

«C 16.01 - RISQUE OPÉRATIONNEL - EXIGENCES DE FONDS PROPRES (OPR OF)»

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **C 16.01 - RISQUE OPÉRATIONNEL - Exigences de fonds propres (OPR OF)** | | | | | | |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | | **Valeur** |  |  | **Exigences de fonds propres** | **Montant d’exposition au risque** |
| **dont: ajustements dus à une fusion/acquisition d'entités ou d'activités** | **(Ajustements dus à une cession d'entités ou d'activités)** |
| 0010 | 0020 | 0030 | 0040 | 0050 |
| 0010 | **Composante «indicateur d’activité» (BIC) et ASA** |  |  |  |  |  |
| 0020 | Indicateur d’activité (BI) |  |  |  |  |  |
| 0030 | **Composante «intérêts, contrats de location et dividendes» (ILDC)** |  |  |  |  |  |
| 0040 | ILDC correspondant à l’établissement individuel/au groupe consolidé (à l’exclusion des entités mentionnées à l'article 314, paragraphe 3) |  |  |  |  |  |
| 0050 | ILDC pour les entités mentionnées à l'article 314, paragraphe 3 |  |  |  |  |  |
| 0060 | **Composante «services» (SC)** |  |  |  |  |  |
| 0070 | **Composante financière (FC)** |  |  |  |  |  |
| 0080 | **ASA appliquée en vertu de l’article 314, paragraphe 4 (banque de détail)** |  |  |  |  |  |
| 0090 | **ASA appliquée en vertu de l’article 314, paragraphe 4 (banque commerciale)** |  |  |  |  |  |
| 0100 | **Pour mémoire**: ILDC correspondant à l’établissement individuel/au groupe consolidé, y compris les entités mentionnées à l'article 314, paragraphe 3 |  |  |  |  |  |
| **Autres informations** | | | | | | |
| 0110 | **Approche suivie pour le calcul de la composante financière** |  |  |  |  |  |

«C 16.02 - RISQUE OPÉRATIONNEL - Composante “indicateur d'activité”(OPR BIC)»

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **C 16.02 - RISQUE OPÉRATIONNEL - Composante «indicateur d'activité»(OPR BIC)** | | | | | | | | |
|  |  |  | |  |  |  |  |  |
|  | | **ANNÉE-3** | | **ANNÉE-2** | | **ANNÉE PASSÉE** | |  |
|  |
| **Valeur comptable** | **Valeur — Approche fondée sur la limite prudentielle** | **Valeur comptable** | **Valeur — Approche fondée sur la limite prudentielle** | **Valeur comptable** | **Valeur — Approche fondée sur la limite prudentielle** | **Valeur moyenne** |  |
| 0010 | 0020 | 0030 | 0040 | 0050 | 0060 | 0070 |  |
| **0010 - 0210** | **1. Composante «intérêts, contrats de location et dividendes» (ILDC)** | | | | | | |  |  |
| 0010 | **Composante «intérêts» (IC)** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0020 | **Résultat net** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0030 | **Produits d’intérêts [y compris d’actifs loués (location simple et location-financement)]** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0040 | Produits d'intérêts |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0050 | Produits d’actifs loués (location simple et location-financement) autres que produits d’intérêts |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0060 | Bénéfices sur actifs loués (location simple et location-financement) |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0070 | **{Charges d’intérêts [y compris sur actifs loués (location simple et location-financement)]}** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0080 | (Charges d’intérêts) |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0090 | (Charges sur actifs en location simple, autres que charges d’intérêts) |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0100 | (Pertes sur actifs en location simple) |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0110 | **Composante «actifs» (AC)** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0120 | **Total actifs** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0130 | Comptes à vue auprès de banques centrales et autres dépôts à vue |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0140 | Titres de créance |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0150 | Prêts et avances |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0160 | Dérivés |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0170 | Négociation et couverture économique |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0180 | Comptabilité de couverture |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0190 | Actifs faisant l'objet d'un contrat de location |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0200 | **Composante «dividendes» (DC)** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0210 | Dividendes reçus |  |  |  |  |  |  |  |  |
| **0220 - 0360** | **2. Composante «services» (SC)** | | | | | | | |  |
| 0220 | **Autres produits d’exploitation** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0230 | Autres produits d’exploitation reçus de membres appartenant au même SPI |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0240 | Bénéfice sur actifs non courants et groupes destinés à être cédés, classés comme étant détenus en vue de la vente, ne remplissant pas les conditions des activités abandonnées |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0250 | Autres |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0260 | **(Autres charges d’exploitation)** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0270 | (Autres charges d’exploitation versées à des membres appartenant au même SPI) |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0280 | (Total des pertes, charges, provisions et autres conséquences financières résultant d’événements de risque opérationnel) |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0290 | Pertes sur actifs non courants et groupes destinés à être cédés, classés comme étant détenus en vue de la vente, ne remplissant pas les conditions des activités abandonnées |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0300 | (Autres) |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0310 | **Composante «produits d’honoraires et de commissions» (FI)** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0320 | Produits d’honoraires et de commissions |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0330 | dont: reçus de membres appartenant au même SPI |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0340 | **(Composante «charges d’honoraires et de commissions») (FE)** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0350 | (Charges d’honoraires et de commissions) |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0360 | (dont: versées à des membres appartenant au même SPI) |  |  |  |  |  |  |  |  |
| **0370 - 0480** | **3. Composante financière (FC)** | | | | | | | |  |
| 0370 | **Composante «portefeuille de négociation» (TC)** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0380 | **Bénéfice net ou (-)perte nette applicable au portefeuille de négociation** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0390 | Profits ou (-) pertes sur actifs et passifs financiers de négociation ou détenus à des fins de négociation, net |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0400 | Portefeuille de négociation – Profits ou (-) pertes résultant de la comptabilité de couverture, net |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0410 | Portefeuille de négociation – Différence de change [profits ou (-) pertes], net |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0420 | **Composante «portefeuille bancaire» (BC)** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0430 | **Bénéfice net ou (-)perte nette applicable au portefeuille bancaire** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0440 | Profits ou (-) pertes sur décomptabilisation d’actifs et passifs financiers non évalués à la juste valeur par le biais du compte de résultat, net |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0450 | Profits ou (-) pertes sur actifs financiers détenus à des fins autres que de négociation obligatoirement évalués à la juste valeur par le biais du compte de résultat, net |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0460 | Profits ou (-) pertes sur actifs et passifs financiers désignés comme évalués à la juste valeur par le biais du compte de résultat, net |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0470 | Portefeuille bancaire – Profits ou (-) pertes résultant de la comptabilité de couverture, net |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0480 | Portefeuille bancaire – Différence de change [profits ou (-) pertes], net |  |  |  |  |  |  |  |  |

«C 16.03 - VENTILATION DU RISQUE OPÉRATIONNEL (OPR BD) - Pertes, charges, provisions et autres conséquences financières résultant d’événements de risque opérationnel»

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **C 16.03 - VENTILATION DU RISQUE OPÉRATIONNEL (OPR BD) - Pertes, charges, provisions et autres conséquences financières résultant d’événements de risque opérationnel** | | | | |
|  | | **Valeur comptable** | | |
| **ANNÉE-3** | **ANNÉE-2** | **ANNÉE PASSÉE** |
|  |
| 0010 | 0020 | 0030 |  |
| **0010 - 0080** | **Pertes, charges, provisions et autres conséquences financières résultant d’événements de risque opérationnel, comme suit:** |  |  |  |  |
| 0010 | (Charges d’intérêts) |  |  |  |  |
| 0020 | (Autres charges d’exploitation) |  |  |  |  |
| 0030 | (Charges administratives) |  |  |  |  |
| 0040 | (Amortissements par suite d’événements de risque opérationnel) |  |  |  |  |
| 0050 | (Provisions ou (–) reprises de provisions) |  |  |  |  |
| 0060 | (Dépréciations ou (–) reprises de dépréciations) |  |  |  |  |
| 0070 | (Autres) |  |  |  |  |
| 0080 | **(Total)** |  |  |  |  |

«C 16.04 - RISQUE OPÉRATIONNEL - Informations sur les filiales visées à l'article 314, paragraphe 3, du CRR»

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **C 16.04 - RISQUE OPÉRATIONNEL - Informations sur les filiales faisant l’objet de la dérogation prévue à l'article 314, paragraphe 3, du CRR** | | | | | | |  |
|  | | | | | | |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | **Nom de l’entité juridique** | **Code LEI** | **ILDC** | **IC** | **AC** | **DC** |  |
|  |
|  |
| Lignes | 0010 | 0020 | 0030 | 0040 | 0050 | 0060 |  |
| … |  |  |  |  |  |  |  |