OFVM)						
	11	Saídas intragrupo ou do RPI”						

— Na página 56, no título do anexo II:

onde se lê:

«ANNEXE II

“ANNEXE XXIII”»,

deve ler-se:

«ANNEXE II

“ANNEXE XXV”.
