

**Regulament pentru modificarea și completarea Regulamentului Autorității de Supraveghere Financiară nr. 3/2014 privind unele aspecte legate de aplicarea Ordonanței de urgență a Guvernului nr. 99/2006 privind instituțiile de credit și adecvarea capitalului și a Regulamentului (UE) nr. 575/2013 al Parlamentului European și al Consiliului din 26 iunie 2013 privind cerințele prudențiale pentru instituțiile de credit și firmele de investiții și de modificare a Regulamentului (UE) nr. 648/2012, precum și pentru modificarea Regulamentului Autorității de Supraveghere Financiară nr. 15/2023 privind autorizarea entităților prevăzute la art. 163<sup>2</sup> din Ordonanța de urgență a Guvernului nr. 99/2006 privind instituțiile de credit și adecvarea capitalului**

În temeiul prevederilor art. 1 alin. (2), art. 2 alin. (1) lit. a) și d) și alin. (5), art. 6 alin. (2) și ale art. 14 din Ordonanța de urgență a Guvernului nr. 93/2012 privind înființarea, organizarea și funcționarea Autorității de Supraveghere Financiară, aprobată cu modificări și completări prin Legea nr. 113/2013, cu modificările și completările ulterioare,

Având în vedere prevederile art. 4<sup>1</sup>, ale art. 163<sup>2</sup> alin. (4) și ale art. 278-283 din Ordonanța de urgență a Guvernului nr. 99/2006 privind instituțiile de credit și adecvarea capitalului, aprobată cu modificări și completări prin Legea nr. 227/2007, cu modificările și completările ulterioare,

potrivit deliberărilor Consiliului Autorității de Supraveghere Financiară din ședința din data de 04.09.2024,

**Autoritatea de Supraveghere Financiară** emite prezentul regulament.

**Art. I.** - Regulamentul Autorității de Supraveghere Financiară nr. 3/2014 privind unele aspecte legate de aplicarea Ordonanței de urgență a Guvernului nr. 99/2006 privind instituțiile de credit și adecvarea capitalului și a Regulamentului (UE) nr. 575/2013 al Parlamentului European și al Consiliului din 26 iunie 2013 privind cerințele prudențiale pentru instituțiile de credit și

firmele de investiții și de modificare a Regulamentului (UE) nr. 648/2012, publicat în Monitorul Oficial al României, Partea I, nr. 170 din 10 martie 2014, cu modificările și completările ulterioare, se modifică și se completează după cum urmează:

**1. La articolul 45, alineatul (3) se modifică și va avea următorul cuprins:**

„(3) S.S.I.F. trebuie să dispună de politici și planuri adecvate de intervenție și de continuitate a activității, inclusiv de politici și planuri de continuitate a activității în domeniul tehnologiei informației și comunicațiilor (TIC) și de planuri de răspuns și de recuperare în domeniul TIC pentru tehnologia pe care o utilizează pentru comunicarea informațiilor. Planurile trebuie să fie elaborate, gestionate și testate în conformitate cu art. 11 din Regulamentul (UE) 2022/2554 al Parlamentului European și al Consiliului din 14 decembrie 2022 privind reziliența operațională digitală a sectorului financiar și de modificare a Regulamentelor (CE) nr. 1060/2009, (UE) nr. 648/2012, (UE) nr. 600/2014, (UE) nr. 909/2014 și (UE) 2016/1011, pentru a permite S.S.I.F. continuarea funcționării în caz de întrerupere gravă a activității și limitarea pierderilor suportate ca urmare a unei astfel de întreruperi.”

**2. La articolul 51<sup>1</sup>, după alineatul (8) se introduce un nou alineat, alineatul (8<sup>1</sup>), cu următorul cuprins:**

„(8<sup>1</sup>) S.S.I.F. îndeplinește cerința de fonduri proprii suplimentare impusă de A.S.F. în temeiul art. 226 alin. (3) lit. a) din Ordonanța de urgență a Guvernului nr. 99/2006, aprobată prin Legea nr. 227/2007, cu modificările și completările ulterioare, pentru abordarea riscului asociat folosirii excesive a efectului de levier cu fonduri proprii de nivel 1.”

**3. La articolul 51<sup>1</sup>, partea introductivă a alineatului (9) se modifică și va avea următorul cuprins:**

„(9) S.S.I.F. îndeplinește cerința de fonduri proprii suplimentare impusă de A.S.F. în temeiul art. 226 alin. (3) lit. a) din Ordonanța de urgență a Guvernului nr. 99/2006, aprobată prin Legea nr. 227/2007, cu modificările și completările ulterioare, pentru abordarea altor riscuri decât riscul asociat folosirii excesive a efectului de levier cu fonduri proprii care îndeplinesc următoarele condiții:”

**4. La articolul 51<sup>1</sup>, alineatul (10) se modifică și va avea următorul cuprins:**

„(10) Prin excepție de la prevederile alin. (8<sup>1</sup>) și (9), A.S.F. poate solicita S.S.I.F. să își îndeplinească cerința de fonduri proprii suplimentare cu un procent mai ridicat de fonduri proprii

de nivel 1 sau de fonduri proprii de nivel 1 de bază, atunci când apreciază a fi necesar și având în vedere circumstanțele specifice ale S.S.I.F.”

**Art. II.** - Regulamentul Autorității de Supraveghere Financiară nr. 15/2023 privind autorizarea entităților prevăzute la art. 163<sup>2</sup> din Ordonanța de urgență a Guvernului nr. 99/2006 privind instituțiile de credit și adecvarea capitalului, publicat în Monitorul Oficial al României, Partea I, nr. 1179 din 27 decembrie 2023, se modifică după cum urmează:

**1. Articolul 9 se modifică și va avea următorul cuprins:**

„**Art. 9.** - Instituțiile de credit prevăzute la art. 4 alin. (1) pct. 1 lit. (b) din Regulamentul (UE) nr. 575/2013, cu modificările ulterioare, respectă prevederile Ghidului privind detalierea și publicarea indicatorilor de importanță sistemică (EBA/GL/2020/14) și ale Ghidului EBA/GL/2023/10 de modificare a Ghidului EBA/GL/2020/14 privind detalierea și publicarea indicatorilor de importanță sistemică, prevăzute în anexele nr. 2 și 3 care fac parte integrantă din prezentul regulament, în situația în care entitățile respective se încadrează în criteriile prevăzute la secțiunea 2 pct. 6 din Ghidul privind detalierea și publicarea indicatorilor de importanță sistemică (EBA/GL/2020/14).”

**2. Anexa nr. 3 se modifică și va avea următorul cuprins:**

„Anexa nr. 3

Ghid de modificare a Ghidului EBA/GL/2020/14 privind detalierea și publicarea indicatorilor de importanță sistemică (EBA/GL/2023/10)

**1. Obligații de conformare și de raportare**

Statutul ghidului

1. Prezentul document conține ghidul emis în temeiul articolului 16 din Regulamentul (UE) nr. 1093/2010<sup>1</sup>. În conformitate cu articolul 16 alineatul (3) din Regulamentul (UE) nr. 1093/2010, autoritățile competente și instituțiile financiare trebuie să depună toate eforturile necesare pentru a respecta ghidul.

---

<sup>1</sup> Regulamentul (UE) nr. 1093/2010 al Parlamentului European și al Consiliului din 24 noiembrie 2010 de instituire a Autorității europene de supraveghere (Autoritatea bancară europeană), de modificare a Deciziei nr. 716/2009/CE și de abrogare a Deciziei 2009/78/CE a Comisiei (JO L 331, 15.12.2010, p. 12).

2. Ghidul prezintă punctul de vedere al ABE privind practicile adecvate de supraveghere în cadrul Sistemului european de supraveghere financiară sau privind modul în care trebuie aplicat dreptul Uniunii într-un anumit domeniu. Autoritățile competente cărora li se aplică ghidul, astfel cum sunt definite la articolul 4 alineatul (2) din Regulamentul (UE) nr. 1093/2010, trebuie să se conformeze prin integrarea acestuia în practicile lor, după caz (de exemplu, prin modificarea cadrului legislativ sau a procedurilor lor de supraveghere), inclusiv în cazurile în care ghidul se adresează în principal instituțiilor.

#### Cerințe de raportare

3. În conformitate cu articolul 16 alineatul (3) din Regulamentul (UE) nr. 1093/2010, autoritățile competente trebuie să notifice ABE dacă se conformează sau intenționează să se conformeze prezentului ghid sau, în caz contrar, să prezinte motivele neconformării, până la 20.05.2024. În lipsa unei notificări până la acest termen, ABE va considera că autoritățile competente nu s-au conformat. Notificările se trimit prin intermediul formularului disponibil pe site-ul ABE, cu mențiunea „EBA/GL/2023/10”. Notificările trebuie transmise de persoane care au competența necesară de a raporta conformitatea, în numele autorităților competente din care fac parte. Orice schimbare cu privire la situația conformării trebuie adusă, de asemenea, la cunoștința ABE.

4. Notificările vor fi publicate pe site-ul ABE, în conformitate cu articolul 16 alineatul (3).

## 2. Destinatari

5. Ghidul se adresează autorităților competente definite la articolul 4 alineatul (2) punctul (i) din Regulamentul (UE) nr. 1093/2010 și instituțiilor financiare cărora li se aplică Ghidul EBA/GL/2020/14. Autoritățile desemnate menționate la articolul 131 alineatul (1) din Directiva 2013/36/UE, altele decât autoritățile competente, sunt încurajate să aplice prezentul ghid. Atât autoritățile competente, cât și cele desemnate sunt denumite în prezentul ghid „autorități relevante”.

## 3. Punerea în aplicare

Data aplicării

9. Prezentul ghid se aplică de la 20.05.2024.

Abrogare

Ghidul de modificare din 29 septembrie 2022 (EBA/GL/2022/12) de modificare a Ghidului privind specificarea și publicarea indicatorilor de importanță sistemică se abrogă și se înlocuiește cu prezentul ghid.

#### 4. Ghidul modificat

10. EBA/GL/2020/14 se modifică după cum urmează:

(a) Punctul 9 se înlocuiește cu următorul text:

„9. *Autoritățile relevante și entitățile relevante trebuie să urmeze instrucțiunile și specificațiile pentru datele enumerate în anexă, astfel cum se prevede la linkul denumit „Instrucțiuni de raportare” de pe site-ul ABE din secțiunea G-SII<sup>2</sup>.*”

(b) Punctul 10 se înlocuiește cu următorul text:

„10. *Autoritățile relevante trebuie să aplice datele auxiliare (secțiunile 15 și 16 din anexa la prezentul ghid) pentru a-și susține procesul de evaluare în vederea supravegherii, în conformitate cu articolul 131 alineatul (10) din Directiva 2013/36/UE, și elementele memorandum (secțiunile 17-22 din anexă) pentru a îmbunătăți calitatea datelor și a contribui la realizarea de îmbunătățiri viitoare ale metodologiei de identificare. Elementele memorandum trebuie să fie completate cu observații detaliate din partea entităților relevante cu privire la calitatea și disponibilitatea datelor, dacă este cazul.*”

(c) Punctul 10a se înlocuiește cu următorul text:

10a. *„În temeiul articolului 131 alineatul (2a) din Directiva 2013/36/UE, care impune o metodologie suplimentară de identificare care exclude activitățile transfrontaliere în cadrul mecanismului unic de rezoluție (MUR), și în conformitate cu acordul internațional al Comitetului de la Basel din 31 mai 2022 de recunoaștere a progreselor înregistrate în dezvoltarea uniunii bancare europene, datele relevante pentru calcularea indicatorilor MUR interjurisdicționali ajustați privind instituțiile cu sediul în statele membre participante la MUR trebuie considerate ca făcând parte din indicatorii activității interjurisdicționale și, ca atare, trebuie publicate în conformitate cu punctul 12 și nu ca fiind elemente auxiliare sau elemente memorandum pentru metodologia de identificare a G-SII și de alocare a subcategoriilor.*”

(d) Punctul 11 se înlocuiește cu următorul text:

„11. *Autoritățile relevante trebuie să se asigure că toate elementele de date specificate în anexa la prezentul ghid sunt colectate de la entitățile relevante care îndeplinesc criteriile specificate la punctul 6 din prezentul ghid, la data de 31 decembrie a fiecărui an.*”

(e) Punctul 12 se înlocuiește cu următorul text:

„12. *Autoritățile relevante trebuie să se asigure că entitățile relevante publică anual pe site-urile lor valorile indicatorilor așa cum se specifică în secțiunile 1-14 din anexa la prezentul ghid și, în cazul în care este necesară metodologia suplimentară de identificare a MUR, elementele e), f) și g) din secțiunea 21, precum și orice alte elemente din secțiunea 21 care se referă la*

<sup>2</sup> <https://www.eba.europa.eu/risk-analysis-and-data/global-systemically-important-institutions>

activitatea interjurisdicțională a MUR, care ar putea fi considerate relevante pentru calcularea unei astfel de metodologii de către autoritatea competentă relevantă.”

(f) Punctul 14 se înlocuiește cu următorul text:

„14. Entitățile relevante trebuie să transmită anual informațiile menționate la punctul 11 autorităților relevante și să publice anual informațiile menționate la punctul 12 în termen de cel mult patru luni de la data încheierii fiecărui exercițiu financiar, începând cu a doua dată consecutivă de încheiere a exercițiului financiar la care a fost depășit pragul specificat la punctul 6 din prezentul ghid. În acest sens, entitățile relevante trebuie să se identifice folosind identificatorii entităților juridice (LEI).”

(g) Anexa se înlocuiește cu anexa de mai jos.

## Anexă

### DATE BANCARE GENERALE

Secțiunea 1 - Informații generale	Răspuns
a. Informații generale furnizate de autoritatea de supraveghere relevantă:	
(1) Codul de țară	
(2) Denumirea băncii	
(3) Data raportării (aaaa-ll-zz)	
(4) Moneda de raportare	
(5) Cursul de schimb al euro	
(6) Data transmiterii (aaaa-ll-zz)	
b. Informații generale furnizate de instituția raportoare:	
(1) Unitatea de raportare	
(2) Standardul de contabilitate	
(3) Data publicării (aaaa-ll-zz)	
(4) Limba publicării	
(5) Adresa web de publicare	
(6) Codul LEI	

### INDICATORI DE DIMENSIUNE

Secțiunea 2 - Expuneri totale	Valoare
a. Instrumente financiare derivate	

(1) Expunerea față de contraparte a contractelor privind instrumentele financiare derivate

(2) Valoarea noțională plafonată a instrumentelor derivate pe riscul de credit

(3) Expunerea viitoare potențială a contractelor privind instrumentele financiare derivate

**b. Operațiuni de finanțare prin titluri de valoare (SFT)**

(1) Valoarea ajustată brută a operațiunilor de finanțare prin titluri de valoare

(2) Expunerea față de contraparte a operațiunilor de finanțare prin titluri de valoare

**c. Alte active**

**d. Valoarea noțională brută a elementelor extrabilanțiere**

(1) Elemente supuse unui factor de conversie a creditului (CCF) de 0 %

(2) Elemente supuse unui CCF de 20 %

(3) Elemente supuse unui CCF de 50 %

(4) Elemente supuse unui CCF de 100 %

**e. Ajustări de reglementare**

f. Expuneri totale înainte de ajustările de reglementare [suma rubricilor 2.a.(1)-2.c, 0,1 înmulțit cu 2.d.(1), 0,2 înmulțit cu 2.d.(2), 0,5 înmulțit cu 2.d.(3) și 2.d.(4)]

g. Expuneri ale filialelor din asigurări care nu sunt incluse la 2.f. după deducerea intragrup:

(1) Activele bilanțiere și extrabilanțiere ale filialelor din asigurări

(2) Expunerea viitoare potențială a contractelor privind instrumentele financiare derivate pentru filialele din asigurări

(3) Valoarea investițiilor în entitățile consolidate

h. Expunerile intragrup incluse la 2.f. față de filialele din asigurări raportate la 2.g.

i. Indicatorul expunerilor totale, inclusiv filialele din asigurări [suma rubricilor 2.f., 2.g.(1)-2.g.(2) minus 2.g.(3)-2.h.]

*INDICATORI DE INTERCONNECTIVITATE*

**Secțiunea 3 - Active din cadrul sistemului financiar**

**Valoare**

a. Fonduri depozitate la alte instituții financiare sau împrumutate acestora

(1) Certificate de depozit



b. Parte neutilizată din liniile de credit angajate acordate altor instituții financiare

c. Dețineri de titluri de valoare emise de alte instituții financiare:

(1) Titluri de datorie garantate

(2) Titluri de datorie cu rang prioritar negarantate

(3) Titluri de datorie subordonate

(4) Titluri pe termen scurt

(5) Titluri de valoare de tip participație

(6) Poziții scurte compensatorii legate de deținerile de titluri de valoare de tip participație specifice incluse la rubrica 3.c.(5)

d. Expunere curentă pozitivă netă a operațiunilor de finanțare prin titluri de valoare cu alte instituții financiare

e. Instrumente financiare derivate extrabursiere cu alte instituții financiare cu o valoare justă pozitivă netă

(1) Valoarea justă pozitivă netă

(2) Expunerea potențială viitoare

f. Indicatorul activelor din cadrul sistemului financiar [suma rubricilor 3.a., 3.b.-3.c.(5), 3.d., 3.e.(1) și 3.e.(2), minus 3.c.(6)]

#### **Secțiunea 4 - Datorii din cadrul sistemului financiar** **Valoare**

a. Fonduri depozitate de către alte instituții financiare sau împrumutate de la acestea

(1) Depozite datorate unor instituții de depozitare

(2) Depozite datorate unor instituții financiare nedepozitare

(3) Împrumuturi obținute de la alte instituții financiare

b. Parte neutilizată din liniile de credit angajate obținute de la alte instituții financiare

c. Expunere curentă negativă netă a operațiunilor de finanțare prin titluri de valoare cu alte instituții financiare

d. Instrumente financiare derivate extrabursiere cu alte instituții financiare cu o valoare justă negativă netă

(1) Valoarea justă negativă netă

(2) Expunerea potențială viitoare

e. Indicatorul datoriilor din cadrul sistemului financiar, inclusiv filiale din asigurări [suma rubricilor 4.a.(1)-4.d.(2)]

#### **Secțiunea 5 - Titluri de valoare în circulație** **Valoare**

a. Titluri de datorie garantate



- 
- b. Titluri de datorie cu rang prioritar negarantate
  - c. Titluri de datorie subordonate
  - d. Titluri pe termen scurt
  - e. Certificate de depozit
  - f. Acțiuni ordinare
  - g. Acțiuni preferențiale și orice alte forme de finanțare subordonată care nu sunt incluse la rubrica 5.c.
  - h. Indicatorul titlurilor de valoare în circulație, inclusiv titlurile de valoare emise de filialele din asigurări (suma rubricilor 5.a.-5.g.)
- 

*INDICATORI PRIVIND POSIBILITATEA DE SUBSTITUIRE/INFRASTRUCTURA  
INSTITUȚIEI FINANCIARE*

---

**Secțiunea 6 - Plăți efectuate în anul de raportare (cu excepția plăților Valoare  
din cadrul grupului)**

- a. Dolari australieni (AUD)
  - b. Dolari canadieni (CAD)
  - c. Franci elvețieni (CHF)
  - d. Yuani renminbi (CNY)
  - e. Euro (EUR)
  - f. Lire sterline (GBP)
  - g. Dolari din Hong Kong (HKD)
  - h. Rupii indiene (INR)
  - i. Yeni japonezi (JPY)
  - j. Dolari neozeelandezi (NZD)
  - k. Coroane suedeze (SEK)
  - l. Dolari americani (USD)
  - m. Indicatorul activității de plăți (suma rubricilor 6.a-6.l)
- 

**Secțiunea 7 - Active în custodie**

**Valoare**

- a. Indicatorul activelor în custodie
- 

**Secțiunea 8 - Tranzacții subscrise pe piețele titlurilor de datorie și de Valoare  
capital**

- a. Activitate de subscriere a titlurilor de capital
  - b. Activitatea de subscriere a titlurilor de datorie
  - c. Indicatorul activității de subscriere (suma rubricilor 8.a și 8.b)
-

<b>Secțiunea 9 - Volumul de tranzacționare</b>	<b>Valoare</b>
a. Volumul de tranzacționare a titlurilor de valoare emise de alte entități din sectorul public, cu excepția tranzacțiilor intragrup	
b. Volumul de tranzacționare a altor titluri de valoare cu venit fix, cu excepția tranzacțiilor intragrup	
c. Subindicatorul volumului de tranzacționare cu venit fix (suma rubricilor 9.a. și 9.b.)	
d. Volumul de tranzacționare a titlurilor de capital cotate, cu excepția tranzacțiilor intragrup	
e. Volumul de tranzacționare a tuturor celorlalte titluri de valoare, cu excepția tranzacțiilor intragrup	
f. Subindicatorul volumului de tranzacționare a titlurilor de capital și a altor titluri de valoare (suma rubricilor 9.d. și 9.e.)	

*INDICATORI DE COMPLEXITATE*

<b>Secțiunea 10 - Valoarea noțională a instrumentelor financiare derivate extrabursiere</b>	<b>Valoare</b>
a. Instrumente financiare derivate extrabursiere compensate printr-o contraparte centrală	
b. Instrumente financiare derivate extrabursiere decontate prin acorduri bilaterale	
c. Valoarea noțională a indicatorului instrumentelor financiare derivate extrabursiere (OTC), inclusiv filiale din asigurări (suma rubricilor 10.a. și 10.b.)	

<b>Secțiunea 11 - Titluri de valoare deținute în vederea tranzacționării și disponibile pentru vânzare</b>	<b>Valoare</b>
a. Titluri de valoare deținute pentru tranzacționare	
b. Titluri de valoare disponibile pentru vânzare	
c. Titluri de valoare deținute în vederea tranzacționării și disponibile pentru vânzare care respectă definiția activelor de nivel 1	
d. Titluri de valoare deținute în vederea tranzacționării și disponibile pentru vânzare care respectă definiția activelor de nivel 2, cu ajustări	
e. Indicatorul de titluri de valoare deținute în vederea tranzacționării și disponibile pentru vânzare (suma rubricilor 11.a. și 11.b., minus suma rubricilor 11.c. și 11.d.)	

**Secțiunea 12 - Active de nivel 3****Valoare**

a. Indicatorul activelor de nivel 3, inclusiv filiale din asigurări

*INDICATORI PRIVIND ACTIVITATEA INTERJURISDICTIONALĂ***Secțiunea 13 - Creanțe interjurisdicționale****Valoare**

a. Totalul creanțelor externe evaluate pe baza riscului final

b. Creanțele externe din instrumente financiare derivate evaluate pe baza riscului final

c. Indicatorul creanțelor interjurisdicționale (suma rubricilor 13.a. și 13.b.)

**Secțiunea 14 - Datorii interjurisdicționale****Valoare**

a. Datorii externe evaluate pe baza riscului iminent, cu excepția instrumentelor financiare derivate și incluzând datoriile locale în moneda locală

b. Datorii externe din instrumente financiare derivate evaluate pe baza riscului iminent

c. Indicatorul datoriilor interjurisdicționale (suma rubricilor 14.a. și 14.b.)

*DATE AUXILIARE***Secțiunea 15 - Indicatori auxiliari****Valoare**

a. Total datorii

b. Finanțare de tip retail

c. Rata de dependență de finanțarea wholesale (diferența dintre rubricile 15.a. și 15.b., împărțită la 15.a.)

d. Total venituri brute

e. Total venituri nete

f. Venituri nete externe

g. Valoarea brută a numerarului dat cu împrumut și valoarea justă brută a titlurilor de valoare plasate în cadrul operațiunilor de finanțare prin titluri de valoare

h. Valoarea brută a numerarului primit cu împrumut și valoarea justă brută a titlurilor de valoare împrumutate în cadrul operațiunilor de finanțare prin titluri de valoare

i. Valoarea justă pozitivă brută a operațiunilor cu instrumente financiare derivate extrabursiere

j. Valoarea justă negativă brută a operațiunilor cu instrumente financiare derivate (OTC)

**Valoare în unități  
individuale**

k. Număr de jurisdicții

**Secțiunea 16 - Elemente auxiliare**

**Valoare**

a. Titluri de valoare deținute până la scadență

b. Plăți efectuate în anul de raportare

(1) Reali brazilieni (BRL)

(2) Pesos mexicani (MXN)

(3) Coroană norvegiană (NOK)

(4) Ruble rusești (RUB)

(5) Dolarul singaporez (SGD)

(6) Wonul sud-coreean (KRW)

*ELEMENTE MEMORANDUM*

**Secțiunea 17 - Elemente de dimensiune**

**Valoare**

a. Expunerea filialelor din asigurări deja incluse în perimetrul de consolidare reglementat prudențial

b. Valoarea medie trimestrială a expunerilor totale

c. Valoarea medie lunară a expunerilor totale

**Secțiunea 18 - Elemente de interconectivitate**

**Valoare**

a. Indicatorul activelor din cadrul sistemului financiar (indicator vechi)

b. Valoarea medie trimestrială a activelor din cadrul sistemului financiar

c. Valoarea medie lunară a activelor din cadrul sistemului financiar

d. Indicatorul datoriilor din cadrul sistemului financiar (indicator vechi)

e. Valoarea medie trimestrială a datoriilor din cadrul sistemului financiar

f. Valoarea medie lunară a datoriilor din cadrul sistemului financiar

g. Indicatorul titlurilor de valoare în circulație (indicator vechi)

h. Valoarea medie trimestrială a titlurilor de valoare în circulație

---

i. Valoarea medie lunară a titlurilor de valoare în circulație

---

**Secțiunea 19 - Elemente privind posibilitatea de substituire/infrastructura instituției financiare****Valoare**

---

a. Volumul de tranzacționare a titlurilor de valoare emise de entități suverane, cu excepția tranzacțiilor intragrup

---

b. Marja inițială depusă la contrapărțile centrale în numele clienților

---

c. Marja inițială depusă la contrapărțile centrale în contul propriu al grupului raportor

---

d. Contribuțiile la fondul de garantare al contrapărților centrale

---

e. Alte facilități la contrapărțile centrale

---

f. Furnizarea de servicii de decontare în legătură cu tranzacții compensate la nivel central

---

g. Valoarea medie trimestrială a activelor în custodie

---

h. Valoarea medie lunară a activelor în custodie

---

**Secțiunea 20 - Elemente de complexitate****Valoare**

---

a. Indicatorul instrumentelor financiare derivate extrabursiere (indicator vechi)

---

b. Valoarea noțională a instrumentelor financiare derivate extrabursiere (OTC), inclusiv filiale din asigurări:

---

(1) Compensate printr-o contraparte centrală în cadrul căreia grupul (inclusiv filialele din asigurări) acționează ca intermediar financiar (segment contraparte centrală)

---

(2) Compensate printr-o contraparte centrală în cadrul căreia grupul (inclusiv filialele din asigurări) acționează ca intermediar financiar (segment client)

---

(3) Compensate printr-o contraparte centrală în cadrul căreia grupul, inclusiv filialele din asigurări, acționează ca agent

---

(4) Compensate printr-o contraparte centrală în cadrul căreia grupul, inclusiv filialele din asigurări, tranzacționează pe cont propriu

---

c. Instrumente financiare derivate extrabursiere compensate printr-o contraparte centrală (excluderea tranziției LIBOR)

---

d. Valoarea medie trimestrială a valorii noționale a instrumentelor financiare derivate extrabursiere

---

e. Valoarea medie lunară a valorii noționale a instrumentelor financiare derivate extrabursiere

---

f. Valoarea medie trimestrială a titlurilor de valoare deținute în vederea tranzacționării și disponibile pentru vânzare

g. Valoarea medie lunară a titlurilor de valoare deținute în vederea tranzacționării și disponibile pentru vânzare

h. Indicatorul activelor de nivel 3 (indicator vechi)

i. Valoarea medie trimestrială a activelor de nivel 3

j. Valoarea medie lunară a activelor de nivel 3

k. Active de nivel 2, inclusiv filiale din asigurări

(1) Active de nivel 2, inclusiv filiale din asigurări, compensate printr-o contraparte centrală

(2) Active de nivel 2, inclusiv filiale din asigurări, decontate prin acorduri bilaterale

(3) Alte active de nivel 2, inclusiv filiale din asigurări

l. Valoarea medie a activelor de nivel 2, inclusiv filiale din asigurări

## **Secțiunea 21 - Elemente de activitate interjurisdicțională**

## **Valoare**

a. Indicatorul datoriilor interjurisdicționale (indicator vechi)

(1) Datorii externe (cu excepția instrumentelor financiare derivate și a datoriilor locale în monedă locală)

(2) Orice datorii externe referitoare la birourile aferente incluse la rubrica 21.a.(1)

(3) Datorii locale în monedă locală (fără activitatea instrumentelor financiare derivate)

b. Datorii locale în monedă locală (cu activitatea instrumentelor financiare derivate)

c. Creanțe locale interjurisdicționale în monedă locală (fără activitatea instrumentelor financiare derivate)

d. Creanțe locale interjurisdicționale în monedă locală (cu activitatea instrumentelor financiare derivate)

e. Total creanțe externe evaluate pe baza riscului final (considerând MUR ca o singură jurisdicție)

f. Creanțe externe din instrumente financiare derivate evaluate pe baza riscului final (considerând MUR ca o singură jurisdicție)

g. Datorii externe evaluate pe baza riscului iminent, inclusiv instrumente financiare derivate (considerând MUR ca o singură jurisdicție)

(1) Datorii externe din instrumente financiare derivate evaluate pe baza riscului iminent (considerând MUR ca o singură jurisdicție)

h. Creanțe locale interjurisdicționale în monedă locală, fără activitatea instrumentelor financiare derivate (considerând MUR ca o singură jurisdicție)

i. Creanțe locale interjurisdicționale în monedă locală, cu activitatea instrumentelor financiare derivate (considerând MUR ca o singură jurisdicție)

j. Datoriile externe, cu excepția instrumentelor financiare derivate și a datoriilor locale în monedă locală (considerând MUR ca o singură jurisdicție)

(1) Orice datorii externe referitoare la birourile aferente incluse la rubrica 20.j. (considerând MUR ca o singură jurisdicție)

k. Datoriile locale în monedă locală, cu excepția instrumentelor financiare derivate (considerând MUR ca o singură jurisdicție)

l. Datoriile locale în monedă locală, inclusiv instrumente financiare derivate (considerând MUR ca o singură jurisdicție)

m. Total poziții locale nete în monedă locală, inclusiv instrumente financiare derivate, dacă valoarea netă este pozitivă

n. Total poziții locale nete în monedă locală, inclusiv instrumente financiare derivate, dacă valoarea netă este negativă

o. Total poziții locale nete în monedă locală în țările neparticipante la MUR, inclusiv instrumente financiare derivate, dacă valoarea netă este pozitivă (considerând MUR ca o singură jurisdicție)

p. Total poziții locale nete în monedă locală în țările neparticipante la MUR, inclusiv instrumente financiare derivate, dacă valoarea netă este negativă (considerând MUR ca o singură jurisdicție)

q. Total poziții locale nete în monedă locală în țările participante la MUR, inclusiv instrumente financiare derivate (considerând MUR ca o singură jurisdicție)

r. Creanțe intra-organizație, înregistrate de filiale din străinătate

s. Creanțe intra-organizație, înregistrate de sucursale din străinătate

t. Datoriile intra-organizație, înregistrate de filiale din străinătate

u. Datoriile intra-organizație, înregistrate de sucursale din străinătate

v. Valoarea medie trimestrială a creanțelor interjurisdicționale

w. Valoarea medie lunară a creanțelor interjurisdicționale

x. Valoarea medie trimestrială a datoriilor interjurisdicționale

y. Valoarea medie lunară a datoriilor interjurisdicționale

## Secțiunea 22 - Indicatori auxiliari

a. Venituri nete externe (considerând MUR ca singură jurisdicție)



b. Numărul jurisdicțiilor (considerând MUR ca singură jurisdicție)

### REZUMATUL VERIFICĂRILOR

Secțiunea 23 – Valorile indicatorilor (metodologie revizuită)	Valoarea indicatorului în moneda de raportare
a. Secțiunea 2 - Indicatorul expunerilor totale, inclusiv filiale din asigurări	
b. Secțiunea 3 - Indicatorul activelor din cadrul sistemului financiar, inclusiv filiale din asigurări	
c. Secțiunea 4 – Indicatorul datoriilor din cadrul sistemului financiar, inclusiv filiale din asigurări	
d. Secțiunea 5 - Indicatorul titlurilor de valoare în circulație, inclusiv filiale din asigurări	
e. Secțiunea 6 - Indicatorul activității de plăți	
f. Secțiunea 7 - Indicatorul activelor în custodie	
g. Secțiunea 8 - Indicatorul activității de subscriere	
h. Secțiunea 9.c - Subindicatorul volumului de tranzacționare cu venit fix	
i. Secțiunea 9.f – Subindicatorul volumului de tranzacționare a titlurilor de capital și a altor titluri de valoare	
j. Secțiunea 10 - Indicatorul instrumentelor financiare derivate extrabursiere (OTC), inclusiv filiale din asigurări	
k. Secțiunea 11 - Indicatorul titlurilor de valoare deținute în vederea tranzacționării și disponibile pentru vânzare (AFS)	
l. Secțiunea 12 - Indicatorul activelor de nivel 3, inclusiv filiale din asigurări	
m. Secțiunea 13 - Indicatorul creanțelor interjurisdicționale	
n. Secțiunea 14 - Indicatorul datoriilor interjurisdicționale	
o. Alte secțiuni	
(1) Elementul 1.a - Informații generale furnizate de autoritatea de supraveghere	
(2) Elementul 1.b - Informații generale furnizate de instituția de raportare	
(3) Secțiunea 15 - Indicatori auxiliari	
(4) Secțiunea 16 - Elemente auxiliare	
(5) Secțiunea 17 - Elemente de dimensiune	
(6) Secțiunea 18 - Elemente de interconectivitate	
(7) Secțiunea 19 - Elemente privind posibilitatea de substituie/infrastructura instituției financiare	

- (8) Secțiunea 20 - Elemente de complexitate
- (9) Secțiunea 21 - Elemente de activitate interjurisdicțională
- (10) Secțiunea 22 - Indicatori auxiliari

**Secțiunea 24 – Valorile indicatorilor (metodologie veche)****Valoarea indicatorului în moneda de raportare**

- a. Secțiunea 2 - Indicatorul expunerilor totale
- b. Secțiunea 18 - Indicatorul activelor din cadrul sistemului financiar
- c. Secțiunea 18 - Indicatorul datoriilor din cadrul sistemului financiar
- d. Secțiunea 18 - Indicatorul titlurilor de valoare în circulație
- e. Secțiunea 6 - Indicatorul activității de plăți
- f. Secțiunea 7 - Indicatorul activelor în custodie
- g. Secțiunea 8 - Indicatorul activității de subscriere
- h. Secțiunea 20 - Indicatorul instrumentelor financiare derivate extrabursiere (OTC)
- i. Secțiunea 11 - Indicatorul titlurilor de valoare deținute în vederea tranzacționării și disponibile pentru vânzare (AFS)
- j. Secțiunea 20 - Indicatorul activelor de nivel 3
- k. Secțiunea 13 - Indicatorul creanțelor interjurisdicționale
- l. Secțiunea 21 - Indicatorul datoriilor interjurisdicționale

**Art. III.** - Prezentul regulament se publică în Monitorul Oficial al României, Partea I și intră în vigoare la data publicării, cu excepția art. I pct. 1, care intră în vigoare la data de 17.01.2025.

\*

Prezentul regulament transpune art. 4 pct. 3 din Directiva (UE) 2022/2556 a Parlamentului European și a Consiliului din 14 decembrie 2022 de modificare a Directivelor 2009/65/CE, 2009/138/CE, 2011/61/UE, 2013/36/UE, 2014/59/UE, 2014/65/UE, (UE) 2015/2366 și (UE) 2016/2341 privind reziliența operațională digitală pentru sectorul financiar, publicată în Jurnalul Oficial al Uniunii Europene, seria L, nr. 333 din 27 decembrie 2022 și art. 1 pct. 33 din Directiva (UE) 2019/878 a Parlamentului European și a Consiliului din 20 mai 2019 de modificare a Directivei 2013/36/UE în ceea ce privește entitățile exceptate, societățile financiare holding,



societățile financiare holding mixte, remunerarea, măsurile și competențele de supraveghere și măsurile de conservare a capitalului, publicată în Jurnalul Oficial al Uniunii Europene seria L, nr. 150 din 7 iunie 2019, referitor la introducerea art. 104a alin. (4) paragrafele 1-3.

**Președintele Autorității de Supraveghere Financiară,  
Alexandru Petrescu**

București, 25.09.2024

Nr. 11