

DA
BILAG I

INDBERETNING VEDRØRENDE MINIMUMSKRAV TIL KAPITALGRUNDLAG OG NEDSKRIVNINGSRELEVANTE PA

SKEMAER TIL MREL OG TLAC			
Skema nr.	Skemakode	Navn på skema/gruppe af skemaer	Navn i kortform
		BELØB: VÆSENTLIGE MÅLEKRITERIER FOR MREL OG TLAC	
1	M 01.00	Væsentlige målekriterier for MREL og TLAC (afviklingskoncerner og -enheder)	KM2
		SAMMENSÆTNING OG LØBETID	
2	M 02.00	Kapacitet for og sammensætning af MREL og TLAC (afviklingskoncerner og -enheder)	TLAC1
3	M 03.00	Internt MREL og internt TLAC	ILAC
4	M 04.00	Finansieringsstruktur for nedskrivningsrelevante passiver	LIAB-MREL
		KREDITORRÆKKEFØLGE	
5	M 05.00	Kreditorrækkefølge (enhed, som ikke er en afviklingsenhed)	TLAC2
6	M 06.00	Kreditorrækkefølge (afviklingsenheder)	TLAC3
		KONTRAKTSPECIFIKKE OPLYSNINGER	
7	M 07.00	Instrumenter, der er underlagt et tredjelands lovgivning	MTCI

DA
BILAG I

M 01.00 — Væsentlige målekriterier for MREL og TLAC (afviklingskoncerner og -enheder) (KM2)

		Minimumskrav for kapitalgrundlag og nedskrivningsrelevante passiver (MREL)	Krav til kapitalgrundlag og nedskrivningsrelevante passiver for G-SII'er (TLAC)
		0010	0020
	Samlet risikoeksponering og samlet eksponeringsmål		
0100	SAMLET RISIKOEKSPONERING (SRE)		
0110	SAMLET EKSPONERINGSMÅL (SRM)		
	Kapitalgrundlag og nedskrivningsrelevante passiver		
0200	KAPITALGRUNDLAG OG NEDSKRIVNINGSRELEVANTE PASSIVER		
0210	Heraf: kapitalgrundlag og efterstillede passiver		
0220	Heraf dem, der er underlagt et tredjeland's lovgivning		
0230	Heraf dem, der indeholder en nedskrivnings- og konverteringsbeføjelse, jf. artikel 55 i direktiv 2014/59/EU		
	Andre passiver, der er omfattet af bail-in		
0250	ANDRE PASSIVER, DER ER OMFATTET AF BAIL-IN		
0260	Heraf dem, der er underlagt et tredjeland's lovgivning		
0270	Heraf dem, der indeholder en nedskrivnings- og konverteringsbeføjelse, jf. artikel 55 i direktiv 2014/59/EU		
0280	Restløbetid < 1 år		
0285	Restløbetid >= 1 år og < 2 år		
0290	Restløbetid >= 2 år		
	Forhold og undtagelser fra efterstilling		
0300	KAPITALGRUNDLAG OG NEDSKRIVNINGSRELEVANTE PASSIVER SOM EN PROCENTDEL AF SRE		
0310	Heraf: kapitalgrundlag og efterstillede passiver		
0320	KAPITALGRUNDLAG OG NEDSKRIVNINGSRELEVANTE PASSIVER SOM EN PROCENTDEL AF SEM		
0330	Heraf: kapitalgrundlag og efterstillede passiver		
0340	Finder undtagelsen fra efterstilling i artikel 72b, stk. 4, i forordning (EU) nr. 575/2013 anvendelse? (undtagelse på 5 %)		
0350	Det samlede beløb, der udgøres af tilladte ikkeefterstillede nedskrivningsrelevante passivinstrumenter, hvis der anvendes et skøn over efterstilling, jf. artikel 72b, stk. 3, i forordning (EU) nr. 575/2013, (undtagelse på maks. 3,5 %)		
0360	Andel af de samlede ikkeefterstillede passiver, der medregnes i kapitalgrundlag og nedskrivningsrelevante passiver		

DA
BILAG I

M 02.00 — Kapacitet for og sammensætning af MREL og TLAC (afviklingskoncerner og -enheder) (TLAC1)				
		Minimumskrav for kapitalgrundlag og nedskrivningsrelevante passiver (MREL)	Krav til kapitalgrundlag og nedskrivningsrelevante passiver for G-SII'er (TLAC)	Memorandumpost: Nedskrivningsegnet beløb med henblik på MREL, men ikke på TLAC
		0010	0020	0030
0010	KAPITALGRUNDLAG OG NEDSKRIVNINGSRELEVANTE PASSIVER			
0020	(Nedskrivningsegnet) kapitalgrundlag			
0030	Egentlig kernekapital (CET1)			
0040	(Nedskrivningsegnet) hybrid kernekapital			
0050	(Nedskrivningsegnet) supplerende kapital			
0060	Nedskrivningsrelevante passiver			
0070	Nedskrivningsrelevante passivposter forud for justeringer			
0080	heraf: strukturelt efterstillede nedskrivningsrelevante passiver			
0090	Nedskrivningsrelevante passiver, som er efterstillet udelukkede passiver			
0100	Nedskrivningsrelevante passivinstrumenter, der udstedes direkte af afviklingsenheden (ikke omfattet af overgangsbestemmelser)			
0110	Nedskrivningsrelevante passivinstrumenter, der udstedes af andre enheder i afviklingskoncernen (ikke omfattet af overgangsbestemmelser)			
0120	Nedskrivningsrelevante passivinstrumenter, der er udstedt før den 27. juni 2019			
0130	Supplerende kapitalinstrumenter med en restløbetid på mindst ét år, for så vidt som de ikke kan betragtes som supplerende kapitalposter			
0132	(-) Egne nedskrivningsrelevante passivinstrumenter, der er efterstillet udelukkede passiver			
0135	(-) heraf: ubrugte beløb omfattet af forudgående tilladelse			
0140	Nedskrivningsrelevante passiver, som ikke er efterstillet udelukkede passiver			
0150	Nedskrivningsrelevante passiver, der ikke er efterstillet udelukkede passiver (ikke omfattet af overgangsbestemmelser, før indførelse af loftet)			
0160	Nedskrivningsrelevante passiver, der ikke er efterstillet udelukkede passiver udstedt før den 27. juni 2019 (før indførelse af loftet)			
0162	(-) Egne nedskrivningsrelevante passivinstrumenter, der ikke er efterstillet udelukkede passiver			
0165	(-) heraf: ubrugte beløb omfattet af forudgående tilladelse			
0170	Nedskrivningsrelevante beløb efter anvendelse af loftet i artikel 72b, stk. 3, i forordning (EU) nr. 575/2013 (ikke omfattet af overgangsbestemmelser)			
0180	Nedskrivningsrelevante beløb efter anvendelse af loftet i artikel 72b, stk. 3, i forordning (EU) nr. 575/2013, som består af poster udstedt før den 27. juni 2019			
0190	(-) Fradrag			
0200	(-) Eksponeringer mellem afviklingskoncerner, der er omfattet af multiple point of entry (MPE)			
0211	(-) Investeringer i andre nedskrivningsrelevante passivinstrumenter			
0220	Overskydende fradrag i nedskrivningsrelevante passiver, som overstiger nedskrivningsrelevante passiver (fratrullet supplerende kapital)			
MEMORANDUMPOSTER				
0400	Egentlig kernekapital (i %) efter opfyldelse af enhedens krav			
0410	Kombineret bufferkrav (i %)			
0420	heraf: krav om kapitalbevaringsbuffer			
0430	heraf: krav om kontracyklisk buffer			
0440	heraf: krav om systemisk risikobuffer			
0450	heraf: buffer for globalt systemisk vigtige institutter (G-SII-buffer) eller buffer for andre systemisk vigtige institutter (O-SII-buffer)			
0460	Investeringer i andre institutters efterstillede nedskrivningsrelevante passiver			
0470	Investeringer i G-SII'ers efterstillede nedskrivningsrelevante passiver			
0480	Investeringer i O-SII'ers efterstillede nedskrivningsrelevante passiver			
0490	Investeringer i andre institutters efterstillede nedskrivningsrelevante passiver			
0500	Udelukkede passiver			

DA
BILAG I

M 03.00 — Internt MREL og internt TLAC (ILAC)			
		Internt MREL	Internt TLAC
		0010	0020
0010	Anvendelsesomfang		
	Samlet risikoeksponering og samlet eksponeringsmål		
0100	SAMLET RISIKOEKSPONERING (SRE)		
0110	Samlet eksponeringsmål (SEM)		
	Nedskrivningsegnet kapitalgrundlag og nedskrivningsrelevante passiver		
0200	Nedskrivningsegnet kapitalgrundlag og nedskrivningsrelevante passiver		
0210	Nedskrivningsegnet kapitalgrundlag		
0220	Egentlig kernekapital (CET1)		
0230	Nedskrivningsegnet hybrid kernekapital		
0240	Nedskrivningsegnet supplerende kapital		
0250	Nedskrivningsrelevante passiver og garantier		
0260	Nedskrivningsrelevante passiver (eksklusive garantier)		
0265	(-) Egne nedskrivningsrelevante passivinstrumenter: Ubrugte beløb omfattet af forudgående tilladelse		
0270	Garantier, der stilles af afviklingsenheden, og hvortil der gives tilladelse af afviklingsmyndigheden		
0280	Memorandumpost: Del af garantien, for hvilken der er stillet sikkerhed		
0290	(-) Kapitalgrundlagsinstrumenter og nedskrivningsrelevante passivinstrumenter udstedt af enheder, der ikke er afviklingsenheder, og som indgår i samme afviklingskoncern		
0293	(-) heraf: Kapitalgrundlagsinstrumenter udstedt af likvidationsenheder		
0295	Overskydende fradrag i nedskrivningsrelevante passiver, som overstiger nedskrivningsrelevante passiver		
	Forhold mellem nedskrivningsegnet kapitalgrundlag og nedskrivningsrelevante passiver		
0400	Kapitalgrundlag og nedskrivningsrelevante passiver som en procentdel af SRE		
0410	heraf: tilladte garantier		
0420	Kapitalgrundlag og nedskrivningsrelevante passiver som en procentdel af SEM		
0430	heraf: tilladte garantier		
0440	Egentlig kernekapital (i %) efter opfyldelse af enhedens krav		
	Memorandumposter		
0500	Kombineret bufferkrav (i %)		
0510	heraf: krav om kapitalbevaringsbuffer		
0520	heraf: krav om kontracyklisk buffer		
0530	heraf: krav om systemisk risikobuffer		
0540	heraf: buffer for globalt systemisk vigtige institutter (G-SII-buffer) eller buffer for andre systemisk vigtige institutter (O-SII-buffer)		
0550	Andre passiver, der er omfattet af bail-in		
0560	heraf dem, der er underlagt et tredjelands lovgivning		
0570	heraf dem, der indeholder en nedskrivnings- og konverteringsbeføjelse, jf. artikel 55 i direktiv 2014/59/EU		
0580	Restløbetid < 1 år		
0590	Restløbetid >= 1 år og < 2 år		
0600	Restløbetid >= 2 år		
0610	Udelukkede passiver		
0620	Kapitalgrundlagsinstrumenter udstedt af likvidationsenheder, som indgår i samme afviklingskoncern		
0630	Andelen af besiddelser af kapitalgrundlagsinstrumenter udstedt af likvidationsenheder i forhold til nedskrivningsegnet kapitalgrundlag og nedskrivningsrelevante passiver		

DA
BILAG I

M 04.00 — Finansierungsstruktur for nedskrivningsrelevante passiver (LIAB-MREL)		
		Relevant beløb for MREL/internt MREL
		0010
0100	NEDSKRIVNINGSRELEVANTE PASSIVER	
0200	Indskud, udækkede og ikke foranstillede ≥ 1 år	
0210	heraf: restløbetid ≥ 1 år og < 2 år	
0220	heraf: restløbetid ≥ 2 år	
0230	heraf: udstedt af datterselskaber	
0300	Sikrede passiver, for hvilke der ikke er stillet sikkerhed ≥ 1 år	
0310	heraf: restløbetid ≥ 1 år og < 2 år	
0320	heraf: restløbetid ≥ 2 år	
0330	heraf: udstedt af datterselskaber	
0400	Strukturerede værdipapirer ≥ 1 år	
0410	heraf: restløbetid ≥ 1 år og < 2 år	
0420	heraf: restløbetid ≥ 2 år	
0430	heraf: udstedt af datterselskaber	
0500	Usikret seniorgæld ≥ 1 år	
0510	heraf: restløbetid ≥ 1 år og < 2 år	
0520	heraf: restløbetid ≥ 2 år	
0530	heraf: udstedt af datterselskaber	
0600	Ikkeforanstillet seniorgæld ≥ 1 år	
0610	heraf: restløbetid ≥ 1 år og < 2 år	
0620	heraf: restløbetid ≥ 2 år	
0630	heraf: udstedt af datterselskaber	
0700	Efterstillede passiver (der ikke indregnes i kapitalgrundlaget) ≥ 1 år	
0710	heraf: restløbetid ≥ 1 år og < 2 år	
0720	heraf: restløbetid ≥ 2 år	
0730	heraf: udstedt af datterselskaber	
0800	Andre nedskrivningsrelevante passiver omfattet af MREL ≥ 1 år	
0810	heraf: restløbetid ≥ 1 år og < 2 år	
0820	heraf: restløbetid ≥ 2 år	
0830	heraf: udstedt af datterselskaber	

DA
BILAG I

M 05.00 – Kreditorrækkefølge (enhed, som ikke er en afviklingsenhed) (TLAC2)										
Placering i prioritetsrækkefølgen ved insolvens	Kreditortype	Beskrivelse af placering i prioritetsrækkefølgen ved insolvens	Passiver og kapitalgrundlag		Passiver og kapitalgrundlag fratrukket udelukkede passiver					
				heraf: udelukkede passiver		heraf: kapitalgrundlag og nedskrivningsrelevante passiver med henblik på internt MREL	heraf: med en restløbetid på			
							≥ 1 år < 2 år	≥ 2 år < 5 år	≥ 5 år < 10 år	≥ 10 år
							heraf: værdipapirer uden udløbsdato			
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110

DA
BILAG I

M 06.00 — Kreditorrækkefølge (afviklingsenheder) (TLAC3)									
Placering i prioritetsrækkefølgen ved insolvens	Beskrivelse af placering i prioritetsrækkefølgen ved insolvens	Passiver og kapitalgrundlag		Passiver og kapitalgrundlag fratrukket udelukkede passiver					
			heraf: udelukkede passiver		heraf: kapitalgrundlag og nedskrivningsrelevante passiver, der er potentielt relevante med henblik på at opfylde MREL	heraf: med en restløbetid på			
						≥ 1 år < 2 år	≥ 2 år < 5 år	≥ 5 år < 10 år	≥ 10 år
						heraf: værdipapirer uden udløbsdato			
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100

M 07.00 — Instrumenter, der er underlagt et tredjelands lovgivning (MTCI)

Udstedende enhed			Kontrakters ID-kode	Gældende lovgivning (tredjeland)	Kontraktlig anerkendelse af nedskrivnings- og konverteringsbeføjelser	Reguleringsmæssig behandling		Beløb	Placering i prioritetsrækkefølgen ved almindelig insolvensbehandling		Løbetid	(Først mulige) indfrielsesdato	Reguleringsmæssig call-option (JA/NEJ)
Navn	Kode	Kodetype				Type af kapitalgrundlag eller nedskrivningsrelevante passiver	Instrument type		Gældende lovgivning	Placering i prioritetsrækkefølgen ved insolvens			
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120	0130	0140