Journal officiel
de l'Union européenne

FR
Série L

2025/379

12.3.2025

RÈGLEMENT D'EXÉCUTION (UE) 2025/379 DE LA COMMISSION

du 26 février 2025

modifiant les normes techniques d'exécution définies dans le règlement d'exécution (UE) 2016/2070 en ce qui concerne les portefeuilles de référence et les modèles et instructions à respecter dans l'Union pour la communication d'informations visée à l'article 78, paragraphe 2, de la directive 2013/36/UE du Parlement européen et du Conseil

(Texte présentant de l'intérêt pour l'EEE)

LA COMMISSION EUROPÉENNE,

vu le traité sur le fonctionnement de l'Union européenne,

vu la directive 2013/36/UE du Parlement européen et du Conseil du 26 juin 2013 concernant l'accès à l'activité des établissements de crédit et la surveillance prudentielle des établissements de crédit, modifiant la directive 2002/87/CE et abrogeant les directives 2006/48/CE et 2006/49/CE ([1]), et notamment son article 78, paragraphe 8, troisième alinéa,

considérant ce qui suit:

(1) En vertu de l'article 78, paragraphe 1, de la directive 2013/36/UE, les établissements autorisés à recourir à des approches internes sont tenus de transmettre à leur autorité compétente, à une fréquence appropriée, au moins une fois par an, les résultats du calcul de leurs montants d'exposition pondérés ou de leurs exigences de fonds propres selon leurs approches internes pour les expositions ou positions incluses dans les portefeuilles de référence, afin de permettre à cette autorité compétente d'évaluer la qualité de ces approches internes («exercice d'analyse comparative»). En vertu de l'article 78, paragraphe 3, deuxième alinéa, de ladite directive, l'Autorité bancaire européenne (ci-après l'«ABE») doit établir un rapport pour prêter assistance aux autorités compétentes dans l'évaluation de la qualité des approches internes des établissements sur la base des résultats de l'exercice d'analyse comparative. Les exigences en matière de communication d'informations pour l'exercice d'analyse comparative ont été précisées dans le règlement d'exécution (UE) 2016/2070 de la Commission ([2]), qui a été modifié à plusieurs reprises. Afin de tenir compte de l'évolution du point de mire des évaluations des autorités compétentes et des rapports de l'ABE, et à la lumière des changements législatifs dans le domaine du risque de marché, il est nécessaire de remettre à jour les portefeuilles de référence, ainsi que les exigences en matière de communication d'informations prévues dans ledit règlement d'exécution.

(2) En ce qui concerne l'analyse comparative du risque de crédit, il convient de modifier les instructions afin de préciser la nature obligatoire de la communication des paramètres de probabilité de défaut (PD) et de risque de perte en cas de défaut (PCD) en ce qui concerne les composantes pour marge de prudence, cumulateur réglementaire et ralentissement, qui peuvent être une source de variabilité dans les modèles. Il convient en outre de préciser que les établissements sont tenus de déclarer l'identifiant des modèles attribué par l'autorité compétente, ce qui permet de simplifier la mise en œuvre opérationnelle de la répartition des données communiquées.

(3) Le règlement délégué (UE) 2024/2795 de la Commission ([3]) a reporté la date d'application des nouvelles exigences de fonds propres pour le risque de marché. En conséquence, les modèles pour l'approche existante fondée sur les modèles internes ne sont pas remplacés pour cet exercice. Par ailleurs, il convient d'étendre les modèles de validation de l'approche standard afin d'y inclure des portefeuilles supplémentaires par rapport à l'exercice 2024, où seuls les instruments sur taux d'intérêt entraient en compte. Cela a pour but de garantir une surveillance adéquate et une mise en œuvre sans accroc de la nouvelle approche standard, qui est utilisée pour le calcul du plancher de fonds propres.

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

([2]) Règlement d'exécution (UE) 2016/2070 de la Commission du 14 septembre 2016 définissant des normes techniques d'exécution concernant les modèles, définitions et solutions informatiques à utiliser par les établissements pour la communication d'informations à l'Autorité bancaire européenne et aux autorités compétentes conformément à l'article 78, paragraphe 2, de la directive 2013/36/UE du Parlement européen et du Conseil (JO L 328 du 2.12.2016, p. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2016/2070/oj).

([3]) Règlement délégué (UE) 2024/2795 de la Commission du 24 juillet 2024 modifiant le règlement (UE) n° 575/2013 du Parlement européen et du Conseil en ce qui concerne la date d'application des exigences de fonds propres pour risque de marché (JO L, 2024/2795, 31.10.2024, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2024/2795/oj).

(4) Il convient dès lors de modifier le règlement d'exécution (UE) 2016/2070 en conséquence.

(5) Le présent règlement se fonde sur les projets de normes techniques d'exécution soumis à la Commission par l'ABE.

(6) L'ABE a procédé à des consultations publiques ouvertes sur les projets de normes techniques d'exécution sur lesquels se fonde le présent règlement, analysé les coûts et avantages potentiels qu'ils impliquent et sollicité l'avis du groupe des parties intéressées au secteur bancaire institué en application de l'article 37 du règlement (UE) nº 1093/2010 du Parlement européen et du Conseil ([4]),

A ADOPTÉ LE PRÉSENT RÈGLEMENT:

Article premier

Le règlement d'exécution (UE) 2016/2070 est modifié comme suit:

1) L'annexe IV est remplacée par le texte figurant à l'annexe I du présent règlement.

2) L'annexe V est remplacée par le texte figurant à l'annexe II du présent règlement.

3) L'annexe VI est remplacée par le texte figurant à l'annexe III du présent règlement.

4) L'annexe VII est remplacée par le texte de l'annexe IV du présent règlement.

5) L'annexe X est remplacée par le texte figurant à l'annexe V du présent règlement.

Article 2

Le présent règlement entre en vigueur le vingtième jour suivant celui de sa publication au *Journal officiel de l'Union européenne*.

Le présent règlement est obligatoire dans tous ses éléments et directement applicable dans tout État membre.

Fait à Bruxelles, le 26 février 2025.

Par la Commission
La présidente
Ursula VON DER LEYEN

([4]) Règlement (UE) nº 1093/2010 du Parlement européen et du Conseil du 24 novembre 2010 instituant une Autorité européenne de surveillance (Autorité bancaire européenne), modifiant la décision nº 716/2009/CE et abrogeant la décision 2009/78/CE de la Commission (JO L 331 du 15.12.2010, p. 12, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2010/1093/oj).

ANNEXE I

«ANNEXE IV

RÉSULTATS — PORTEFEUILLES DE RÉFÉRENCE À DES FINS DE SURVEILLANCE

PARTIE I: INSTRUCTIONS GÉNÉRALES

PARTIE II: INSTRUCTIONS RELATIVES AUX MODÈLES

C 101 — Détails relatifs aux expositions des portefeuilles à faible défaut (LDP), par contrepartie

C 102 — Détails relatifs aux expositions des portefeuilles à faible défaut (LDP)

C 103 — Détails relatifs aux expositions des portefeuilles à défaut élevé

C 105.01 — Définition des modèles internes

C 105.02 — Mise en correspondance des modèles internes et des portefeuilles

C 105.03 — Mise en correspondance des modèles internes et des pays

PARTIE I: INSTRUCTIONS GÉNÉRALES

1. Les informations ne sont à communiquer que pour les contreparties et portefeuilles pour lesquels il existe une exposition réelle à la date de référence, soit sous la forme d'une exposition initiale, soit d'une exposition après atténuation du risque de crédit. Pour les contreparties et portefeuilles pour lesquels il n'existe pas d'exposition à la date de référence, elles ne sont pas à communiquer.

2. Les informations ne sont à communiquer que pour les expositions pour lesquelles l'autorité compétente a approuvé un modèle interne pour le calcul des montants d'exposition pondérés (RWA). Dans le modèle C 101, les codes de contrepartie se terminant par "STDA" ne doivent pas être déclarés. Pour les autres codes de contrepartie du modèle C 101 de l'annexe I et pour les portefeuilles de référence visés dans les modèles C 102 et C 103, les expositions selon l'approche standard et les expositions pour lesquelles l'autorité compétente concernée a autorisé l'utilisation partielle temporaire ou permanente de l'approche standard doivent être exclues.

3. Les champs recueillant des informations non applicables/mal définies doivent être laissés vierges, ou bien il convient d'y inscrire la mention "NULL" ("NÉANT"); cela vaut également pour les quantités pondérées en fonction de l'exposition en cas de défaut (EAD) ou les paramètres qui ne peuvent pas être calculés. De même, les champs de données qu'il n'est pas obligatoire de déclarer peuvent être laissés vierges ou porter la mention "NULL" ("NÉANT"). La valeur zéro ne doit être utilisée que si l'intention est de déclarer une quantité ou un paramètre égal à zéro. Ne pas laisser le champ vierge et ne pas utiliser la mention "NULL" ("NÉANT") pour déclarer une quantité ou un paramètre égal à zéro.

4. Les montants monétaires sont déclarés de la même manière qu'ils sont déclarés pour le calcul des exigences de fonds propres à une date de référence spécifique conformément au règlement d'exécution (UE) 2021/451 de la Commission ([1]).

([1]) Règlement d'exécution (UE) 2021/451 de la Commission du 17 décembre 2020 définissant des normes techniques d'exécution pour l'application du règlement (UE) n° 575/2013 du Parlement européen et du Conseil en ce qui concerne l'information prudentielle à fournir par les établissements, et abrogeant le règlement d'exécution (UE) n° 680/2014 (JO L 97 du 19.3.2021, p. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2021/451/oj).

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

C 101 — Détails relatifs aux expositions des portefeuilles à faible défaut (LDP), par contrepartie

Les expositions de financement spécialisé sont exclues.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0010	Code de la contrepartie	Annexe I, modèle C 101, colonne 0010	Indiquer le code de contrepartie de la colonne 0010 du modèle C 101 de l'annexe I attribué à la contrepartie incluse dans les portefeuilles échantillons à faible défaut (LDP). Ce code est un identifiant de ligne qui est propre à chaque ligne du modèle.
0020	Catégorie d'exposition	Paragraphe 76 de l'annexe II du règlement d'exécution (UE) 2021/451	Chaque contrepartie est classée dans l'une des catégories d'expositions suivantes: a) Banques centrales et administrations centrales; b) Établissements; c) Entreprises — PME (petites et moyennes entreprises); d) Entreprises — Financement spécialisé; e) Entreprises — Autres; f) Clientèle de détail — Expositions garanties par des biens immobiliers PME; g) Clientèle de détail — Expositions garanties par des biens immobiliers non-PME; h) Clientèle de détail — Expositions renouvelables éligibles; i) Clientèle de détail — Autres PME; j) Clientèle de détail — Entreprises autres que des PME; k) Sans objet "Sans objet" doit être utilisé lorsqu'aucune des réponses de la liste ne s'applique, ce qui est le cas lorsque les expositions sur une contrepartie sont classées dans plusieurs catégories d'expositions sans qu'aucune ne prédomine clairement.
0040	Notation		Indiquer le rang de l'échelon de notation interne attribué à la contrepartie selon l'échelle de notation interne applicable de l'établissement. Il suit l'ordre numérique 1, 2, 3, etc., depuis le risque le plus faible jusqu'au risque le plus élevé en excluant les défauts dont la PD est de 100 %. Lorsqu'un établissement utilise une échelle de notation continue conformément à l'article 169, paragraphe 3, du règlement (UE) nº 575/2013 du Parlement européen et du Conseil ([2]), il convient d'utiliser les échelons de notation déclarés dans la colonne 0005 du modèle C 08.02 de l'annexe I du règlement d'exécution (UE) 2021/451. Lorsque les expositions sur une contrepartie ont été affectées à différents échelons de notation conformément à l'article 172, paragraphe 1, point e), i) ou iii), du règlement (UE) nº 575/2013, il convient de déclarer l'échelon de notation zéro (0).

([2]) Règlement (UE) nº 575/2013 du Parlement européen et du Conseil du 26 juin 2013 concernant les exigences prudentielles applicables aux établissements de crédit et aux entreprises d'investissement et modifiant le règlement (UE) nº 648/2012 (JO L 176 du 27.6.2013, p. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2013/575/oj).

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0050	Date de la notation la plus récente de la contrepartie		Indiquer la date de la notation la plus récente de la contrepartie.
0060	PD (probabilité de défaut)	Annexe I, modèle C 08.01, colonne 0010, du règlement d'exécution (UE) 2021/451	Déclarer la PD attribuée à la contrepartie. Il s'agit de la PD utilisée pour le calcul des RWA, hors effet des mesures instaurées conformément à l'article 458 du règlement (UE) nº 575/2013. La PD doit être une valeur comprise entre 0 et 1.
0070	Statut de défaut		Déclarer le statut de défaut de la contrepartie. Ce statut déterminé conformément à l'article 178 du règlement (UE) nº 575/2013 sera l'un des suivants: a) En défaut; b) Non en défaut.
0080	Exposition initiale avant application des facteurs de conversion	Annexe I, modèle C 08.01, colonne 0020, du règlement d'exécution (UE) 2021/451	Indiquer la valeur d'exposition initiale compte non tenu des corrections de valeur, des provisions, des effets dus aux techniques d'atténuation du risque de crédit ou des facteurs de conversion de crédit.
0090	Exposition après effets de substitution ARC et avant application des facteurs de conversion	Annexe I, modèle C 08.01, colonne 0090, du règlement d'exécution (UE) 2021/451	Indiquer le montant auquel des facteurs de conversion ("CCF") sont appliqués pour obtenir l'exposition en cas de défaut (colonne 0110). Il convient pour cela de tenir compte des techniques d'atténuation du risque de crédit avec effets de substitution sur l'exposition.
0100	Facteur de conversion (CCF)	Article 166, paragraphe 8, du règlement (UE) nº 575/2013	Indiquer la moyenne pondérée des CCF. Les pondérations à utiliser sont les montants auxquels les CCF sont appliqués pour obtenir l'EAD. Pour les contreparties dont les facilités correspondent exclusivement aux éléments visés à l'article 166, paragraphe 8, du règlement (UE) nº 575/2013, la moyenne pondérée des CCF déclarée sera basée sur l'ensemble des facilités. Pour les contreparties dont les facilités ne font pas partie des éléments visés à l'article 166, paragraphe 8, du règlement (UE) nº 575/2013, il convient soit de laisser vierge le champ CCF, soit d'y inscrire la mention "NULL" ("NÉANT").

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
			Pour les contreparties ayant des facilités correspondant aux éléments visés à l'article 166, paragraphe 8, du règlement (UE) nº 575/2013 et des facilités ne faisant pas partie des éléments visés à l'article 166, paragraphe 8, dudit règlement, la moyenne pondérée des CCF déclarée sera basée uniquement sur les facilités correspondant aux éléments visés à l'article 166, paragraphe 8, du règlement (UE) nº 575/2013. En particulier, les facilités correspondant aux éléments visés à l'article 166, paragraphe 10, dudit règlement ne seront pas prises en compte dans le calcul. Si l'établissement applique ses propres estimations des CCF pour les éléments visés à l'article 166, paragraphe 8, du règlement (UE) nº 575/2013, ce sont ces CCF qu'il convient d'utiliser pour calculer la moyenne pondérée des CCF. Si l'établissement n'applique pas ses propres estimations des CCF pour les éléments visés à l'article 166, paragraphe 8, du règlement (UE) nº 575/2013, il convient d'utiliser les CCF réglementaires prévus à l'article 166, paragraphe 8, du règlement (UE) nº 575/2013. Les CCF doivent être des valeurs comprises entre 0 et 1.
0110	Exposition en cas de défaut (EAD)	Annexe I, modèle C 08.01, colonne 0110, du règlement d'exécution (UE) 2021/451	Indiquer la valeur d'exposition.
0120	Valeur de la sûreté	Annexe I, modèle C 08.01, colonnes 0150 à 0210, du règlement d'exécution (UE) 2021/451	Indiquer la valeur de marché de la sûreté.
0130	LGD hypothétiques pour expositions de rang supérieur non garanties, sans clause de nantissement négative (negative pledge)	Article 161 du règlement (UE) nº 575/2013	Indiquer les propres estimations hypothétiques des pertes en cas de défaut ("LGD") qui seraient appliquées par l'établissement aux expositions sur la contrepartie conformément à ce qui suit: (a) le périmètre des expositions est le même que pour la valeur de LGD déclarée dans la colonne 0150; (b) les expositions sont de rang supérieur et non garanties; (c) il n'y a pas clause de nantissement négative. Une clause de nantissement négative est une clause stipulant que l'emprunteur ou l'émetteur de dette ne donnera aucun de ses actifs en nantissement à un tiers.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0140	LGD hypothétiques pour expositions de rang supérieur non garanties, avec clause de nantissement négative	Article 161 du règlement (UE) nº 575/2013	Indiquer les propres estimations hypothétiques de LGD qui seraient appliquées par l'établissement aux expositions sur la contrepartie conformément à ce qui suit: (a) le périmètre des expositions est le même que pour la valeur de LGD déclarée dans la colonne 0150; (b) les expositions sont de rang supérieur et non garanties; (c) il existe une clause de nantissement négative. Une clause de nantissement négative est une clause stipulant que l'emprunteur ou l'émetteur de dette ne donnera aucun de ses actifs en nantissement à un tiers.
0150	Pertes en cas de défaut (LGD)	Annexe I, modèle C 08.01, colonnes 0230 et 0240, du règlement d'exécution (UE) 2021/451	Indiquer la moyenne pondérée en fonction de l'EAD des valeurs des LGD des expositions sur la contrepartie. Les LGD seront celles utilisées pour le calcul des RWA. Plus précisément, si l'établissement a obtenu de son autorité compétente l'autorisation d'utiliser ses propres estimations de LGD, les LGD seront basées sur les propres estimations de l'établissement. Dans le cas contraire, les LGD seront basées sur les valeurs réglementaires de LGD en tenant compte de l'atténuation des risques applicable. Les LGD pour les entités réglementées de grande taille du secteur financier et les entités financières non réglementées seront incluses. Les effets des mesures instaurées conformément à l'article 458 du règlement (UE) nº 575/2013 doivent être exclus. Les LGD doivent être des valeurs comprises entre 0 et 1.
0160	Échéance	Annexe I, modèle C 08.01, colonne 0250, du règlement d'exécution (UE) 2021/451	Indiquer l'échéance, pondérée en fonction de l'EAD, pour les expositions sur la contrepartie. Elle doit être exprimée en nombre de jours.
0170	Montants d'exposition pondérés (RWA)	Annexe I, modèle C 08.01, colonne 0260, du règlement d'exécution (UE) 2021/451	Indiquer les RWA après facteurs supplétifs (facteurs supplétifs pour les PME et les infrastructures). Les RWA n'incluent pas l'effet des éventuelles mesures prises en vertu de l'article 458 du règlement (UE) nº 575/2013.

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

C 102 — Détails relatifs aux expositions des portefeuilles à faible défaut (LDP)

Pour les portefeuilles visés dans l'annexe I avec un statut de couverture par des sûretés autre que "Sans objet", les informations suivantes sont facultatives lorsque le modèle approuvé ne permet pas de calculs distincts de LGD pour la partie garantie et pour la partie non garantie d'une exposition: LGD (colonne 0130), LGD sans mesures de surveillance (colonne 0131), LGD sans marge de prudence et sans mesures de surveillance (colonne 0132), LGD sans marge de prudence, sans mesures de surveillance et sans composante pour ralentissement (colonne 0133), Montant des pertes anticipées (colonne 0150) et RWA (colonne 0170).

Pour les portefeuilles faisant l'objet d'une approche réglementaire définie comme "Critères de référencement du financement spécialisé", les informations suivantes doivent être omises: PD (colonne 0060), PD sans mesures de surveillance (colonne 0061), PD sans marge de prudence et sans mesures de surveillance (colonne 0062), LGD (colonne 0130), LGD sans mesures de surveillance (colonne 0131), LGD sans marge de prudence et sans mesures de surveillance (colonne 0132), LGD sans marge de prudence, sans mesures de surveillance et sans composante pour ralentissement (colonne 0133).

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0010	Identifiant du portefeuille	Annexe I, modèle C 102, colonne 0010	Indiquer l'identifiant de portefeuille de la colonne 0010 du modèle C.102 de l'annexe I définissant le portefeuille. Cet identifiant est un identifiant de ligne qui est propre à chaque ligne du modèle. L'affectation des expositions aux identifiants de portefeuille n'est pas exclusive: les expositions ou parties d'expositions sont déclarées sous chaque identifiant de portefeuille qui est applicable.
0040	Nombre de débiteurs		Indiquer le nombre de débiteurs. Ce nombre est fondé sur les débiteurs qui ont une valeur strictement positive déclarée soit dans la colonne 0080, soit dans la colonne 0090. En cas de substitution intégrale du fait d'une technique d'atténuation du risque de crédit, le débiteur d'origine est ajouté au "nombre de débiteurs" de son portefeuille d'origine, et le garant est ajouté au "nombre de débiteurs" du portefeuille du garant.
0060	PD (probabilité de défaut)	Annexe I, modèle C 08.01, colonne 0010, du règlement d'exécution (UE) 2021/451	La PD est celle utilisée pour le calcul des RWA, hors effet des mesures éventuellement prises conformément à l'article 458 du règlement (UE) nº 575/2013. Pour les portefeuilles correspondant à un échelon particulier de débiteurs ou à une catégorie particulière de débiteurs, déclarer la PD qui est attribuée à cet échelon ou catégorie de débiteurs spécifique. Pour les portefeuilles correspondant à un ensemble de débiteurs de différents échelons ou catégories, indiquer la moyenne, pondérée en fonction de l'EAD, des PD attribuées aux expositions incluses dans cet ensemble. La PD doit être une valeur comprise entre 0 et 1.
0061	PD sans mesures de surveillance		La PD sans mesures de surveillance est la PD fondée sur les dispositions des articles 179 et 180 du règlement (UE) nº 575/2013, qui inclut la marge de prudence ajoutée par l'établissement, mais exclut les mesures (multiplicateurs, majorations, planchers ou mesures similaires qui augmentent directement la PD) qui ont été imposées par les autorités compétentes. Pour les portefeuilles correspondant à un échelon donné ou à une catégorie donnée, il convient d'indiquer la PD pour cet échelon, marge de prudence comprise, mais à l'exclusion des mesures de surveillance. Pour les portefeuilles correspondant à un ensemble de débiteurs de différents échelons ou catégories, indiquer la moyenne, pondérée en fonction de l'EAD, des PD des différentes expositions, marges de prudence comprises, mais à l'exclusion des mesures de surveillance. La PD sans mesures de surveillance doit être une valeur comprise entre 0 et 1. Lorsque l'institution n'est pas en mesure d'isoler les ajustements prudents pertinents, la partie I, point 3, s'applique.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0062	PD sans marge de prudence et sans mesures de surveillance		La PD sans marge de prudence et sans mesures de surveillance n'inclut ni la marge de prudence ajoutée par l'établissement conformément à l'article 179, paragraphe 1, point f), et à l'article 180, paragraphe 1, point e), du règlement (UE) nº 575/2013, ni l'effet des mesures imposées par les autorités compétentes (multiplicateurs, majorations, planchers ou mesures similaires qui augmentent directement la PD). Pour les portefeuilles correspondant à un échelon donné ou à une catégorie donnée, il convient d'indiquer la PD pour cet échelon, sans la marge de prudence et sans les mesures de surveillance. Pour les portefeuilles correspondant à un ensemble de débiteurs de différents échelons ou catégories, indiquer la moyenne, pondérée en fonction de l'EAD, des PD des différentes expositions, sans la marge de prudence et sans les mesures de surveillance. La PD sans marge de prudence et sans mesures de surveillance doit être une valeur comprise entre 0 et 1. Lorsque l'institution n'est pas en mesure d'isoler les ajustements prudents pertinents, la partie I, point 3, s'applique.
0080	Exposition initiale avant application des facteurs de conversion	Annexe I, modèle C 08.01, colonne 0020, du règlement d'exécution (UE) 2021/451	Indiquer la valeur d'exposition initiale compte non tenu des corrections de valeur, des provisions, des effets dus aux techniques d'atténuation du risque de crédit ou des facteurs de conversion de crédit.
0090	Exposition après effets de substitution ARC et avant application des facteurs de conversion	Annexe I, modèle C 08.01, colonne 0090, du règlement d'exécution (UE) 2021/451	Indiquer le montant auquel des facteurs de conversion ("CCF") sont appliqués pour obtenir l'exposition en cas de défaut (colonne 0110). Il convient pour cela de tenir compte des techniques d'atténuation du risque de crédit avec effets de substitution sur l'exposition.
0100	Facteur de conversion (CCF)	Article 166, paragraphe 8, du règlement (UE) nº 575/2013	Indiquer la moyenne pondérée des CCF. Les pondérations à utiliser sont les montants auxquels les CCF sont appliqués pour obtenir l'EAD. Pour les portefeuilles qui contiennent des facilités correspondant exclusivement aux éléments visés à l'article 166, paragraphe 8, du règlement (UE) nº 575/2013, la moyenne pondérée des CCF déclarée sera basée sur l'ensemble des facilités. Pour les portefeuilles qui ne contiennent aucune facilité faisant partie des éléments visés à l'article 166 du règlement (UE) nº 575/2013, il convient soit de laisser vierge le champ CCF, soit d'y inscrire la mention "NULL" ("NÉANT"). Pour les contreparties qui contiennent des facilités correspondant aux éléments visés à l'article 166, paragraphe 8, du règlement (UE) nº 575/2013 et des facilités ne faisant pas partie des éléments visés à l'article 166, paragraphe 8, dudit règlement, la moyenne pondérée des CCF déclarée sera basée uniquement sur les facilités correspondant aux éléments visés à l'article 166,

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
			paragraphe 8, du règlement (UE) nº 575/2013. En particulier, les facilités correspondant aux éléments visés à l'article 166, paragraphe 10, dudit règlement ne seront pas prises en compte dans le calcul. Si l'établissement applique ses propres estimations des CCF pour les éléments visés à l'article 166, paragraphe 8, du règlement (UE) nº 575/2013, ce sont ces CCF qu'il convient d'utiliser pour calculer la moyenne pondérée des CCF. Si l'établissement n'applique pas ses propres estimations des CCF pour les éléments visés à l'article 166, paragraphe 8, du règlement (UE) nº 575/2013, il convient d'utiliser les CCF réglementaires prévus à l'article 166, paragraphe 8, du règlement (UE) nº 575/2013. Les CCF doivent être des valeurs comprises entre 0 et 1.
0110	Exposition en cas de défaut (EAD)	Annexe I, modèle C 08.01, colonne 0110, du règlement d'exécution (UE) 2021/451	Indiquer la valeur d'exposition.
0120	Valeur de la sûreté	Annexe I, modèle C 08.01, colonnes 0150 à 0210, du règlement d'exécution (UE) 2021/451	Indiquer la valeur de marché de la sûreté.
0130	Pertes en cas de défaut (LGD)	Annexe I, modèle C 08.01, colonnes 0230 et 0240, du règlement d'exécution (UE) 2021/451	Indiquer la moyenne pondérée en fonction de l'EAD des valeurs des LGD des expositions dans le portefeuille concerné. Les LGD seront celles utilisées pour le calcul des RWA. Plus précisément, si l'établissement a obtenu de son autorité compétente l'autorisation d'utiliser ses propres estimations de LGD, les LGD seront basées sur les propres estimations de l'établissement. Dans le cas contraire, les LGD seront basées sur les valeurs réglementaires de LGD en tenant compte de l'atténuation des risques applicable. Les expositions et les LGD respectives pour les entités réglementées de grande taille du secteur financier et les entités financières non réglementées seront incluses. Les effets des mesures instaurées conformément à l'article 458 du règlement (UE) nº 575/2013 doivent être exclus. Les LGD doivent être des valeurs comprises entre 0 et 1.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0131	LGD sans mesures de surveillance		La LGD sans mesures de surveillance est la LGD fondée sur les dispositions des articles 179 et 181 du règlement (UE) nº 575/2013, qui inclut la marge de prudence ajoutée par l'établissement, mais exclut les mesures (multiplicateurs, majorations, planchers ou mesures similaires qui augmentent directement la LGD) qui ont été imposées par les autorités compétentes. Pour les portefeuilles correspondant à un échelon donné ou à une catégorie donnée, il convient d'indiquer les LGD pour cet échelon, marge de prudence comprise, mais à l'exclusion des mesures de surveillance. Pour les portefeuilles correspondant à un ensemble de débiteurs de différents échelons ou catégories, indiquer la moyenne, pondérée en fonction de l'EAD, des LGD des différentes expositions, marge de prudence comprise, mais à l'exclusion des mesures de surveillance. Les LGD sans mesures de surveillance doivent être des valeurs comprises entre 0 et 1. Lorsque l'institution n'est pas en mesure d'isoler les ajustements prudents pertinents, la partie I, point 3, s'applique.
0132	LGD sans marge de prudence et sans mesures de surveillance		La LGD sans marge de prudence et sans mesures de surveillance n'inclut ni la marge de prudence ajoutée par l'établissement conformément à l'article 179, paragraphe 1, point f), et à l'article 181 du règlement (UE) nº 575/2013, ni l'effet des mesures imposées par les autorités compétentes (multiplicateurs, majorations, planchers ou mesures similaires qui augmentent directement les LGD). Pour les portefeuilles correspondant à un échelon donné ou à une catégorie donnée, il convient d'indiquer la LGD pour cet échelon, sans la marge de prudence et sans les mesures de surveillance. Pour les portefeuilles correspondant à un ensemble de débiteurs de différents échelons ou catégories, indiquer la moyenne, pondérée en fonction de l'EAD, des LGD des différentes expositions, sans la marge de prudence et sans les mesures de surveillance. Les LGD sans marge de prudence et sans mesures de surveillance doivent être des valeurs comprises entre 0 et 1. Lorsque l'institution n'est pas en mesure d'isoler les ajustements prudents pertinents, la partie I, point 3, s'applique.
0133	LGD sans marge de prudence, sans mesures de surveillance et sans composante pour ralentissement,		La LGD sans marge de prudence, sans mesures de surveillance et sans composante pour ralentissement n'inclut ni la marge de prudence ajoutée par l'établissement conformément à l'article 179, paragraphe 1, point f), et à l'article 181 du règlement (UE) nº 575/2013, ni l'effet des mesures imposées par les autorités compétentes (multiplicateurs, majorations, planchers ou mesures similaires qui augmentent directement les LGD), ni la composante de ralentissement requise par l'article 181, paragraphe 1, point b), dudit règlement. Pour les portefeuilles correspondant à un échelon donné ou à une catégorie donnée, il convient d'indiquer les LGD pour cet échelon, sans la marge de prudence, sans les mesures de surveillance et sans la composante pour ralentissement. Pour les portefeuilles correspondant à un ensemble de débiteurs de différents échelons ou catégories, indiquer la moyenne, pondérée en fonction de l'EAD, des LGD des différentes expositions, sans les marges de prudence, sans les mesures de surveillance et sans la composante pour ralentissement.

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

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
			Les LGD sans marge de prudence, sans mesures de surveillance et sans composante pour ralentissement doivent être des valeurs comprises entre 0 et 1. Lorsque l'institution n'est pas en mesure d'isoler les ajustements prudents pertinents, la partie I, point 3, s'applique.
0140	Échéance	Annexe I, modèle C 08.01, colonne 0250, du règlement d'exécution (UE) 2021/451	Indiquer l'échéance pondérée en fonction de l'EAD. Elle doit être exprimée en nombre de jours. Cette information ne sera pas déclarée pour les expositions pour lesquelles l'échéance ne constitue pas un élément du calcul des RWA. En particulier, l'échéance ne sera pas déclarée pour les portefeuilles qui représentent des expositions de la catégorie d'expositions "Clientèle de détail".
0150	Montant des pertes anticipées	Annexe I, modèle C 08.01, colonne 0280, du règlement d'exécution (UE) 2021/451	Indiquer le montant des pertes anticipées.
0160	Provisions expositions en défaut	Annexe I, modèle C 09.02, colonnes 0050, 0055 et 0060, du règlement d'exécution (UE) 2021/451	Indiquer les provisions pour expositions en défaut. Celles-ci doivent inclure tous les ajustements pour risque de crédit général et spécifique relatifs aux expositions en défaut, au sens de l'article 110 du règlement (UE) nº 575/2013. Les ajustements pour risque de crédit (ponctuels) qu'un établissement applique en lien avec des changements dans la mise en œuvre de la définition du défaut seront déclarés tels qu'enregistrés dans la base de données de l'établissement.
0170	Montants d'exposition pondérés (RWA)	Annexe I, modèle C 08.01, colonne 0260, du règlement d'exécution (UE) 2021/451	Indiquer les RWA après facteurs supplétifs (facteurs supplétifs pour les PME et les infrastructures). Les RWA n'incluent pas l'effet des éventuelles mesures prises en vertu de l'article 458 du règlement (UE) nº 575/2013.
0180	RWA standard	Troisième partie, titre II, chapitre 2, du règlement (UE) nº 575/2013	Le RWA standard est le montant de RWA hypothétique obtenu en appliquant aux expositions l'approche standard pour le risque de crédit au lieu de l'approche NI.

C 103 — Détails relatifs aux expositions des portefeuilles à défaut élevé

Pour les portefeuilles visés dans l'annexe I avec un statut de couverture par des sûretés autre que "Sans objet", les informations suivantes sont facultatives lorsque le modèle approuvé ne permet pas de calculs distincts de LGD pour la partie garantie et pour la partie non garantie d'une exposition: LGD (colonne 0130), LGD sans mesures de surveillance (colonne 0131), LGD sans marge de prudence et sans mesures de surveillance (colonne 0132), LGD sans marge de prudence, sans mesures de surveillance et sans composante pour ralentissement (colonne 0133), Montant des pertes anticipées (colonne 0150), RWA (colonne 0170), Taux de perte année précédente (colonne 0210) et Taux de perte 5 dernières années (colonne 0220).

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0010	Identifiant du portefeuille		Indiquer l'identifiant de portefeuille de la colonne 0010 du modèle C.103 de l'annexe I définissant le portefeuille. Cet identifiant est un identifiant de ligne qui est propre à chaque ligne du modèle. L'affectation des expositions aux identifiants de portefeuille n'est pas exclusive: les expositions ou parties d'expositions sont déclarées sous chaque identifiant de portefeuille qui est applicable.
0040	Nombre de débiteurs		Les instructions relatives au tableau C 102, colonne 0040, de l'annexe I s'appliquent.
0060	PD (probabilité de défaut)		Les instructions relatives au tableau C 102, colonne 0060, de l'annexe I s'appliquent.
0061	PD sans mesures de surveillance		Les instructions relatives au tableau C 102, colonne 0061, de l'annexe I s'appliquent.
0062	PD sans marge de prudence et sans mesures de surveillance		Les instructions relatives au tableau C 102, colonne 0062, de l'annexe I s'appliquent.
0080	Exposition initiale avant application des facteurs de conversion		Les instructions relatives au tableau C 102, colonne 0080, de l'annexe I s'appliquent.
0090	Exposition après effets de substitution ARC et avant application des facteurs de conversion		Les instructions relatives au tableau C 102, colonne 0090, de l'annexe I s'appliquent.
0100	Facteur de conversion (CCF)		Les instructions relatives au tableau C 102, colonne 0100, de l'annexe I s'appliquent.
0110	Exposition en cas de défaut (EAD)		Les instructions relatives au tableau C 102, colonne 0110, de l'annexe I s'appliquent.
0120	Valeur de la sûreté		Les instructions relatives au tableau C 102, colonne 0120, de l'annexe I s'appliquent.
0130	Pertes en cas de défaut (LGD)		Les instructions relatives au tableau C 102, colonne 0130, de l'annexe I s'appliquent.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0131	LGD sans mesures de surveillance		Les instructions relatives au tableau C 102, colonne 0131, de l'annexe I s'appliquent.
0132	LGD sans marge de prudence et sans mesures de surveillance		Les instructions relatives au tableau C 102, colonne 0132, de l'annexe I s'appliquent.
0133	LGD sans marge de prudence, sans mesures de surveillance et sans composante pour ralentissement		Les instructions relatives au tableau C 102, colonne 0133, de l'annexe I s'appliquent.
0140	Échéance		Les instructions relatives au tableau C 102, colonne 0140, de l'annexe I s'appliquent.
0150	Montant des pertes anticipées		Les instructions relatives au tableau C 102, colonne 0150, de l'annexe I s'appliquent.
0160	Provisions expositions en défaut		Les instructions relatives au tableau C 102, colonne 0160, de l'annexe I s'appliquent.
0170	Montants d'exposition pondérés (RWA)		Les instructions relatives au tableau C 102, colonne 0170, de l'annexe I s'appliquent.
0180	RWA standard		Les instructions relatives au tableau C 102, colonne 0180, de l'annexe I s'appliquent.
0190	Taux de défaut année précédente		Indiquer le taux de défaut de l'année la plus récente. À cet effet, le taux de défaut est égal au ratio entre les valeurs suivantes: a) la somme des expositions (exposition initiale, colonne 0080, mesurée à la date de référence moins un an) qui n'étaient pas en défaut un an exactement avant la date de référence et pour lesquelles un défaut est survenu entre la date de référence moins un an et la date de référence; b) la somme des expositions (exposition initiale, colonne 0080, mesurée à la date de référence moins un an) qui n'étaient pas en défaut à la date de référence moins un an. Les nouvelles expositions qui ont été générées au cours de l'année précédant la date de référence ne doivent pas être prises en compte. Les expositions pour lesquelles un défaut puis un rétablissement sont survenus au cours de l'année précédant la date de référence doivent être incluses aussi bien dans le numérateur que dans le dénominateur. Les défauts multiples d'un même débiteur ne doivent être inclus qu'une seule fois.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
			Cette information doit être déclarée pour les identifiants de portefeuille correspondant uniquement à des expositions non en défaut; elle doit être une valeur comprise entre 0 et 1. Les défauts et les dates de défaut à utiliser sont ceux enregistrés dans le cadre de la mise en œuvre de la définition du défaut applicable au moment de l'évènement, c'est-à-dire qu'un établissement considérera qu'un défaut est survenu d'après la définition du défaut qu'il appliquait au moment où l'évènement a été enregistré. Les changements apportés à la définition du défaut ne seront pris en considération que de manière prospective à compter de la date de leur mise en œuvre, tandis qu'il ne sera pas procédé à l'application rétrospective des changements de la définition du défaut après l'évènement de défaut considéré (simulation rétrograde).
0200	Taux de défaut 5 dernières années		Indiquer la moyenne pondérée des taux de défaut observés au cours des cinq dernières années précédant la date de référence. Appliquer la définition du taux de défaut de la colonne 0190. Les pondérations à utiliser sont les expositions non en défaut utilisées dans le calcul du taux de défaut conformément à la colonne 0190. Lorsque l'établissement n'est pas tenu de calculer un taux de défaut pour les cinq dernières années précédant la date de référence en vertu de l'article 180, paragraphe 1, point h), ou de l'article 180, paragraphe 2, point e), du règlement (UE) nº 575/2013, il doit réaliser une approximation sur la base de son historique le plus long jusqu'à cinq ans précédant la date de référence, et fournir la documentation détaillée relative au calcul à l'autorité compétente. Cette information doit être déclarée pour les identifiants de portefeuille correspondant uniquement à des expositions "non en défaut"; elle doit être une valeur comprise entre 0 et 1. Les défauts et les dates de défaut à utiliser sont ceux enregistrés dans le cadre de la mise en œuvre de la définition du défaut applicable au moment de l'évènement, c'est-à-dire qu'un établissement considérera qu'un défaut est survenu d'après la définition du défaut qu'il appliquait au moment où l'évènement a été enregistré. Les changements apportés à la définition du défaut ne seront pris en considération que de manière prospective à compter de la date de leur mise en œuvre, tandis qu'il ne sera pas procédé à l'application rétrospective des changements de la définition du défaut après l'évènement de défaut considéré (simulation rétrograde).
0210	Taux de perte année précédente		Le taux de perte observé au cours de l'année la plus récente est déclaré pour les identifiants de portefeuille correspondant uniquement à des expositions "non en défaut" et à des expositions "en défaut". Pour les portefeuilles non en défaut, le taux de perte est égal à la somme des ajustements pour risque de crédit et des sorties de bilan appliqués, au cours de l'année précédant la date de référence, aux expositions qui n'étaient pas en défaut un an exactement avant la date de référence et pour lesquelles un défaut est survenu au cours de l'année précédant la date de référence, divisée par la somme des EAD, mesurées un an exactement avant la date de référence, des expositions qui n'étaient pas en défaut un an exactement avant la date de référence et pour lesquelles un défaut est survenu au cours de l'année précédant la date de référence.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
			Le numérateur du taux de perte intègre tous les ajustements pour risque de crédit et les sorties de bilan relatifs aux expositions pour lesquelles un défaut est survenu au cours de l'année précédant la date de référence, y compris les ajustements pour risque de crédit appliqués avant la date du défaut. Les nouvelles expositions générées au cours de l'année précédant la date de référence ne doivent pas être prises en compte. Les expositions pour lesquelles un défaut puis un rétablissement sont survenus au cours de l'année précédant la date de référence doivent être incluses dans le dénominateur du taux de perte et les ajustements pour risque de crédit et sorties de bilan relatifs à ces expositions doivent être pris en considération dans le numérateur du taux de perte. Les défauts multiples d'un seul et même débiteur ne doivent être pris en considération qu'une seule fois. Pour les portefeuilles en défaut, le taux de perte prend en considération les expositions qui étaient en défaut un an exactement avant la date de référence. Il est égal à la somme: a) des ajustements pour risque de crédit apportés à ces expositions un an avant la date de référence, et b) des ajustements pour risque de crédit et des sorties de bilan appliqués au cours de l'année précédant la date de référence, divisée par la somme des EAD, mesurées un an exactement avant la date de référence des expositions en question. Les nouveaux défauts au cours de l'année précédant la date de référence ne doivent pas être pris en compte. Les expositions pour lesquelles un rétablissement est survenu au cours de l'année précédant la date de référence doivent être incluses dans le dénominateur du taux de perte, et les ajustements pour risque de crédit et sorties de bilan relatifs à ces expositions doivent être inclus dans le numérateur du taux de perte. Les défauts multiples d'un même débiteur ne doivent être inclus qu'une seule fois. Le taux de perte doit être exprimé sous la forme d'une valeur comprise entre 0 et 1. Les défauts et les dates de défaut à utiliser sont ceux enregistrés dans le cadre de la mise en œuvre de la définition du défaut applicable au moment de l'évènement, c'est-à-dire qu'un établissement considérera qu'un défaut est survenu d'après la définition du défaut qu'il appliquait au moment où l'évènement a été enregistré. Les changements apportés à la définition du défaut ne seront pris en considération que de manière prospective à compter de la date de leur mise en œuvre, tandis qu'il ne sera pas procédé à l'application rétrospective des changements de la définition du défaut après l'évènement de défaut considéré (simulation rétrograde).
0220	Taux de perte 5 dernières années		La moyenne, pondérée en fonction de l'EAD, des taux de perte observés au cours des cinq dernières années précédant la date de référence est déclarée pour les identifiants de portefeuille correspondant uniquement à des expositions "non en défaut" et à des expositions "en défaut". Appliquer la définition du taux de perte de la colonne 0210. Le taux de perte cinq dernières années se fonde sur les taux de perte annuels des cinq dernières années, ces taux de perte annuels étant définis par analogie avec la définition du taux de perte de la colonne 0210; en particulier, les taux de pertes annuels n'incluent pas les changements supplémentaires des ajustements pour risque de crédit et des sorties de bilan qui sont survenus après l'horizon d'observation (année civile) de chaque taux de perte annuel. Lorsque l'établissement n'est pas tenu d'utiliser des données pour les cinq dernières années précédant la date de référence en vertu de l'article 181, paragraphe 2, dernier alinéa, du règlement (UE) n° 575/2013, il doit réaliser une approximation sur la base de son historique le plus long jusqu'à cinq ans précédant la date de référence, et fournir la documentation détaillée relative au calcul à l'autorité compétente. Le taux de perte doit être exprimé sous la forme d'une valeur comprise entre 0 et 1. Les défauts et les dates de défaut à utiliser sont ceux enregistrés dans le cadre de la mise en œuvre de la définition du défaut applicable au moment de l'évènement, c'est-à-dire qu'un établissement considérera qu'un défaut est survenu d'après la définition du défaut qu'il appliquait au moment où l'évènement a été enregistré. Les changements apportés à la définition du défaut ne seront pris en considération que de manière prospective à compter de la date de leur mise en œuvre, tandis qu'il ne sera pas procédé à l'application rétrospective des changements de la définition du défaut après l'évènement de défaut considéré (simulation rétrograde).

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0250	RWA-		Les établissements calculent et déclarent RWA- pour les portefeuilles visés à l'annexe I, modèle 103, ayant les identifiants de portefeuille suivants: CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RWA- est le RWA hypothétique, après application des facteurs supplétifs, qui résulte de l'application, pour chaque exposition, des valeurs de PD-, au lieu des valeurs de PD de l'établissement. Les autres paramètres nécessaires au calcul ne doivent pas être modifiés. La PD- est basée sur un calcul effectué séparément pour chaque échelon de débiteurs. Il convient d'utiliser les échelons de débiteurs déclarés dans la colonne 0005 du modèle C 08.02 de l'annexe I du règlement d'exécution (UE) 2021/451 de la Commission (pour les instructions, voir le modèle C 08.01, colonne 0010, et le modèle C 08.02 de l'annexe II dudit règlement). Pour chaque échelon de débiteurs, p^- est la plus petite valeur positive vérifiant l'équation $$p^- + \Phi^{-1}(q) \cdot \sqrt{\frac{p^- \cdot (1-p^-)}{n}} \geq DR_{1y}$$ where $DR_{1y} > 0$, et $p^- := 0$ si $DR_{1y} = 0$, avec: Φ^{-1} = la réciproque de la fonction de répartition (cumulative) normale centrée réduite; q = le niveau de confiance fixé à 90 %; DR_{1y} = le taux de défaut pondéré selon le cas de l'année précédant la date de référence, c'est-à-dire le nombre de débiteurs qui n'étaient pas en défaut un an exactement avant la date de référence et auxquels l'échelon de débiteurs en question était alors attribué et qui ont fait défaut au cours de l'année la plus récente, divisé par le nombre de débiteurs qui n'étaient pas en défaut un an exactement avant la date de référence et auxquels l'échelon de débiteurs en question était alors attribué; n = le nombre de débiteurs qui n'étaient pas en défaut un an exactement avant la date de référence et auxquels l'échelon de débiteurs en question était alors attribué. Pour chaque débiteur, PD- est égal à p^-, p^- étant calculé selon la formule indiquée au quatrième alinéa pour l'échelon de débiteurs attribué au débiteur.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0260	RWA+		Les établissements calculent et déclarent RWA+ pour les portefeuilles visés à l'annexe I, modèle 103, ayant les identifiants de portefeuille suivants: CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RWA+ est le RWA hypothétique, après application des facteurs supplétifs, qui résulte de l'application, pour chaque exposition, des valeurs de PD+, au lieu des valeurs de PD de l'établissement. Les autres paramètres nécessaires au calcul ne doivent pas être modifiés. La PD+ est basée sur un calcul effectué séparément pour chaque échelon de débiteurs. Il convient d'utiliser les échelons de débiteurs déclarés dans la colonne 0005 du modèle C 08.02 de l'annexe I du règlement d'exécution (UE) 2021/451 de la Commission (pour les instructions, voir le modèle C 08.01, colonne 0010, et le modèle C 08.02 de l'annexe II dudit règlement). Pour chaque échelon de débiteurs, p^+ est la plus grande valeur positive vérifiant l'équation $$p^+ - \Phi^{-1}(q) \cdot \sqrt{\frac{p^+ \cdot (1 - p^+)}{n}} \leq DR_{1y}$$ avec: Φ^{-1} = la réciproque de la fonction de répartition (cumulative) normale centrée réduite; q = le niveau de confiance fixé à 90 %; DR_{1y} = le taux de défaut pondéré selon le cas de l'année précédant la date de référence, c'est-à-dire le nombre de débiteurs qui n'étaient pas en défaut un an exactement avant la date de référence et auxquels l'échelon de débiteurs en question était alors attribué et qui ont fait défaut au cours de l'année la plus récente, divisé par le nombre de débiteurs qui n'étaient pas en défaut un an exactement avant la date de référence et auxquels l'échelon de débiteurs en question était alors attribué; n = le nombre de débiteurs qui n'étaient pas en défaut un an exactement avant la date de référence et auxquels l'échelon de débiteurs en question était alors attribué. Pour chaque débiteur, PD+ est égal à p^+, p^+ étant calculé selon la formule indiquée au quatrième alinéa pour l'échelon de débiteurs attribué au débiteur.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0270	RWA–		Les établissements calculent et déclarent RWA– pour les portefeuilles visés à l'annexe I, modèle 103, ayant les identifiants de portefeuille suivants: CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RWA– est le RWA hypothétique, après application des facteurs supplétifs, qui résulte de l'application, pour chaque exposition, des valeurs de PD--, au lieu des valeurs de PD de l'établissement. Les autres paramètres nécessaires au calcul ne doivent pas être modifiés. La PD-- est basée sur un calcul effectué séparément pour chaque échelon de débiteurs. Il convient d'utiliser les échelons de débiteurs déclarés dans la colonne 0005 du modèle C 08.02 de l'annexe I du règlement d'exécution (UE) 2021/451 de la Commission (pour les instructions, voir le modèle C 08.01, colonne 0010, et le modèle C 08.02 de l'annexe II dudit règlement). Pour chaque échelon de débiteurs, p^{--} est la plus petite valeur positive vérifiant l'équation $$p^{--} + \Phi^{-1}(q) \cdot \sqrt{\frac{p^{--} \cdot (1 - p^{--})}{n}} \geq DR_{5y}$$ where $DR_{5y} > 0$, et $p^{--} := 0$ si $DR_{5y} = 0$ avec: Φ^{-1} = la réciproque de la fonction de répartition (cumulative) normale centrée réduite; q = le niveau de confiance fixé à 90 %; DR_{5y} = le taux de défaut des 5 dernières années pour l'échelon de débiteurs, calculé comme étant la moyenne simple de cinq taux de défaut annuels pondérés selon le cas; n = le nombre de débiteurs qui n'étaient pas en défaut un an exactement avant la date de référence et auxquels l'échelon de débiteurs en question était alors attribué. Pour chaque débiteur, PD-- est égal à p^{--}, p^{--} étant calculé selon la formule indiquée au quatrième alinéa pour l'échelon de débiteurs attribué au débiteur.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0280	RWA++		Les établissements calculent et déclarent RWA++ pour les portefeuilles visés à l'annexe I, modèle 103, ayant les identifiants de portefeuille suivants: CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RWA++ est le RWA hypothétique, après application des facteurs supplétifs, qui résulte de l'application, pour chaque exposition, des valeurs de PD++, au lieu des valeurs de PD de l'établissement. Les autres paramètres nécessaires au calcul ne doivent pas être modifiés. La PD++ est basée sur un calcul effectué séparément pour chaque échelon de débiteurs. Il convient d'utiliser les échelons de débiteurs déclarés dans la colonne 0005 du modèle C 08.02 de l'annexe I du règlement d'exécution (UE) 2021/451 de la Commission (pour les instructions, voir le modèle C 08.01, colonne 0010, et le modèle C 08.02 de l'annexe II dudit règlement). Pour chaque échelon de débiteurs, p^{++} est la plus grande valeur positive vérifiant l'équation $$p^{++} - \Phi^{-1}(q) \cdot \sqrt{\frac{p^{++} \cdot (1 - p^{++})}{n}} \leq DR_{5y}$$ avec: Φ^{-1} = la réciproque de la fonction de répartition (cumulative) normale centrée réduite; q = le niveau de confiance fixé à 90 %; DR_{5y} = le taux de défaut des 5 dernières années pour l'échelon de débiteurs, calculé comme étant la moyenne simple de cinq taux de défaut annuels pondérés selon le cas; n = le nombre de débiteurs qui n'étaient pas en défaut un an exactement avant la date de référence et auxquels l'échelon de débiteurs en question était alors attribué. Pour chaque débiteur, PD++ est égal à p^{++}, p^{++} étant calculé selon la formule indiquée au quatrième alinéa pour l'échelon de débiteurs attribué au débiteur.

C 105.01 —Définition des modèles internes

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0010	Identifiant du modèle interne		L'établissement déclare l'identifiant du modèle interne attribué par l'autorité compétente. Si celui-ci n'est pas disponible, l'établissement déclare l'identifiant du modèle interne qu'il s'est attribué lui-même. L'identifiant du modèle interne correspond de manière unique à un modèle interne approuvé par l'autorité compétente et utilisé pour le calcul des RWA. C'est un identifiant de ligne qui est propre à chaque ligne du modèle.
0020	Nom du modèle		Indiquer le nom donné au modèle interne par l'établissement déclarant.
0030	Paramètre de risque selon l'approche NI		Le paramètre de risque selon l'approche NI est l'un des suivants: a) PD; b) LGD; c) CCF. Pour un modèle interne pour les expositions Entreprises — Financement spécialisé visées à l'article 153, paragraphe 5, du règlement (UE) nº 575/2013 ("Critères de référencement du financement spécialisé"), il convient soit de laisser ce champ vierge, soit d'y inscrire la mention "NULL" ("NÉANT").
0040	Exposition en cas de défaut (EAD)	Annexe I, modèle C 08.01, colonne 0110, du règlement d'exécution (UE) 2021/451	Indiquer la valeur d'exposition totale des expositions dans le champ d'application du modèle de notation.
0050	Taux de défaut moyen, pondéré en fonction de l'EAD, utilisé pour le calibrage		Indiquer la moyenne, pondérée en fonction de l'EAD, des taux de défaut annuels utilisée pour le calibrage des modèles PD. Cette information n'est à fournir que pour les modèles PD. Il convient d'utiliser les données employées pour le calibrage des paramètres du modèle. S'il n'existe pas de données internes et que le calibrage se base sur des données externes, ce sont alors ces données externes qu'il convient de déclarer.
0060	Taux de défaut moyen, pondéré selon le cas, utilisé pour le calibrage		Indiquer la moyenne simple des taux de défaut annuels pondérés selon le cas ayant servi au calibrage des modèles PD. Cette information n'est à fournir que pour les modèles PD. Il convient d'utiliser les données employées pour le calibrage des paramètres du modèle. S'il n'existe pas de données internes et que le calibrage se base sur des données externes, ce sont alors ces données externes qu'il convient de déclarer.
0070	Probabilité de défaut (PD) à long terme		Indiquer la tendance centrale utilisée par l'établissement pour le calibrage des modèles qui inclut toute correction prudente de la moyenne simple pondérée selon le cas des taux de défaut annuels utilisée pour le calibrage des modèles PD. Cette information n'est à fournir que pour les modèles PD.
0080	Taux de rétablissement des actifs en défaut		Le taux de rétablissement des actifs en défaut correspond au pourcentage de l'encours en défaut qui repasse au statut "non en défaut" sur une période de 12 mois. Un établissement qui ne calcule pas de taux de rétablissement pour un modèle donné doit calculer une approximation des taux de rétablissement, conformément à la définition donnée. L'établissement déclare l'utilisation d'une approximation à l'autorité compétente. Cette information n'est à fournir que pour les modèles LGD.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0090	Taux de recouvrement pour les défauts non rétablis		Indiquer le taux de recouvrement moyen, pondéré selon le cas, des défauts non rétablis compris dans les séries chronologiques utilisées par l'établissement pour le calibrage des modèles LGD sur les actifs non en défaut. Il convient d'utiliser les données employées pour le calibrage des paramètres du modèle. S'il n'existe pas de données internes et que le calibrage se base sur des données externes, ce sont alors ces données externes qu'il convient de déclarer. Un établissement qui, en raison d'une procédure de recouvrement non achevée, ne dispose pas d'un taux de recouvrement spécifique pour les défauts non rétablis en calcule une approximation en prenant en compte les recouvrements constatés ainsi que les estimations des recouvrements pour les procédures non achevées. L'établissement déclare l'utilisation d'une approximation à l'autorité compétente. Cette information n'est à fournir que pour les modèles LGD.
0100	Durée du délai de recouvrement pour les défauts non rétablis		Indiquer la durée moyenne, pondérée selon le cas, du délai de recouvrement (du début du statut en défaut jusqu'à la date de fin des procédures de recouvrement) des défauts non rétablis compris dans les séries chronologiques utilisées par l'établissement pour le calibrage des modèles LGD sur les actifs non en défaut. La durée moyenne pondérée selon le cas doit être exprimée en nombre de jours. Il convient d'utiliser les données employées pour le calibrage des paramètres du modèle. S'il n'existe pas de données internes et que le calibrage se base sur des données externes, ce sont alors ces données externes qu'il convient de déclarer. Un établissement qui, en raison d'une procédure de recouvrement inachevée, ne dispose pas d'une durée spécifique de délai de recouvrement pour les défauts non rétablis en calcule une approximation en tenant compte de la définition fournie. L'établissement déclare l'utilisation d'une approximation à l'autorité compétente. Cette information n'est à fournir que pour les modèles LGD.
0110	Décision commune	Article 20, paragraphe 2, point a), du règlement (UE) nº 575/2013	L'établissement indique s'il existe ou non une décision commune relative aux exigences prudentielles entre l'autorité compétente sur base consolidée et l'autorité compétente du pays d'accueil en ce qui concerne l'autorisation d'utiliser l'approche NI pour calculer les exigences prudentielles pour les expositions détenues par les filiales des établissements dans les portefeuilles de référence déclarés.
0120	Autorité de surveillance sur base consolidée	Article 20 du règlement (UE) nº 575/2013	Indiquer le code ISO du pays d'origine de l'autorité compétente responsable de la surveillance sur base consolidée de l'établissement utilisant une approche NI.
0130	Montants d'exposition pondérés (RWA)	Annexe I, modèle C 08.01, colonne 0260, du règlement d'exécution (UE) 2021/451	Indiquer le RWA total après facteurs supplétifs (facteurs supplétifs pour les PME et les infrastructures) des expositions dans le champ d'application du modèle de notation.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0140	Majorations RWA		Les majorations de RWA sont une sous-position (“dont”) des RWA (colonne 0130 du modèle C 105.01) et comprennent: a) le RWA qui est ajouté au RWA résultant de l’application du ou des paramètres de risque du modèle du fait des mesures internes supplémentaires de prudence directement appliquées au RWA, le cas échéant; b) le RWA qui est ajouté au RWA résultant de l’application du ou des paramètres de risque du modèle du fait des mesures de surveillance directement appliquées au RWA, le cas échéant. Les montants sous a) et b) n’incluent pas les mesures déjà prises en compte dans les PD (colonne 0060 des modèles C 102 et C 103), les CCF (colonne 0100 des modèles C 102 et C 103) ou les LGD (colonne 0130 des modèles C 102 et C 103), mais se limitent aux mesures qui sont directement appliquées au RWA et, le cas échéant, en sus des marges de prudence et des mesures de surveillance (multiplicateurs, majorations, planchers ou mesures similaires) qui augmentent les paramètres de risque. Les majorations de RWA n’incluent pas l’effet des éventuelles mesures prises en vertu de l’article 458 du règlement (UE) n° 575/2013. Lorsque l’institution n’est pas en mesure d’isoler les ajustements prudents pertinents, la partie I, point 3, s’applique.

C 105.02 — Mise en correspondance des modèles internes et des portefeuilles

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0010	Identifiant du portefeuille	Colonne 0010 des modèles C 102 et C 103	Indiquer l’identifiant du portefeuille identifiant de manière unique le portefeuille conformément aux modèles C 102 et C 103 de l’annexe I. Les colonnes 0010 et 0020 constituent un identifiant de ligne composite dont la combinaison est propre à chaque ligne de ce modèle.
0020	Identifiant du modèle interne	Modèle C 105.01, colonne 0010	Indiquer l’identifiant du modèle interne attribué par l’établissement déclarant. Les colonnes 0010 et 0020 constituent un identifiant de ligne composite dont la combinaison est propre à chaque ligne du modèle C 105.02.
0030	Exposition en cas de défaut (EAD)	Annexe I, modèle C 08.01, colonne 0110, du règlement d’exécution (UE) 2021/451	Indiquer la valeur d’exposition totale des expositions qui sont incluses dans le portefeuille défini par la colonne 0010 et dans le champ d’application du modèle de notation défini par la colonne 0020. Si toutes les expositions d’un portefeuille donné sont traitées avec un seul modèle spécifique, la valeur d’exposition doit être identique au montant déclaré pour le même portefeuille dans la colonne 0110 du modèle C 102 ou C 103, selon le cas.
0040	Montants d’exposition pondérés (RWA)	Annexe I, modèle C 08.01, colonne 0260, du règlement d’exécution (UE) 2021/451	Indiquer le RWA total après facteurs supplétifs pour les expositions qui sont incluses dans le portefeuille défini par la colonne 0010 et dans le champ d’application du modèle de notation défini par la colonne 0020. Si toutes les expositions d’un portefeuille donné sont traitées avec un seul modèle spécifique, le RWA doit être identique au montant déclaré pour le même portefeuille dans la colonne 0170 du modèle C 102 ou C 103, selon le cas.

C 105.03 — Mise en correspondance des modèles internes et des pays

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0005	Identifiant de ligne		Ce code est un identifiant de ligne qui est propre à chaque ligne du modèle. Il suit l'ordre numérique: 1, 2, 3, etc.
0010	Identifiant du modèle interne	Colonne 0010 du modèle C 105.01	Indiquer l'identifiant du modèle interne attribué par l'établissement déclarant. Lorsqu'un identifiant de modèle interne est associé à plusieurs pays, il convient de déclarer chaque combinaison d'"identifiant du modèle interne" et de "localisation de l'établissement" dans une ligne distincte. Les colonnes 0010 et 0020 constituent un identifiant de ligne composite dont la combinaison est propre à chaque ligne du tableau.
0020	Localisation de l'établissement	Article 20 du règlement (UE) nº 575/2013	Indiquer le code ISO du pays de résidence légale de chaque filiale où les expositions selon l'approche NI déclarées pour chaque portefeuille de référence sont comptabilisées, qu'il existe ou non une autorisation d'appliquer une approche NI délivrée par l'autorité de surveillance du pays d'accueil.»

ANNEXE II

«ANNEXE V

INSTRUMENTS ET PORTEFEUILLES DE RÉFÉRENCE POUR LE RISQUE DE MARCHÉ

Section 1: Instructions

Section 2: Instruments

Section 3: Portefeuilles individuels — Instrument unique

Section 4: Portefeuilles individuels — Instruments multiples

Section 5: Portefeuilles consolidés

Section 6: Spécifications supplémentaires pour les instruments

Section 7: Portefeuilles de validation SBM

Section 1: Instructions

a) Aux fins de la présente annexe, les définitions suivantes s'appliquent:

i) "date de comptabilisation": la date et l'heure auxquelles les établissements comptabilisent les opérations aux fins de l'exercice d'analyse comparative;

ii) "valorisation de marché initiale" ou "IMV" (*Initial Market Valuation*): la valeur de marché des instruments visés à la section 2 de la présente annexe à la date et à l'heure de référence de l'IMV;

iii) "date de référence de l'IMV": la date et l'heure utilisées comme référence par les établissements pour déterminer l'IMV des opérations du portefeuille de référence;

iv) "date de remise de l'IMV": la date à laquelle les établissements doivent communiquer les résultats de l'IMV des opérations du portefeuille de référence;

v) "VaR": la valeur en risque;

vi) "sVaR": la valeur en risque en situation de tensions;

vii) "IRC" (*Incremental Risk Charge*): l'exigence de fonds propres pour risques supplémentaires;

viii) "portefeuille de négociation en corrélation" ou "CTP" (*Correlation Trading Portfolio*): le portefeuille de négociation en corrélation;

ix) "risque de prix total" ou "APR" (*All Price Risk*): le risque de prix total calculé conformément à l'article 377, paragraphe 2, du règlement (UE) n° 575/2013;

x) "mesures du risque" ou "MR": la valeur de la VaR, de la sVaR et, le cas échéant, de l'IRC et de l'APR pour les portefeuilles, comme indiqué aux sections 3, 4 et 5 de la présente annexe, entre la date de référence initiale des MR et la date de référence finale des MR;

xi) "date de référence initiale des MR": la date à laquelle les établissements commencent à calculer les valeurs des MR;

xii) "date de référence finale des MR": la date à laquelle les établissements finissent de calculer les valeurs des MR;

xiii) "date de remise des MR": la date à laquelle les établissements doivent communiquer les résultats des MR des opérations du portefeuille de référence;

xiv) "valeur actuelle" ou "VA": la valeur de marché des portefeuilles visés à la section 3 de la présente annexe à la date de référence finale des MR;

xv) "ATM" (*At The Money*): à parité pour ce qui est de la position relative du prix actuel ou futur de l'actif sous-jacent d'un dérivé par rapport au prix d'exercice de ce dérivé;

xvi) "OTM" (*Out of The Money*): hors du cours pour ce qui est de la position relative du prix actuel ou futur de l'actif sous-jacent d'un dérivé par rapport au prix d'exercice de ce dérivé;

xvii) "ITM" (*In The Money*): dans le cours pour ce qui est de la position relative du prix actuel ou futur de l'actif sous-jacent d'un dérivé par rapport au prix d'exercice de ce dérivé;

xviii) "long" signifie "acheté" et "court" signifie "vendu";

xix) "CDS" (*Credit Default Swap*): contrats d'échange sur risque de crédit;

xx) en ce qui concerne les CDS, "long" signifie "protection achetée" et "court", "protection vendue";

xxi) "MLN": millions;

xxii) "OTC" (*Over-The-Counter*): de gré à gré;

xxiii) "ASA": l'approche standard alternative prévue à la troisième partie, titre IV, chapitre 1 *bis*, section 1, du règlement (UE) n° 575/2013;

xxiv) "SBM": la méthode des sensibilités prévue à la troisième partie, titre IV, chapitre 1 *bis*, section 2, du règlement (UE) n° 575/2013;

xxv) "DRC": l'exigence de fonds propres pour risque de défaut prévue à la troisième partie, titre IV, chapitre 1 *bis*, section 5, du règlement (UE) n° 575/2013;

xxvi) "RRAO": la majoration pour risque résiduel prévue à la troisième partie, titre IV, chapitre 1 *bis*, section 4, du règlement (UE) n° 575/2013.

b) Les dates suivantes s'appliquent pour l'exercice d'"analyse comparative":

i) la date de comptabilisation est le 30 janvier 2025;

ii) la date de référence de l'IMV (et de la SBM initiale) est le 6 février 2025 à 17h30 HEC;

iii) la date de remise de l'IMV (et de la SBM initiale, et de la validation SBM) est le 28 février 2025;

iv) la date de référence initiale des MR est le 2 juin 2025;

v) la date de référence finale des MR (et de l'ASA finale) est le 13 juin 2025;

vi) la date de remise des MR (et de l'ASA finale) est le 18 juillet 2025.

c) Sauf indication explicite contraire dans la section 2 de la présente annexe, toutes les positions sont comptabilisées à la date de comptabilisation indiquée au point b), i), de la présente section. Une fois les positions comptabilisées, chaque portefeuille mature pour la durée de l'exercice d'analyse comparative et est calculé en partant de l'hypothèse que l'établissement n'engage pas d'action de gestion du portefeuille pendant toute la durée de l'exercice d'analyse comparative. Sauf indication contraire explicite dans les spécifications d'un instrument donné, le prix d'exercice des positions d'option est déterminé par rapport au prix du sous-jacent tel qu'observé à la clôture du marché à la date de comptabilisation.

d) Aux fins de la valorisation de marché initiale, la valorisation de chaque instrument doit être communiquée à l'autorité compétente de l'établissement au plus tard à la date de remise de l'IMV. Au plus tard à cette date, l'établissement doit transmettre une note explicative accompagnant les résultats, conformément au point e). L'IMV doit être fournie conformément à la valorisation de la salle des marchés de l'établissement, si possible. Si les IMV ne sont pas fournies par la salle des marchés de l'établissement, ce dernier doit préciser dans la note explicative la source qui a fourni les données relatives aux IMV.

e) La note explicative dont les établissements doivent accompagner l'IMV comprend toutes les informations suivantes pour chaque instrument:

i) les facteurs de risque utilisés pour calculer l'IMV de l'instrument;

ii) le modèle d'évaluation du prix utilisé pour calculer l'IMV de l'instrument et une description de ce modèle de tarification;

iii) les facteurs de risque inclus dans le modèle de VaR pour l'instrument;

iv) les facteurs de risque inclus dans le modèle de VaR qui sont également des données d'entrée de valorisation pour l'IMV de l'instrument;

v) les spécificités du modèle de VaR relativement à l'instrument;

vi) les données de référence disponibles pour l'instrument dans le format propre à l'établissement;

vii) les aspects visés aux points h), i), k), m), n), o), v), w), y), gg) et kk) de cette section.

f) Aux fins du point e), v), tous les éléments suivants doivent être déclarés:

i) descriptions concises du modèle de VaR;

ii) méthodes de réévaluation appliquées;

iii) forme fonctionnelle appliquée pour la modélisation des rendements (absolus, relatifs, ou autre méthode);

iv) informations qualitatives sur les séries chronologiques utilisées pour calibrer le modèle de la VaR relativement à l'instrument (telles que la source, la méthode de normalisation, les tranches appliquées, d'autres informations jugées pertinentes par les établissements pour expliquer les résultats fournis).

g) La note explicative visée au point d) doit être mise à jour à chaque fois qu'une valeur est à nouveau communiquée, pour rendre compte des changements par rapport à la précédente communication. La note explicative doit contenir une section énumérant toutes les dates de communication et les motifs pour lesquels les valeurs ont été communiquées à nouveau.

h) Les risques des positions sont calculés compte non tenu des coûts de financement. S'il y a lieu, les établissements utilisent le taux au jour le jour de la monnaie de l'instrument comme taux d'actualisation. Un accord de sûreté doit être considéré comme en place pour les instruments dérivés visés à la section 2 de la présente annexe. Lorsque cela n'est pas possible, le motif doit en être fourni dans la note explicative visée au point d).

i) Le risque de crédit de contrepartie et le risque d'ajustement de l'évaluation de crédit ("CVA") ne sont pas pris en compte dans l'évaluation des risques des portefeuilles. Lorsque cela n'est pas possible, le motif doit en être fourni dans la note explicative visée au point d) de cette section. Les établissements déclarent les cas dans lesquels d'autres types d'ajustements de l'évaluation sont inclus dans l'IMV et, pour chaque instrument financier, en expliquent la méthode et l'impact dans la note explicative visée au point d) de cette section.

j) Pour les opérations comprenant des positions longues sur des CDS, les établissements supposent qu'une commission d'entrée immédiate est versée pour entrer dans la position, conformément aux normes et conventions du marché. La date d'échéance de tous les CDS doit correspondre aux dates de cessation trimestrielles conventionnelles.

k) Les spécifications supplémentaires nécessaires pour effectuer les calculs de prix requis pour les positions sur CDS doivent être conformes aux normes et conventions de marché communément admises et elles doivent être expliquées dans la note explicative visée au point d) de la présente section.

l) La date d'échéance doit garantir que la transaction est le plus proche possible de l'échéance résiduelle spécifiée conformément aux normes et conventions du marché.

m) En ce qui concerne les détails des instruments non visés à la section 2 de la présente annexe, les établissements fournissent les hypothèses qui ont été utilisées, y compris la convention sur le décompte des jours et le choix d'un instrument négociable et liquide, lorsque cela est autorisé, ainsi que les résultats dans la note explicative visée au point d) de la présente section.

n) S'ils estiment que des hypothèses supplémentaires, outre celles mentionnées dans la présente section, sont pertinentes pour l'interprétation des résultats de leur exercice, telles qu'entre autres l'heure de clôture des activités, les opérations de type coupon rolls et la correspondance avec des indices, les établissements fournissent une description de ces hypothèses dans la note explicative visée au point d) de la présente section.

o) La note explicative visée au point d) de la présente section doit contenir des explications concernant les risques qui ne sont pas pris en compte par le modèle applicable aux instruments visés à la section 2 de la présente annexe.

p) Sauf indication contraire explicite, toutes les options sont traitées comme si elles étaient négociées de gré à gré.

q) Les conventions de calendrier standard pour les options de gré à gré doivent être respectées. L'échéance résiduelle pour une option "n mois" est dans n mois. Si des options expirent un jour non ouvrable, les établissements doivent ajuster la date d'expiration pour qu'elle corresponde à un jour ouvrable, conformément aux normes et conventions du marché.

r) Toutes les options OTC sont considérées comme suit:

   i) comme américaines pour les actions individuelles et les matières premières;

   ii) comme européennes pour les indices d'actions, le change et les swaptions.

s) Toutes les options OTC sont considérées comme "nues", de sorte que la prime est exclue de la valorisation de marché initiale.

t) En ce qui concerne les portefeuilles de négociation en corrélation (CTP), les établissements qui sont autorisés à utiliser le modèle APR pour les CTP doivent fournir le détail de leurs hypothèses les plus pertinentes et des normes et conventions du marché en ce qui concerne les instruments du CTP visés à la section 2 de la présente annexe, y compris les ratios de couverture qu'ils ont calculés pour rendre les instruments du CTP neutres sur le plan du CS01 à la date de comptabilisation.

u) L'IMV pour chaque instrument est fournie dans la monnaie de l'instrument ABE indiquée à la section 2 de la présente annexe pour cet instrument.

v) Pour les portefeuilles composés d'un ou de plusieurs instruments libellés dans des monnaies d'instrument ABE qui sont différentes de la monnaie du portefeuille ABE, le résultat est converti dans la monnaie du portefeuille ABE déclarée en utilisant le taux de change au comptant de la BCE à la date pertinente. Le résultat converti doit être expliqué dans la note explicative visée au point d) de la présente section.

w) Lors de la comptabilisation des positions, les établissements respectent les conventions de marché pertinentes, sauf indication contraire dans les présentes instructions dans les descriptions des instruments (section 2 de la présente annexe).

x) Lorsqu'un instrument ou l'instrument sous-jacent d'un dérivé fait l'objet d'une opération sur titres ayant une incidence sur l'exercice d'analyse comparative, telle qu'un rachat par l'émetteur, un défaut ou une opération similaire, les établissements doivent exclure de l'exercice cet instrument ainsi que tout CDS ou toute option lié(e).

y) En ce qui concerne une série indicielle, "on-the-run" désigne la série la plus liquide et la plus négociable de cet indice qui soit disponible sur le marché. Les établissements expliquent leur choix de séries "on-the-run" ainsi que les résultats correspondants dans la note explicative visée au point d) de la présente section.

z) Sauf indication contraire, les établissements appliquent le règlement de l'Union sur les indices de référence pour le taux d'intérêt pour comptabiliser les instruments visés à la section 2 de la présente annexe. Les établissements précisent le taux appliqué, à l'exception de ceux spécifiés à la section 2 de la présente annexe, dans la note explicative visée au point d) des présentes instructions.

aa) Les mesures du risque pour les portefeuilles visés aux sections 3, 4 et 5, ainsi que la valeur actuelle, sont calculées depuis la "date de référence initiale des MR" jusqu'à la "date de référence finale des MR". Les mesures de risque FRTB ASA (SBM, DRC et RRAO) sont calculées pour la "date de référence finale des MR". Les établissements doivent communiquer les résultats de ces calculs à leur autorité compétente au plus tard à la date de remise des RM. L'IMV et la SBM doivent être déclarées pour chaque instrument. Les mesures du risque, la SBM, la DRC, la RRAO et la valeur actuelle, le cas échéant, doivent être déclarées pour chaque portefeuille, aussi bien individuel que consolidé. La SBM, la DRC et la RRAO, le cas échéant, sont déclarées au moins pour les portefeuilles pour lesquels des mesures de risque sont déclarées.

bb) Pour les portefeuilles visés à la section 7, les établissements déclarent les résultats SBM et les soumettent dans le respect des dates de déclaration de la soumission de l'IMV.

cc) Seuls les établissements qui ont reçu l'autorisation de modéliser le risque spécifique des instruments de dette doivent déclarer les portefeuilles d'écart de crédit. Pour les portefeuilles de taux d'intérêt qui incluent des risques dans le cadre de certains instruments, les portefeuilles individuels et consolidés doivent être modélisés par les établissements qui ont reçu l'autorisation de modéliser le risque général de taux d'intérêt, ainsi que par les établissements qui ont reçu l'autorisation de modéliser le risque général et le risque spécifique de taux d'intérêt.

dd) Les résultats tant pour les portefeuilles individuels que pour les portefeuilles agrégés ne sont transmis que si les résultats des instruments qui en font partie sont eux aussi transmis.

ee) À la section 2 de la présente annexe (Instruments), l'"Année T" désigne l'année "2025" et l'"Année T + X" désigne l'année 2025 + X, où X prend la valeur indiquée à la section 2.

ff) À la section 2 de la présente annexe (Instruments), les établissements déterminent le jour d'expiration/d'échéance conformément aux instructions suivantes:

  i) lorsque la date est spécifiée, il convient d'utiliser cette date spécifique;

  ii) lorsqu'aucune date n'est spécifiée, il convient d'utiliser les conventions de marché, le cas échéant. Si, par exemple, il existe une convention de marché selon laquelle le jour d'expiration/d'échéance est le 3e vendredi du mois, "Juin Année T" désignera alors le 3e vendredi du mois de juin de l'année T;

  iii) à la fin du mois, lorsqu'il est indiqué "Fin de", il s'agit du dernier jour civil du mois;

  iv) pour une période fixe qui suit la "date de comptabilisation", si la période est définie en nombre de jours, il s'agit du dernier jour de cette période. Si la période est définie en semaines, en mois ou en années, il s'agit du même jour de la semaine, du mois ou de l'année suivant(e) par rapport à la date de comptabilisation ou, si le dernier mois ou la dernière année de la période est plus court(e), il s'agit du dernier jour de ce mois ou de cette année; si la "date de comptabilisation + période x" tombe un jour férié, il convient alors de prendre le jour ouvrable suivant;

  v) sauf indication contraire, il convient d'utiliser les hypothèses suivantes: Convention de calcul des jours: Act/360, calendrier des jours de fermeture: TARGET2.

gg) Dans la section 2 de la présente annexe (Instruments), pour tous les CDS, sauf indication contraire explicite, les exigences suivantes s'appliquent:

  i) Fréquence de coupon: Trimestrielle;

  ii) Coupon (points de base): 100;

  iii) Décompte de jours: ACT/360;

  iv) Année des définitions ISDA: 2014;

v) Clause de restructuration: Modified-Modified Restructuring (MMR);

vi) Échéance: Décembre Année T+4;

vii) Type de créance: Tranche avec le rang le plus élevé;

viii) Durée: 5 ans;

ix) La date de prise d'effet équivaut à la date de comptabilisation;

x) La courbe d'actualisation et le taux de recouvrement utilisés doivent être indiqués dans la note explicative visée au point d) de la présente annexe.

hh) L'IMV des instruments obligataires inclut les intérêts courus.

ii) Les établissements doivent fournir les informations relatives au moment de la valorisation pour la VA en indiquant ce moment dans la note explicative visée au point d) de la présente section. Dans la mesure du possible, la valorisation de la VA est calculée à la clôture du jour ouvrable.

jj) Les mesures du risque des portefeuilles sont calculées dans la même monnaie que la monnaie du portefeuille sans inclure les risques de change également liés à la monnaie de déclaration des établissements. Le risque de change n'est pris en considération que s'il est intrinsèquement inclus dans les instruments. Lorsqu'aussi bien les résultats en monnaie de déclaration que les résultats en monnaie du portefeuille sont déclarés dans le cadre de l'exercice, pour les chiffres ASA, les résultats calculés dans la monnaie de déclaration de l'établissement sont convertis dans la monnaie du portefeuille ABE par conversion au taux comptant, en utilisant le taux de change au comptant de la BCE correspondant à la date du calcul. La conversion dans la monnaie du portefeuille ABE n'implique pas de modification des facteurs de risque de change.

kk) Lorsque l'article 325 *octodecies*, paragraphe 7, du règlement (UE) n° 575/2013 (approche de la "monnaie de base") s'applique, les établissements tiennent compte, lors de la réalisation de calculs SBM et de la déclaration de sensibilités SBM, des facteurs de risque de change résultant de l'application de l'approche de la monnaie de base. Les valeurs déclarées ne sont pas exprimées dans la monnaie de base choisie, mais plutôt dans la monnaie de déclaration de l'établissement en effectuant une conversion au comptant à l'aide du taux de change au comptant de la BCE correspondant à la date pertinente.

Section 2: Instruments

Les établissements fournissent, conformément aux instructions de la section 1 de la présente annexe, l'IMV des instruments financiers suivants, pour lesquels ils fournissent les mesures du risque et la valeur actuelle des portefeuilles précisés à la section 3 et à la section 4:

ACTIONS

101. Position longue contrats à terme (futures) indice EURO STOXX 50 (Ticker: FESX).

Montant notionnel: équivalent à la valeur de l'indice multipliée par 1 000 EUR

Bourse: Eurex

Date d'expiration: Juin Année T

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

102. Position longue sur 10 000 actions BAYER (Ticker: BAYN GR).

Bourse: Xetra

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

103. Position courte sur futures BAYER (Ticker: BAYN GR).

Montant notionnel: équivalent à la valeur de 10 000 actions de l'actif sous-jacent

Bourse: Eurex

Date d'expiration: Juin Année T

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

104. Position courte sur futures, STELLANTIS (Ticker: STLA FP).

Montant notionnel: équivalent à la valeur de 10 000 actions de l'actif sous-jacent

Bourse: Euronext

Date d'expiration: Juin Année T

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

105. Position courte sur futures, ALLIANZ (Ticker: ALV GR).

Montant notionnel: équivalent à la valeur de 10 000 actions de l'actif sous-jacent

Bourse: Eurex

Date d'expiration: Juin Année T

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

106. Position courte sur futures BARCLAYS (Ticker: BARC LN).

Montant notionnel: équivalent à la valeur de 10 000 actions de l'actif sous-jacent

Bourse: Eurex

Date d'expiration: Juin Année T

Monnaie de l'instrument ABE: GBP

107. Position courte sur futures DEUTSCHE BANK (Ticker: DBK GR).

Montant notionnel: équivalent à la valeur de 10 000 actions de l'actif sous-jacent

Bourse: Eurex

Date d'expiration: Juin Année T

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

108. Position courte sur futures CRÉDIT AGRICOLE (Ticker: ACA FP).

Montant notionnel: équivalent à la valeur de 10 000 actions de l'actif sous-jacent

Bourse: Euronext

Date d'expiration: Juin Année T

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

109. Position longue sur options d'achat. Sous-jacent BAYER (Ticker: BAYN GR), ATM (1 contrat = 100 actions).

Montant notionnel: équivalent à la valeur de 10 000 actions de l'actif sous-jacent

Date d'expiration: Juin Année T

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

110. Position courte sur options d'achat. Sous-jacent BAYER (Ticker: BAYN GR), ATM (1 contrat = 100 actions).

Montant notionnel: équivalent à la valeur de 10 000 actions de l'actif sous-jacent

Date d'expiration: Décembre Année T

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

111. Position longue sur options d'achat. Sous-jacent PFIZER (Ticker PFE US) 10 % OTM, (1 contrat = 100 actions).

Montant notionnel: équivalent à la valeur de 10 000 actions de l'actif sous-jacent

Date d'expiration: Juin Année T

Monnaie de l'instrument ABE: USD

112. Position longue sur options de vente. Sous-jacent PFIZER (Ticker PFE US) 10 % OTM, (1 contrat = 100 actions).

Montant notionnel: équivalent à la valeur de 10 000 actions de l'actif sous-jacent

Date d'expiration: Juin Année T

Monnaie de l'instrument ABE: USD

113. Position longue sur options d'achat. Sous-jacent BAYER (Ticker: BAYN GR), 10 % OTM (1 contrat = 100 actions).

Montant notionnel: équivalent à la valeur de 10 000 actions de l'actif sous-jacent

Date d'expiration: Décembre Année T

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

114. Position courte sur options d'achat. Sous-jacent BAYER (Ticker: BAYN GR), 10 % OTM (1 contrat = 100 actions).

Montant notionnel: équivalent à la valeur de 10 000 actions de l'actif sous-jacent

Date d'expiration: Juin Année T

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

115. Position longue sur options d'achat. Sous-jacent AVIVA (Ticker: AV/LN), 10 % OTM (1 contrat = 100 actions).

Montant notionnel: équivalent à la valeur de 10 000 actions de l'actif sous-jacent

Date d'expiration: Décembre Année T

Monnaie de l'instrument ABE: GBP

116. Position longue sur options de vente. Sous-jacent AVIVA (Ticker: AV/LN), 10 % OTM (1 contrat = 100 actions).

Montant notionnel: équivalent à la valeur de 10 000 actions de l'actif sous-jacent

Date d'expiration: Décembre Année T

Monnaie de l'instrument ABE: GBP

117. Position courte sur futures NIKKEI 225 (Ticker: NKY).

Montant notionnel: équivalent à la valeur de l'indice multipliée par 20 000 JPY

Bourse: CME

Date d'expiration: Juin Année T

Monnaie de l'instrument ABE: JPY

118. Produit de fonds propres avec mécanisme de remboursement automatique.

Position longue

Comptabilisation à la "Date de comptabilisation"

Montant notionnel ("capital"): 1 000 000 EUR

Sous-jacent: Indice EURO STOXX 50 (Ticker: SX5E)

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

Échéance: 5 ans

Paiement annuel et observation annuelle ("date de comptabilisation + 1 an", "date de comptabilisation + 2 ans", "date de comptabilisation + 3 ans", "date de comptabilisation + 4 ans", "date de comptabilisation + 5 ans"). Le paiement a lieu 10 jours après la date de référence.

Coupon: 6 %

Niveau de déclenchement du remboursement automatique ("valeur initiale"): Fin de journée Date de comptabilisation + 1 mois

Barrière de coupon: 60 % du niveau de déclenchement du remboursement automatique

Barrière de protection: 55 % du niveau de déclenchement du remboursement automatique

— Capital non garanti si l'indice est inférieur à la barrière de protection (le capital remboursé la cinquième année sera calculé au prorata lorsque le niveau de l'indice est inférieur à la barrière de protection: par exemple, si l'indice SX5E = 40 % de son niveau initial, le capital remboursé équivaut à 40 %);

— Si SX5E ≥ 60 % (barrière de coupon) de la valeur initiale à la fin d'une année donnée, alors le coupon versé est de 6 %;

— Si SX5E ≥ 100 % de la valeur initiale à la fin d'une année donnée, alors le produit est remboursé et le montant versé est égal au coupon plus le capital (100 %);

— Si SX5E < 60 % (barrière de coupon) de la valeur initiale à la fin d'une année donnée, alors aucun coupon n'est versé;

— Si SX5E < 55 % (barrière de protection) de la valeur initiale à la fin de la cinquième année, alors le capital n'est versé qu'au prorata. En revanche, si SX5E >= 55 % (barrière de protection) de la valeur initiale à la fin de la cinquième année, alors le capital est versé entièrement.

119. Position longue sur options d'achat. Sous-jacent indice EURO STOXX 50 (Ticker: SX5E), ATM.

Montant notionnel: équivalent à la valeur de l'indice multipliée par 1 000 EUR

Date d'expiration: Juin Année T

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

120. Position longue sur options d'achat. Sous-jacent indice EURO STOXX 600 (Ticker: SXXP), ATM.

Montant notionnel: équivalent à la valeur de l'indice multipliée par 10 000 EUR

Date d'expiration: Juin Année T

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

121. Position longue sur options d'achat. Sous-jacent VIX (CBOE), ATM.

Montant notionnel: équivalent à la valeur de l'indice multipliée par 100 000 USD

Date d'expiration: Juin Année T

Monnaie de l'instrument ABE: USD

TAUX D'INTÉRÊT

201. Swap de taux d'intérêt à 5 ans en EUR – Taux fixe reçu et taux flottant payé.

Jambe fixe: reçue annuellement

Taux flottant: EURIBOR à 6 mois, payé semestriellement Décompte de jours: ACT/360

Montant notionnel: 10 000 000 EUR

Convention de glissement et calendrier: standard

La date de prise d'effet équivaut à la date de comptabilisation (c'est-à-dire que les taux à utiliser sont ceux à la clôture du marché à la date de comptabilisation).

Échéance: Septembre Année T+4.

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

202. Swaption en EUR à deux ans sur swap de taux d'intérêt à 5 ans en EUR — taux fixe payé et taux variable reçu.

Montant notionnel: 10 000 000 EUR.

L'établissement est le vendeur de l'option sur le swap. La contrepartie de l'établissement achète le droit de conclure un swap avec l'établissement; si la contrepartie exerce son droit, elle reçoit le taux fixe alors que l'établissement reçoit le taux flottant.

Swaption avec échéance à deux ans (Date de comptabilisation + 2 ans) sur le swap de taux d'intérêt défini comme suit: Jambe fixe - payée annuellement; Taux flottant: EURIBOR à 6 mois, reçu semestriellement; Montant notionnel: 10 000 000 EUR; Convention de glissement et calendrier: standard; Date de prise d'effet du swap sous-jacent: Date de comptabilisation + 2 ans.

Échéance du swap sous-jacent: Date de comptabilisation + 7 ans

Prime payée à la date de comptabilisation (Date de comptabilisation). Règlement en espèces

Le prix d'exercice est basé sur le taux ATM du swap à terme défini dans cet instrument

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

203. Swap de taux d'intérêt à cinq ans en USD. Taux fixe reçu et taux flottant payé.

Taux fixe: reçu annuellement

Taux flottant: SOFR USD à trois mois, payé trimestriellement

Montant notionnel: 1 000 000 USD

Convention de glissement et calendrier: standard

La date de prise d'effet équivaut à la date de comptabilisation (c'est-à-dire que les taux à utiliser sont ceux à la clôture du marché à la date de comptabilisation).

Date d'échéance: Septembre Année T+4.

Monnaie de l'instrument ABE: USD

204. Swap de taux d'intérêt à deux ans en GBP. Taux fixe reçu et taux flottant payé.

Taux fixe: reçu annuellement

Taux flottant: Taux SONIA (au jour le jour) composé et payé trimestriellement Décompte de jours: ACT/365

Montant notionnel: 10 000 000 GBP

Convention de glissement et calendrier: standard

La date de prise d'effet équivaut à la date de comptabilisation (c'est-à-dire que les taux à utiliser sont ceux à la clôture du marché à la date de comptabilisation).

Échéance: Date de comptabilisation + 2 ans

Monnaie de l'instrument ABE: GBP

205. Obligation à taux variable tunnel à 10 ans vendue par UBS.

Montant (principal) notionnel: 1 000 000 USD.

Les titres de créance à taux flottant sont des obligations de rang supérieur non garanties d'UBS AG ("UBS").

Monnaie de l'instrument ABE: USD

— Les titres de créance portent intérêt à un taux annuel égal au SOFR à trois mois en USD majoré de 1,5 % par an ("taux d'intérêt flottant"), dans les limites d'un taux maximal de 7,5 % par an ("taux plafond") et d'un taux minimal de 2,5 % par an ("taux plancher").

— Tout paiement sur ces titres de créance, y compris les intérêts et le principal à l'échéance, est subordonné à la solvabilité de UBS AG. Il est demandé aux établissements d'utiliser une courbe d'actualisation appropriée, qui sera motivée dans la note explicative.

— Revenu: Les titres de créance porteront intérêt chaque trimestre à un taux égal au taux d'intérêt flottant, à condition que si à une date donnée de détermination du coupon, i) le taux d'intérêt flottant est inférieur au taux plancher, alors le taux d'intérêt applicable à la période d'intérêt concernée sera égal à ce taux plancher; ou ii) le taux d'intérêt flottant est supérieur au taux plafond, alors le taux d'intérêt applicable à la période d'intérêt concernée sera égal à ce taux plafond.

Montant des intérêts versés	Le montant des intérêts à payer sur les titres de créance pour une période d'intérêt donnée est égal au produit a) du montant principal des titres de créance, b) du taux d'intérêt applicable à la période d'intérêt en question et c) d'une fraction dont le numérateur est le nombre de jours de la période d'intérêt (calculé sur la base d'une année de 360 jours de douze mois de 30 jours) et dont le dénominateur est 360.
Date de négociation et de règlement	"Date de comptabilisation"
Date de paiement des intérêts	Trimestriellement, à la date de comptabilisation + 3 mois, à la date de comptabilisation + 6 mois, à la date de comptabilisation + 9 mois et à la date de comptabilisation + 1 an, à partir de la date de comptabilisation + 3 mois, pendant la durée de vie des titres de créance (sous réserve d'ajustements, tels que décrits ici).
Date d'échéance	Date de comptabilisation + 10 ans
Monnaie	USD
Base de décompte des jours	30/360
Convention relative aux jours ouvrables	*Following Unadjusted* (suivant, non ajusté)
Date de détermination du coupon	Pour chaque période d'intérêt, le deuxième jour d'ouverture des banques à Londres précédant immédiatement la date d'intérêt pertinente. Par "jour d'ouverture des banques à Londres", on entend tout jour où les banques commerciales à Londres ouvrent en vue d'exercer leurs activités courantes (y compris les opérations de change et les dépôts en devises) et où des opérations en dollars des États-Unis sont menées sur le marché interbancaire londonien.

206. Position longue sur emprunts d'État de l'ALLEMAGNE (inflation) de 1 000 000 EUR (ISIN DE0001030583).

Échéance: 15 avril 2033

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

207. Position courte sur emprunts d'État de l'ALLEMAGNE de 1 000 000 EUR (ISIN DE0001030708).

Échéance: 15 août 2030

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

208. Position longue sur emprunts d'État de l'ITALIE (inflation) de 1 000 000 EUR (ISIN IT0005138828)

Échéance: 15 septembre 2032

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

209. Position longue sur emprunts d'État de l'ITALIE de 1 000 000 EUR (ISIN IT0005340929).

Échéance: 1er décembre 2028

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

210. Position longue sur emprunts d'État de l'ESPAGNE de 1 000 000 EUR (ISIN ES00000127A2).

Échéance: 30 juillet 2030

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

211. Position courte sur emprunts d'État de la FRANCE de 1 000 000 EUR (ISIN FR0012993103).

Échéance: 25 mai 2031

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

212. Position courte sur emprunts d'État de l'ALLEMAGNE de 1 000 000 EUR (ISIN DE0001135176).

Échéance: 4 janvier 2031

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

213. Position longue sur emprunts d'État du ROYAUME-UNI de 1 000 000 GBP (ISIN GB0004893086).

Échéance: 7 juin 2032

Monnaie de l'instrument ABE: GBP

214. Position longue sur emprunts d'État du PORTUGAL de 1 000 000 EUR (ISIN PTOTEXOE0024).

Échéance: 15 juin 2029

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

215. Position courte sur emprunts d'État des ÉTATS-UNIS de 1 000 000 USD (ISIN US91282CAV37).

Échéance: 15 novembre 2030

Monnaie de l'instrument ABE: USD

216. Position longue sur emprunts d'État du BRÉSIL (remboursable) de 1 000 000 USD (ISIN US105756BZ27).

Échéance: 13 janvier 2028

Monnaie de l'instrument ABE: USD

217. Position longue sur emprunts d'État du MEXIQUE (remboursable) de 1 000 000 USD (ISIN US91087BAT70).

Échéance: 19 mai 2033

Monnaie de l'instrument ABE: USD

218. Swap de taux d'intérêt à 10 ans EURO – Taux flottant reçu et taux fixe payé.

Jambe fixe: payée annuellement

Taux flottant: EURIBOR à trois mois, reçu trimestriellement Décompte de jours: ACT/360

Montant notionnel: 10 000 000 EUR

Convention de glissement et calendrier: étalon

La date de prise d'effet équivaut à la date de comptabilisation (c'est-à-dire que les taux à utiliser sont ceux à la clôture du marché à la date de comptabilisation).

Échéance: Date de comptabilisation + 10 ans

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

219. Swap de taux d'intérêt à 5 ans EURO – Taux flottant reçu et taux fixe payé.

Jambe fixe: payée annuellement

Taux flottant: EURIBOR à six mois, reçu semestriellement Décompte de jours: ACT/360

Montant notionnel: 10 000 000 EUR

Convention de glissement et calendrier: standard

La date de prise d'effet équivaut à la date de comptabilisation (c'est-à-dire que les taux à utiliser sont ceux à la clôture du marché à la date de comptabilisation).

Échéance: Date de comptabilisation + 5 ans

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

220. SWAP de devises EUR/USD à cinq ans avec valorisation au prix du marché (MtM). USD reçus, EUR payés.

EUR: ESTER à 3 mois, payé trimestriellement composé avec un décalage de paiement de 2 jours Décompte de jours: ACT/360

USD: SOFR à 3 mois, reçu trimestriellement composé avec un décalage de paiement de 2 jours Décompte de jours: ACT/360

Jambe 1 — USD: Montant notionnel équivalent à 10 000 000 EUR ajusté sur une base trimestrielle

Jambe 2 — EUR: Montant notionnel 10 000 000 EUR

Convention de glissement et calendrier: standard

La date de prise d'effet équivaut à la date de comptabilisation + 6 mois.

Échéance: Date de comptabilisation + 5,5 ans

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

Voir également la section 6 de la présente annexe — Spécifications supplémentaires pour les instruments

221. Swap de taux d'intérêt à 10 ans EURO – ESTER reçu et EURIBOR payé.

Jambe ESTER: reçue annuellement. Décompte de jours: ACT/360

Jambe EURIBOR: EURIBOR à trois mois + Base, payé trimestriellement Décompte de jours: ACT/360

Montant notionnel: 10 000 000 EUR

Convention de glissement et calendrier: standard

La date de prise d'effet équivaut à la date de comptabilisation (c'est-à-dire que les taux à utiliser sont ceux à la clôture du marché à la date de comptabilisation).

Échéance: Septembre Année T + 9 ans

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

222. Position longue sur emprunts d'État de l'ITALIE (inflation) de 1 000 000 EUR (ISIN IT0005387052).

Échéance: 15 mai 2030

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

223. Swap d'inflation zéro-coupon à 5 ans (EUR) — Retour indexé sur l'inflation reçu et taux fixe (r) payé.

Indice d'inflation: IPC (IPCHxT)

Jambe fixe (paiement fixe): $[(1 + r)^5 - 1]$

Retour indexé sur l'inflation reçu: $\left[\left(\frac{CPI \text{ at the end (maturity) date}}{CPI \text{ at the start date}}\right) - 1\right]$

Montant notionnel: 10 000 000 EUR

Date de fixation de la base: Juin Année T-1

Fixation finale: Août Année T+4

Échéance: Septembre Année T+4

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

224. Swaption en EUR à deux ans sur swap de taux d'intérêt à 5 ans en EUR — taux fixe reçu et taux variable payé.

Montant notionnel: 10 000 000 EUR.

L'établissement est le vendeur de l'option sur le swap. La contrepartie de l'établissement achète le droit de conclure un swap avec l'établissement; si la contrepartie exerce son droit, elle reçoit le taux flottant alors que l'établissement reçoit le taux fixe.

Swaption avec échéance à deux ans (Date de comptabilisation + 2 ans) sur le swap de taux d'intérêt défini comme suit: Jambe fixe - reçue annuellement; Taux flottant: EURIBOR à six mois, payé semestriellement; Montant notionnel: 10 000 000 EUR; Convention de glissement et calendrier: standard; Date de prise d'effet du swap sous-jacent: Date de comptabilisation + 2 ans.

Échéance du swap sous-jacent: Date de comptabilisation + 7 ans

Prime payée à la date de comptabilisation (Date de comptabilisation). Règlement en espèces

Le prix d'exercice est basé sur le taux ATM du swap à terme défini dans cet instrument + 100 points de base

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

CHANGE

301. Contrat à terme "forward" USD/EUR à six mois. Règlement en espèces. Position longue USD – Position courte EUR; Montant notionnel 10 000 000 USD; Prix d'exercice à terme: égal à 100 % du taux de référence au comptant applicable de la BCE en vigueur à la clôture du jour de comptabilisation.

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

302. contrat à terme (forward) EUR/GBP à six mois. Règlement en espèces. Position longue EUR — position courte GBP; Notionnel 10 000 000 GBP; Prix d'exercice à terme: égal à 100 % du taux de référence au comptant applicable de la BCE en vigueur à la clôture du jour de comptabilisation.

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

303. Position longue 10 000 000 USD en espèces.

Solde de trésorerie. Considéré comme présentant un risque de change intrinsèque comme indiqué au point kk)

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

304. Position longue sur option d'achat EUR/USD (longue EUR, courte USD). Règlement en espèces. Montant notionnel: 10 000 000 EUR. Montant équivalent basé sur le taux de référence au comptant EUR/USD de la BCE en vigueur à la clôture du jour de comptabilisation.

Prix d'exercice: 110 % du taux de référence EUR/USD de la BCE en vigueur à la clôture du jour de comptabilisation.

Date d'expiration: Date de comptabilisation + 1 an

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

305. Position longue sur option d'achat EUR/USD (longue EUR, courte USD). Règlement en espèces. Montant notionnel: 10 000 000 EUR. Montant équivalent basé sur le taux de référence au comptant EUR/USD de la BCE en vigueur à la clôture du jour de comptabilisation.

Prix d'exercice: 90 % du taux de référence EUR/USD de la BCE en vigueur à la clôture du jour de comptabilisation.

Date d'expiration: Date de comptabilisation + 1 an

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

306. Position courte sur option d'achat EUR/USD (courte EUR, longue USD). Règlement en espèces. Montant notionnel: 10 000 000 EUR. Montant équivalent basé sur le taux de référence au comptant EUR/USD de la BCE en vigueur à la clôture du jour de comptabilisation.

Prix d'exercice: 100 % du taux de référence EUR/USD de la BCE en vigueur à la clôture du jour de comptabilisation.

Date d'expiration: Date de comptabilisation + 1 an

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

307. Position courte sur option d'achat EUR/GBP (courte EUR, longue GBP). Règlement en espèces. Montant notionnel: 10 000 000 EUR. Montant équivalent basé sur le taux de référence au comptant EUR/GBP de la BCE en vigueur à la clôture du jour de comptabilisation.

Prix d'exercice: 110 % du taux de référence EUR/GBP de la BCE en vigueur à la clôture du jour de comptabilisation.

Date d'expiration: Date de comptabilisation + 1 an

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

308. Position longue sur option de vente EUR/JPY (courte EUR, longue JPY). Règlement en espèces. Montant notionnel: 10 000 000 EUR. Montant équivalent basé sur le taux de référence au comptant EUR/JPY de la BCE en vigueur à la clôture du jour de comptabilisation.

Prix d'exercice: 110 % du taux de référence EUR/JPY de la BCE en vigueur à la clôture du jour de comptabilisation.

Date d'expiration: Date de comptabilisation + 1 an

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

309. Position courte sur option de vente EUR/AUD (longue EUR, courte AUD). Règlement en espèces. Montant notionnel: 10 000 000 EUR. Montant équivalent basé sur le taux de référence au comptant EUR/AUD de la BCE en vigueur à la clôture du jour de comptabilisation.

Prix d'exercice: 110 % du taux de référence EUR/AUD de la BCE en vigueur à la clôture du jour de comptabilisation.

Date d'expiration: Date de comptabilisation + 1 an

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

310. Contrat à terme (forward) EUR/DKK à six mois (long EUR, court DKK). Règlement en espèces. Montant notionnel 10 000 000 EUR. Taux de change au comptant EUR/DKK de référence de la BCE en vigueur à la clôture du jour de comptabilisation pour déterminer le taux à terme.

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

311. Contrat à terme (forward) non livrable EUR/BRL à six mois (long EUR, court BRL). Montant notionnel 10 000 000 EUR. Taux de change au comptant EUR/BRL de référence de la BCE en vigueur à la clôture du jour de comptabilisation pour déterminer le taux à terme.

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

MATIÈRES PREMIÈRES

401. Position longue sur contrats à terme "London Gold Forward"
(3 500 onces Troy) à 6 mois (longue or, courte USD). Règlement en espèces. Prix d'exercice: prix à terme à six mois à la clôture à la date de comptabilisation

Monnaie de l'instrument ABE: USD

402. Position courte sur contrats à terme "London Gold Forward" (3 500 onces Troy) à 12 mois (courte or, longue USD) Règlement en espèces. Prix d'exercice: prix à terme à 12 mois à la clôture à la date de comptabilisation

Monnaie de l'instrument ABE: USD

403. Position longue sur option d'achat de 30 000 barils de pétrole brut Brent (longue WTI, courte USD). Règlement en espèces. Prix d'exercice: prix à terme à 12 mois à la clôture à la date de comptabilisation. Date d'expiration: Date de comptabilisation + 6 mois

Monnaie de l'instrument ABE: USD

404. Position courte sur option de vente de 30 000 barils de pétrole brut Brent (longue WTI, courte USD). Règlement en espèces. Prix d'exercice: prix à terme à 12 mois à la clôture à la date de comptabilisation. Date d'expiration: Date de comptabilisation + 6 mois

Monnaie de l'instrument ABE: USD

405. Position longue sur option d'achat London Gold
(5 000 onces Troy) (longue or, courte USD). Règlement en espèces. Prix d'exercice: prix à terme à 18 mois à la clôture à la date de comptabilisation. Date d'expiration: Date de comptabilisation + 18 mois

Monnaie de l'instrument ABE: USD

ÉCART DE CRÉDIT

501. Position longue (achat protection) de 1 000 000 USD en CDS sur le PORTUGAL.

Clause de restructuration: intégrale

Monnaie de l'instrument ABE: USD

502. Position longue (achat protection) de 1 000 000 USD en CDS sur l'ITALIE.

Clause de restructuration: intégrale
Monnaie de l'instrument ABE: USD

503. Position courte (vente protection) de 1 000 000 USD en CDS sur l'ESPAGNE.

Clause de restructuration: intégrale
Monnaie de l'instrument ABE: USD

504. Position longue (achat protection) de 1 000 000 USD en CDS sur le MEXIQUE.

Clause de restructuration: intégrale
Monnaie de l'instrument ABE: USD

505. Position longue (achat protection) de 1 000 000 USD en CDS sur le BRÉSIL.

Clause de restructuration: intégrale
Monnaie de l'instrument ABE: USD

506. Position longue (achat protection) de 1 000 000 USD en CDS sur le ROYAUME-UNI.

Clause de restructuration: intégrale
Monnaie de l'instrument ABE: USD

507. Position courte (vente protection) de 1 000 000 EUR en CDS sur Telefonica (Ticker TEF SM).

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

508. Position longue (achat protection) de 1 000 000 EUR en CDS sur Telefonica (Ticker TEF SM).

Échéance: Décembre Année T+2
Monnaie de l'instrument ABE: EUR

509. Position courte (vente protection) de 1 000 000 EUR en CDS sur Aviva (Ticker AV LN).

Année des définitions ISDA 2003
Monnaie de l'instrument ABE: EUR

510. Position longue (achat protection) de 1 000 000 EUR en CDS sur Aviva (Ticker AV LN).

Année des définitions ISDA 2003
Échéance: Décembre Année T+2
Monnaie de l'instrument ABE: EUR

511. Position courte (vente protection) de 1 000 000 EUR en CDS sur Vodafone (Ticker VOD LN).

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

512. Position courte (vente protection) de 1 000 000 EUR en CDS sur ENI SpA (Ticker ENI IM).

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

513. Position courte (vente protection) de 1 000 000 USD en CDS sur Eli Lilly (Ticker LLY US).

Clause de restructuration: Pas de restructuration (XR14)
Monnaie de l'instrument ABE: USD

514. Position courte (vente protection) de 1 000 000 EUR en CDS sur Unilever (Ticker UNA NA).

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

515. Position longue (achat protection) de 1 000 000 EUR en CDS sur Total SA (Ticker FP FP).

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

516. Position longue (achat protection) de 1 000 000 EUR en CDS sur Volkswagen Group (Ticker VOW GR).

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

517. Position longue sur emprunts d'État de la TURQUIE de 1 000 000 USD(ISIN US900123CT57).

Échéance: 26 avril 2029

Monnaie de l'instrument ABE: USD

518. Position longue (achat protection) de 1 000 000 USD en CDS sur la TURQUIE. La date de prise d'effet équivaut à la date de comptabilisation.

Clause de restructuration: intégrale

Monnaie de l'instrument ABE: USD

519. Position longue sur titres de créance Telefonica de 1 000 000 EUR (ISIN XS1681521081).

Échéance: 12 janvier 2028

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

520. Position longue sur titres de créance Volkswagen Group de 1 000 000 EUR (ISIN XS2234567233).

Échéance: 22 septembre 2028

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

521. Position courte sur titres de créance Volkswagen Group de 1 000 000 EUR (ISIN XS1167667283).

Échéance: 16 janvier 2030

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

522. Position longue sur titres de créance Total SA de 1 000 000 EUR (ISIN XS1856281834).

Échéance: 11 juillet 2033

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

523. Position longue sur emprunt d'État de l'AUTRICHE de 1 000 000 EUR (ISIN AT0000A04967).

Échéance: 15 mars 2037

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

524. Position longue (achat protection) de 1 000 000 USD en CDS sur l'AUTRICHE.

Échéance: Juin Année T+15

Monnaie de l'instrument ABE: USD

525. Position longue sur emprunt d'État des PAYS-BAS de 1 000 000 EUR (ISIN NL0013552060).

Échéance: 15 janvier 2040

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

526. Position longue (achat protection) de 1 000 000 USD en CDS sur les PAYS-BAS.

Échéance: Juin Année T+20

Monnaie de l'instrument ABE: USD

527. Position longue sur emprunt d'État de la BELGIQUE de 1 000 000 EUR (ISIN BE0000348574).

Échéance: 22 juin 2050

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

528. Position longue (achat protection) de 1 000 000 USD en CDS sur la BELGIQUE.

Échéance: Juin Année T+30

Monnaie de l'instrument ABE: USD

529. Position longue (achat protection) de 10 000 000 EUR en CDS sur la série on-the-run de l'indice iTraxx Europe.

Échéance: Juin Année T+4

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

530. Position courte sur option de vente. 10 000 000 EUR. Série on-the-run de l'indice iTraxx Europe sous-jacente (même instrument que 529).

Prix d'exercice: ATM

Date d'expiration: Date de comptabilisation + 6 mois

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

531. Position longue sur AXA SA (remboursable) de 1 000 000 EUR (ISIN XS1799611642).

Échéance: 28 mai 2049

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

532. Position longue sur obligation AT&T (remboursable) de 1 000 000 USD (ISIN US00206RFW79).

Échéance: 15 août 2037

Monnaie de l'instrument ABE: USD

533. Position longue sur BAYER AG (remboursable) de 1 000 000 EUR (ISIN XS2199266268).

Échéance: 6 janvier 2030

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

534. Position longue sur obligation ORANGE SA (remboursable) de 1 000 000 EUR (ISIN FR0013323870).

Échéance: 20 mars 2028

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

PORTEFEUILLE DE NÉGOCIATION EN CORRÉLATION

601. Position courte (vente protection) sur la série on-the-run de l'indice iTraxx Europe.

Point d'attachement: 3 %

Point de détachement: 6 %

Montant notionnel: 5 000 000 EUR

Échéance: 5 ans

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

602. Position longue (achat protection) de 5 000 000 EUR en CDS sur la série on-the-run de l'indice iTraxx Europe la plus récente.

Échéance: Juin Année T+4

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

Notionnel ajusté pour couvrir intégralement CS01 de 601 sans re-couverture requise

603. Position longue (achat protection) sur la série on-the-run de l'indice iTraxx Europe.

Point d'attachement: 3 %

Point de détachement: 6 %

Montant notionnel: 5 000 000 EUR

Échéance: 5 ans

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

604. Position courte (vente protection) de 5 000 000 EUR en CDS sur la série on-the-run de l'indice iTraxx Europe la plus récente.

Échéance: Juin Année T+4

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

Notionnel ajusté pour couvrir intégralement CS01 de 603 sans re-couverture requise

605. Position courte (vente protection) sur la série on-the-run de l'indice iTraxx Europe.

Point d'attachement: 12 %

Point de détachement: 100 %

Montant notionnel: 5 000 000 EUR

Échéance: 5 ans

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

606. Position longue (achat protection) de 5 000 000 EUR en CDS sur la série on-the-run de l'indice iTraxx Europe la plus récente.

Échéance: Juin Année T+4

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

Notionnel ajusté pour couvrir intégralement CS01 de 605 sans re-couverture requise

607. Position longue (achat protection) sur la série on-the-run de l'indice iTraxx Europe.

Point d'attachement: 12 %

Point de détachement: 100 %

Montant notionnel: 5 000 000 EUR

Échéance: 5 ans

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

608. Position courte (vente protection) de 5 000 000 EUR en CDS sur la série on-the-run de l'indice iTraxx Europe la plus récente.

Échéance: Juin Année T+4

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

Notionnel ajusté pour couvrir intégralement CS01 de 607 sans re-couverture requise

609. Position courte (vente protection) sur la série on-the-run de l'indice iTraxx Europe.

Point d'attachement: 3 %

Point de détachement: 6 %

Montant notionnel: 5 000 000 EUR

Échéance: 5 ans

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

Taux de recouvrement: 40 % fixe.

610. Position longue (achat protection) de 5 000 000 EUR en CDS sur la série on-the-run de l'indice iTraxx Europe la plus récente.

Échéance: Juin Année T+4

Monnaie de l'instrument ABE: EUR

Notionnel ajusté pour couvrir intégralement CS01 de 609 sans re-couverture requise

Section 3: Portefeuilles individuels — Instrument unique

Les établissements doivent fournir les mesures du risque requises, ainsi que la valeur actuelle, des portefeuilles individuels suivants:

Portefeuille	*Combinaison d'instruments:* Le premier chiffre représente l'instrument (tel qu'indiqué dans la section 2 de la présente annexe). Le deuxième chiffre représente la quantité de chaque instrument ou le nombre de contrats, selon le cas.	Monnaie du portefeuille ABE	Mesures du risque requises
1001	101 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
1002	102 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
1003	103 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
1004	104 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
1005	105 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
1006	106 – 1 instrument	GBP	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
1007	107 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
1008	108 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
1009	109 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
1010	110 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
1011	111 – 1 instrument	USD	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
1012	112 – 1 instrument	USD	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
1013	113 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
1014	114 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
1015	115 – 1 instrument	GBP	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
1016	116 – 1 instrument	GBP	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
1017	117 – 1 instrument	JPY	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
1018	118 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO

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

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

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

5033	533 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
5034	534 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
6001	601 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; APR; SBM; DRC; RRAO
6002	602 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; APR; SBM; DRC; RRAO
6003	603 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; APR; SBM; DRC; RRAO
6004	604 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; APR; SBM; DRC; RRAO
6005	605 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; APR; SBM; DRC; RRAO
6006	606 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; APR; SBM; DRC; RRAO
6007	607 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; APR; SBM; DRC; RRAO
6008	608 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; APR; SBM; DRC; RRAO
6009	609 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; APR; SBM; DRC; RRAO
6010	610 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; APR; SBM; DRC; RRAO

Section 4: Portefeuilles individuels — Instruments multiples

Les établissements doivent fournir les mesures du risque requises, ainsi que la valeur actuelle, des portefeuilles individuels suivants:

Portefeuille	*Combinaison d'instruments:* Le premier chiffre représente l'instrument (tel qu'indiqué dans la section 2 de la présente annexe). Le deuxième chiffre représente la quantité de chaque instrument ou le nombre de contrats, selon le cas.	Monnaie du portefeuille ABE	Mesures du risque requises
1101	103 – 1 instrument 104 – 1 instrument 105 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
1102	113 – 1 instrument 110 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
1103	115 – 1 instrument 116 – 1 instrument	GBP	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
1104	109 – 1 instrument 110 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO

1105	111 – 1 instrument 112 – 1 instrument	USD	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
1106	102 – 1 instrument 114 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
1107	106 – 1 instrument 107 – 1 instrument 108 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
1108	101 – 1 instrument 103 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
1109	101 – 1 instrument 103 – 1 instrument 104 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
1110	102 – 1 instrument 104 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
2201	206 – 1 instrument 207 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
2202	206 – 1 instrument 207 – 1 instrument 208 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
2203	206 – 1 instrument 207 – 1 instrument 208 – 1 instrument 209 – 1 instrument 210 – 1 instrument 211 – 1 instrument 212 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
2204	201 – 1 instrument 218 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
2205	201 – 1 instrument 219 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
2206	218 – 1 instrument 219 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
2207	201 – 1 instrument 202 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
2208	215 – 1 instrument 216 – 1 instrument 217 – 1 instrument	USD	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
2209	203 – 1 instrument 215 – 1 instrument	USD	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO

2210	208 – 1 instrument 209 – 1 instrument 210 – 1 instrument 214 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
2211	209 – 1 instrument 219 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
2212	201 – 1 instrument 223 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
3301	301 – 1 instrument 302 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
3302	303 – 1 instrument 304 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
3303	304 – 1 instrument 305 – 1 instrument 306 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
3304	307 – 1 instrument 308 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
4401	401 – 1 instrument 402 – 1 instrument	USD	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
4402	403 – 1 instrument 404 – 1 instrument	USD	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
4403	401 – 1 instrument 404 – 1 instrument	USD	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
5501	501 – 1 instrument 502 – 1 instrument 503 – 1 instrument	USD	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
5502	504 – 1 instrument 505 – 1 instrument	USD	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
5503	507 – 1 instrument 508 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
5504	503 – 1 instrument 504 – 1 instrument	USD	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
5505	509 – 1 instrument 510 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
5506	511 – 1 instrument 512 – 1 instrument 514 – 1 instrument 515 – 1 instrument 516 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO

5507	517 – 1 instrument 518 – 1 instrument	USD	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
5508	519 – 1 instrument 520 – 1 instrument 522 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
5509	520 – 1 instrument 521 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
5510	519 – 1 instrument 508 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
5511	515 – 1 instrument 522 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
5512	520 – 1 instrument 521 – 1 instrument 516 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
5513	506 – 1 instrument 503 – 1 instrument	USD	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
5514	502 – 1 instrument 209 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
5515	504 – 1 instrument 217 – 1 instrument	USD	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
5516	505 – 1 instrument 216 – 1 instrument	USD	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
5517	504 – 1 instrument 217 – 1 instrument 505 – 1 instrument 216 – 1 instrument	USD	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
5518	502 – 1 instrument 209 – 1 instrument 219 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
5519	523 – 1 instrument 525 – 1 instrument 527 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
5520	524 – 1 instrument 526 – 1 instrument 528 – 1 instrument	USD	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
5521	523 – 1 instrument 524 – 1 instrument 525 – 1 instrument 526 – 1 instrument 527 – 1 instrument 528 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO

5522	529 – 1 instrument 530 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
6601	601 – 1 instrument 602 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; APR; SBM; DRC; RRAO
6602	603 – 1 instrument 604 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; APR; SBM; DRC; RRAO
6603	605 – 1 instrument 606 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; APR; SBM; DRC; RRAO
6604	607 – 1 instrument 608 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; APR; SBM; DRC; RRAO
6605	609 – 1 instrument 610 – 1 instrument	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; APR; SBM; DRC; RRAO

Section 5: Portefeuilles consolidés

Les établissements doivent fournir les mesures du risque requises, ainsi que la valeur actuelle, des portefeuilles consolidés suivants:

Portefeuille consolidé	Description	*Combinaison de portefeuilles individuels* (portefeuilles individuels désignés par leur numéro, tel qu'indiqué dans les sections 3 et 4 de la présente annexe)	Monnaie du portefeuille ABE	Mesures du risque requises
10000	ALL-IN hors portefeuille de négociation en corrélation	1001, 1101, 1104, 1106, 2001, 2002, 2203, 2206, 3301, 3303, 3304, 4401, 4402, 5503, 5506, 5508, 5521	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
11000	ACTIONS – cumulatif	1001, 1101, 1104, 1106	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
12000	Taux d'intérêt – cumulatif	2001, 2002, 2203, 2206	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
13000	Change – cumulatif	3301, 3303, 3304	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
14000	Matières premières – cumulatif	4401, 4402	USD	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; SBM; DRC; RRAO
15000	Écart de crédit – cumulatif	5503, 5506, 5508, 5521	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; IRC; SBM; DRC; RRAO
16000	Portefeuille de négociation en corrélation – cumulatif, EUR	6601, 6602	EUR	Valeur en risque (VaR); VaR en situation de tensions; APR; SBM; DRC; RRAO

Section 6: Spécifications supplémentaires pour les instruments

Les établissements appliquent les spécifications supplémentaires suivantes aux instruments financiers décrits à la section 2 de la présente annexe:

Instrument	220
Description:	SWAP de devises EUR/USD à cinq ans avec valorisation au prix du marché (MtM). USD reçus, EUR payés Montant notionnel: 10 000 000 EUR, USD (10 000 000 EUR * FX USD/EUR)
Payé:	Jambe flottante 2
Reçu:	Jambe flottante 1
Échange et révision du notionnel:	À la date de prise d'effet et à la date d'échéance. Ensuite, à chaque date de paiement du coupon, un paiement supplémentaire correspondant à l'ajustement du montant notionnel en USD de la jambe 2 est effectué. Le montant notionnel en USD est ajusté afin qu'il corresponde à 10 000 000 EUR, au taux de change au comptant 2 jours ouvrables avant chaque date de paiement.
Solde en espèces	Inclus
Jambe flottante 1	
Montant notionnel:	Équivalent à 10 000 000 EUR convertis en USD au taux de change au comptant à la date de prise d'effet, équivalent ajusté sur une base trimestrielle
Date de prise d'effet:	Date de comptabilisation + 6 mois
Date d'échéance:	Date de comptabilisation + 5,5 ans
Génération des dates de paiement:	En avançant dans le temps en partant de la date de prise d'effet
Fréquence de paiement du coupon:	Trimestrielle
Taux du coupon:	SOFR à 3 mois + 0 point de base.
Fréquence de révision du taux du coupon:	Trimestrielle
Convention de fixation du taux du coupon:	Composé quotidiennement sur la période de 3 mois
Fréquence de composition du taux de coupon:	Intérêts simples
Décompte de jours:	ACT/360
Jour ouvrable du paiement:	LON, NYC, TARGET
Convention relative au jour ouvrable du paiement:	*Modified Following* (modifié suivant)
Jour ouvrable de la révision du notionnel:	LON, NYC, TARGET
Convention relative au jour ouvrable de la révision du notionnel:	Précédent
Jour ouvrable de révision du taux de coupon:	LON, NYC, TARGET
Convention relative au jour ouvrable de révision du taux de coupon:	Précédent

Jambe flottante 2	
Montant notionnel:	10 000 000 EUR
Date de prise d'effet:	Date de comptabilisation + 6 mois
Date d'échéance:	Date de comptabilisation + 5,5 ans
Génération des dates de paiement:	En avançant dans le temps en partant de la date de prise d'effet
Fréquence de paiement du coupon:	Trimestrielle
Taux du coupon:	ESTER à 3 mois + 0 point de base.
Fréquence de révision du taux du coupon:	Trimestrielle
Convention de fixation du taux du coupon:	Composé quotidiennement sur la période de 3 mois
Fréquence de composition du taux de coupon:	Intérêts simples
Décompte de jours:	ACT/360
Jour ouvrable du paiement:	LON, NYC, TARGET
Jour ouvrable du paiement	*Modified Following* (modifié suivant)
Jour ouvrable de la révision du notionnel:	LON, NYC, TARGET
Convention relative au jour ouvrable de la révision du notionnel:	Précédent
Jour ouvrable de révision du taux de coupon:	LON, NYC, TARGET
Convention relative au jour ouvrable de révision du taux de coupon:	Précédent»

Section 7: Portefeuilles de validation SBM

a) Les établissements fournissent la mesure du risque SBM des portefeuilles définis à l'annexe X (portefeuilles de validation SBM) dans le cadre de la soumission de l'IMV, dans le respect des dates de déclaration de la soumission de l'IMV.

b) Les dispositions suivantes s'appliquent à la soumission des résultats correspondant aux portefeuilles de validation SBM:

i) les établissements ne remplissent que le modèle C120.02 et ne déclarent dans ce modèle que les résultats en monnaie de déclaration (c'est-à-dire que la colonne 0060 du modèle C120.02 ne doit pas être remplie et que les modèles C 106.00 et C 106.01 ne doivent pas être remplis pour les portefeuilles de validation SBM);

ii) les établissements doivent supposer que les sensibilités au risque et les positions de risque de courbure définies par les instruments précisés à l'annexe X sont exprimées dans la monnaie de déclaration de l'établissement et que les informations sont fournies dans le format précisé dans les instructions de déclaration pour les modèles C 106.01/ C 120.01 et dans le tableau correspondant contenant des orientations pour la déclaration de ces modèles à l'annexe VI (instructions sur les modèles).»

ANNEXE III

«ANNEXE VI

RÉSULTATS — PORTEFEUILLES DE RÉFÉRENCE À DES FINS DE SURVEILLANCE

INSTRUCTIONS RELATIVES AUX MODÈLES

C 106.00 — Valorisation de marché initiale et justification des exclusions 57
C 106.01 — Méthode des sensibilités (SBM). Sensibilités au risque par instrument 57
C 107.01 — VaR et sVaR hors portefeuille de négociation en corrélation (non-CTP). Description détaillée. 61
C 107.02 — VaR, sVaR et VA — Hors portefeuille de négociation en corrélation (non-CTP). Résultats dans la monnaie du portefeuille ABE. 63
C 108.00 — Séries chronologiques profits et pertes (P&L) 64
C 109.01 — Exigence de fonds propres pour risques supplémentaires (IRC). Description détaillée du modèle 65
C 109.02 — Exigence de fonds propres pour risques supplémentaires (IRC). Description détaillée par portefeuille 65
C 109.03 — Exigence de fonds propres pour risques supplémentaires (IRC). Montant par portefeuille/date. 66
C 110.01 — Négociation en corrélation. Description détaillée du modèle. 67
C 110.02 — Négociation en corrélation. Description détaillée par portefeuille. 68
C 110.03 — Négociation en corrélation. Risque de prix total (APR) par portefeuille/date 69
C 120.01 — Méthode des sensibilités (SBM). SENSIBILITÉS AU RISQUE PAR INSTRUMENT/PORTEFEUILLE 69
C 120.02 — Méthode des sensibilités (SBM). COMPOSITION DES EXIGENCES DE FONDS PROPRES (OFR) PAR PORTEFEUILLE 72
C 120.04 — DRC. VALEURS DE MARCHÉ ET MONTANTS JTD BRUTS PAR INSTRUMENT/PORTEFEUILLE 74
C 120.05 — DRC. COMPOSITION DES EXIGENCES DE FONDS PROPRES (OFR) PAR PORTEFEUILLE 80
C 120.06 — ASA. Exigences de fonds propres (OFR) 82

INSTRUCTIONS RELATIVES AUX MODÈLES

C 106.00 — Valorisation de marché initiale et justification des exclusions

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0010	Numéro de l'instrument	Annexe V, section 2	Le numéro de l'instrument tiré de l'annexe V doit être indiqué.
0020	Instrument modélisé pour VaR et sVaR (TRUE/FALSE)		Indiquer soit TRUE, soit FALSE.
0030	Instrument modélisé pour IRC (exigence de fonds propres pour risques supplémentaires) (TRUE/FALSE)		Indiquer soit TRUE, soit FALSE.
0040	Instrument modélisé pour négociation en corrélation (TRUE/FALSE)		Indiquer soit TRUE, soit FALSE.
0050	Justification de l'exclusion	Article 3, paragraphe 2	L'un des éléments suivants doit être indiqué: a) Modèle non autorisé par le régulateur; b) Instrument ou sous-jacent non autorisé en interne; c) Sous-jacent ou caractéristique de modélisation non envisagé(e) en interne; d) Autre justification de l'exclusion. Veuillez expliquer cette justification à la colonne 0060.
0060	Zone de texte libre		L'établissement peut fournir des informations supplémentaires dans cette colonne.
0070	Valorisation de marché initiale (IMV)		La valeur de marché de chacun des instruments à la date de référence à 17h30 HEC [telle qu'indiquée à l'annexe V, section 1, point b)]. La cellule doit être laissée vierge si l'établissement ne souhaite pas fournir d'IMV pour un portefeuille donné (c.-à-d. qu'une valeur zéro n'est à inscrire que si le résultat du calcul est zéro).

C 106.01 — Méthode des sensibilités (SBM). Sensibilités au risque par instrument

L'établissement indique les sensibilités aux facteurs de risque auxquels l'instrument est exposé. Une ligne est utilisée par facteur de risque/sensibilité. La position nette de risque de courbure haussier de ce facteur de risque (CVRk+) ou la position nette de risque de courbure baissier de ce facteur de risque (CVRk-), telle que précisée à l'article 325 *octies* du règlement (UE) nº 575/2013, est indiquée à chaque ligne. Toutes les valeurs se réfèrent à "la date de référence de l'IMV (et de la SBM initiale)" [telle que précisée à l'annexe V, section 1, point b) ii), du présent règlement]. L'établissement ne déclare chaque combinaison de numéro de l'instrument, identifiant de risque (colonne 0010), classe (colonne 0020) et identifiant supplémentaire (colonne 0030) qu'une seule fois.

Instructions relatives aux feuilles (axe des z)

Dénomination	Référence juridique	Instructions
Numéro de l'instrument	Annexe V, section 2	Le numéro de l'instrument tiré de l'annexe V doit être indiqué.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0010	Identifiant du facteur de risque	Articles 325 *terdecies*, 325 *quaterdecies*, 325 *quindecies*, 325 *sexdecies*, 325 *septdecies* et 325 *octodecies* du règlement (UE) nº 575/2013	L'identifiant du facteur de risque, tel que précisé dans le tableau figurant à la fin de la présente annexe, doit être indiqué.
0020	Classe	Article 325 *quinquies*, point 3), du règlement (UE) nº 575/2013	Indiquer la classe, lorsque l'identifiant du facteur de risque sélectionné dans la colonne 0010 correspond à la catégorie de risque: — risque de taux d'intérêt global, donner le nom de la monnaie du facteur de risque correspondant à un taux sans risque, du facteur de risque d'inflation ou du facteur de risque d'écart de taux entre monnaies pertinent (en utilisant la désignation des monnaies selon la norme ISO 4217, par exemple "EUR"); — risque d'écart de crédit (credit spread risk ou CSR) sur expositions hors titrisation, donner le numéro de classe indiqué dans le tableau 4 de l'article 325 *quintricies*, paragraphe 1), du règlement (UE) nº 575/2013; — risque d'écart de crédit (CSR) sur expositions de titrisation hors portefeuille de négociation en corrélation alternatif (portefeuille ACTP): (non-ACTP CSR); donner le numéro de classe indiqué à l'article 325 *quadragies*, paragraphe 1, tableau 7, dudit règlement; — risque d'écart de crédit (CSR) sur expositions de titrisation du portefeuille de négociation en corrélation alternatif (portefeuille ACTP): (ACTP CSR); donner le numéro de classe indiqué à l'article 325 *octotricies*, tableau 6, dudit règlement; — risque sur actions, donner le numéro de classe indiqué à l'article 325 *terquadragies*, paragraphe 1, tableau 8, dudit règlement; — risque sur matières premières, donner le numéro de classe indiqué à l'article 325 *sexquadragies*, tableau 9, dudit règlement; — risque de change et composantes delta ou courbure, donner le nom de la monnaie (par exemple "USD"; les codes monnaie déclarés doivent suivre la désignation des monnaies selon la norme ISO 4217); — risque de change et composante vega, donner le nom de la paire de devises (par exemple "EUR_USD"; les codes monnaie déclarés doivent suivre la désignation des monnaies selon la norme ISO 4217).
0030	Identifiant supplémentaire 1	Articles 325 *terdecies*, 325 *octodecies* et 325 *sextricies* du règlement (UE) nº 575/2013	Les informations ci-dessous, permettant de distinguer le facteur de risque au niveau intra-classe, doivent être déclarées. Lorsque l'identifiant du facteur de risque sélectionné dans la colonne 0010 correspond à la catégorie de risque: — risque de taux d'intérêt global et composante delta, donner le nom de la courbe sans risque ou un autre identifiant unique correspondant; — risque d'écart de crédit sur expositions hors titrisation, ou risque d'écart de crédit sur expositions de titrisation du portefeuille de négociation en corrélation alternatif (ACTP CSR); indiquer le nom de l'émetteur ou un autre identifiant

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
			unique correspondant; cette valeur doit être identique pour toute paire de sensibilités déclarées à deux facteurs de risque qui reçoit un coefficient de corrélation $\rho_{kl}^{(nom)}$ égal à 1 conformément à l'article 325 *sextricies*, paragraphe 1, du règlement (UE) nº 575/2013. — risque d'écart de crédit sur expositions de titrisation hors portefeuille de négociation en corrélation alternatif (non-ACTP CSR); indiquer le nom de la tranche ou un autre identifiant unique correspondant; — risque sur actions, donner le nom de l'émetteur des actions ou un autre identifiant unique correspondant; — risque sur matières premières, donner le nom de la matière première ou un autre identifiant unique correspondant. Dans tous les autres cas, les établissements indiquent une valeur explicite (NULL) comme non applicable.
0050	Sensibilité au risque (résultats dans la monnaie de déclaration)	Article 325 *quinquies*, point 2), et articles 325 *octies*, 325 *novodecies*, 325 *vicies*, 325 *unvicies* et 325 *unquinquagies* du règlement (UE) nº 575/2013	Les sensibilités au risque (sensibilités delta / vega et positions de risque de courbure) doivent être indiquées au niveau de chaque instrument pour tous les facteurs de risque pertinents tels que précisés dans les colonnes 0010 à 0030. Les valeurs doivent être déclarées dans la monnaie de déclaration de l'établissement. Lorsque l'identifiant du facteur de risque sélectionné dans la colonne 0010 correspond: — à la composante risque delta de la méthode des sensibilités, indiquer la sensibilité nette au facteur de risque (S_k) telle que précisée à l'article 325 *novodecies* du règlement (UE) nº 575/2013. Si les établissements ont obtenu de leur autorité compétente, en vertu de l'article 325 *unvicies*, paragraphe 5, dudit règlement, l'autorisation d'utiliser d'autres définitions des sensibilités au risque delta, ils se réfèrent à ces autres définitions pour leur déclaration. — à la composante risque vega de la méthode des sensibilités, indiquer la sensibilité vega d'une option à un facteur de risque donné (S_k) telle que précisée à l'article 325 vicies du règlement (UE) nº 575/2013. Si les établissements ont obtenu de leur autorité compétente, en vertu de l'article 325 unvicies, paragraphe 6, dudit règlement, l'autorisation d'utiliser d'autres modes de calcul des sensibilités vega, ils se réfèrent à ceux-ci pour leur déclaration. Que l'établissement utilise la définition de l'article 325 *vicies*, ou un autre calcul en vertu de l'article 325 *unvicies*, paragraphe 6, dudit règlement, cette sensibilité est indiquée après pondération par la volatilité implicite correspondante. — à la composante risque de courbure de la méthode des sensibilités, indiquer la position nette de risque de courbure haussier de ce facteur de risque (CVR_k^+) ou la position nette de risque de courbure baissier de ce facteur de risque (CVR_k^-), telle que précisée à l'article 325 *octies* du règlement (UE) nº 575/2013. Le chiffre déclaré est exprimé sous la forme d'une valeur décimale, avec une précision minimale de deux chiffres après la virgule. Une valeur zéro n'est à inscrire que si le résultat du calcul est effectivement zéro.
0060	Monnaie de déclaration		Indiquer la monnaie de déclaration de l'établissement (la valeur déclarée doit suivre la désignation des monnaies selon la norme ISO 4217).

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0070	Sensibilité au risque (résultats dans la monnaie de l'instrument déterminée par l'ABE)	Annexe V, section 2, du présent règlement et article 325 *quinquies*, point 2), et articles 325 *octies*, 325 *novodecies* et 325 *vicies* du règlement (UE) nº 575/2013	Les valeurs doivent être déclarées conformément aux instructions relatives à la colonne 0050, mais converties au taux de change au comptant de la BCE associé à la monnaie de l'instrument, telle que définie à l'annexe V, section 2, du présent règlement.
0080	Modèle de tarification	Article 325 *unvicies* du règlement (UE) nº 575/2013	L'établissement précise quel modèle de tarification est appliqué pour dériver les sensibilités. L'un des éléments suivants doit être indiqué: a) "Modèles de tarification de l'établissement qui servent de base aux déclarations des profits et pertes à la direction générale" [conformément à l'article 325 *unvicies*, paragraphe 1, premier alinéa, du règlement (UE) nº 575/2013] b) "Approche fondée sur les modèles internes de l'établissement" [conformément à l'article 325 *unvicies*, paragraphe 1, deuxième alinéa, dudit règlement].
0090	Définition des sensibilités	Article 325 *novodecies*, 325 *vicies* et 325 *unvicies* du règlement (UE) nº 575/2013	L'établissement précise quelle définition des sensibilités il utilise dans le calcul de ses exigences de fonds propres. L'un des éléments suivants doit être indiqué: a) "Définition des sensibilités au sens des articles 325 *novodecies* et 325 *vicies* du règlement (UE) nº 575/2013"; b) "Définition des sensibilités conformément à l'article 325 *unvicies*, paragraphes 5 et 6, du règlement (UE) nº 575/2013"; lorsque l'identifiant de facteur de risque sélectionné dans la colonne 0010 correspond à la composante risque de courbure de la méthode des sensibilités, indiquer la valeur visée au point b) si l'une au moins des sensibilités utilisées pour calculer la position de risque de courbure déclarée est basée sur une définition des sensibilités conformément à l'article 325 unvicies, paragraphes 5 et 6, du règlement (UE) nº 575/2013, et la valeur visée au point a) dans tous les autres cas.
0100	Zone de texte libre		Dans cette colonne, l'établissement peut fournir des informations supplémentaires concernant le modèle de tarification et la définition des sensibilités utilisés.
0110	Identifiant supplémentaire 2	Article 325 *septdecies*, paragraphe 2, du règlement (UE) nº 575/2013	Lorsque l'identifiant de facteur de risque sélectionné dans la colonne 0010 correspond à la catégorie Risque sur matières premières et à la composante Risque delta de la méthode des sensibilités, indiquer l'ensemble des conditions juridiques concernant le lieu de livraison, ou un autre identifiant unique correspondant. Dans tous les autres cas, les établissements indiquent une valeur explicite (NULL) comme non applicable.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0120	Catégorie de qualité de crédit	Article 325 *quaterdecies*, paragraphe 1, et article 325 *quintricies*, paragraphe 1, du règlement (UE) nº 575/2013	Lorsque l'identifiant de facteur de risque sélectionné dans la colonne 0010 correspond à la catégorie risque d'écart de crédit sur expositions hors titrisation et à la composante risque delta de la méthode des sensibilités, indiquer une réponse parmi les suivantes: a) "EQC 1"; b) "EQC 2"; c) "EQC 3"; d) "EQC 4"; e) "EQC 5"; f) "EQC 6"; g) "Pas d'EQC (non noté)". Dans tous les autres cas, les établissements indiquent une valeur explicite (NULL) comme non applicable.

C 107.01 - VaR et sVaR hors portefeuille de négociation en corrélation (non-CTP). Description détaillée

Ligne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0010 – 0060	Valeur en risque (VaR)		
0010	Méthode		L'un des éléments suivants doit être indiqué à la colonne 0010: a) Simulation historique; b) Simulation Monte Carlo; c) Méthode paramétrique; d) Combinaison/ autre méthode (veuillez préciser). L'établissement doit utiliser la colonne 0020 pour clarifier la réponse donnée à la colonne 0010. Si l'option d) a été choisie à la colonne 0010, l'établissement doit donner des précisions dans la colonne 0020.
0020	Calcul à un horizon de 10 jours	Article 365, paragraphe 1, du règlement (UE) nº 575/2013	L'un des éléments suivants doit être indiqué à la colonne 0010: a) 1 jour porté à 10 jours; b) 10 jours avec périodes de chevauchement; c) 10 jours avec une autre méthode. L'établissement doit utiliser la colonne 0020 pour clarifier la réponse donnée à la colonne 0010.
0030	Durée de la période d'observation	Article 365, paragraphe 1, point d), du règlement (UE) nº 575/2013	L'un des éléments suivants doit être indiqué à la colonne 0010: a) Inférieure ou égale à 1 an; b) Supérieure à 1 an et inférieure ou égale à 2 ans; c) Supérieure à 2 ans et inférieure ou égale à 3 ans; d) Supérieure à 3 ans. L'établissement doit utiliser la colonne 0020 pour clarifier la réponse donnée à la colonne 0010.

Ligne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0040	Pondération des données	Article 365, paragraphe 1, point d), du règlement (UE) nº 575/2013	L'un des éléments suivants doit être indiqué à la colonne 0010: a) Sans pondération (pondération données VaR); b) Avec pondération (pondération données VaR); c) Mesure la plus élevée entre avec pondération et sans pondération (pondération données VaR) aux points a) et b). L'établissement doit utiliser la colonne 0020 pour clarifier la réponse donnée à la colonne 0010.
0050	Cumulateur lié aux contrôles a posteriori	Article 366, paragraphe 2, du règlement (UE) nº 575/2013	Par cumulateur lié aux contrôles a posteriori, on entend le cumulateur compris entre 0 et 1 prévu à l'article 366, paragraphe 2, tableau 1, du règlement (UE) nº 575/2013. L'établissement doit utiliser la colonne 0020 pour clarifier la réponse donnée à la colonne 0010.
0060	Cumulateur réglementaire pour la VaR	Article 366, paragraphe 2, du règlement (UE) nº 575/2013 ("3, au minimum");	Par cumulateur réglementaire pour la VaR, on entend la charge supplémentaire imposée par l'autorité compétente en ce qui concerne le facteur de multiplication pour la VaR (3, au minimum) conformément à l'article 366, paragraphe 2, du règlement (UE) nº 575/2013. Le cumulateur réglementaire pour la VaR est la somme du cumulateur lié aux contrôles a posteriori et du cumulateur qualitatif, le cas échéant, en dépassement de 3. L'établissement doit utiliser la colonne 0020 pour clarifier la réponse donnée à la colonne 0010.
0070 – 0100	SVaR (c'est-à-dire VaR en situation de tensions)		
0070	Méthode		L'un des éléments suivants doit être indiqué à la colonne 0010: a) Simulation historique; b) Simulation Monte Carlo; c) Méthode paramétrique; d) Combinaison/ autre méthode (veuillez préciser). L'établissement doit utiliser la colonne 0020 pour clarifier la réponse donnée à la colonne 0010. Si l'option d) a été choisie à la colonne 0010, l'établissement doit donner des précisions dans la colonne 0020.
0080	Calcul à un horizon de 10 jours	Article 365, paragraphe 1, du règlement (UE) nº 575/2013,	L'un des éléments suivants doit être indiqué à la colonne 0010: a) 1 jour porté à 10 jours; b) 10 jours avec périodes de chevauchement; c) 10 jours avec une autre méthode. L'établissement doit utiliser la colonne 0020 pour clarifier la réponse donnée à la colonne 0010.
0090	Cumulateur réglementaire pour la sVaR	Article 366, paragraphe 2, du règlement (UE) nº 575/2013,	Par cumulateur réglementaire, on entend la charge supplémentaire imposée par l'autorité compétente en ce qui concerne le facteur de multiplication pour la sVaR (3, au minimum) conformément à l'article 366, paragraphe 2, du règlement (UE) nº 575/2013. Le cumulateur réglementaire est la somme de 3, du cumulateur lié aux contrôles a posteriori et du cumulateur qualitatif (le cas échéant).

Ligne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
			L'établissement doit utiliser la colonne 0020 pour clarifier la réponse donnée à la colonne 0010.
0100	Période pour la sVaR	Article 365, paragraphe 2, du règlement (UE) n° 575/2013	L'un des éléments suivants doit être indiqué à la colonne 0010: a) Calcul quotidien de la VaR en situation de tensions calibré pour une période continue de 12 mois commençant à la date indiquée dans la colonne 0020; b) Calcul hebdomadaire de la VaR en situation de tensions calibré pour une période continue de 12 mois commençant à la date indiquée dans la colonne 0020; c) Calcul quotidien de la VaR en situation de tensions calibré pour différentes périodes continues de 12 mois dans le cadre des dates de déclaration de la VaR en situation de tensions indiquées dans la colonne 0010 du modèle C 107.02, commençant aux dates indiquées dans la colonne 0020; d) Calcul hebdomadaire de la VaR en situation de tensions calibré pour différentes périodes continues de 12 mois dans le cadre des dates de déclaration de la VaR en situation de tensions indiquées dans la colonne 0010 du modèle C 107.02, commençant aux dates indiquées à la colonne 0020; e) Maximum des calculs quotidiens de la VaR en situation de tensions calibrés pour plus d'une période de 12 mois; f) Maximum des calculs hebdomadaires de la VaR en situation de tensions calibrés pour plus d'une période de 12 mois; g) Autres choix pour le calibrage de la VaR en situation de tensions (veuillez préciser). L'établissement doit utiliser la colonne 0020 pour fournir la date de début au format "jj/mm/aaaa" dans le cas où l'option a) ou b) a été indiquée à la colonne 0010 et les dates de début au format "jj/mm/aaaa" utilisées pour chaque calcul de la VaR en situation de tensions dans le cas où l'option c) ou d) a été indiquée à la colonne 0010. L'établissement doit également utiliser la colonne 0020 pour clarifier la période de 12 mois utilisée pour chaque calcul de la VaR en situation de tensions dans le cas où l'option e), f) ou g) est indiquée à la colonne 0010.

C 107.02 — VaR, sVaR et VA — Hors portefeuille de négociation en corrélation (non-CTP). Résultats dans la monnaie du portefeuille ABE

Instructions relatives aux feuilles (axe des z)

Dénomination	Référence juridique	Instructions
Portefeuille	Sections 3, 4 et 5 de l'annexe V	Le numéro du portefeuille tiré de l'annexe V doit être indiqué.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0010	Date		Les résultats pour les valeurs VaR, sVaR et VA (valeur actuelle) sont indiqués pour chacun des 10 jours ouvrables entre la "date de référence initiale des MR" et la "date de référence finale des MR (et de l'ASA)" telles que précisées à l'annexe V, section 1, point b). La convention "jj/mm/aaaa" sera suivie pour la déclaration des dates.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0020	Valeur en risque (VaR)	Article 365 du règlement (UE) nº 575/2013	La VaR réglementaire à 10 jours obtenue pour chacun des portefeuilles, sans application du facteur de multiplication réglementaire "3 au minimum", doit être indiquée. Les chiffres doivent être indiqués pour chacune des dates indiquées dans la colonne 0010. La cellule doit être laissée vierge si l'établissement ne calcule pas de VaR à la date indiquée dans la colonne 0010 (c.-à-d. qu'une valeur zéro n'est à inscrire que si le résultat du calcul est zéro).
0030	Valeur en risque en situation de tension (sVaR)	Article 365 du règlement (UE) nº 575/2013	La sVaR réglementaire à 10 jours obtenue pour chacun des portefeuilles, sans application du facteur de multiplication réglementaire "3, au minimum", doit être indiquée. Les chiffres doivent être indiqués pour chacune des dates indiquées dans la colonne 0010. La cellule doit être laissée vierge si l'établissement ne calcule pas de sVaR à la date indiquée dans la colonne 0010 (c.-à-d. qu'une valeur zéro n'est à inscrire que si le résultat du calcul est zéro).
0040	VA		Indiquer la valeur actuelle (VA) pour chaque portefeuille. Les chiffres doivent être indiqués pour chacune des dates indiquées dans la colonne 0010. La cellule doit être laissée vierge si l'établissement ne calcule pas de VA à la date indiquée dans la colonne 0010 (c.-à-d. qu'une valeur zéro n'est à inscrire que si le résultat du calcul est zéro).

C 108.00 — Séries chronologiques profits et pertes (P&L)

Le modèle C 108.00 ("Séries chronologiques profits et pertes") n'est à remplir que par les établissements qui calculent la VaR à l'aide d'une simulation historique.

Instructions relatives aux feuilles (axe des z)

Dénomination	Référence juridique	Instructions
Portefeuille	Sections 3, 4 et 5 de l'annexe V	Le numéro du portefeuille tiré de l'annexe V doit être indiqué.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0010	Date	Article 365, paragraphe 1, point d), du règlement (UE) nº 575/2013	Chaque jour ouvrable, déterminé conformément au calendrier utilisé dans le pays de l'établissement, les établissements fournissent la série de données P&L utilisée pour calculer la VaR dans C107.02, colonne 0010, en remontant dans le temps à partir de la "date de référence finale des MR (et de l'ASA)", telle que précisée à l'annexe V, section 1, point b), v), avec un minimum de 250 observations.
0020	P&L quotidien		Les établissements qui calculent la VaR à l'aide d'une simulation historique indiquent l'intégralité de la série de données historiques utilisée par l'établissement, qui doit être d'une durée minimale d'un an, avec la variation de la valorisation du portefeuille (P&L quotidien) produite en utilisant la simulation historique des changements des facteurs de risque quotidiens (la série de P&L quotidiens utilisée pour en dériver la VaR réglementaire à 1 jour).

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
			Au cas où le jour concerné est un jour férié dans le pays en question, cette cellule doit être laissée vierge (un P&L de valeur zéro ne doit être indiqué que si aucune variation de la valeur hypothétique du portefeuille ne s'est produite un jour ouvrable donné).

C 109.01 — Exigence de fonds propres pour risques supplémentaires (IRC). Description détaillée du modèle

Ligne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0010	Nombre de facteurs de modélisation		Orientations EBA/GL/2012/3 Le nombre de facteurs de modélisation pour l'ensemble du modèle IRC doit être indiqué. La réponse sera l'une des suivantes: a) 1 facteur de modélisation; b) 2 facteurs de modélisation; c) plus de 2 facteurs de modélisation. L'établissement doit utiliser la colonne 0020 pour clarifier la réponse donnée à la colonne 0010.
0020	Source des LGD		Orientations EBA/GL/2012/3 La source des LGD pour l'ensemble du modèle IRC doit être indiquée. La réponse sera l'une des suivantes: a) Convention de marché; b) LGD utilisées dans l'approche NI; c) Autre source des LGD (veuillez préciser). L'établissement doit utiliser la colonne 0020 pour clarifier la réponse donnée à la colonne 0010. Si l'option c) a été choisie à la colonne 0010, l'établissement doit donner des détails dans cette colonne.

C 109.02 — Exigence de fonds propres pour risques supplémentaires (IRC). Description détaillée par portefeuille

Instructions relatives aux feuilles (axe des z)

Dénomination	Référence juridique	Instructions
Portefeuille	Sections 3, 4 et 5 de l'annexe V	Indiquer le numéro du portefeuille tiré de l'annexe V, uniquement pour les portefeuilles pour lesquels l'IRC est requise.

Ligne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0010	Horizon de liquidité	Article 374, paragraphe 5, du règlement (UE) nº 575/2013	Orientations EBA/GL/2012/3 Indiquer l'horizon de liquidité appliqué au niveau du portefeuille. La réponse sera l'une des suivantes: a) Inférieur ou égal à 3 mois; b) Supérieur à 3 mois et inférieur ou égal à 6 mois; c) Supérieur à 6 mois et inférieur ou égal à 9 mois; d) Supérieur à 9 mois et inférieur ou égal à 12 mois.
0020	Source des PD		Orientations EBA/GL/2012/3 Indiquer la source des PD appliquées au niveau du portefeuille. La réponse sera l'une des suivantes: a) Agences de notation; b) Approche NI; c) PD suggérées par le marché; d) Autre source des PD (veuillez préciser). L'établissement doit utiliser la colonne 0020 pour clarifier la réponse donnée à la colonne 0010. Si l'option d) a été choisie à la colonne 0010, l'établissement doit donner des précisions dans la présente colonne 0020.
0030	Source des matrices de transition		Orientations EBA/GL/2012/3 Indiquer la source des matrices de transition appliquées au niveau du portefeuille. La réponse sera l'une des suivantes: a) Agences de notation; b) Approche NI; c) Matrices de transition suggérées par le marché; d) Autre source des matrices de transition (veuillez préciser). L'établissement doit utiliser la colonne 0020 pour clarifier la réponse donnée à la colonne 0010. Si l'option d) a été choisie à la colonne 0010, l'établissement doit donner des précisions dans la présente colonne 0020.

C 109.03 - Exigence de fonds propres pour risques supplémentaires (IRC). Montant par portefeuille/date

Instructions relatives aux feuilles (axe des z)

Dénomination	Référence juridique	Instructions
Portefeuille	Sections 3, 4 et 5 de l'annexe V	Indiquer le numéro du portefeuille tiré de l'annexe V, uniquement pour les portefeuilles pour lesquels l'IRC est requise.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0010	Date		L'IRC (exigence de fonds propres pour risques supplémentaires est indiquée pour chacun des 10 jours ouvrables entre la "date de référence initiale des MR" et la "date de référence finale des MR (et de l'ASA)" telles que précisées à l'annexe V, section 1, point b). La convention "jj/mm/aaaa" sera suivie pour la déclaration des dates.
0020	IRC	Articles 372 à 376 du règlement (UE) nº 575/2013	Orientations EBA/GL/2012/3 L'IRC réglementaire obtenue pour chacun des portefeuilles doit être indiquée. Les chiffres doivent être indiqués pour chacune des dates indiquées dans la colonne 0010. La cellule doit être laissée vierge si l'établissement ne calcule pas d'IRC à la date indiquée dans la colonne 0010 (c.-à-d. qu'une valeur zéro n'est à inscrire que si le résultat du calcul est zéro).

C 110.01 — Négociation en corrélation. Description détaillée du modèle

Ligne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0010	Nombre de facteurs de modélisation	Article 377 du règlement (UE) nº 575/2013	Le nombre de facteurs de modélisation pour l'ensemble du modèle de négociation en corrélation doit être indiqué. La réponse sera l'une des suivantes: a) 1 facteur de modélisation; b) 2 facteurs de modélisation; c) plus de 2 facteurs de modélisation. L'établissement doit utiliser la colonne 0020 pour clarifier la réponse donnée à la colonne 0010.
0020	Source des LGD	Article 377 du règlement (UE) nº 575/2013	Indiquer la source des LGD pour l'ensemble du modèle de négociation en corrélation. La réponse sera l'une des suivantes: a) Convention de marché; b) LGD utilisées dans l'approche NI; c) Autres sources des LGD (veuillez préciser). L'établissement doit utiliser la colonne 0020 pour clarifier la réponse donnée à la colonne 0010. Si l'option c) a été choisie à la colonne 0010, l'établissement doit donner des détails dans cette colonne.

C 110.02 — Négociation en corrélation. Description détaillée par portefeuille.

Instructions relatives aux feuilles (axe des z)

Dénomination	Référence juridique	Instructions
Portefeuille	Sections 3, 4 et 5 de l'annexe V	Indiquer le numéro du portefeuille tiré de l'annexe V, uniquement pour les portefeuilles pour lesquels l'APR est requis.

Ligne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0010	Horizon de liquidité	Article 377, paragraphe 2, du règlement (UE) nº 575/2013	Indiquer l'horizon de liquidité appliqué au niveau du portefeuille. La réponse sera l'une des suivantes: a) Inférieur ou égal à 3 mois; b) Supérieur à 3 mois et inférieur ou égal à 6 mois; c) Supérieur à 6 mois et inférieur ou égal à 9 mois; d) Supérieur à 9 mois et inférieur ou égal à 12 mois.
0020	Source des PD	Article 377 du règlement (UE) nº 575/2013	Indiquer la source des PD appliquées au niveau du portefeuille. La réponse sera l'une des suivantes: a) Agences de notation; b) Approche NI; c) PD suggérées par le marché; d) Autre source des PD (veuillez préciser). L'établissement doit utiliser la colonne 0020 pour clarifier la réponse donnée à la colonne 0010. Si l'option d) a été choisie à la colonne 0010, l'établissement doit donner des précisions dans la colonne 0020.
0030	Source des matrices de transition	Article 377 du règlement (UE) nº 575/2013	Indiquer la source des matrices de transition appliquées au niveau du portefeuille. La réponse sera l'une des suivantes: a) Agences de notation; b) Approche NI; c) Matrices de transition suggérées par le marché; d) Autre source des matrices de transition (veuillez préciser). L'établissement doit utiliser la colonne 0020 pour clarifier la réponse donnée à la colonne 0010. Si l'option d) a été choisie à la colonne 0010, l'établissement doit donner des précisions dans la colonne 0020.

C 110.03 — Négociation en corrélation. Risque de prix total (APR) par portefeuille/date

Instructions relatives aux feuilles (axe des z)

Dénomination	Référence juridique	Instructions
Portefeuille	Sections 3, 4 et 5 de l'annexe V	Indiquer le numéro du portefeuille tiré de l'annexe V, uniquement pour les portefeuilles pour lesquels l'APR est requis.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0010	Date	Article 377 du règlement (UE) nº 575/2013	Le risque de prix total (APR) est indiqué pour chacun des 10 jours ouvrables entre la "date de référence initiale des MR" et la "date de référence finale des MR (et de l'ASA)" [telles que précisées à l'annexe V, section 1, point b)]. La convention "jj/mm/aaaa" sera suivie pour la déclaration des dates.
0060	APR	Article 377 du règlement (UE) nº 575/2013	Indiquer les résultats obtenus en appliquant le modèle réglementaire de négociation en corrélation à chacun des portefeuilles. Les chiffres doivent être indiqués pour chacune des dates indiquées dans la colonne 0010. La cellule doit être laissée vierge si l'établissement n'utilise pas de modèle de négociation en corrélation à la date indiquée dans la colonne 0010 (c.-à-d. qu'une valeur zéro n'est à inscrire que si le résultat du calcul est zéro).

C 120.01 — Méthode des sensibilités (SBM). SENSIBILITÉS AU RISQUE PAR INSTRUMENT/PORTEFEUILLE

L'établissement déclare, instrument par instrument, les sensibilités aux facteurs de risque auxquels l'instrument est exposé. Une ligne est utilisée par facteur de risque/sensibilité. La position nette de risque de courbure haussier de ce facteur de risque (CVRk+) ou la position nette de risque de courbure baissier de ce facteur de risque (CVRk-), telle que précisée à l'article 325 *octies* du règlement (UE) nº 575/2013, est indiquée à chaque ligne. Toutes les valeurs se réfèrent à la "date de référence finale des MR (et de l'ASA)" [telle que précisée à l'annexe V, section 1, point b), v), du présent règlement]. L'établissement ne déclare chaque combinaison de portefeuille, numéro de l'instrument (colonne 0010), identifiant de risque (colonne 0020), classe (colonne 0030) et identifiant supplémentaire (colonne 0040) qu'une seule fois.

Instructions relatives aux feuilles (axe des z)

Dénomination	Référence juridique	Instructions
Portefeuille	Sections 3, 4 et 5 de l'annexe V	Indiquer le numéro du portefeuille tiré de l'annexe V.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0010	Numéro de l'instrument	Annexe V, section 2	Le numéro de l'instrument tiré de l'annexe V doit être indiqué.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0020	Identifiant du facteur de risque	Articles 325 *terdecies*, 325 *quaterdecies*, 325 *quindecies*, 325 *sexdecies*, 325 *septdecies* et 325 *octodecies* du règlement (UE) nº 575/2013	L'identifiant du facteur de risque, tel que précisé dans le tableau figurant à la fin de la présente annexe, doit être indiqué.
0030	Classe	Article 325 *quinquies*, point 3), du règlement (UE) nº 575/2013	La classe doit être indiquée, lorsque l'identifiant du facteur de risque sélectionné dans la colonne 0020 correspond à la catégorie de risque: — risque de taux d'intérêt global. Donner le nom de la monnaie du facteur de risque correspondant à un taux sans risque, du facteur de risque d'inflation ou du facteur de risque d'écart de taux entre monnaies pertinent (en utilisant la désignation des monnaies selon la norme ISO 4217, par exemple "EUR"); — risque d'écart de crédit (CSR) sur expositions hors titrisation. Donner le numéro de classe indiqué à l'article 325 *quintricies*, paragraphe 1, tableau 4, du règlement (UE) nº 575/2013; — risque d'écart de crédit sur expositions de titrisation hors portefeuille de négociation en corrélation alternatif (non-ACTP CSR). Donner le numéro de classe indiqué à l'article 325 *quadragies*, paragraphe 1, tableau 7, dudit règlement. — risque d'écart de crédit sur expositions de titrisation du portefeuille de négociation en corrélation alternatif (ACTP CSR). Donner le numéro de classe indiqué à l'article 325 *octotricies*, tableau 6, dudit règlement; — risque sur actions. Donner le numéro de classe indiqué à l'article 325 *terquadragies*, paragraphe 1, tableau 8, dudit règlement; — risque sur matières premières. Donner le numéro de classe indiqué à l'article 325 *sexquadragies*, tableau 9, dudit règlement. — risque de change et composantes delta ou courbure. Donner le nom de la monnaie (par exemple "USD"; les codes monnaie déclarés doivent suivre la désignation des monnaies selon la norme ISO 4217); — risque de change et composante vega. Donner le nom de la paire de devises (par exemple "EUR_USD"; les codes monnaie déclarés doivent suivre la désignation des monnaies selon la norme ISO 4217).
0040	Identifiant supplémentaire 1	Articles 325 *terdecies*, 325 *octodecies* et 325 *sextricies* du règlement (UE) nº 575/2013	Les informations ci-dessous, permettant de distinguer le facteur de risque au niveau intra-classe, doivent être déclarées. Lorsque l'identifiant du facteur de risque sélectionné dans la colonne 0020 correspond à la catégorie de risque: — risque de taux d'intérêt global et composante delta, donner le nom de la courbe sans risque ou un autre identifiant unique correspondant; — risque d'écart de crédit sur expositions hors titrisation, ou risque d'écart de crédit sur expositions de titrisation du portefeuille de négociation en corrélation alternatif (ACTP CSR); indiquer le nom de l'émetteur ou un autre identifiant unique correspondant; cette valeur doit être identique pour toute paire de sensibilités déclarées à deux facteurs de risque qui reçoit un coefficient de corrélation $\rho_{kl}^{(nom)}$ égal à 1 conformément à l'article 325 *sextricies*, paragraphe 1, du règlement (UE) nº 575/2013. — risque d'écart de crédit sur expositions de titrisation hors portefeuille de négociation en corrélation alternatif (non-ACTP CSR); indiquer le nom de la tranche ou un autre identifiant unique correspondant; — risque sur actions, donner le nom de l'émetteur des actions ou un autre identifiant unique correspondant;

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
			— risque sur matières premières, donner le nom de la matière première ou un autre identifiant unique correspondant. Dans tous les autres cas, les établissements indiquent une valeur explicite (NULL) comme non applicable.
0060	Sensibilité au risque (résultats dans la monnaie de déclaration)	Article 325 *quinquies*, point 2), et articles 325 *octies*, 325 *novodecies*, 325 *vicies*, 325 *unvicies* et 325 *unquinquagies* du règlement (UE) nº 575/2013	Les sensibilités au risque (sensibilités delta / vega et positions de risque de courbure) doivent être indiquées au niveau de chaque instrument pour tous les facteurs de risque pertinents tels que précisés dans les colonnes 0020 à 0040. Les valeurs doivent être déclarées dans la monnaie de déclaration de l'établissement. Lorsque l'identifiant du facteur de risque sélectionné dans la colonne 0020 correspond: — à la composante risque delta de la méthode des sensibilités, indiquer la sensibilité nette au facteur de risque (S_k) telle que précisée à l'article 325 *novodecies* du règlement (UE) nº 575/2013 Si les établissements ont obtenu de leur autorité compétente, en vertu de l'article 325 *unvicies*, paragraphe 5, dudit règlement, l'autorisation d'utiliser d'autres calculs des sensibilités au risque delta, ils se réfèrent à ces autres définitions pour leur déclaration. — à la composante risque vega de la méthode des sensibilités, indiquer la sensibilité vega d'une option à un facteur de risque donné (S_k) telle que précisée à l'article 325 *vicies* du règlement (UE) nº 575/2013. Si les établissements ont obtenu de leur autorité compétente, en vertu de l'article 325 *unvicies*, paragraphe 6, dudit règlement, l'autorisation d'utiliser d'autres modes de calcul des sensibilités vega, ils se réfèrent à ceux-ci pour leur déclaration. Que l'établissement effectue le calcul prévu à l'article 325 *vicies*, ou qu'il utilise un autre mode de calcul en vertu de l'article 325 *unvicies*, paragraphe 6, dudit règlement, cette sensibilité est indiquée après pondération par la volatilité implicite correspondante. — à la composante risque de courbure de la méthode des sensibilités, indiquer la position nette de risque de courbure haussier de ce facteur de risque (CVR_k^+) ou la position nette de risque de courbure baissier de ce facteur de risque (CVR_k^-), telle que précisée à l'article 325 *octies* du règlement (UE) nº 575/2013. Le chiffre déclaré est exprimé sous la forme d'une valeur décimale, avec une précision minimale de deux chiffres après la virgule. Une valeur zéro n'est à inscrire que si le résultat du calcul est effectivement zéro.
0070	Monnaie de déclaration		Indiquer le nom de la monnaie de déclaration de l'établissement (la valeur déclarée doit suivre la désignation des monnaies selon la norme ISO 4217).
0080	Sensibilité au risque (résultats dans la monnaie du portefeuille ABE)	Annexe V, sections 3 et 4, du présent règlement et Article 325 *quinquies*, point 2), et articles 325 *octies*, 325 *novodecies*, 325 *vicies*, 325 *unvicies* et 325 *unquinquagies* du règlement (UE) nº 575/2013	Les valeurs doivent être déclarées conformément aux instructions relatives à la colonne 0060, mais converties au taux de change au comptant de la BCE associé à la monnaie du portefeuille, telle que définie à l'annexe V, sections 3 et 4, du présent règlement.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0090	Pondération de risque	Troisième partie, titre IV, chapitre 1 *bis*, section 6, du règlement (UE) nº 575/2013	Indiquer la pondération de risque correspondant au facteur de risque précisé dans les colonnes 0020 à 0040. Lorsque l'identifiant de facteur de risque sélectionné dans la colonne 0020 correspond à la composante "risque de courbure", indiquer la pondération de risque utilisée pour déterminer la variation applicable. Le chiffre déclaré est exprimé sous la forme d'une valeur décimale avec une précision minimale de quatre chiffres après la virgule.
0110	Identifiant supplémentaire 2	Article 325 *septdecies*, paragraphe 2, du règlement (UE) nº 575/2013	Lorsque l'identifiant de facteur de risque sélectionné dans la colonne 0010 correspond à la catégorie Risque sur matières premières et à la composante Risque delta de la méthode des sensibilités, indiquer l'ensemble des conditions juridiques concernant le lieu de livraison, ou un autre identifiant unique correspondant. Dans tous les autres cas, les établissements indiquent une valeur explicite (NULL) comme non applicable.
0120	Catégorie de qualité de crédit	Article 325 *quaterdecies*, paragraphe 1, et article 325 *quintricies*, paragraphe 1, du règlement (UE) nº 575/2013	Lorsque l'identifiant de facteur de risque sélectionné dans la colonne 0010 correspond à la catégorie risque d'écart de crédit sur expositions hors titrisation et à la composante risque delta de la méthode des sensibilités, indiquer une réponse parmi les suivantes: a) "EQC 1"; b) "EQC 2"; c) "EQC 3"; d) "EQC 4"; e) "EQC 5"; f) "EQC 6"; g) "Pas d'EQC (non noté)". Dans tous les autres cas, les établissements indiquent une valeur explicite (NULL) comme non applicable.

C 120.02 — Méthode des sensibilités (SBM). COMPOSITION DES EXIGENCES DE FONDS PROPRES (OFR) PAR PORTEFEUILLE

Instructions relatives aux feuilles (axe des z)

Dénomination	Référence juridique	Instructions
Portefeuille	Sections 3, 4 et 5 de l'annexe V	Indiquer le numéro du portefeuille tiré de l'annexe V.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0010	Catégorie de risque	Article 325 *quinquies*, point 1), du règlement (UE) nº 575/2013	Indiquer la catégorie de risque. La réponse sera l'une des suivantes: a) "Risque de taux d'intérêt global (RTG)"; b) "Risque d'écart de crédit.CSR sur expositions hors titrisation" (risque d'écart de crédit sur expositions hors titrisation); c) "Risque d'écart de crédit. Non-ACTP CSR" (risque d'écart de crédit sur expositions de titrisation hors portefeuille de négociation en corrélation alternatif); d) "Risque d'écart de crédit. ACTP CSR" (risque d'écart de crédit sur expositions de titrisation du portefeuille de négociation en corrélation alternatif); e) "Risque sur actions"; f) "Risque sur matières premières"; g) "Risque de change".
0020	Composante	Article 325 *sexies*, paragraphe 1, du règlement (UE) nº 575/2013	Indiquer la composante de la méthode des sensibilités. La réponse sera l'une des suivantes: a) "Risque delta"; b) "Risque vega"; c) "Risque de courbure".
0030	Scénario à corrélations	Article 325 *nonies* du règlement (UE) nº 575/2013	Indiquer le scénario à corrélations. La réponse sera l'une des suivantes: a) "Scénario à corrélations moyennes"; b) "Scénario à corrélations fortes"; c) "Scénario à corrélations faibles".
0040	Exigences de fonds propres (résultats dans la monnaie de déclaration)	Article 325 *nonies* du règlement (UE) nº 575/2013	Les valeurs des exigences de fonds propres doivent être déclarées pour la "date de référence finale des MR (et de l'ASA)" [telle que précisée à l'annexe V, section 1, point b), du présent règlement] pour chaque portefeuille et pour toutes les combinaisons pertinentes de catégorie de risque, composante et scénario à corrélations. Les valeurs doivent être déclarées dans la monnaie de déclaration de l'établissement et sont exprimées avec une précision minimale de deux chiffres après la virgule décimale.
0050	Monnaie de déclaration		Indiquer la monnaie de déclaration de l'établissement (la valeur déclarée suit la désignation des monnaies selon la norme ISO 4217).
0060	Exigences de fonds propres (résultats dans la monnaie du portefeuille ABE)	Annexe V, sections 3 et 4, du présent règlement et article 325 *nonies* du règlement (UE) nº 575/2013	Les valeurs doivent être déclarées conformément aux instructions relatives à la colonne 0040, mais converties au taux de change au comptant de la BCE associé à la monnaie du portefeuille, telle que définie à l'annexe V, sections 3 et 4, du présent règlement.
0070	Positions sans option soumises à des exigences de fonds propres pour le risque de courbure	Article 325 *sexies*, paragraphe 3, du règlement (UE) nº 575/2013	Lorsque le composant de la colonne 0020 correspond au risque de courbure: a) Indiquer "TRUE" (vrai) si l'établissement applique l'approche prévue à l'article 325 *sexies*, paragraphe 3, premier alinéa, du règlement (UE) nº 575/2013 pour calculer le résultat déclaré dans les colonnes 0040 et 0060. b) Indiquer "FALSE" dans le cas contraire. Indiquer aussi "FALSE" dans tous les autres cas.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0080	Approche fondée sur la monnaie de base appliquée pour les risques delta et de courbure du risque de change	Article 325 *octodecies*, paragraphe 7, du règlement (UE) nº 575/2013	Lorsque la catégorie de risque de la colonne 0010 correspond au risque de change et que la composante de la colonne 0020 correspond au risque delta ou au risque de courbure: a) Indiquer "TRUE" (vrai) si l'établissement applique l'approche prévue à l'article 325 *octodecies*, paragraphe 7, premier alinéa, du règlement (UE) nº 575/2013 pour calculer le résultat déclaré dans les colonnes 0040 et 0060. b) Indiquer "FALSE" dans le cas contraire. Indiquer aussi "FALSE" dans tous les autres cas.
0090	Répartition des composantes du risque de courbure pour le risque de change par scalaire	Article 325 *octodecies*, paragraphe 6, du règlement (UE) nº 575/2013	Lorsque la catégorie de risque de la colonne 0010 correspond au risque de change et que la composante de la colonne 0020 correspond au risque de courbure: a) Indiquer "TRUE" (vrai) si l'établissement applique l'approche prévue à l'article 325 *octodecies*, paragraphe 6, premier alinéa, du règlement (UE) nº 575/2013 pour calculer le résultat déclaré dans les colonnes 0040 et 0060. b) Indiquer "FALSE" dans le cas contraire. Indiquer aussi "FALSE" dans tous les autres cas.
0095	Soumission des résultats des portefeuilles de validation SBM	Article 325 *sexies*, paragraphe 1, du règlement (UE) nº 575/2013	Lorsque le portefeuille pour lequel des informations sont déclarées est un portefeuille de validation SBM tel que visé à l'annexe V, section 7: a) Indiquer "communiqué" si l'établissement soumet des résultats correspondant à ce portefeuille; b) Indiquer "Non communiqué — pas d'exposition au facteur de risque" si l'établissement choisit de ne pas soumettre de résultats pour le portefeuille de validation SBM concerné, faute d'approbation interne de la direction de l'établissement pour opérer sur des instruments qui généreraient une exposition au facteur de risque pertinent. Indiquer "Sans objet" lorsque le portefeuille pour lequel les informations sont déclarées est un portefeuille visé à l'annexe V, section 3, 4 ou 5.
0100	Zone de texte libre		L'établissement peut fournir des informations supplémentaires dans cette colonne.

C 120.04 - DRC. VALEURS DE MARCHÉ ET MONTANTS JTD BRUTS PAR INSTRUMENT/PORTEFEUILLE

Les établissements déclarent, instrument par instrument, les expositions correspondant à chaque instrument. Utiliser une ligne par exposition. Toutes les valeurs se réfèrent à la "date de référence finale des MR (et de l'ASA)" [telle que précisée à l'annexe V, section 1, point b), v), du présent règlement]. Les expositions sont déclarées avant toute compensation, mais après les étapes de réplication ou de décomposition [telles que définies aux articles 325 *septvicies* et 325 *tricies* du règlement (UE) nº 575/2013], le cas échéant.

Instructions relatives aux feuilles (axe des z)

Dénomination	Référence juridique	Instructions
Portefeuille	Sections 3, 4 et 5 de l'annexe V	Indiquer le numéro du portefeuille tiré de l'annexe V.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0010	Numéro de l'instrument	Annexe V, section 2	Le numéro de l'instrument tiré de l'annexe V doit être indiqué.
0020	Catégorie de risque	Article 325 *tervicies*, paragraphe 2, du règlement (UE) nº 575/2013	Indiquer la catégorie de risque correspondant à l'exigence pour risque de défaut (DRC) déclarée dans les colonnes 0030 et 0040. Répondre par l'un des types d'instruments suivants: a) "Instruments autres que des positions de titrisation"; b) «Positions de titrisation non incluses dans le portefeuille ACTP»; c) «Positions de titrisation incluses dans le portefeuille ACTP».
0030	Classe (bucket) 1	Article 325 *sexvicies*, paragraphe 3, article 325 *octovicies*, paragraphe 4, et article 325 *untricies*, paragraphe 2, du règlement (UE) nº 575/2013	Indiquer la classe. Si la catégorie de risque déclarée dans la colonne 0020 correspond à des expositions "hors HYPERLINK "https://lexparency.org/eu/32013R0575/ART_4/" \l "1-61"titrisation", choisir une seule des réponses suivantes: a) "Entreprises"; b) "Souverains"; c) "Administrations locales/municipalités". Si la catégorie de risque déclarée dans la colonne 0020 correspond à des «titrisations non incluses dans le portefeuille ACTP», répondre par a) ou par l'une des réponses suivantes: d) "ABCP - Asie"; e) "ABCP - Europe"; f) "ABCP - Amérique du Nord"; g) "ABCP - Reste du monde"; h) "Prêts/contrats de location automobiles - Asie"; i) "Prêts/contrats de location automobiles - Europe"; j) "Prêts/contrats de location automobiles - Amérique du Nord"; k) "Prêts/contrats de location automobiles - Reste du monde"; l) "Obligations adossées à des créances au carré (CDO au carré) - Asie"; m) "Obligations adossées à des créances au carré (CDO au carré) - Europe"; n) "Obligations adossées à des créances au carré (CDO au carré) - Amérique du Nord"; o) "Obligations adossées à des créances au carré (CDO au carré) - Reste du monde"; p) "Obligations adossées à des prêts - Asie"; q) "Obligations adossées à des prêts - Europe"; r) "Obligations adossées à des prêts - Amérique du Nord"; s) "Obligations adossées à des prêts - Reste du monde"; t) "Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales (CMBS) - Asie"; u) "Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales (CMBS) - Europe"; v) "Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales (CMBS) - Amérique du Nord"; w) "Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales (CMBS) - Reste du monde"; x) "Cartes de crédit - Asie"; y) "Cartes de crédit - Europe"; z) "Cartes de crédit - Amérique du Nord"; aa) "Cartes de crédit - Reste du monde"; bb) "Autres expositions sur la clientèle de détail - Asie"; cc) "Autres expositions sur la clientèle de détail - Europe"; dd) "Autres expositions sur la clientèle de détail - Amérique du Nord";

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
			ee) "Autres expositions sur la clientèle de détail - Reste du monde"; ff) "Autres expositions sur la clientèle de gros - Asie"; gg) "Autres expositions sur la clientèle de gros - Europe"; hh) "Autres expositions sur la clientèle de gros - Amérique du Nord"; ii) "Autres expositions sur la clientèle de gros - Reste du monde"; jj) "Titres adossés à des prêts hypothécaires résidentiels (RMBS) - Asie"; kk) "Titres adossés à des prêts hypothécaires résidentiels (RMBS) - Europe"; ll) "Titres adossés à des prêts hypothécaires résidentiels (RMBS) - Amérique du Nord"; mm) "Titres adossés à des prêts hypothécaires résidentiels (RMBS) - Reste du monde"; nn) "Petites et moyennes entreprises (PME) - Asie"; oo) "Petites et moyennes entreprises (PME) - Europe"; pp) "Petites et moyennes entreprises (PME) - Amérique du Nord"; qq) "Petites et moyennes entreprises (PME) - Reste du monde"; rr) "Prêts étudiants - Asie"; ss) "Prêts étudiants - Europe"; tt) "Prêts étudiants - Amérique du Nord"; uu) "Prêts étudiants - Reste du monde". Si la catégorie de risque déclarée dans la colonne 0020 correspond à des «titrisations incluses dans le portefeuille ACTP», répondre par «Titrisations incluses dans le portefeuille ACTP».
0040	Classe (bucket) 2	Article 325 *untricies*, paragraphe 2, du règlement (UE) nº 575/2013	Si la catégorie de risque déclarée dans la colonne 0020 correspond à des «titrisations incluses dans le portefeuille ACTP», répondre par le nom de l'indice, ou à défaut, par "NUL".
0050	Débiteur	Article 325 *tervicies*, paragraphe 2, article 325 *quinvicies*, paragraphe 1, et articles 325 *septvicies* et 325 *tricies* du règlement (UE) nº 575/2013.	Les établissements communiquent les informations relatives au débiteur. Si la catégorie de risque indiquée dans la colonne 0020 correspond: — à "Instruments autres que des positions de titrisation", répondre par le nom du débiteur; — pour "Positions de titrisation non incluses dans le portefeuille ACTP", répondre par le nom du débiteur ou par un identifiant unique désignant le panier d'actifs sous-jacents et la tranche; — pour "Positions de titrisation incluses dans le portefeuille ACTP", répondre par un identifiant unique désignant la famille de l'indice, la série et la tranche.
0060	Catégorie de qualité de crédit	Article 325 *sexvicies*, paragraphes 1 et 2, article 325 *octovicies*, paragraphe 1 et article 325 *untricies*, paragraphe 1, du règlement (UE) nº 575/2013	Les établissements déclarent la qualité de crédit. en choisissant l'une des réponses suivantes: a) "EQC 1"; b) "EQC 2"; c) "EQC 3"; d) "EQC 4"; e) "EQC 5"; f) "EQC 6"; g) "Pas d'EQC (non noté)";

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
			h) “Pas d’EQC (en défaut)”; i) “Pas d’EQC (pondération de risque de 0 %)”. Si la catégorie de risque déclarée dans la colonne 0020 correspond à des «titrisations incluses dans le portefeuille ACTP» ou à des «titrisations non incluses dans le portefeuille ACTP»choisir l’une des réponses ci-dessus ou l’une des réponses suivantes: j) “EQC 7”; k) “EQC 8”; l) “EQC 9”; m) “EQC 10”; n) “EQC 11”; o) “EQC 12”; p) “EQC 13”; q) “EQC 14”; r) “EQC 15”; s) “EQC 16”; t) “EQC 17”; u) “EQC Autre”;
0070	Pondération pour risque de défaut	Article 325 *tervicies*, paragraphe 1, point f), article 325 *sexvicies*, paragraphes 1 et 2, article 325 *octovicies*, paragraphe 1 et article 325 *untricies*, paragraphe 1, du règlement (UE) nº 575/2013	Les établissements déclarent la pondération de risque pertinente. Les pondérations de risque appliquées aux expositions de titrisation sont déclarées après la multiplication par 8 % prévue par l’article 325 octovicies, paragraphe 1, du règlement (UE) nº 575/2013.
0080	Rang	Article 325 *quatervicies*, paragraphes 3 et 6, du règlement (UE) nº 575/2013	Indiquer le rang de l’exposition. Si la catégorie de risque déclarée dans la colonne 0020 correspond à des “Instruments autres que des positions de titrisation” ou à “Positions de titrisation non incluses dans le portefeuille ACTP”, choisir l’une des réponses suivantes: a) “Instruments de capitaux propres”; b) “Instruments de dette de rang non supérieur”; c) “Instruments de dette de rang supérieur”; d) “Obligations garanties”. Dans tous les autres cas, laisser la cellule vide.
0090	Échéance	Articles 325 *quinvicies*, 325 *septvicies* et 325 *tricies* du règlement (UE) nº 575/2013	Indiquer la date d’échéance de l’exposition. Respecter la convention “jj/mm/aaaa” pour la déclaration des dates.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0100	Taux de recouvrement	Article 325 *tervicies*, paragraphe 1, point e), du règlement (UE) nº 575/2013	Les établissements déclarent le taux de recouvrement calculé par déduction de la perte en cas de défaut (LGD) applicable: taux de recouvrement = 1 – LGD. Le taux de recouvrement est exprimé sous la forme d'une valeur décimale située entre 0 et 1, avec une précision minimale de quatre chiffres après la virgule.
0110	Sens	Article 325 *tervicies*, paragraphe 1, points a) et b), du règlement (UE) nº 575/2013	Les établissements déclarent le sens de l'exposition conformément aux définitions de l'article 325 *tervicies*, paragraphe 1, points a) et b), du règlement (UE) nº 575/2013. La réponse sera l'une des suivantes: a) "Exposition courte"; b) "Exposition longue".
0120	Point d'attachement (%)	Articles 325 *octovicies* et 325 *untricies* du règlement (UE) nº 575/2013	Si l'exposition déclarée concerne une tranche, les établissements déclarent le point d'attachement de la tranche. Le chiffre déclaré est exprimé sous la forme d'une valeur décimale avec une précision minimale de quatre chiffres après la virgule.
0130	Point de détachement (%)	Articles 325 *octovicies* et 325 *untricies* du règlement (UE) nº 575/2013	Si l'exposition déclarée concerne une tranche, les établissements déclarent le point de détachement de la tranche. Le chiffre déclaré est exprimé sous la forme d'une valeur décimale avec une précision minimale de quatre chiffres après la virgule.
0140-0170	Résultats dans la monnaie de déclaration		Les valeurs sont déclarées dans la monnaie de déclaration de l'établissement et exprimées avec une précision minimale de deux chiffres après la virgule décimale.
0140	Montant notionnel	Article 325 *quatervicies*, paragraphes 1, 2 et 5, du règlement (UE) nº 575/2013	Si la catégorie de risque déclarée dans la colonne 0020 correspond à "Instruments autres que des positions de titrisation", les établissements déclarent le montant notionnel de l'instrument. La valeur correspond au terme $V_{notionnelle}$ de l'article 325 *quatervicies*, paragraphes 1 et 2, du règlement (UE) nº 575/2013 ou au terme V de l'article 325 *quatervicies*, paragraphe 5, dudit règlement, selon le type d'exposition. Ne rien indiquer dans cette cellule si aucun de ces cas ne s'applique, ou si l'établissement ne calcule pas ou n'utilise pas explicitement le montant à déclarer dans cette colonne pour estimer le montant brut pour défaut soudain (JTD).
0150	P&L + Ajustement	Article 325 *quatervicies*, paragraphes 1, 2 et 5, du règlement (UE) nº 575/2013	Les établissements déclarent la somme de P&L et de Ajustement pour chaque exposition: — Si la catégorie de risque déclarée dans la colonne 0020 correspond à "Instruments autres que des positions de titrisation" et si l'exposition déclarée est une exposition longue, les établissements déclarent la somme de $P\&L_{longue}$ et de $Ajustement_{longue}$ au sens de l'article 325 *quatervicies*, paragraphe 1, du règlement (UE) nº 575/2013. — Si la catégorie de risque déclarée dans la colonne 0020 correspond à "Instruments autres que des positions de titrisation" et si l'exposition déclarée est une exposition courte, les établissements déclarent la somme de $P\&L_{courte}$ et de $Ajustement_{courte}$ au sens de l'article 325 *quatervicies*, paragraphe 2, dudit règlement.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
			Ne rien indiquer dans cette cellule si aucun de ces cas ne s'applique, ou si l'établissement ne calcule pas ou n'utilise pas explicitement le montant à déclarer dans cette colonne pour estimer le montant JTD brut.
0160	Montant JTD brut	Article 325 *tervicies*, paragraphe 1, point c), article 325 *quatervicies*, paragraphes 1, 2 et 5, article 325 *septvicies*, paragraphe 1 et article 325 *tricies*, paragraphe 2, du règlement (UE) nº 575/2013	Les établissements déclarent le montant brut JTD pour l'exposition concernée.
0170	Monnaie		Indiquer la monnaie de déclaration de l'établissement (la valeur déclarée suit la désignation des monnaies selon la norme ISO 4217).
0180-0200	Résultats dans la monnaie du portefeuille ABE	Annexe V, sections 3 et 4, du présent règlement et articles 325 *sexvicies*, 325 *octovicies* et 325 *untricies* du règlement (UE) nº 575/2013	Les valeurs doivent être déclarées conformément aux instructions relatives à la colonne 0030, mais converties au taux de change au comptant de la BCE associé à la monnaie du portefeuille, telle que définie à l'annexe V, sections 3 et 4, du présent règlement.
0180	Montant notionnel	Article 325 *quatervicies*, paragraphes 1, 2 et 5, du règlement (UE) nº 575/2013	Si la catégorie de risque déclarée dans la colonne 0020 correspond à "Instruments autres que des positions de titrisation", les établissements déclarent le montant notionnel de l'instrument. La valeur correspond au terme $V_{notionnelle}$ de l'article 325 *quatervicies*, paragraphes 1 et 2, du règlement (UE) nº 575/2013 ou au terme V de l'article 325 *quatervicies*, paragraphe 5, dudit règlement, selon le type d'exposition. Ne rien indiquer dans cette cellule si aucun de ces cas ne s'applique, ou si l'établissement ne calcule pas ou n'utilise pas explicitement le montant à déclarer dans cette colonne pour estimer le montant JTD brut.
0190	P&L + Ajustement	Article 325 *quatervicies*, paragraphes 1, 2 et 5, du règlement (UE) nº 575/2013	Les établissements déclarent la somme de P&L et de Ajustement pour chaque exposition: — Si la catégorie de risque déclarée dans la colonne 0020 correspond à "Instruments autres que des positions de titrisation" et si l'exposition déclarée est une exposition longue, les établissements déclarent la somme de $P\&L_{longue}$ et de $Ajustement_{longue}$ au sens de l'article 325 *quatervicies*, paragraphe 1, du règlement (UE) nº 575/2013. — Si la catégorie de risque déclarée dans la colonne 0020 correspond à "Instruments autres que des positions de titrisation" et si l'exposition déclarée est une exposition courte, les établissements déclarent la somme de $P\&L_{courte}$ et de $Ajustement_{courte}$ au sens de l'article 325 *quatervicies*, paragraphe 2, dudit règlement.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
			Ne rien indiquer dans cette cellule si aucun de ces cas ne s'applique, ou si l'établissement ne calcule pas ou n'utilise pas explicitement le montant à déclarer dans cette colonne pour estimer le montant JTD brut.
0200	Montant JTD brut	Article 325 *tervicies*, paragraphe 1, point c), article 325 *quatervicies*, paragraphes 1, 2 et 5, article 325 *septvicies*, paragraphe 1 et article 325 *tricies*, paragraphe 2, du règlement (UE) nº 575/2013	Les établissements déclarent le montant brut pour défaut soudain (JTD) pour l'exposition concernée.

C 120.05 - DRC. COMPOSITION DES EXIGENCES DE FONDS PROPRES (OFR) PAR PORTEFEUILLE

Instructions relatives aux feuilles (axe des z)

Dénomination	Référence juridique	Instructions
Portefeuille	Sections 3, 4 et 5 de l'annexe V	Indiquer le numéro du portefeuille tiré de l'annexe V.

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0010	Catégorie de risque	Article 325 *tervicies*, paragraphe 2, du règlement (UE) nº 575/2013	Indiquer la catégorie de risque correspondant à l'exigence pour risque de défaut déclarée dans les colonnes 0030 et 0040. Répondre par l'un des types d'instruments suivants: a) "instruments autres que des positions de titrisation"; b) "Positions de titrisation non incluses dans le portefeuille ACTP"; c) "Positions de titrisation incluses dans le portefeuille ACTP".
0020	Classe (bucket) 1	Article 325 *sexvicies*, paragraphe 3, article 325 *octovicies*, paragraphe 4, et article 325 *untricies*, paragraphe 2, du règlement (UE) nº 575/2013	Indiquer la classe. Lorsque la catégorie de risque déclarée dans la colonne 0010 correspond à "Instruments autres que des positions de titrisation", choisir une seule des réponses suivantes: a) "Entreprises"; b) "Souverains"; c) "Administrations locales/municipalités".

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
			Si la catégorie de risque déclarée dans la colonne 0010 correspond à des «titrisations non incluses dans le portefeuille ACTP», répondre par a) ou par l'une des réponses suivantes: d) "ABCP - Asie"; e) "ABCP - Europe"; f) "ABCP - Amérique du Nord"; g) "ABCP - Reste du monde"; h) "Prêts/contrats de location automobiles - Asie"; i) "Prêts/contrats de location automobiles - Europe"; j) "Prêts/contrats de location automobiles - Amérique du Nord"; k) "Prêts/contrats de location automobiles - Reste du monde"; l) "Obligations adossées à des créances au carré (CDO au carré) - Asie"; m) "Obligations adossées à des créances au carré (CDO au carré) - Europe"; n) "Obligations adossées à des créances au carré (CDO au carré) - Amérique du Nord"; o) "Obligations adossées à des créances au carré (CDO au carré) - Reste du monde"; p) "Obligations adossées à des prêts - Asie"; q) "Obligations adossées à des prêts - Europe"; r) "Obligations adossées à des prêts - Amérique du Nord"; s) "Obligations adossées à des prêts - Reste du monde"; t) "Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales (CMBS) - Asie"; u) "Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales (CMBS) - Europe"; v) "Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales (CMBS) - Amérique du Nord"; w) "Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales (CMBS) - Reste du monde"; x) "Cartes de crédit - Asie"; y) "Cartes de crédit - Europe"; z) "Cartes de crédit - Amérique du Nord"; aa) "Cartes de crédit - Reste du monde"; bb) "Autres expositions sur la clientèle de détail - Asie"; cc) "Autres expositions sur la clientèle de détail - Europe"; dd) "Autres expositions sur la clientèle de détail - Amérique du Nord"; ee) "Autres expositions sur la clientèle de détail - Reste du monde"; ff) "Autres expositions sur la clientèle de gros - Asie"; gg) "Autres expositions sur la clientèle de gros - Europe"; hh) "Autres expositions sur la clientèle de gros - Amérique du Nord"; ii) "Autres expositions sur la clientèle de gros - Reste du monde"; jj) "Titres adossés à des prêts hypothécaires résidentiels (RMBS) - Asie"; kk) "Titres adossés à des prêts hypothécaires résidentiels (RMBS) - Europe"; ll) "Titres adossés à des prêts hypothécaires résidentiels (RMBS) - Amérique du Nord"; mm) "Titres adossés à des prêts hypothécaires résidentiels (RMBS) - Reste du monde"; nn) "Petites et moyennes entreprises (PME) - Asie"; oo) "Petites et moyennes entreprises (PME) - Europe"; pp) "Petites et moyennes entreprises (PME) - Amérique du Nord"; qq) "Petites et moyennes entreprises (PME) - Reste du monde"; rr) "Prêts étudiants - Asie";

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
			ss) "Prêts étudiants - Europe"; tt) "Prêts étudiants - Amérique du Nord"; uu) "Prêts étudiants - Reste du monde". Si la catégorie de risque déclarée dans la colonne 0010 correspond à «Positions de titrisation incluses dans le portefeuille ACTP», répondre par «Titrisations incluses dans le portefeuille ACTP».
0030	Classe (bucket) 2	Article 325 *untricies*, paragraphe 2, du règlement (UE) nº 575/2013	Si la catégorie de risque déclarée dans la colonne 0010 correspond à «Positions de titrisation incluses dans le portefeuille ACTP», répondre par le nom de l'indice, ou à défaut, par "NUL".
0040	Exigences de fonds propres (résultats dans la monnaie de déclaration)	Articles 325 *sexdecies*, 325 *octovicies* et 325 *untricies* du règlement (UE) nº 575/2013	Indiquer les exigences de fonds propres pour risque de défaut à la "date de référence finale des MR (et de l'ASA)" [telle que précisée à l'annexe V, section 1, point b), du présent règlement]. Les valeurs doivent être déclarées dans la monnaie de déclaration de l'établissement et sont exprimées avec une précision minimale de deux chiffres après la virgule décimale.
0050	Monnaie de déclaration		Indiquer la monnaie de déclaration de l'établissement (la valeur déclarée suit la désignation des monnaies selon la norme ISO 4217).
0060	Exigences de fonds propres (résultats dans la monnaie du portefeuille ABE)	Annexe V, sections 3 et 4, du présent règlement et articles 325 *sexvicies*, 325 *octovicies* et 325 *untricies* du règlement (UE) nº 575/2013	Les valeurs doivent être déclarées conformément aux instructions relatives à la colonne 0030, mais converties au taux de change au comptant de la BCE associé à la monnaie du portefeuille, telle que définie à l'annexe V, sections 3 et 4, du présent règlement.

C 120.06 - ASA. Exigences de fonds propres (OFR)

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0010	Numéro de portefeuille	Sections 3, 4 et 5 de l'annexe V	Indiquer le numéro du portefeuille tiré de l'annexe V.
0020-0040	Résultats dans la monnaie de déclaration	Annexe V, sections 3 et 4	

Colonne	Dénomination	Référence juridique	Instructions
0020	Exigences de fonds propres en vertu de la méthode des sensibilités (SBM OFR)	Article 325 *nonies* du règlement (UE) n° 575/2013	Déclarer pour chaque portefeuille les exigences de fonds propres selon la méthode des sensibilités de l'approche standard alternative à la "date de référence finale des MR (et de l'ASA)" [telle que précisée à l'annexe V, section 1, point b), du présent règlement].
0030	DRC OFR	Article 325 *tervicies* du règlement (UE) n° 575/2013	Déclarer pour chaque portefeuille les exigences de fonds propres correspondant à l'exigence pour risque de défaut selon l'approche standard alternative à la "date de référence finale des MR (et de l'ASA)" [telle que précisée à l'annexe V, section 1, point b), du présent règlement].
0040	RRAO OFR	Article 325 *duovicies* du règlement (UE) n° 575/2013	Déclarer pour chaque portefeuille les exigences de fonds propres correspondant à la majoration pour risque résiduel selon l'approche standard alternative à la "date de référence finale des MR (et de l'ASA)" [telle que précisée à l'annexe V, section 1, point b), du présent règlement].
0050-0070	Résultats dans la monnaie du portefeuille ABE	Annexe V, sections 3 et 4	Si la monnaie de déclaration de l'établissement diffère des monnaies de portefeuille déterminées par l'ABE à l'annexe V, sections 3 et 4, l'établissement convertit sa monnaie de déclaration au taux de change au comptant de la BCE applicable.
0050	Exigences de fonds propres en vertu de la méthode des sensibilités (SBM OFR)	Article 325 *nonies* du règlement (UE) n° 575/2013	Déclarer pour chaque portefeuille les exigences de fonds propres selon la méthode des sensibilités de l'approche standard alternative à la "date de référence finale des MR (et de l'ASA)" [telle que précisée à l'annexe V, section 1, point b), du présent règlement].
0060	DRC OFR	Article 325 *tervicies* du règlement (UE) n° 575/2013	Déclarer pour chaque portefeuille les exigences de fonds propres correspondant à l'exigence pour risque de défaut selon l'approche standard alternative à la "date de référence finale des MR (et de l'ASA)" [telle que précisée à l'annexe V, section 1, point b), du présent règlement].
0070	RRAO OFR	Article 325 *duovicies* du règlement (UE) n° 575/2013	Déclarer pour chaque portefeuille les exigences de fonds propres correspondant à la majoration pour risque résiduel selon l'approche standard alternative à la "date de référence finale des MR (et de l'ASA)" [telle que précisée à l'annexe V, section 1, point b), du présent règlement].

Tableau: Indications pour les modèles 106.01 (colonne 0010) et 120.01 (colonne 0020)

— La colonne “catégorie de risque” renvoie à l’article 325 *quinquies*, point 1), du règlement (UE) nº 575/2013. Les acronymes suivants sont utilisés pour désigner les catégories de risque:

a) “GIRR” (risque de taux d’intérêt global);

b) “CSR_NON_SEC” [risque d’écart de crédit (*credit spread risk* ou CSR) sur expositions hors titrisation];

c) “CSR_SEC_NON_ACTP” [risque d’écart de crédit sur expositions de titrisation hors portefeuille de négociation en corrélation alternatif (non-ACTP CSR)];

d) “CSR_SEC_ACTP” [risque d’écart de crédit sur expositions de titrisation du portefeuille de négociation en corrélation alternatif (ACTP CSR)];

e) “EQ” (risque sur actions);

f) “CM” (risque sur matières premières);

g) “FX” (risque de change).

— La colonne “composante” renvoie à l’article 325 *sexies*, paragraphe 1, du règlement (UE) nº 575/2013. Les acronymes suivants sont utilisés pour désigner les composantes de la méthode des sensibilités:

a) “DELTA” (risque delta);

b) “VEGA” (risque vega);

c) “COURBURE” (risque de courbure).

— La colonne “échéance” renvoie à l’échéance du facteur de risque, les facteurs de risque étant définis selon des vertex spécifiés conformément aux articles 325 *terdecies*, 325 *quaterdecies*, 325 *quindecies*, 325 *sexdecies*, 325 *septdecies* et 325 *octodecies* du règlement (UE) nº 575/2013. Pour les facteurs de risque vega de taux d’intérêt global précisés à l’article 325 *terdecies*, paragraphe 7, dudit règlement, deux échéances sont indiquées et elles sont séparées par un tiret (par exemple, “0,5 an – 0,5 an”). La première correspond à l’échéance de l’option, et la seconde à l’échéance du sous-jacent de l’option à la date d’expiration de l’option.

— La colonne “Spécifications supplémentaires” précise le facteur de risque concerné, au regard de la distinction entre facteur de risque d’inflation et facteur de risque d’écart de taux entre monnaies conformément à l’article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013, de la distinction entre facteurs de risque liés aux instruments de dette et facteurs de risque liés aux contrats d’échange sur risque de crédit conformément aux articles 325 *quaterdecies* et 325 *quindecies* dudit règlement, de la distinction entre facteurs de risque liés au cours au comptant des actions et facteurs de risque liés au taux des opérations de pension conformément à l’article 325 *sexdecies* dudit règlement, et de la distinction entre la position nette de risque de courbure haussier de ce facteur de risque (CVRk+) et la position nette de risque de courbure baissier de ce facteur de risque (CVRk-) conformément à l’article 325 *octies*, dudit règlement.

Catégorie de risque	Composante	Échéance	Spécifications supplémentaires	Identifiant du facteur de risque	Référence juridique
CM	DELTA	0 an		CM_D_00.00	Article 325 *septdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CM	DELTA	0,25 an		CM_D_00.25	Article 325 *septdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CM	DELTA	0,5 an		CM_D_00.50	Article 325 *septdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CM	DELTA	1 an		CM_D_01.00	Article 325 *septdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CM	DELTA	2 ans		CM_D_02.00	Article 325 *septdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CM	DELTA	3 ans		CM_D_03.00	Article 325 *septdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CM	DELTA	5 ans		CM_D_05.00	Article 325 *septdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CM	DELTA	10 ans		CM_D_10.00	Article 325 *septdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CM	DELTA	15 ans		CM_D_15.00	Article 325 *septdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CM	DELTA	20 ans		CM_D_20.00	Article 325 *septdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CM	DELTA	30 ans		CM_D_30.00	Article 325 *septdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CM	VEGA	0,5 an		CM_V_00.50	Article 325 *septdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CM	VEGA	1 an		CM_V_01.00	Article 325 *septdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CM	VEGA	3 ans		CM_V_03.00	Article 325 *septdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CM	VEGA	5 ans		CM_V_05.00	Article 325 *septdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CM	VEGA	10 ans		CM_V_10.00	Article 325 *septdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CM	COURBURE		Haussier	CM_CU	Articles 325 *octies* et 325 *septdecies* du règlement (UE) nº 575/2013

Catégorie de risque	Composante	Échéance	Spécifications supplémentaires	Identifiant du facteur de risque	Référence juridique
CM	COURBURE		Baissier	CM_CD	Articles 325 *octies* et 325 *septdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	0,5 an	Instrument de dette	CSR_NON_SEC_D_00.50_DEBT	Article 325 *quaterdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	1 an	Instrument de dette	CSR_NON_SEC_D_01.00_DEBT	Article 325 *quaterdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	3 ans	Instrument de dette	CSR_NON_SEC_D_03.00_DEBT	Article 325 *quaterdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	5 ans	Instrument de dette	CSR_NON_SEC_D_05.00_DEBT	Article 325 *quaterdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	10 ans	Instrument de dette	CSR_NON_SEC_D_10.00_DEBT	Article 325 *quaterdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	0,5 an	Contrat d'échange sur risque de crédit (CDS)	CSR_NON_SEC_D_00.50_CDS	Article 325 *quaterdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	1 an	Contrat d'échange sur risque de crédit (CDS)	CSR_NON_SEC_D_01.00_CDS	Article 325 *quaterdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	3 ans	Contrat d'échange sur risque de crédit (CDS)	CSR_NON_SEC_D_03.00_CDS	Article 325 *quaterdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	5 ans	Contrat d'échange sur risque de crédit (CDS)	CSR_NON_SEC_D_05.00_CDS	Article 325 *quaterdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	10 ans	Contrat d'échange sur risque de crédit (CDS)	CSR_NON_SEC_D_10.00_CDS	Article 325 *quaterdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	0,5 an		CSR_NON_SEC_V_00.50	Article 325 *quaterdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	1 an		CSR_NON_SEC_V_01.00	Article 325 *quaterdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	3 ans		CSR_NON_SEC_V_03.00	Article 325 *quaterdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	5 ans		CSR_NON_SEC_V_05.00	Article 325 *quaterdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	10 ans		CSR_NON_SEC_V_10.00	Article 325 *quaterdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_NON_SEC	COURBURE		Haussier	CSR_NON_SEC_CU	Articles 325 *octies* et 325 *quaterdecies* du règlement (UE) nº 575/2013

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

Catégorie de risque	Composante	Échéance	Spécifications supplémentaires	Identifiant du facteur de risque	Référence juridique
CSR_NON_SEC	COURBURE		Baissier	CSR_NON_SEC_CD	Articles 325 *octies* et 325 *quaterdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	0,5 an	Instrument de dette	CSR_SEC_ACTP_D_00.50_DEBT	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	1 an	Instrument de dette	CSR_SEC_ACTP_D_01.00_DEBT	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	3 ans	Instrument de dette	CSR_SEC_ACTP_D_03.00_DEBT	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	5 ans	Instrument de dette	CSR_SEC_ACTP_D_05.00_DEBT	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	10 ans	Instrument de dette	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_DEBT	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	0,5 an	Contrat d'échange sur risque de crédit (CDS)	CSR_SEC_ACTP_D_00.50_CDS	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	1 an	Contrat d'échange sur risque de crédit (CDS)	CSR_SEC_ACTP_D_01.00_CDS	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	3 ans	Contrat d'échange sur risque de crédit (CDS)	CSR_SEC_ACTP_D_03.00_CDS	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	5 ans	Contrat d'échange sur risque de crédit (CDS)	CSR_SEC_ACTP_D_05.00_CDS	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	10 ans	Contrat d'échange sur risque de crédit (CDS)	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_CDS	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	0,5 an		CSR_SEC_ACTP_V_00.50	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	1 an		CSR_SEC_ACTP_V_01.00	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	3 ans		CSR_SEC_ACTP_V_03.00	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	5 ans		CSR_SEC_ACTP_V_05.00	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	10 ans		CSR_SEC_ACTP_V_10.00	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_ACTP	COURBURE		Haussier	CSR_SEC_ACTP_CU	Articles 325 *octies* et 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013

Catégorie de risque	Composante	Échéance	Spécifications supplémentaires	Identifiant du facteur de risque	Référence juridique
CSR_SEC_ACTP	COURBURE		Baissier	CSR_SEC_ACTP_CD	Articles 325 *octies* et 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	0,5 an	Instrument de dette	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_00.50_DEBT	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	1 an	Instrument de dette	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_01.00_DEBT	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	3 ans	Instrument de dette	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_03.00_DEBT	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	5 ans	Instrument de dette	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_05.00_DEBT	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	10 ans	Instrument de dette	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_10.00_DEBT	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	0,5 an	Contrat d'échange sur risque de crédit (CDS)	CSR_SEC_NON_ACTP_D_00.50_CDS	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	1 an	Contrat d'échange sur risque de crédit (CDS)	CSR_SEC_NON_ACTP_D_01.00_CDS	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	3 ans	Contrat d'échange sur risque de crédit (CDS)	CSR_SEC_NON_ACTP_D_03.00_CDS	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	5 ans	Contrat d'échange sur risque de crédit (CDS)	CSR_SEC_NON_ACTP_D_05.00_CDS	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	10 ans	Contrat d'échange sur risque de crédit (CDS)	CSR_SEC_NON_ACTP_D_10.00_CDS	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	0,5 an		CSR_SEC_NON_ACTP_V_00.50	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	1 an		CSR_SEC_NON_ACTP_V_01.00	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	3 ans		CSR_SEC_NON_ACTP_V_03.00	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	5 ans		CSR_SEC_NON_ACTP_V_05.00	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	10 ans		CSR_SEC_NON_ACTP_V_10.00	Article 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	COURBURE		Haussier	CSR_SEC_NON_ACTP_CU	Articles 325 *octies* et 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013

Catégorie de risque	Composante	Échéance	Spécifications supplémentaires	Identifiant du facteur de risque	Référence juridique
CSR_SEC_NO-N_ACTP	COURBURE		Baissier	CSR_SEC_NON_ACTP_CD	Articles 325 *octies* et 325 *quindecies* du règlement (UE) nº 575/2013
EQ	DELTA		Prix au comptant	EQ_D_SPOT	Article 325 *sexdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
EQ	DELTA		Taux des opérations de pension	EQ_D_REPO	Article 325 *sexdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
EQ	VEGA	0,5 an		EQ_V_00.50	Article 325 *sexdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
EQ	VEGA	1 an		EQ_V_01.00	Article 325 *sexdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
EQ	VEGA	3 ans		EQ_V_03.00	Article 325 *sexdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
EQ	VEGA	5 ans		EQ_V_05.00	Article 325 *sexdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
EQ	VEGA	10 ans		EQ_V_10.00	Article 325 *sexdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
EQ	COURBURE		Haussier	EQ_CU	Articles 325 *octies* et 325 *sexdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
EQ	COURBURE		Baissier	EQ_CD	Articles 325 *octies* et 325 *sexdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
FX	DELTA			FX_D	Article 325 *octodecies* du règlement (UE) nº 575/2013
FX	VEGA	0,5 an		FX_V_00.50	Article 325 *octodecies* du règlement (UE) nº 575/2013
FX	VEGA	1 an		FX_V_01.00	Article 325 *octodecies* du règlement (UE) nº 575/2013
FX	VEGA	3 ans		FX_V_03.00	Article 325 *octodecies* du règlement (UE) nº 575/2013
FX	VEGA	5 ans		FX_V_05.00	Article 325 *octodecies* du règlement (UE) nº 575/2013
FX	VEGA	10 ans		FX_V_10.00	Article 325 *octodecies* du règlement (UE) nº 575/2013
FX	COURBURE		Haussier	FX_CU	Articles 325 *octies* et 325 *octodecies* du règlement (UE) nº 575/2013

Catégorie de risque	Composante	Échéance	Spécifications supplémentaires	Identifiant du facteur de risque	Référence juridique
FX	COURBURE		Baissier	FX_CD	Articles 325 *octies* et 325 *octodecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	DELTA	0,25 an		GIRR_D_00.25	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	DELTA	0,5 an		GIRR_D_00.50	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	DELTA	1 an		GIRR_D_01.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	DELTA	2 ans		GIRR_D_02.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	DELTA	3 ans		GIRR_D_03.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	DELTA	5 ans		GIRR_D_05.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	DELTA	10 ans		GIRR_D_10.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	DELTA	15 ans		GIRR_D_15.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	DELTA	20 ans		GIRR_D_20.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	DELTA	30 ans		GIRR_D_30.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	DELTA		Inflation	GIRR_D_INF	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	DELTA		Écart de taux entre monnaies (par rapport à l'euro)	GIRR_D_CRO_EUR	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	DELTA		Écart de taux entre monnaies (par rapport au dollar américain)	GIRR_D_CRO_USD	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 an – 0,5 an		GIRR_V_00.50_00.50	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	1 an – 0,5 an		GIRR_V_01.00_00.50	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	3 ans – 0,5 an		GIRR_V_03.00_00.50	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013

Catégorie de risque	Composante	Échéance	Spécifications supplémentaires	Identifiant du facteur de risque	Référence juridique
GIRR	VEGA	5 ans – 0,5 an		GIRR_V_05.00_00.50	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	10 ans – 0,5 an		GIRR_V_10.00_00.50	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 an – 1 an		GIRR_V_00.50_01.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	1 an – 1 an		GIRR_V_01.00_01.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	3 ans – 1 an		GIRR_V_03.00_01.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	5 ans – 1 an		GIRR_V_05.00_01.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	10 ans – 1 an		GIRR_V_10.00_01.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 an – 3 ans		GIRR_V_00.50_03.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	1 an – 3 ans		GIRR_V_01.00_03.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	3 ans – 3 ans		GIRR_V_03.00_03.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	5 ans – 3 ans		GIRR_V_05.00_03.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	10 ans – 3 ans		GIRR_V_10.00_03.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 an – 5 ans		GIRR_V_00.50_05.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	1 an – 5 ans		GIRR_V_01.00_05.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	3 ans – 5 ans		GIRR_V_03.00_05.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	5 ans – 5 ans		GIRR_V_05.00_05.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	10 ans – 5 ans		GIRR_V_10.00_05.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013

Catégorie de risque	Composante	Échéance	Spécifications supplémentaires	Identifiant du facteur de risque	Référence juridique
GIRR	VEGA	0,5 an – 10 ans		GIRR_V_00.50_10.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	1 an – 10 ans		GIRR_V_01.00_10.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	3 ans – 10 ans		GIRR_V_03.00_10.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	5 ans – 10 ans		GIRR_V_05.00_10.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	10 ans – 10 ans		GIRR_V_10.00_10.00	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 an	Inflation	GIRR_V_00.50_INF	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	1 an	Inflation	GIRR_V_01.00_INF	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	3 ans	Inflation	GIRR_V_03.00_INF	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	5 ans	Inflation	GIRR_V_05.00_INF	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	10 ans	Inflation	GIRR_V_10.00_INF	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 an	Écart de taux entre monnaies (par rapport à l'euro)	GIRR_V_00.50_CRO_EUR	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	1 an	Écart de taux entre monnaies (par rapport à l'euro)	GIRR_V_01.00_CRO_EUR	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	3 ans	Écart de taux entre monnaies (par rapport à l'euro)	GIRR_V_03.00_CRO_EUR	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	5 ans	Écart de taux entre monnaies (par rapport à l'euro)	GIRR_V_05.00_CRO_EUR	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	10 ans	Écart de taux entre monnaies (par rapport à l'euro)	GIRR_V_10.00_CRO_EUR	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 an	Écart de taux entre monnaies (par rapport au dollar américain)	GIRR_V_00.50_CRO_USD	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	1 an	Écart de taux entre monnaies (par rapport au dollar américain)	GIRR_V_01.00_CRO_USD	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013

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

Catégorie de risque	Composante	Échéance	Spécifications supplémentaires	Identifiant du facteur de risque	Référence juridique
GIRR	VEGA	3 ans	Écart de taux entre monnaies (par rapport au dollar américain)	GIRR_V_03.00_CRO_USD	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	5 ans	Écart de taux entre monnaies (par rapport au dollar américain)	GIRR_V_05.00_CRO_USD	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	VEGA	10 ans	Écart de taux entre monnaies (par rapport au dollar américain)	GIRR_V_10.00_CRO_USD	Article 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	COURBURE		Haussier	GIRR_CU	Articles 325 *octies* et 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013
GIRR	COURBURE		Baissier	GIRR_CD	Articles 325 *octies* et 325 *terdecies* du règlement (UE) nº 575/2013»

ANNEXE IV

«ANNEXE VII

Résultats — Portefeuilles de référence à des fins de surveillance RISQUE DE MARCHÉ

RÉSULTATS – PORTEFEUILLES DE RÉFÉRENCE. RISQUE DE MARCHÉ			
Numéro de modèle	**Code du modèle**	**Nom du modèle /groupe de modèles**	**Nom abrégé**
		VALORISATION DE MARCHÉ INITIALE	
106,1	C 106.00	VALORISATION DE MARCHÉ INITIALE ET JUSTIFICATION DES EXCLUSIONS	IMV
106,2	C 106.01	SENSIBILITÉS AU RISQUE PAR INSTRUMENT	SENSIBILITÉS
		VaR, sVaR et VA	
107,1	C 107.01	DESCRIPTION DÉTAILLÉE	VaR&SVaR 1
107,2	C 107.02	RÉSULTATS DANS LA MONNAIE **DU PORTEFEUILLE ABE**	VaR&SVaR 2
		SÉRIES CHRONOLOGIQUES PROFITS ET PERTES	
108	C 108.00	SÉRIES CHRONOLOGIQUES PROFITS ET PERTES	P&L
		EXIGENCE POUR RISQUES SUPPLÉMENTAIRES (IRC)	
109,1	C 109.01	IRC. DESCRIPTION DÉTAILLÉE DU MODÈLE	IRC 1
109,2	C 109.02	IRC. DESCRIPTION DÉTAILLÉE PAR PORTEFEUILLE	IRC 2
109,3	C 109.03	IRC. MONTANT PAR PORTEFEUILLE/DATE	IRC 3
		NÉGOCIATION EN CORRÉLATION (CT)	
110,1	C 110.01	CT. DESCRIPTION DÉTAILLÉE DU MODÈLE	CT 1
110,2	C 110.02	CT. DESCRIPTION DÉTAILLÉE PAR PORTEFEUILLE	CT 2
110,3	C 110.03	CT. MONTANT PAR PORTEFEUILLE/DATE	CT 3
		ASA (SBM &DRC)	
120,1	C 120.01	SBM. SENSIBILITÉS AU RISQUE PAR INSTRUMENT/PORTEFEUILLE	SBM 1
120,2	C 120.02	SBM. COMPOSITION DES EXIGENCES DE FONDS PROPRES (OFR) PAR PORTEFEUILLE	SBM 2
120,4	C 120.04	DRC. VALEURS DE MARCHÉ ET MONTANTS JTD BRUTS PAR INSTRUMENT/PORTEFEUILLE	DRC 1
120,5	C 120.05	DRC. COMPOSITION DES EXIGENCES DE FONDS PROPRES (OFR) PAR PORTEFEUILLE	DRC 2
120,6	C 120.06	ASA. COMPOSITION DES EXIGENCES DE FONDS PROPRES (OFR) PAR PORTEFEUILLE	ASA OFR

C 106.00 - VALORISATION DE MARCHÉ INITIALE ET JUSTIFICATION DES EXCLUSIONS

Numéro de l'instrument	Instrument modélisé pour VaR + sVaR (Vrai/Faux)	Instrument modélisé pour IRC (exigence de fonds propres pour risques supplémentaires) (Vrai/Faux)	Instrument modélisé pour négociation en corrélation (Vrai/Faux)	Justification de l'exclusion	Zone de texte libre	Valorisation de marché initiale
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070

C 106.01 - SENSIBILITÉS AU RISQUE PAR INSTRUMENT

Numéro de l'instrument

Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Sensibilité au risque (résultats dans la monnaie de déclaration)	Monnaie de déclaration	Sensibilité au risque (résultats dans la monnaie de l'instrument ABE)	Modèle de tarification	Définition des sensibilités	Zone de texte libre	Identifiant supplémentaire2	Catégorie de qualité de crédit
0010	0020	0030	0050	0060	0070	0080	0090	0100	110	120

C 107.01 - VaR, sVaR et VA. DESCRIPTION DÉTAILLÉE

		Option	Zone de texte libre
		0010	0020
Valeur en risque (VaR)			
0010	**Méthode**		
0020	**Calcul à un horizon de 10 jours**		

		Option	Zone de texte libre
		0010	0020
0030	**Durée de la période d'observation**		
0040	**Pondération des données**		
0050	**Cumulateur lié aux contrôles a posteriori**		
0060	**Cumulateur réglementaire pour la VaR**		
Valeur en risque en situation de tensions (sVaR)			
0070	**Méthode**		
0080	**Calcul à un horizon de 10 jours**		
0090	**Cumulateur réglementaire pour la sVaR**		
0100	**Période pour la sVaR**		

C 107.02 - VaR et sVaR HORS PORTEFEUILLE DE NÉGOCIATION EN CORRÉLATION. RÉSULTATS DANS LA MONNAIE DU PORTEFEUILLE ABE

Portefeuille

Date	Valeur en risque (VaR)	Valeur en risque en situation de tension (sVaR)	VA
0010	0020	0030	0040

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

C 108.00- SÉRIES CHRONOLOGIQUES PROFITS ET PERTES

Portefeuille

Date	**P&L quotidien**
0010	0020

C 109.01 - Exigence de fonds propres pour risques supplémentaires (IRC). DESCRIPTION DÉTAILLÉE DU MODÈLE

		Option	**Zone de texte libre**
Ligne	**Élément**	0010	0020
0010	**Nombre de facteurs de modélisation**		
0020	**Source des LGD**		

C 109.02 - Exigence de fonds propres pour risques supplémentaires (IRC). DESCRIPTION DÉTAILLÉE PAR PORTEFEUILLE

Portefeuille

		Option	Zone de texte libre
Ligne	**Élément**	0010	0020
0010	**Horizon de liquidité**		
0020	**Source des PD**		
0030	**Source des matrices de transition**		

C 109.03 - Exigence de fonds propres pour risques supplémentaires (IRC). MONTANT PAR PORTEFEUILLE/DATE

Portefeuille

Date	IRC
0010	0020

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

C 110.01 - NÉGOCIATION EN CORRÉLATION. DESCRIPTION DÉTAILLÉE DU MODÈLE

		Option	Zone de texte libre
Ligne	**Élément**	0010	0020
0010	**Nombre de facteurs de modélisation**		
0020	**Source des LGD**		

C 110.02 – NÉGOCIATION EN CORRÉLATION. DESCRIPTION DÉTAILLÉE PAR PORTEFEUILLE.

Portefeuille

		Option	Zone de texte libre
Ligne	**Élément**	0010	0020
0010	**Horizon de liquidité**		
0020	**Source des PD**		
0030	**Source des matrices de transition**		

C 110.03 - NÉGOCIATION EN CORRÉLATION. RISQUE DE PRIX TOTAL (APR) PAR PORTEFEUILLE/DATE

Portefeuille

Date	APR
0010	0060

C 120.01 – Méthode des sensibilités (SBM). SENSIBILITÉS AU RISQUE PAR INSTRUMENT/PORTEFEUILLE

Portefeuille

Numéro de l'instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Sensibilité au risque (résultats dans la monnaie de déclaration)	Monnaie de déclaration	Sensibilité au risque (résultats dans la monnaie du portefeuille ABE)	Pondération de risque	Identifiant supplémentaire2	Catégorie de qualité de crédit
0010	0020	0030	0040	0060	0070	0080	0090	110	120

C 120.02 – Méthode des sensibilités (SBM). COMPOSITION DES EXIGENCES DE FONDS PROPRES (OFR) PAR PORTEFEUILLE

Portefeuille

Catégorie de risque	Composante de risque	Scénario à corrélations	Exigences de fonds propres (résultats dans la monnaie de déclaration)	Monnaie de déclaration	Exigences de fonds propres (résultats dans la monnaie du portefeuille ABE)	Positions sans option soumises à des exigences de fonds propres pour le risque de courbure	Approche fondée sur la monnaie de base appliquée pour les risques delta et de courbure du risque de change	Répartition des composantes du risque de courbure pour le risque de change par scalaire	Soumission des résultats des portefeuilles de validation SBM	Zone de texte libre
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0950	0100

C 120.04 - DRC. Valeurs de marché et montants JTD bruts par instrument/portefeuille

Portefeuille

Integer (entier)

Numéro de l'instrument	Catégorie de risque	Classe (bucket) 1	Classe (bucket) 2	Débiteur	Catégorie de qualité de crédit	Pondération pour risque de défaut	Rang	Échéance	Taux de recouvrement	Sens	Point d'attachement (%)	Point de détachement (%)	Résultats dans la monnaie de déclaration				Résultats dans la monnaie du portefeuille ABE		
													Montant notionnel	P&L + Ajustement	Montant JTD brut	Monnaie	Montant notionnel	P&L + Ajustement	Montant JTD brut
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120	0130	0140	0150	0160	0170	0180	0190	0200

C 120.05 - DRC. COMPOSITION DES EXIGENCES DE FONDS PROPRES (OFR) PAR PORTEFEUILLE

Portefeuille

Integer (entier)

Catégorie de risque	Classe (bucket) 1	Classe (bucket) 2	Exigences de fonds propres (résultats dans la monnaie de déclaration)	Monnaie de déclaration	Exigences de fonds propres (résultats dans la monnaie du portefeuille ABE)
0010	0020	0030	0040	0050	0060

C 120.06 - ASA. Exigences de fonds propres (OFR)

Numéro de portefeuille	Résultats dans la monnaie de déclaration			Résultats dans la monnaie du portefeuille ABE		
	SBM OFR	DRC OFR	RRAO OFR	SBM OFR	DRC OFR	RRAO OFR
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070»

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

ANNEXE V

«ANNEXE X

Portefeuilles de validation SBM

Nom de la feuille	Description
Instruments	Instruments (sensibilités et positions de risque de courbure) aux fins de validations SBM
Portefeuilles	Portefeuilles de validation SBM, définis comme des combinaisons d'instruments visés dans la présente annexe

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
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

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
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

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

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
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

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
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

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
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

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
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	ÉMETTEUR A			100,00

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

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
S_EQV_aa4#	EQ_V_5.00	5	ÉMETTEUR AA			1 200,00
S_EQV_ac1#	EQ_V_5.00	7	ÉMETTEUR AC			– 50,00
S_EQV_ae4#	EQ_V_5.00	9	ÉMETTEUR AE			600,00
S_EQV_af4#	EQ_V_5.00	10	ÉMETTEUR AF			375,00
S_EQV_b4#	EQ_V_5.00	1	ÉMETTEUR B			50,00
S_EQV_f4#	EQ_V_5.00	5	ÉMETTEUR F			450,00
S_EQV_j4#	EQ_V_5.00	9	ÉMETTEUR J			– 200,00
S_EQV_k4#	EQ_V_5.00	10	ÉMETTEUR K			– 825,00
S_EQV_m1#	EQ_V_5.00	11	ÉMETTEUR M			– 700,00
S_EQV_n4#	EQ_V_5.00	12	INDICE N			850,00
S_EQV_o4#	EQ_V_5.00	12	INDICE O			150,00
S_EQV_y1#	EQ_V_5.00	3	ÉMETTEUR Y			700,00
S_EQV_a4#	EQ_V_3.00	1	ÉMETTEUR A			– 500,00
S_EQV_aa3#	EQ_V_3.00	5	ÉMETTEUR AA			– 850,00
S_EQV_ad1#	EQ_V_3.00	8	ÉMETTEUR AD			300,00
S_EQV_ae3#	EQ_V_3.00	9	ÉMETTEUR AE			– 450,00
S_EQV_af3#	EQ_V_3.00	10	ÉMETTEUR AF			– 725,00
S_EQV_b3#	EQ_V_3.00	1	ÉMETTEUR B			– 500,00

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
S_EQV_f3#	EQ_V_3.00	5	ÉMETTEUR F			250,00
S_EQV_j3#	EQ_V_3.00	9	ÉMETTEUR J			– 900,00
S_EQV_k3#	EQ_V_3.00	10	ÉMETTEUR K			– 975,00
S_EQV_n3#	EQ_V_3.00	12	INDICE N			– 1 250,00
S_EQV_o3#	EQ_V_3.00	12	INDICE O			100,00
S_EQV_x1#	EQ_V_3.00	2	ÉMETTEUR X			– 200,00
S_EQV_z1#	EQ_V_3.00	4	ÉMETTEUR Z			– 800,00
S_EQV_a6#	EQ_V_10.00	1	ÉMETTEUR A			100,00
S_EQV_aa5#	EQ_V_10.00	5	ÉMETTEUR AA			– 300,00
S_EQV_ab1#	EQ_V_10.00	6	ÉMETTEUR AB			– 400,00
S_EQV_ae5#	EQ_V_10.00	9	ÉMETTEUR AE			– 850,00
S_EQV_af5#	EQ_V_10.00	10	ÉMETTEUR AF			525,00
S_EQV_b5#	EQ_V_10.00	1	ÉMETTEUR B			500,00
S_EQV_f5#	EQ_V_10.00	5	ÉMETTEUR F			600,00
S_EQV_j5#	EQ_V_10.00	9	ÉMETTEUR J			150,00
S_EQV_k5#	EQ_V_10.00	10	ÉMETTEUR K			300,00
S_EQV_n5#	EQ_V_10.00	12	INDICE N			225,00
S_EQV_o5#	EQ_V_10.00	12	INDICE O			– 200,00

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

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
S_EQV_q1#	EQ_V_10.00	13	INDICE Q			– 800,00
S_EQV_a3#	EQ_V_1.00	1	ÉMETTEUR A			400,00
S_EQV_aa2#	EQ_V_1.00	5	ÉMETTEUR AA			– 400,00
S_EQV_ae2#	EQ_V_1.00	9	ÉMETTEUR AE			– 250,00
S_EQV_af2#	EQ_V_1.00	10	ÉMETTEUR AF			– 1 150,00
S_EQV_b2#	EQ_V_1.00	1	ÉMETTEUR B			200,00
S_EQV_f2#	EQ_V_1.00	5	ÉMETTEUR F			– 750,00
S_EQV_j2#	EQ_V_1.00	9	ÉMETTEUR J			350,00
S_EQV_k2#	EQ_V_1.00	10	ÉMETTEUR K			1 050,00
S_EQV_n2#	EQ_V_1.00	12	INDICE N			– 800,00
S_EQV_o2#	EQ_V_1.00	12	INDICE O			400,00
S_EQV_a1#	EQ_V_0.50	1	ÉMETTEUR A			– 100,00
S_EQV_a2#	EQ_V_0.50	1	ÉMETTEUR A			700,00
S_EQV_aa1#	EQ_V_0.50	5	ÉMETTEUR AA			950,00
S_EQV_ae1#	EQ_V_0.50	9	ÉMETTEUR AE			50,00
S_EQV_af1#	EQ_V_0.50	10	ÉMETTEUR AF			– 300,00
S_EQV_b1#	EQ_V_0.50	1	ÉMETTEUR B			900,00
S_EQV_c1#	EQ_V_0.50	2	ÉMETTEUR C			– 500,00

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
S_EQV_d1#	EQ_V_0.50	3	ÉMETTEUR D			600,00
S_EQV_e1#	EQ_V_0.50	4	ÉMETTEUR E			– 800,00
S_EQV_f1#	EQ_V_0.50	5	ÉMETTEUR F			1 000,00
S_EQV_g1#	EQ_V_0.50	6	ÉMETTEUR G			– 400,00
S_EQV_h1#	EQ_V_0.50	7	ÉMETTEUR H			– 50,00
S_EQV_i1#	EQ_V_0.50	8	ÉMETTEUR I			300,00
S_EQV_j1#	EQ_V_0.50	9	ÉMETTEUR J			50,00
S_EQV_k1#	EQ_V_0.50	10	ÉMETTEUR K			– 300,00
S_EQV_l1#	EQ_V_0.50	11	ÉMETTEUR L			1 000,00
S_EQV_n1#	EQ_V_0.50	12	INDICE N			750,00
S_EQV_o1#	EQ_V_0.50	12	INDICE O			– 500,00
S_EQV_p1#	EQ_V_0.50	13	INDICE P			40,00
S_EQD_a1#	EQ_D_SPOT	1	ÉMETTEUR A			16 500,00
S_EQD_a2#	EQ_D_SPOT	1	ÉMETTEUR A			– 35 000,00
S_EQD_b1#	EQ_D_SPOT	1	ÉMETTEUR B			20 000,00
S_EQD_c1#	EQ_D_SPOT	2	ÉMETTEUR C			66 000,00
S_EQD_d1#	EQ_D_SPOT	3	ÉMETTEUR D			1 700,00
S_EQD_e1#	EQ_D_SPOT	4	ÉMETTEUR E			1 100,00

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

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
S_EQD_f1#	EQ_D_SPOT	5	ÉMETTEUR F			25 000,00
S_EQD_g1#	EQ_D_SPOT	5	ÉMETTEUR G			8 400,00
S_EQD_h1#	EQ_D_SPOT	6	ÉMETTEUR H			22 500,00
S_EQD_i1#	EQ_D_SPOT	7	ÉMETTEUR I			– 12 300,00
S_EQD_j1#	EQ_D_SPOT	8	ÉMETTEUR J			– 450,00
S_EQD_k1#	EQ_D_SPOT	9	ÉMETTEUR K			– 143,00
S_EQD_l1#	EQ_D_SPOT	9	ÉMETTEUR L			– 143,00
S_EQD_m1#	EQ_D_SPOT	10	ÉMETTEUR M			– 100,00
S_EQD_n1#	EQ_D_SPOT	10	ÉMETTEUR N			– 100,00
S_EQD_o1#	EQ_D_SPOT	11	ÉMETTEUR O			– 19 600,00
S_EQD_q1#	EQ_D_SPOT	12	INDICE Q			1 100,00
S_EQD_r1#	EQ_D_SPOT	12	INDICE R			– 40 000,00
S_EQD_s1#	EQ_D_SPOT	13	INDICE S			– 1 950,00
S_EQD_s2#	EQ_D_SPOT	13	INDICE S			280,00
S_EQD_t2#	EQ_D_SPOT	13	INDICE T			3 150,00
S_EQD_u1#	EQ_D_SPOT	9	ÉMETTEUR U			– 57,00
S_EQD_v1#	EQ_D_SPOT	10	ÉMETTEUR V			– 100,00

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
S_EQD_a3#	EQ_D_REPO	1	ÉMETTEUR A			50 000,00
S_EQD_aa1#	EQ_D_REPO	6	ÉMETTEUR AA			79 000,00
S_EQD_ab1#	EQ_D_REPO	7	ÉMETTEUR AB			31 000,00
S_EQD_ac1#	EQ_D_REPO	8	ÉMETTEUR AC			– 10 000,00
S_EQD_b2#	EQ_D_REPO	1	ÉMETTEUR B			– 39 000,00
S_EQD_f2#	EQ_D_REPO	5	ÉMETTEUR F			90 000,00
S_EQD_g2#	EQ_D_REPO	5	ÉMETTEUR G			60 000,00
S_EQD_k2#	EQ_D_REPO	9	ÉMETTEUR K			– 14 250,00
S_EQD_l2#	EQ_D_REPO	9	ÉMETTEUR L			– 150 000,00
S_EQD_m2#	EQ_D_REPO	10	ÉMETTEUR M			– 85 000,00
S_EQD_n2#	EQ_D_REPO	10	ÉMETTEUR N			– 72 000,00
S_EQD_p1#	EQ_D_REPO	11	ÉMETTEUR P			48 000,00
S_EQD_q2#	EQ_D_REPO	12	INDICE Q			85 000,00
S_EQD_r2#	EQ_D_REPO	12	INDICE R			– 40 000,00
S_EQD_t1#	EQ_D_REPO	13	INDICE T			– 125 000,00
S_EQD_x1#	EQ_D_REPO	2	ÉMETTEUR X			75 000,00
S_EQD_y1#	EQ_D_REPO	3	ÉMETTEUR Y			4 800,00

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

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
S_EQD_z1#	EQ_D_REPO	4	ÉMETTEUR Z			– 15 000,00
S_EQC_a1#	EQ_CU	1	ÉMETTEUR A			– 37 820,00
S_EQC_a2#	EQ_CU	1	ÉMETTEUR A			77 655,00
S_EQC_aa1#	EQ_CU	2	ÉMETTEUR AA			39 300,00
S_EQC_ab1#	EQ_CU	4	ÉMETTEUR AB			17 262,00
S_EQC_ac1#	EQ_CU	5	ÉMETTEUR AC			7 139,60
S_EQC_ad1#	EQ_CU	6	ÉMETTEUR AD			– 3 642,50
S_EQC_ae1#	EQ_CU	7	ÉMETTEUR AE			3 900,00
S_EQC_af1#	EQ_CU	8	ÉMETTEUR AF			41 550,00
S_EQC_ag1#	EQ_CU	9	ÉMETTEUR AG			36 860,00
S_EQC_ah1#	EQ_CU	10	ÉMETTEUR AH			22 150,00
S_EQC_b1#	EQ_CU	1	ÉMETTEUR B			20 677,50
S_EQC_c1#	EQ_CU	2	ÉMETTEUR C			– 31 440,00
S_EQC_d1#	EQ_CU	3	ÉMETTEUR D			6 238,00
S_EQC_e1#	EQ_CU	4	ÉMETTEUR E			– 21 605,00
S_EQC_f1#	EQ_CU	5	ÉMETTEUR F			– 2 850,00
S_EQC_g1#	EQ_CU	6	ÉMETTEUR G			– 3 642,50

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
S_EQC_h1#	EQ_CU	7	ÉMETTEUR H			– 7 800,00
S_EQC_i1#	EQ_CU	8	ÉMETTEUR I			– 29 550,00
S_EQC_j1#	EQ_CU	9	ÉMETTEUR J			– 216 320,00
S_EQC_k1#	EQ_CU	10	ÉMETTEUR K			1 950,00
S_EQC_q1#	EQ_CU	11	ÉMETTEUR Q			– 19 142,00
S_EQC_r1#	EQ_CU	11	ÉMETTEUR R			28 713,00
S_EQC_s1#	EQ_CU	3	ÉMETTEUR S			– 17 025,00
S_EQC_t1#	EQ_CU	12	ÉMETTEUR T			7 466,67
S_EQC_u1#	EQ_CU	13	ÉMETTEUR U			11 160,00
S_EQC_v1#	EQ_CU	12	ÉMETTEUR V			– 39 200,00
S_EQC_w1#	EQ_CU	13	ÉMETTEUR W			– 58 590,00
S_EQC_y1#	EQ_CU	1	ÉMETTEUR Y			– 23 930,00
S_EQC_z1#	EQ_CU	1	ÉMETTEUR Z			– 47 860,00
S_EQC_a1#	EQ_CD	1	ÉMETTEUR A			39 157,50
S_EQC_a2#	EQ_CD	1	ÉMETTEUR A			– 80 349,00
S_EQC_aa1#	EQ_CD	2	ÉMETTEUR AA			– 30 600,00
S_EQC_ab1#	EQ_CD	4	ÉMETTEUR AB			– 9 826,00
S_EQC_ac1#	EQ_CD	5	ÉMETTEUR AC			– 5 414,60

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

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
S_EQC_ad1#	EQ_CD	6	ÉMETTEUR AD			2 617,50
S_EQC_ae1#	EQ_CD	7	ÉMETTEUR AE			– 2 720,00
S_EQC_af1#	EQ_CD	8	ÉMETTEUR AF			– 28 250,00
S_EQC_ag1#	EQ_CD	9	ÉMETTEUR AG			– 30 935,00
S_EQC_ah1#	EQ_CD	10	ÉMETTEUR AH			– 15 025,00
S_EQC_b1#	EQ_CD	1	ÉMETTEUR B			– 238 910,00
S_EQC_c1#	EQ_CD	2	ÉMETTEUR C			24 480,00
S_EQC_d1#	EQ_CD	3	ÉMETTEUR D			– 6 068,00
S_EQC_e1#	EQ_CD	4	ÉMETTEUR E			12 310,00
S_EQC_f1#	EQ_CD	5	ÉMETTEUR F			2 160,00
S_EQC_g1#	EQ_CD	6	ÉMETTEUR G			2 617,50
S_EQC_h1#	EQ_CD	7	ÉMETTEUR H			5 440,00
S_EQC_i1#	EQ_CD	8	ÉMETTEUR I			20 050,00
S_EQC_j1#	EQ_CD	9	ÉMETTEUR J			181 560,00
S_EQC_k1#	EQ_CD	10	ÉMETTEUR K			– 2 900,00
S_EQC_q1#	EQ_CD	11	ÉMETTEUR Q			20 052,00
S_EQC_r1#	EQ_CD	11	ÉMETTEUR R			– 30 078,00
S_EQC_s1#	EQ_CD	3	ÉMETTEUR S			– 9 435,00

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
S_EQC_t1#	EQ_CD	12	ÉMETTEUR T			– 7 400,00
S_EQC_u1#	EQ_CD	13	ÉMETTEUR U			– 11 040,00
S_EQC_v1#	EQ_CD	12	ÉMETTEUR V			38 850,00
S_EQC_w1#	EQ_CD	13	ÉMETTEUR W			57 960,00
S_EQC_y1#	EQ_CD	1	ÉMETTEUR Y			13 590,00
S_EQC_z1#	EQ_CD	1	ÉMETTEUR Z			27 180,00
S_CNV_a5#	CSR_NON_SEC_V_5.00	1	ÉMETTEUR A			100,00
S_CNV_b4#	CSR_NON_SEC_V_5.00	1	ÉMETTEUR B			50,00
S_CNV_c4#	CSR_NON_SEC_V_5.00	3	ÉMETTEUR C			150,00
S_CNV_hb1#	CSR_NON_SEC_V_5.00	9	ÉMETTEUR HA			– 750,00
S_CNV_a4#	CSR_NON_SEC_V_3.00	1	ÉMETTEUR A			– 500,00
S_CNV_ab1#	CSR_NON_SEC_V_3.00	2	ÉMETTEUR AB			325,00
S_CNV_b3#	CSR_NON_SEC_V_3.00	1	ÉMETTEUR B			– 500,00
S_CNV_c3#	CSR_NON_SEC_V_3.00	3	ÉMETTEUR C			100,00
S_CNV_v1#	CSR_NON_SEC_V_3.00	20	INDICE V			500,00
S_CNV_a6#	CSR_NON_SEC_V_10.00	1	ÉMETTEUR A			100,00
S_CNV_b5#	CSR_NON_SEC_V_10.00	1	ÉMETTEUR B			500,00

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

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
S_CNV_c5#	CSR_NON_SEC_V_10.00	3	ÉMETTEUR C			– 200,00
S_CNV_a3#	CSR_NON_SEC_V_1.00	1	ÉMETTEUR A			400,00
S_CNV_b2#	CSR_NON_SEC_V_1.00	1	ÉMETTEUR B			200,00
S_CNV_c2#	CSR_NON_SEC_V_1.00	3	ÉMETTEUR C			400,00
S_CNV_a1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	ÉMETTEUR A			– 100,00
S_CNV_a2#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	ÉMETTEUR A			700,00
S_CNV_b1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	ÉMETTEUR B			900,00
S_CNV_c1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	3	ÉMETTEUR C			– 500,00
S_CNV_d1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	4	ÉMETTEUR D			700,00
S_CNV_e1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	5	ÉMETTEUR E			– 800,00
S_CNV_f1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	6	ÉMETTEUR F			700,00
S_CNV_g1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	7	ÉMETTEUR G			– 400,00
S_CNV_h1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	8	ÉMETTEUR H			– 50,00
S_CNV_i1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	10	ÉMETTEUR I			300,00
S_CNV_j1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	11	ÉMETTEUR J			50,00
S_CNV_k1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	12	ÉMETTEUR K			– 300,00
S_CNV_l1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	13	ÉMETTEUR L			1 000,00

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
S_CNV_m1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	14	ÉMETTEUR M			– 350,00
S_CNV_n1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	15	ÉMETTEUR N			950,00
S_CNV_o1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	16	ÉMETTEUR O			– 900,00
S_CNV_p1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	17	ÉMETTEUR P			200,00
S_CNV_q1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	18	ÉMETTEUR Q			400,00
S_CNV_r1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	18	ÉMETTEUR R			– 300,00
S_CNV_s1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	19	INDICE S			850,00
S_CNV_t1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	20	INDICE T			– 650,00
S_CNV_u1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	19	INDICE U			– 350,00
S_CND_hb2#	CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT	9	ÉMETTEUR HB			– 17 000,00
S_CND_t1#	CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT	3	ÉMETTEUR T			– 6 000,00
S_CND_y1#	CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT	20	INDICE Y			9 000,00
S_CND_ab2#	CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS	2	ÉMETTEUR AC			14 000,00
S_CND_b2#	CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS	1	ÉMETTEUR B			– 17 000,00
S_CND_w1#	CSR_NON_-SEC_D_10.00_DEBT	10	ÉMETTEUR W		CQS 1	9 000,00
S_CND_a4#	CSR_NON_-SEC_D_1.00_DEBT	1	ÉMETTEUR A			– 10 000,00
S_CND_s1#	CSR_NON_-SEC_D_1.00_DEBT	3	ÉMETTEUR S			– 6 000,00

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

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
S_CND_x1#	CSR_NON_SEC_D_1.00_CDS	19	INDICE X			– 18 500,00
S_CND_a1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	1	ÉMETTEUR A			20 000,00
S_CND_a2#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	1	ÉMETTEUR A			– 30 000,00
S_CND_b1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	1	ÉMETTEUR B			12 000,00
S_CND_c1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	3	ÉMETTEUR C			– 6 000,00
S_CND_d1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	4	ÉMETTEUR D			25 000,00
S_CND_e1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	5	ÉMETTEUR E			– 4 000,00
S_CND_f1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	6	ÉMETTEUR F			– 8 000,00
S_CND_g1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	7	ÉMETTEUR G			8 000,00
S_CND_h1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	8	ÉMETTEUR H			3 000,00
S_CND_hb1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	9	ÉMETTEUR HA			– 23 000,00
S_CND_i1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	10	ÉMETTEUR I		CQS 2	– 5 000,00
S_CND_j1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	11	ÉMETTEUR J			2 000,00
S_CND_k1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	12	ÉMETTEUR K			7 000,00
S_CND_l1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	13	ÉMETTEUR L			– 9 000,00
S_CND_m1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	14	ÉMETTEUR M			10 000,00
S_CND_n1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	15	ÉMETTEUR N			– 20 000,00

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
S_CND_o1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	16	ÉMETTEUR O			5 000,00
S_CND_p1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	17	ÉMETTEUR P			– 3 000,00
S_CND_q1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	18	ÉMETTEUR Q			10 000,00
S_CND_r1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	18	ÉMETTEUR R			– 5 000,00
S_CND_a3#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	1	ÉMETTEUR A			15 000,00
S_CND_ab1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	2	ÉMETTEUR AB			21 000,00
S_CND_u1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	19	INDICE U			– 32 000,00
S_CND_v1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	20	INDICE V			– 13 000,00
S_CND_x2#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	19	INDICE X			52 500,00
S_CNC_a1#	CSR_NON_SEC_CU	1	ÉMETTEUR A			– 2 338,64
S_CNC_a2#	CSR_NON_SEC_CU	1	ÉMETTEUR A			35 116,67
S_CNC_aa1#	CSR_NON_SEC_CU	10	ÉMETTEUR AA		CQS 1	– 1 212,50
S_CNC_ab1#	CSR_NON_SEC_CU	2	ÉMETTEUR AB1			– 247,47
S_CNC_b1#	CSR_NON_SEC_CU	1	ÉMETTEUR B			890,91
S_CNC_c1#	CSR_NON_SEC_CU	3	ÉMETTEUR C			– 500,00
S_CNC_d1#	CSR_NON_SEC_CU	4	ÉMETTEUR D			415,00
S_CNC_e1#	CSR_NON_SEC_CU	5	ÉMETTEUR E			– 1 050,00

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
S_CNC_f1#	CSR_NON_SEC_CU	6	ÉMETTEUR F			– 150,00
S_CNC_g1#	CSR_NON_SEC_CU	7	ÉMETTEUR G			– 318,75
S_CNC_h1#	CSR_NON_SEC_CU	8	ÉMETTEUR H			– 425,00
S_CNC_hb1#	CSR_NON_SEC_CU	9	ÉMETTEUR HB1			– 500,00
S_CNC_i1#	CSR_NON_SEC_CU	10	ÉMETTEUR I		CQS 2	– 937,50
S_CNC_j1#	CSR_NON_SEC_CU	11	ÉMETTEUR J			– 4 650,00
S_CNC_k1#	CSR_NON_SEC_CU	12	ÉMETTEUR K			– 425,00
S_CNC_l1#	CSR_NON_SEC_CU	13	ÉMETTEUR L			– 27 660,00
S_CNC_m1#	CSR_NON_SEC_CU	14	ÉMETTEUR M			– 488,00
S_CNC_n1#	CSR_NON_SEC_CU	15	ÉMETTEUR N			13 237,50
S_CNC_o1#	CSR_NON_SEC_CU	16	ÉMETTEUR O			– 1 127,50
S_CNC_p1#	CSR_NON_SEC_CU	17	ÉMETTEUR P			– 5 775,00
S_CNC_q1#	CSR_NON_SEC_CU	18	ÉMETTEUR Q			– 7 842,00
S_CNC_r1#	CSR_NON_SEC_CU	18	ÉMETTEUR R			15 684,00
S_CNC_s1#	CSR_NON_SEC_CU	4	ÉMETTEUR S			– 750,00
S_CNC_t1#	CSR_NON_SEC_CU	19	ÉMETTEUR T			3 550,00
S_CNC_u1#	CSR_NON_SEC_CU	20	ÉMETTEUR U			1 660,00
S_CNC_v1#	CSR_NON_SEC_CU	19	ÉMETTEUR V			– 18 637,50

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
S_CNC_w1#	CSR_NON_SEC_CU	20	ÉMETTEUR W			– 8 715,00
S_CNC_x1#	CSR_NON_SEC_CU	3	ÉMETTEUR X			– 500,00
S_CNC_y1#	CSR_NON_SEC_CU	1	ÉMETTEUR Y			– 249,95
S_CNC_z1#	CSR_NON_SEC_CU	1	ÉMETTEUR Z			– 249,95
S_CNC_a1#	CSR_NON_SEC_CD	1	ÉMETTEUR A			2 363,38
S_CNC_a2#	CSR_NON_SEC_CD	1	ÉMETTEUR A			– 35 314,65
S_CNC_aa1#	CSR_NON_SEC_CD	10	ÉMETTEUR AA		CQS 1	1 150,00
S_CNC_ab1#	CSR_NON_SEC_CD	2	ÉMETTEUR AB1			247,47
S_CNC_b1#	CSR_NON_SEC_CD	1	ÉMETTEUR B			– 5 543,43
S_CNC_c1#	CSR_NON_SEC_CD	3	ÉMETTEUR C			500,00
S_CNC_d1#	CSR_NON_SEC_CD	4	ÉMETTEUR D			– 385,00
S_CNC_e1#	CSR_NON_SEC_CD	5	ÉMETTEUR E			575,00
S_CNC_f1#	CSR_NON_SEC_CD	6	ÉMETTEUR F			75,00
S_CNC_g1#	CSR_NON_SEC_CD	7	ÉMETTEUR G			287,50
S_CNC_h1#	CSR_NON_SEC_CD	8	ÉMETTEUR H			400,00
S_CNC_hb1#	CSR_NON_SEC_CD	9	ÉMETTEUR HB1			500,00
S_CNC_i1#	CSR_NON_SEC_CD	10	ÉMETTEUR I		CQS 2	750,00
S_CNC_j1#	CSR_NON_SEC_CD	11	ÉMETTEUR J			4 100,00

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

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
S_CNC_k1#	CSR_NON_SEC_CD	12	ÉMETTEUR K			387,50
S_CNC_l1#	CSR_NON_SEC_CD	13	ÉMETTEUR L			22 130,00
S_CNC_m1#	CSR_NON_SEC_CD	14	ÉMETTEUR M			160,00
S_CNC_n1#	CSR_NON_SEC_CD	15	ÉMETTEUR N			– 23 437,50
S_CNC_o1#	CSR_NON_SEC_CD	16	ÉMETTEUR O			1 246,25
S_CNC_p1#	CSR_NON_SEC_CD	17	ÉMETTEUR P			6 225,00
S_CNC_q1#	CSR_NON_SEC_CD	18	ÉMETTEUR Q			8 752,00
S_CNC_r1#	CSR_NON_SEC_CD	18	ÉMETTEUR R			– 17 504,00
S_CNC_s1#	CSR_NON_SEC_CD	4	ÉMETTEUR S			– 250,00
S_CNC_t1#	CSR_NON_SEC_CD	19	ÉMETTEUR T			– 3 500,00
S_CNC_u1#	CSR_NON_SEC_CD	20	ÉMETTEUR U			– 1 540,00
S_CNC_v1#	CSR_NON_SEC_CD	19	ÉMETTEUR V			18 375,00
S_CNC_w1#	CSR_NON_SEC_CD	20	ÉMETTEUR W			8 085,00
S_CNC_x1#	CSR_NON_SEC_CD	3	ÉMETTEUR X			500,00
S_CNC_y1#	CSR_NON_SEC_CD	1	ÉMETTEUR Y			– 226,77
S_CNC_z1#	CSR_NON_SEC_CD	1	ÉMETTEUR Z			– 226,77
S_CMV_a5#	CM_V_5.00	1	CHARBON			– 300,00

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
S_CMV_b4#	CM_V_5.00	1	URANIUM			450,00
S_CMV_a4#	CM_V_3.00	1	CHARBON			800,00
S_CMV_b3#	CM_V_3.00	1	URANIUM			800,00
S_CMV_a6#	CM_V_10.00	1	CHARBON			100,00
S_CMV_b5#	CM_V_10.00	1	URANIUM			– 250,00
S_CMV_a3#	CM_V_1.00	1	CHARBON			– 200,00
S_CMV_b2#	CM_V_1.00	1	URANIUM			– 750,00
S_CMV_d1#	CM_V_1.00	2	WTI			– 175,00
S_CMV_f1#	CM_V_1.00	3	FWD ELECTRICITY NE			– 450,00
S_CMV_h1#	CM_V_1.00	4	PANAMAX			– 5 500,00
S_CMV_j1#	CM_V_1.00	5	CUIVRE			– 200,00
S_CMV_l1#	CM_V_1.00	6	GAZ NATUREL LIQUÉFIÉ			1 000,00
S_CMV_n1#	CM_V_1.00	7	ARGENT			500,00
S_CMV_p1#	CM_V_1.00	8	MAÏS			– 1 000,00
S_CMV_r1#	CM_V_1.00	9	LACTOSÉRUM			– 125,00
S_CMV_t1#	CM_V_1.00	10	CAOUTCHOUC			– 50,00
S_CMV_v1#	CM_V_1.00	11	POTASSE			– 1 800,00

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
S_CMV_a1#	CM_V_0.50	1	CHARBON			1 000,00
S_CMV_a2#	CM_V_0.50	1	CHARBON			– 350,00
S_CMV_b1#	CM_V_0.50	1	URANIUM			150,00
S_CMV_c1#	CM_V_0.50	2	BRENT			200,00
S_CMV_e1#	CM_V_0.50	3	SPOT ELECTRICITY SE			– 300,00
S_CMV_g1#	CM_V_0.50	4	SUPRAMAX			– 5 000,00
S_CMV_i1#	CM_V_0.50	5	ACIER			550,00
S_CMV_k1#	CM_V_0.50	6	GAZ NATUREL			400,00
S_CMV_m1#	CM_V_0.50	7	OR			– 200,00
S_CMV_o1#	CM_V_0.50	8	GRAINES DE SOJA			– 750,00
S_CMV_q1#	CM_V_0.50	9	POISSON			250,00
S_CMV_s1#	CM_V_0.50	10	CACAO			350,00
S_CMV_u1#	CM_V_0.50	11	VERRE PLAT			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	MAÏS	OKLAHOMA		– 10 000,00
S_CMD_f1#	CM_D_3.00	3	FWD ELECTRICITY NE	TEXAS		– 4 500,00

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
S_CMD_h1#	CM_D_3.00	4	PANAMAX	NOUVELLE ORLÉANS		– 68 750,00
S_CMD_n1#	CM_D_20.00	7	ARGENT	EU1		5 000,00
S_CMD_r1#	CM_D_20.00	9	LACTOSÉRUM	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	GAZ NATUREL LIQUÉFIÉ	OKLAHOMA		10 000,00
S_CMD_t1#	CM_D_15.00	10	CAOUTCHOUC	NEWCASTLE		– 500,00
S_CMD_j1#	CM_D_10.00	5	CUIVRE	OKLAHOMA		– 2 000,00
S_CMD_v1#	CM_D_10.00	11	POTASSE	NEWCASTLE		– 18 000,00
S_CMD_b1#	CM_D_1.00	1	URANIUM	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	NOUVELLE ORLÉANS		187 500,00
S_CMD_a4#	CM_D_0.50	1	CHARBON	NEWCASTLE		8 000,00
S_CMD_a1#	CM_D_0.00	1	CHARBON	NEWCASTLE		10 000,00
S_CMD_a2#	CM_D_0.00	1	CHARBON	NEWCASTLE		– 3 500,00
S_CMD_a3#	CM_D_0.00	1	CHARBON	LONDRES		– 2 000,00
S_CMD_c1#	CM_D_0.00	2	BRENT	LE HAVRE		2 000,00

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
S_CMD_e1#	CM_D_0.00	3	SPOT ELECTRICITY SE	LONDRES		– 3 000,00
S_CMD_i1#	CM_D_0.00	5	ACIER	LE HAVRE		5 500,00
S_CMD_k1#	CM_D_0.00	6	GAZ NATUREL	LE HAVRE		4 000,00
S_CMD_m1#	CM_D_0.00	7	OR	UK1		– 2 000,00
S_CMD_o1#	CM_D_0.00	8	GRAINES DE SOJA	LE HAVRE		– 7 500,00
S_CMD_q1#	CM_D_0.00	9	POISSON	LONDRES		2 500,00
S_CMD_s1#	CM_D_0.00	10	CACAO	LONDRES		3 500,00
S_CMD_u1#	CM_D_0.00	11	VERRE PLAT	LONDRES		30 000,00
S_CMC_a1#	CM_CU	1	CHARBON			17 335,00
S_CMC_a2#	CM_CU	1	CHARBON			36 936,00
S_CMC_b1#	CM_CU	1	URANIUM			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	SPOT ELECTRICITY SE			8 563,00
S_CMC_f1#	CM_CU	3	FWD ELECTRICITY NE			– 27 250,00
S_CMC_g1#	CM_CU	4	SUPRAMAX			– 36 880,00
S_CMC_h1#	CM_CU	4	PANAMAX			29 472,00

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
S_CMC_i1#	CM_CU	5	ACIER			– 5 850,00
S_CMC_j1#	CM_CU	5	CUIVRE			14 644,80
S_CMC_k1#	CM_CU	6	GAZ NATUREL			– 6 147,50
S_CMC_l1#	CM_CU	6	GAZ NATUREL LIQUÉFIÉ			– 6 147,50
S_CMC_m1#	CM_CU	7	OR			– 1 486,67
S_CMC_n1#	CM_CU	7	ARGENT			743,33
S_CMC_o1#	CM_CU	8	GRAINES DE SOJA			– 14 535,00
S_CMC_p1#	CM_CU	8	MAÏS			20 475,00
S_CMC_q1#	CM_CU	9	POISSON			– 19 900,00
S_CMC_r1#	CM_CU	9	LACTOSÉRUM			3 387,00
S_CMC_s1#	CM_CU	10	CACAO			1 005,00
S_CMC_t1#	CM_CU	10	CAOUTCHOUC			10 892,20
S_CMC_u1#	CM_CU	11	VERRE PLAT			– 13 790,00
S_CMC_v1#	CM_CU	11	POTASSE			20 685,00
S_CMC_x1#	CM_CU	9	LAIT			– 6 300,00
S_CMC_y1#	CM_CU	1	URANIUM			– 65 864,00
S_CMC_z1#	CM_CU	4	PANAMAX			29 472,00

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

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
S_CMC_a1#	CM_CD	1	CHARBON			– 18 260,00
S_CMC_a2#	CM_CD	1	CHARBON			– 37 630,00
S_CMC_b1#	CM_CD	1	URANIUM			– 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	SPOT ELECTRICITY SE			– 8 233,00
S_CMC_f1#	CM_CD	3	FWD ELECTRICITY 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	ACIER			4 080,00
S_CMC_j1#	CM_CD	5	CUIVRE			– 10 219,80
S_CMC_k1#	CM_CD	6	GAZ NATUREL			4 222,50
S_CMC_l1#	CM_CD	6	GAZ NATUREL LIQUÉFIÉ			4 222,50
S_CMC_m1#	CM_CD	7	OR			1 353,33
S_CMC_n1#	CM_CD	7	ARGENT			– 676,67
S_CMC_o1#	CM_CD	8	GRAINES DE SOJA			10 435,00
S_CMC_p1#	CM_CD	8	MAÏS			– 14 735,00

Instrument	Identifiant du facteur de risque	Classe (bucket)	Identifiant supplémentaire	Identifiant supplémentaire 2	Catégorie de qualité de crédit	Sensibilité au risque
S_CMC_q1#	CM_CD	9	POISSON			6 700,00
S_CMC_r1#	CM_CD	9	LACTOSÉRUM			– 3 012,00
S_CMC_s1#	CM_CD	10	CACAO			– 1 415,00
S_CMC_t1#	CM_CD	10	CAOUTCHOUC			– 7 817,20
S_CMC_u1#	CM_CD	11	VERRE PLAT			14 200,00
S_CMC_v1#	CM_CD	11	POTASSE			– 21 300,00
S_CMC_x1#	CM_CD	9	LAIT			– 4 700,00
S_CMC_y1#	CM_CD	1	URANIUM			– 66 344,00
S_CMC_z1#	CM_CD	4	PANAMAX			– 22 856,00

Portefeuille	Catégorie de risque	Composante	Instruments
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#

Portefeuille	Catégorie de risque	Composante	Instruments
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#

Portefeuille	Catégorie de risque	Composante	Instruments
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	COURBURE	S_IRC_b1#
G047	GIRR	COURBURE	S_IRC_c1#
G048	GIRR	COURBURE	S_IRC_a1# S_IRC_b1#
G049	GIRR	COURBURE	S_IRC_d1#
G050	GIRR	COURBURE	S_IRC_b1# S_IRC_c1#
G051	GIRR	COURBURE	S_IRC_c1# S_IRC_e1#
G052	GIRR	COURBURE	S_IRC_d1# S_IRC_e1#
G053	GIRR	COURBURE	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#

Portefeuille	Catégorie de risque	Composante	Instruments
G054	GIRR	TOUTES	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#

Portefeuille	Catégorie de risque	Composante	Instruments
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#

Portefeuille	Catégorie de risque	Composante	Instruments
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#

Portefeuille	Catégorie de risque	Composante	Instruments
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#

Portefeuille	Catégorie de risque	Composante	Instruments
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	COURBURE	S_EQC_b1#
E089	EQ	COURBURE	S_EQC_c1#
E090	EQ	COURBURE	S_EQC_d1#
E091	EQ	COURBURE	S_EQC_e1#
E092	EQ	COURBURE	S_EQC_f1#
E093	EQ	COURBURE	S_EQC_g1#
E094	EQ	COURBURE	S_EQC_h1#
E095	EQ	COURBURE	S_EQC_i1#
E096	EQ	COURBURE	S_EQC_j1#
E097	EQ	COURBURE	S_EQC_k1#
E098	EQ	COURBURE	S_EQC_q1#
E099	EQ	COURBURE	S_EQC_t1#
E100	EQ	COURBURE	S_EQC_u1#
E101	EQ	COURBURE	S_EQC_a1# S_EQC_a2#
E102	EQ	COURBURE	S_EQC_a1# S_EQC_b1#
E103	EQ	COURBURE	S_EQC_f1# S_EQC_ac1#
E104	EQ	COURBURE	S_EQC_j1# S_EQC_ag1#
E105	EQ	COURBURE	S_EQC_k1# S_EQC_ah1#
E106	EQ	COURBURE	S_EQC_q1# S_EQC_r1#
E107	EQ	COURBURE	S_EQC_t1# S_EQC_v1#

Portefeuille	Catégorie de risque	Composante	Instruments
E108	EQ	COURBURE	S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_y1# S_EQC_z1#
E109	EQ	COURBURE	S_EQC_s1#
E110	EQ	COURBURE	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	COURBURE	S_EQC_a2# S_EQC_q1#
E112	EQ	COURBURE	S_EQC_t1# S_EQC_u1#
E113	EQ	COURBURE	S_EQC_a2# S_EQC_t1#
E114	EQ	COURBURE	S_EQC_a1# S_EQC_b1# S_EQC_d1# S_EQC_s1#
E115	EQ	COURBURE	S_EQC_a1# S_EQC_b1# S_EQC_t1# S_EQC_u1#
E116	EQ	COURBURE	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	TOUTES	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#

Portefeuille	Catégorie de risque	Composante	Instruments
			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#

Portefeuille	Catégorie de risque	Composante	Instruments
F015	FX	COURBURE	S_FXC_b1#
F016	FX	COURBURE	S_FXC_c1#
F017	FX	COURBURE	S_FXC_a1# S_FXC_b1#
F018	FX	COURBURE	S_FXC_d1#
F019	FX	COURBURE	S_FXC_b1# S_FXC_c1#
F020	FX	COURBURE	S_FXC_c1# S_FXC_e1#
F021	FX	COURBURE	S_FXC_b1# S_FXC_d1# S_FXC_e1#
F022	FX	COURBURE	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	TOUTES	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	COURBURE	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#

Portefeuille	Catégorie de risque	Composante	Instruments
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#

Portefeuille	Catégorie de risque	Composante	Instruments
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#

Portefeuille	Catégorie de risque	Composante	Instruments
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	COURBURE	S_CNC_b1#
N066	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_c1#
N067	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_d1#
N068	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_e1#
N069	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_f1#
N070	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_g1#
N071	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_h1#
N072	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_i1#
N073	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_aa1#
N074	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_j1#
N075	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_k1#
N076	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_l1#
N077	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_m1#
N078	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_n1#
N079	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_o1#
N080	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_p1#

Portefeuille	Catégorie de risque	Composante	Instruments
N081	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_q1#
N082	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_t1#
N083	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_u1#
N084	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_a1# S_CNC_a2#
N085	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_a1# S_CNC_b1#
N086	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_q1# S_CNC_r1#
N087	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_t1# S_CNC_v1#
N088	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_u1# S_CNC_w1#
N089	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_y1# S_CNC_z1#
N090	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_s1#
N091	CSR_NON_SEC	COURBURE	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	COURBURE	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	COURBURE	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	COURBURE	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	COURBURE	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	COURBURE	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	COURBURE	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	COURBURE	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	COURBURE	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	COURBURE	S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N101	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_c1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_z1#
N102	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_a1# S_CNC_b1# S_CNC_d1# S_CNC_s1#

Portefeuille	Catégorie de risque	Composante	Instruments
N103	CSR_NON_SEC	COURBURE	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	TOUTES	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#

Portefeuille	Catégorie de risque	Composante	Instruments
N104(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	COURBURE	S_CNC_ab1#
N105(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	COURBURE	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#

Portefeuille	Catégorie de risque	Composante	Instruments
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#

Portefeuille	Catégorie de risque	Composante	Instruments
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	COURBURE	S_CMC_b1#
C052	CM	COURBURE	S_CMC_c1#
C053	CM	COURBURE	S_CMC_e1#
C054	CM	COURBURE	S_CMC_g1#
C055	CM	COURBURE	S_CMC_i1#
C056	CM	COURBURE	S_CMC_k1#
C057	CM	COURBURE	S_CMC_m1#
C058	CM	COURBURE	S_CMC_o1#
C059	CM	COURBURE	S_CMC_q1#
C060	CM	COURBURE	S_CMC_s1#
C061	CM	COURBURE	S_CMC_u1#
C062	CM	COURBURE	S_CMC_a1# S_CMC_a2#
C063	CM	COURBURE	S_CMC_a1# S_CMC_b1#
C064	CM	COURBURE	S_CMC_c1# S_CMC_d1#
C065	CM	COURBURE	S_CMC_e1# S_CMC_f1#
C066	CM	COURBURE	S_CMC_g1# S_CMC_h1#
C067	CM	COURBURE	S_CMC_i1# S_CMC_j1#
C068	CM	COURBURE	S_CMC_k1# S_CMC_l1#
C069	CM	COURBURE	S_CMC_m1# S_CMC_n1#
C070	CM	COURBURE	S_CMC_o1# S_CMC_p1#
C071	CM	COURBURE	S_CMC_q1# S_CMC_r1#
C072	CM	COURBURE	S_CMC_s1# S_CMC_t1#
C073	CM	COURBURE	S_CMC_u1# S_CMC_v1#
C074	CM	COURBURE	S_CMC_a2# S_CMC_b1#
C075	CM	COURBURE	S_CMC_g1# S_CMC_z1#

Portefeuille	Catégorie de risque	Composante	Instruments
C076	CM	COURBURE	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	COURBURE	S_CMC_a2# S_CMC_u1#
C078	CM	COURBURE	S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_y1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_x1#
C079	CM	COURBURE	S_CMC_x1# S_CMC_g1# S_CMC_z1#
C080	CM	COURBURE	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	TOUTES	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#»