

Principaux événements générateurs de pertes relatives aux risques opérationnels actuels ou de l'année écoulée

Ce formulaire doit être rempli par toutes les banques appliquant une approche spécifique à l'établissement (AMA) ainsi que par toutes les banques actives à l'étranger qui appliquent l'approche standard (cf. Circulaire «Risques opérationnels», Cm 30 et 36).

ID	Dénomination	Commentaires
Colonnes		
01	Numéro de référence interne	Code interne utilisé par l'établissement dans sa base de données internes relatives aux pertes pour identifier les différents événements générateurs de pertes.
02	Montant brut de la perte	Circulaire «Risques opérationnels», Cm 81.
03	dont non réalisée	Part du montant brut de la perte non encore réalisée (par ex. non provisionnée).
04	Statut définitif ? YES/NO	«YES»: si le montant des pertes est définitivement déterminé et que l'on ne s'attend pas à des pertes supplémentaires.
05	Recouvrements directs de la perte	Circulaire «Risques opérationnels», Cm 81. Tous montants déjà recouverts par l'établissement à la suite de son action pour réduire l'impact d'une perte (à l'exclusion des prestations d'assurance).
06	Recouvrements de la perte au moyen de mécanismes de transfert de risque	Circulaire «Risques opérationnels», Cm 81 et 98-107. Paiements reçus en compensation de pertes résultant de risques opérationnels couverts par des mécanismes de transfert de risque.
07	Recouvrements de la perte attendus (directement ou au moyen de mécanismes de transfert de risque)	Circulaire «Risques opérationnels», Cm 81 et 98-107. Tous montants compensatoires de pertes auxquels l'établissement s'attend en raison de son action pour réduire l'impact des pertes ou de mécanismes de transfert de risque.
08	En rapport avec les risques de crédit ou avec les risques de marché	Circulaire «Risques opérationnels», Cm 83 et 84.
09-16	Répartition des pertes brutes (%) par segments d'affaires.	Circulaire «Risques opérationnels», Cm 79. Définition des segments d'affaires : cf. formulaire OPR.
17	Type d'événement (numéro)	Circulaire «Risques opérationnels», annexe 3 Le numéro est celui qui est utilisé pour chaque type d'événement dans le formulaire OPRDETAILS.
18	Date de la survenance	Circulaire «Risques opérationnels», Cm 81. Date de la survenance ou du début de l'événement générateur de pertes.
19	Date de l'identification	Circulaire «Risques opérationnels», Cm 81. Date de l'identification de l'événement générateur de pertes par l'établissement.
20	Date du premier paiement résultant de mécanismes de transfert du risque	Circulaire «Risques opérationnels», Cm 81. Date du versement de la première indemnisation par une compagnie d'assurance.
21	Date du dernier paiement résultant de mécanismes de transfert du risque	Circulaire «Risques opérationnels», Cm 81. Date du dernier versement de prestations par une compagnie d'assurance.