

Funds sheet

Enquête **Bâle 3**
Formulaire **[P/C]_CRFUNDS_Erl**

ID	Désignation	Référence à des textes réglementaires et remarques
Lignes		
	Approche <i>look-through</i> (ALT)	Circulaire FINMA 2017/7 « Risques de crédit – banques », Cm 338 à 344
001	Toutes les participations FCG dans l'ALT	Toutes les participations FCG traitées selon l'ALT conformément à la hiérarchie décrite au Cm 337
002	Dont: toutes les participations FCG dans l'ALT qui sont gérées par la banque elle-même	Parmi les investissements indiqués à la ligne 001 : ceux gérés par la banque elle-même
	Approche sur la base du mandat (ABM)	Circulaire FINMA 2017/7 « Risques de crédit – banques » Cm 345 à 350
003	Toutes les participations FCG dans l'ABM	Toutes les participations qui sont traitées selon l'ABM conformément à la hiérarchie décrite au Cm 337
004	Dont : toutes les participations FCG dans l'ABM qui sont gérées par la banque elle-même	Parmi les investissements indiqués à la ligne 003 : ceux gérés par la banque elle-même
	Approche <i>fallback</i> (AFB)	Circulaire FINMA 2017/7 « Risques de crédit – banques » Cm 351
005	Toutes les participations FCG dans l'AFB	Toutes les participations FCG qui sont gérées selon l'AFB conformément à la hiérarchie décrite au Cm 337
006	Dont: toutes les participations FCG dans l'AFB qui sont gérées par la banque elle-même	Parmi les investissements indiqués à la ligne 005 : ceux gérés par la banque elle-même
	Approche simplifiée	Circulaire FINMA 2017/7 «Risques de crédit – banques», Cm 335 et 352
007	Toutes les participations FCG dans l'approche simplifiée avec 250%	Toutes les participations FCG qui sont gérées selon l'approche simplifiée conformément à la hiérarchie décrite au Cm 337 et pondérées à 250%
008	Dont: toutes les participations FCG dans l'approche simplifiée gérées par la banque elle-même	Parmi les investissements indiqués à la ligne 007 : ceux gérés par la banque elle-même
024	Toutes les participations FCG dans l'approche simplifiée avec 400%	Toutes les participations FCG qui sont gérées selon l'approche simplifiée conformément à la hiérarchie décrite au Cm 337 et pondérées à 400%
025	Dont: toutes les participations FCG dans l'approche simplifiée gérées par la banque elle-même	Parmi les investissements indiqués à la ligne 024 : ceux gérés par la banque elle-même
009 – 013	Exposition ALT en fonction de la pondération-risque	Pour les investissements indiqués à la ligne 001 : répartition en fonction de la pondération-risque dans l'ALT
014 – 018	Exposition ABM en fonction de la pondération-risque	Pour les investissements indiqués à la ligne 003 : répartition en fonction de la pondération-risque dans l'ABM
019	Approche simplifiée avec pondération à 250%	Indiquer les mêmes investissements qu'à la ligne 007
020	Dont: avec indicateur de risque synthétique de valeur 1	Parmi les investissements indiqués à la ligne 019 : ceux ayant un indicateur de risque synthétique de valeur 1 selon l'ordonnance sur les placements collectifs de capitaux, annexe 3, section 3 « profil de risque et de rendement »
021	Dont: avec indicateur de risque synthétique de valeur 2	Parmi les investissements indiqués à la ligne 019 : ceux ayant un indicateur de risque synthétique de valeur 2 selon l'ordonnance sur les placements collectifs de capitaux, annexe 3, section 3 « profil de risque et de rendement »
022	Dont: avec indicateur de risque synthétique de valeur 3	Parmi les investissements indiqués à la ligne 019 : ceux ayant un indicateur de risque synthétique de valeur 3 selon l'ordonnance sur les placements collectifs de capitaux, annexe 3, section 3 « profil de risque

Funds sheet

Enquête **Bâle 3**
Formulaire **[P/C]_CRFUNDS_Erl**

ID	Désignation	Référence à des textes réglementaires et remarques
		et de rendement »
023	Dont: avec indicateur de risque synthétique de valeur 4	Parmi les investissements indiqués à la ligne 019 : ceux ayant un indicateur de risque synthétique de valeur 4 selon l'ordonnance sur les placements collectifs de capitaux, annexe 3, section 3 « profil de risque et de rendement »
026	Dont: avec indicateur de risque synthétique de valeur 5	Parmi les investissements indiqués à la ligne 019 : ceux ayant un indicateur de risque synthétique de valeur 5 selon l'ordonnance sur les placements collectifs de capitaux, annexe 3, section 3 « profil de risque et de rendement »
027	Dont: avec indicateur de risque synthétique de valeur 6	Parmi les investissements indiqués à la ligne 019 : ceux ayant un indicateur de risque synthétique de valeur 6 selon l'ordonnance sur les placements collectifs de capitaux, annexe 3, section 3 « profil de risque et de rendement »
028	Dont: avec indicateur de risque synthétique de valeur 7	Parmi les investissements indiqués à la ligne 019 : ceux ayant un indicateur de risque synthétique de valeur 7 selon l'ordonnance sur les placements collectifs de capitaux, annexe 3, section 3 « profil de risque et de rendement »
029	Approche simplifiée avec pondération à 400%	Indiquer les mêmes investissements qu'à la ligne 024
030	Dont: avec indicateur de risque synthétique de valeur 5	Parmi les investissements indiqués à la ligne 029 : ceux ayant un indicateur de risque synthétique de valeur 5 selon l'ordonnance sur les placements collectifs de capitaux, annexe 3, section 3 « profil de risque et de rendement »
031	Dont: avec indicateur de risque synthétique de valeur 6	Parmi les investissements indiqués à la ligne 029 : ceux ayant un indicateur de risque synthétique de valeur 6 selon l'ordonnance sur les placements collectifs de capitaux, annexe 3, section 3 « profil de risque et de rendement »
032	Dont: avec indicateur de risque synthétique de valeur 7	Parmi les investissements indiqués à la ligne 029 : ceux ayant un indicateur de risque synthétique de valeur 7 selon l'ordonnance sur les placements collectifs de capitaux, annexe 3, section 3 « profil de risque et de rendement »
Colonnes		
01	Nombre d'investissements	Nombre de fortunes collectives gérées dans laquelle la banque a investi. Si une fortune collective est traitée sous plusieurs approches il faut la compter l'investissement sous chaque approche.
02	Equivalents-crédit pour le risque de crédit de la contrepartie de SFTs	Equivalent-crédit pour le risque de crédit de la contrepartie de SFTs (circulaire FINMA 2017/7 «Risques de crédit – banques», Cm 131, 163 à 278)
03	Equivalents-crédit pour le risque de crédit de la contrepartie de dérivés	Equivalent-crédit pour le risque de crédit de la contrepartie de dérivés (circulaire FINMA 2017/7 «Risques de crédit – banques», Cm 32 à 123)
04	Position pondérée en fonction des risques pour le risque de crédit de contrepartie de SFTs et de dérivés (y compris CVA)	Equivalents-crédit des colonnes 02 et 03, multipliés par les pondérations-risque correspondantes, plus l'exigence en CVA (convertie en RWA)
05	Position nette totale avant pondération en fonction des risques	Position nette totale en participations FCG, y compris les équivalents-crédit pour le risque de crédit de contrepartie indiqué à la ligne 04
06	Position pondérée en fonction des risques	Position pondérée en fonction des risques : somme des positions nettes pondérée individuellement en fonction des risques (colonne 05)
07	Fonds propres minimaux (sans multiplicateurs)	Fonds propres minimaux à hauteur de 8 % de la position pondérée en fonction des risques (colonne 06) sans appliquer de multiplicateurs