

FR

## ANNEXE XIII

### RAPPORTS SUR LA LIQUIDITÉ (PARTIE 2 sur 5: SORTIES DE TRÉSORERIE)

#### 1. Sorties de trésorerie

##### 1.1. Remarques générales

1. Le présent modèle récapitulatif comprend des informations sur les sorties de trésorerie mesurées sur les 30 jours suivants, aux fins du suivi de l'exigence de couverture des besoins de liquidité telle que visée à l'article 412 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013. Les éléments qui ne doivent pas être remplis par les établissements sont grisés.
2. Conformément à l'article 420 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013, la présente section couvre les obligations de déclaration concernant les dépôts de la clientèle de détail (article 421), les autres dépôts et passifs (article 422), les sorties de trésorerie supplémentaires (article 423) et les sorties de trésorerie relatives à des facilités de crédit et de caisse (article 424).
3. Conformément à l'article 421, paragraphe 5, du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013, les établissements peuvent exclure du calcul des sorties de trésorerie certaines catégories bien définies de dépôts de la clientèle de détail. Par souci d'exhaustivité, ces dépôts doivent être déclarés au point 1.1.6 du modèle.
- 4.

##### 1.2. Sous-modèle Sorties de trésorerie

###### 1.2.1. Instructions concernant les lignes spécifiques

| Ligne   | Références légales et instructions   |
|---------|--|
| 020-137 | <b><u>1. SORTIES DE TRÉSORERIE</u></b><br>Articles 421 à 424 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013.<br>Les passifs déclarés dans la présente section ont été explicitement identifiés en tant que source potentielle de sorties de trésorerie, au cours des 30 jours suivants, aux fins des obligations de déclaration.  |
| 020-100 | <b><u>1.1 Dépôts de la clientèle de détail</u></b><br>Article 421 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013<br>Le montant total des dépôts de la clientèle de détail tel que défini à l'article 411, paragraphe 2, du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013, y compris les dépôts à vue et les dépôts à terme, est déclaré en colonne 020. La sortie de trésorerie qui en résulte, après application du taux de sortie de trésorerie approprié, est déclarée en colonne 030.<br>Les sous-catégories suivantes font l'objet d'une déclaration: |
| 020-040 | <b><u>1.1.1 couverts par un système de garantie des dépôts conformément à la directive 94/19/CE ou un système de garantie des dépôts équivalent d'un pays tiers</u></b>  |

|     |  |
|-----|--|
|     | Article 421(1) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013   |
| 020 | <p><b><u>1.1.1.1 dans le cadre d'une relation établie, rendant un retrait très improbable</u></b></p> <p>Article 421(1)(a) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Parmi les dépôts de la clientèle de détail déclarés en 1.1.1 et couverts par un système de garantie des dépôts conformément à la directive 94/19/CE ou un système de garantie des dépôts équivalent d'un pays tiers, les dépôts qui s'inscrivent dans le cadre d'une relation établie, rendant un retrait très improbable.</p> <p>Les dépôts de la clientèle de détail qui s'inscrivent dans le cadre d'une relation établie rendant un retrait très improbable et qui sont détenus sur des comptes courants, y compris les comptes où sont régulièrement versés des salaires, sont, en revanche, déclarés en 1.1.1.2.</p> |
| 030 | <p><b><u>1.1.1.2 détenus sur des comptes courants, y compris les comptes où sont régulièrement versés des salaires</u></b></p> <p>Article 421(1)(b) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Parmi les dépôts de la clientèle de détail déclarés en 1.1.1 et couverts par un système de garantie des dépôts conformément à la directive 94/19/CE ou un système de garantie des dépôts équivalent d'un pays tiers, les dépôts qui sont détenus sur un compte courant, y compris les comptes où sont régulièrement versés des salaires, rendant un retrait très improbable.</p>  |
| 040 | <p><b><u>1.1.2 couverts par un système de garantie des dépôts conformément à la directive 94/19/CE ou un système de garantie des dépôts équivalent d'un pays tiers qui ne peuvent être déclarés en 1.1.1.1 ou 1.1.1.2</u></b></p> <p>Article 421(2) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Parmi les dépôts de la clientèle de détail couverts par un système de garantie des dépôts conformément à la directive 94/19/CE ou un système de garantie des dépôts équivalent d'un pays tiers, les dépôts autres qui ne peuvent être déclarés en 1.1.1.1 ou 1.1.1.2.</p>   |
| 050 | <p><b><u>1.1.3 dépôts de la clientèle de détail non garantis</u></b></p> <p>Article 421(2) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Dépôts de la clientèle de détail non couverts par un système de garantie des dépôts conformément à la directive 94/19/CE ou un système de garantie des dépôts équivalent d'un pays tiers.</p>  |

|         |  |
|---------|--|
|         |  |
| 060-080 | <p><b><u>1.1.4 dépôts soumis à des sorties de trésorerie plus élevées que celles prévues à l'article 421, paragraphe 1 ou 2</u></b></p> <p>Article 421(3) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Les dépôts de la clientèle de détail soumis à des sorties de trésorerie plus élevées que celles prévues à l'article 421 paragraphe 1 ou 2 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013 sont déclarés dans les sous-catégories suivantes:</p> |
| 060     | <p><b><u>1.1.4.1 dépôts soumis à un taux de sortie de trésorerie supérieur - Catégorie 1 - risque de sortie de trésorerie moyen</u></b></p> <p>Article 421(3) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Dépôts de la clientèle de détail à affecter en catégorie 1 d'après les établissements.</p>  |
| 070     | <p><b><u>1.1.4.2 dépôts soumis à un taux de sortie de trésorerie supérieur - Catégorie 2 - risque de sortie de trésorerie élevé</u></b></p> <p>Article 421(3) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Dépôts de la clientèle de détail à affecter en catégorie 2 d'après les établissements.</p>  |
| 080     | <p><b><u>1.1.4.3 dépôts soumis à un taux de sortie de trésorerie supérieur - Catégorie 3 - risque de sortie de trésorerie très élevé</u></b></p> <p>Article 421(3) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Dépôts de la clientèle de détail à affecter en catégorie 3 d'après les établissements.</p>   |
| 090     | <p><b><u>1.1.5 dépôts dans les pays tiers où une sortie de trésorerie supérieure est appliquée</u></b></p> <p>Article 421(4) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Dépôts de la clientèle de détail reçus dans des pays tiers et soumis à des sorties de trésorerie dans le pays tiers concerné supérieures à celles énoncées à l'article 421, paragraphe 1 ou 2 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013.</p>                           |
| 100     | <p><b><u>1.1.6 dépôts exclus du calcul des sorties de trésorerie lorsque les conditions de l'article 421, paragraphe 5, point a) et b) sont</u></b></p>  |

|          |   |
|----------|---|
|          | <p><b><u>remplies</u></b></p> <p>Article 421(5) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Dépôts de la clientèle de détail exclus du calcul des sorties de trésorerie, tels que visés à l'article 421, paragraphe 5 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013.</p>   |
| 110-1130 | <p><b><u>1.2 sorties de trésorerie relatives aux autres passifs</u></b></p> <p>Article 422 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Le total des sorties de trésorerie relatives aux autres passifs exigibles au cours des 30 jours suivants est déclaré comme suit dans les sous-catégories suivantes:</p> <p>Les passifs déclarés dans la présente section ne comprennent que les obligations générales autres que les dépôts de la clientèle de détail définis à l'article 411, paragraphe 2 (lesquels sont déclarés en rubrique 1.1 ci-dessus).</p> <p>Les passifs déclarés ici sont ceux qui sont exigibles au cours des 30 jours suivants, dont la date d'échéance contractuelle la plus proche tombe dans les 30 jours suivants ou dont la date d'échéance n'est pas définie. Cela comprend à la fois (i) les passifs dont les options peuvent être exercées à la discrétion de l'investisseur et (ii) les passifs dont les options peuvent être exercées à la discrétion de l'établissement, lorsque la capacité de l'établissement à ne pas exercer l'option est limitée pour des raisons de réputation. En particulier, lorsque le marché prévoit le remboursement de certains passifs au cours des 30 jours suivants, avant leur date d'échéance légale finale, lesdits passifs sont inclus dans la sous-catégorie appropriée.</p> |
| 110      | <p><b><u>1.2.1 passifs découlant des propres coûts d'exploitation de l'établissement</u></b></p> <p>Article 422(1) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Montant total des passifs dus au cours des 30 jours suivant, résultant des propres coûts d'exploitation de l'établissement. Exemples: dépenses bureautiques et de services généraux, dépenses comptables, salaire et traitements etc. et tout autre coût engagé pour la conduite des activités propres de l'établissement.</p>  |
| 120-950  | <p><b><u>1.2.2 passifs résultant d'opérations de prêts garanties et d'opérations ajustées aux conditions du marché tels que définies à l'article 192</u></b></p> <p>Article 422(2) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Pour les sous-catégories suivantes, les établissements identifient le montant des sorties de trésorerie relatives aux opérations de prêts garanties et opérations ajustées aux conditions du marché au cours des 30 jours suivants, la valeur de marché des actifs correspondants qui garantissent les opérations et la valeur de ces actifs d'après</p>  |

|   |
|---|
| <p>l'article 418 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013.</p> <p>En vertu de l'article 192:</p> <ol style="list-style-type: none"><li>1. «opération de prêt garantie»: toute opération qui génère une exposition, garantie par une sûreté sans clause conférant à l'établissement le droit de procéder à un appel de marge au moins quotidien;</li><li>2. «opération ajustée aux conditions du marché»: toute opération qui génère une exposition, garantie par une sûreté avec clause conférant à l'établissement le droit de procéder à un appel de marge au moins quotidien.</li></ol> <p>Par conséquent, toute opération permettant à l'établissement d'obtenir un prêt garanti en espèces, par exemple une opération de pension au sens de l'article 4, point 83), du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013, à échéance 30 jours, est déclarée dans la présente section.</p> <p>Les établissements déclarent la valeur de marché des actifs qui garantissent les opérations de prêts garantis et les opérations ajustées aux conditions du marché en colonne 010. Les établissements déclarent ces opérations dans l'une des sept catégories suivantes:</p> <p><i>Catégorie 1:</i> lorsque la contrepartie n'est pas une banque centrale et que les actifs garantissant l'opération sont d'une liquidité et d'une qualité de crédit extrêmement élevées, le montant dû est déclaré en colonne 020 et la valeur de l'actif garantissant l'opération, calculée d'après l'article 418 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013, est déclaré en colonne 030.</p> <p><i>Catégorie 2:</i> lorsque la contrepartie n'est pas une banque centrale et que les actifs garantissant l'opération sont d'une liquidité et d'une qualité de crédit élevées, le montant dû est déclaré en colonne 040 et la valeur de l'actif garantissant l'opération d'après l'article 418 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013 est déclarée en colonne 050.</p> <p><i>Catégorie 3:</i> lorsque la contrepartie n'est pas une banque centrale et que les actifs garantissant l'opération sont d'une liquidité et d'une qualité de crédit autres, le montant dû est déclaré en colonne 060.</p> <p><i>Catégorie 4:</i> lorsque la contrepartie est une banque centrale et que les actifs garantissant l'opération sont d'une liquidité et d'une qualité de crédit extrêmement élevées, le montant dû est déclaré en colonne 070 et la valeur de l'actif garantissant l'opération d'après l'article 418 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013 est déclarée en colonne 080.</p> <p><i>Catégorie 5:</i> lorsque la contrepartie est une banque centrale et que les actifs garantissant l'opération sont d'une liquidité et d'une qualité de crédit élevées, le montant dû est déclaré en colonne 090 et la valeur de l'actif garantissant l'opération d'après l'article 418 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013 est déclarée en colonne 100.</p> <p><i>Catégorie 6:</i> lorsque la contrepartie est une banque centrale et que les actifs garantissant l'opération sont d'une liquidité et d'une qualité de crédit autres, le montant dû est déclaré en colonne 110.</p> |
|---|

|         |  |
|---------|--|
|         | <p><i>Catégorie 7:</i> lorsque la contrepartie est l'administration centrale, une entité du secteur public de l'État membre dans lequel l'établissement de crédit a été agréé ou a établi une succursale, ou une banque multilatérale de développement, le montant dû est déclaré en colonne 120.</p> <p><b>Pour répartir les opérations, les établissements déterminent la liquidité et la qualité de crédit des actifs garantissant l'opération en utilisant les mêmes critères que ceux appliqués aux fins de la déclaration des actifs dans le modèle 1.1 «Actifs».</b></p> <p>C'est-à-dire, en vertu de l'article 416, paragraphe 1 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013, dans l'attente d'une définition uniforme, conformément à l'article 460 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013, des notions de liquidité et de qualité de crédit élevées et extrêmement élevées, les établissements déterminent eux-mêmes, pour une devise donnée, les actifs cessibles qui sont respectivement d'une liquidité et d'une qualité de crédit élevées ou extrêmement élevées.</p> <p><b>Si l'établissement a constitué un gisement de sûretés contenant à la fois des actifs d'une liquidité et d'une qualité de crédit «extrêmement élevées», «élevées» et «autres», et qu'aucun actif n'est spécifiquement mobilisé comme garantie aux opérations de prêts garanties et opérations ajustées aux conditions du marché, l'établissement présume que les actifs d'une liquidité et d'une qualité de crédit moindres sont affectés en premier, c'est-à-dire les actifs «d'une liquidité et d'une qualité de crédit autres». Les actifs d'une liquidité et d'une qualité de crédit «élevées» ne sont mobilisés qu'une fois terminée l'affectation de tous les actifs d'une liquidité et d'une qualité de crédit «autres». Les actifs d'une liquidité et d'une qualité de crédit «extrêmement élevées» ne sont mobilisés qu'une fois terminée l'affectation de tous les actifs d'une liquidité et d'une qualité de crédit «élevées».</b></p> <p><b>Les échanges de sûretés par lesquels l'établissement emprunte et prête simultanément des sûretés (sous la forme d'actifs autres que des espèces) sont déclarés comme suit:</b></p> <p>La valeur de l'actif <u>emprunté</u> déclarée en colonne 010 est sa valeur de marché. Sa valeur conformément à l'article 418 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013 est déclarée dans la colonne appropriée. Les échanges de sûretés ne concernent que des sûretés, et aucun «Montant dû» correspondant ne doit être déclaré.</p> <p>La valeur de marché de l'actif <u>prêté</u> est déclarée dans la colonne «Valeur de marché de l'actif garantissant l'opération» dans la sous-catégorie appropriée du point 3 du modèle «Entrées de trésorerie». Les échanges de sûretés ne concernent que des sûretés, et aucun «Montant dû» correspondant ne doit être déclaré.</p> |
| 120-190 | <p><b><u>1.2.2.1 Autres actifs cessibles représentant des créances sur, ou garanties par,</u></b></p> <p><b>Article 416(1)(c) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</b></p>  |

|         |  |
|---------|--|
|         | <p>Les opérations garanties par des actifs cessibles sont déclarées ici, conformément au point 1.2.2 ci-dessus, dans la sous-catégorie appropriée.</p> <p>Les actifs déclarés dans la présente section ont été explicitement identifiés comme étant potentiellement d'une liquidité et d'une qualité de crédit extrêmement élevées ou élevées.</p> <p>Les actifs déclarés dans cette section doivent satisfaire à toutes les exigences applicables contenues dans les articles 416 et 417 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013.</p> |
| 120-130 | <p><b><u>1.2.2.1.1 Actifs cessibles représentant des créances sur, ou garanties par, l'administration centrale d'un État membre, d'une région habilitée à lever et à collecter des impôts ou d'un pays tiers, émises dans la monnaie locale de l'administration centrale ou régionale, si l'établissement est exposé à un risque de liquidité dans cet État membre ou ce pays tiers qu'il couvre en détenant ces actifs liquides</u></b></p> <p><b>Article 416(1)(c)(i) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</b></p>                |
| 120     | <p><b><u>1.2.2.1.1.1 représentant des créances sur</u></b></p> <p>Actifs visés en rubrique 1.3.1 du modèle «Actifs liquides», représentant des créances sur les contreparties susmentionnées, d'après l'article 416, paragraphe 1, point c) i)</p>   |
| 130     | <p><b><u>1.2.2.1.1.2 garanties par</u></b></p> <p>Actifs visés en rubrique 1.3.1 du modèle Actifs liquides, garantis par les contreparties susmentionnées, d'après l'article 416, paragraphe 1, point c) i)</p>  |
| 140-150 | <p><b><u>1.2.2.1.2 Actifs cessibles représentant des créances sur, ou garanties par, des banques centrales et des entités du secteur public décentralisées, émises dans la monnaie locale de la banque centrale et de l'entité du secteur public</u></b></p> <p>Article 416(1)(c)(ii) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p>  |
| 140     | <p><b><u>1.2.2.1.2.1 représentant des créances</u></b></p> <p>Actifs visés en 1.3.2 du modèle Actifs liquides représentant des créances sur les contreparties susmentionnées, d'après l'article 416, paragraphe 1, point c) ii)</p>  |
| 150     | <p><b><u>1.2.2.1.2.2 garanties par</u></b></p> <p>Actifs visés en 1.3.2 du modèle Actifs liquides garantis par les contreparties susmentionnées, d'après l'article 416, paragraphe 1,</p>  |

|         |   |
|---------|---|
|         | point c) ii)  |
| 160-170 | <p><b><u>1.2.2.1.3 actifs cessibles représentant des créances sur, ou garanties par, la Banque des règlements internationaux, le Fonds monétaire international, la Commission et les banques multilatérales de développement.</u></b></p> <p>Article 416(1)(c)(iii) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p>   |
| 160     | <p><b><u>1.2.2.1.3.1 représentant des créances sur</u></b></p> <p>Actifs visés en rubrique 1.3.3 du modèle «Actifs liquides» représentant des créances sur les contreparties susmentionnées, d'après l'article 416, paragraphe 1, point c) iii)</p>   |
| 170     | <p><b><u>1.2.2.1.3.2 garanties par</u></b></p> <p>Actifs visés en rubrique 1.3.3 du modèle «Actifs liquides» garantis par les contreparties susmentionnées, d'après l'article 416, paragraphe 1, point c) iii)</p>  |
| 180-190 | <p><b><u>1.2.2.1.4 actifs cessibles représentant des créances sur, ou garanties par, le Fonds européen de stabilité financière et le Mécanisme européen de stabilité</u></b></p> <p>Article 416(1)(c)(iv) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p>   |
| 180     | <p><b><u>1.2.2.1.4.1 représentant des créances sur</u></b></p> <p>Actifs visés en rubrique 1.3.4 du modèle «Actifs liquides» représentant des créances sur les contreparties susmentionnées, d'après l'article 416, paragraphe 1, point c) iv)</p>  |
| 190     | <p><b><u>1.2.2.1.4.2 garanties par</u></b></p> <p>Actifs visés en rubrique 1.3.4 du modèle «Actifs liquides», garantis par les contreparties susmentionnées, d'après l'article 416, paragraphe 1, point c) iv)</p>  |
| 200-220 | <p><b><u>1.2.2.2 total des parts ou actions d'OPC avec actifs sous-jacents visés à l'article 416, paragraphe 1</u></b></p> <p>Article 416(6) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Le total des parts ou actions d'OPC avec actifs sous-jacents visés à l'article 416, paragraphe 1 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013 est déclaré ici, conformément au point 1.2.2 ci-dessus, dans la sous-catégorie appropriée.</p> |



|         |   |
|---------|---|
| 200     | <b><u>1.2.2.2.1 actifs sous-jacents visés à l'article 416, paragraphe 1, point a)</u></b>   |
| 210     | <b><u>1.2.2.2.2 actifs sous-jacents visés à l'article 416, paragraphe 1, points b) et c)</u></b>  |
| 220     | <b><u>1.2.2.2.3 actifs sous-jacents visés à l'article 416, paragraphe 1, point d)</u></b>   |
| 230     | <b><u>1.2.2.3 Actifs émis par un établissement de crédit créé par l'administration centrale ou une administration régionale d'un État membre</u></b><br><br>Article 416(2)(a)(iii) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013  |
| 240-260 | <b><u>1.2.2.4 obligations d'entreprises non financières</u></b><br><br>Article 416(1)(b) ou (d) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013<br><br>Les obligations d'entreprises non financières sont déclarées d'après leur qualité de crédit conformément à l'article 122 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013, et conformément au point 1.2.2 ci-dessus, dans la sous-catégorie appropriée.   |
| 240     | <b><u>1.2.2.4.1 échelon 1 de qualité de crédit</u></b>  |
| 250     | <b><u>1.2.2.4.2 échelon 2 de qualité de crédit</u></b>  |
| 260     | <b><u>1.2.2.4.3 échelon 3 de qualité de crédit</u></b>  |
| 270-290 | <b><u>1.2.2.5 obligations émises par un établissement de crédit qui peuvent bénéficier du traitement énoncé à l'article 129, paragraphe 4 ou 5</u></b><br><br>Article 416(2)(a)(i) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013<br><br>Les obligations qui peuvent bénéficier du traitement énoncé à l'article 129, paragraphe 4 ou 5 sont déclarées en fonction de leur qualité de crédit conformément à l'article 129, paragraphe 4 ou 5 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013, et conformément au point 1.2.2 ci-dessus, dans la sous-catégorie appropriée. |
| 270     | <b><u>1.2.2.5.1 échelon 1 de qualité de crédit</u></b>  |
| 280     | <b><u>1.2.2.5.2 échelon 2 de qualité de crédit</u></b>  |
| 290     | <b><u>1.2.2.5.3 échelon 3 de qualité de crédit</u></b>  |
| 300-320 | <b><u>1.2.2.6 instruments adossés à des actifs émis par un établissement de crédit s'il est démontré qu'ils sont de la qualité de crédit la plus élevée, telle qu'elle est définie par l'ABE conformément aux critères de l'article 509, paragraphes</u></b>  |

|         |  |
|---------|--|
|         | <p><b><u>3, 4 et 5</u></b></p> <p>Article 416(2)(a)(i) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Ces éléments sont déclarés d'après leur qualité de crédit conformément au titre 2, chapitre 5 et aux articles 123, 124, 125, 126 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013, et conformément au point 1.2.2 ci-dessus, dans la sous-catégorie appropriée</p>  |
| 300     | <b><u>1.2.2.6.1 échelon 1 de qualité de crédit</u></b>   |
| 310     | <b><u>1.2.2.6.2 échelon 2 de qualité de crédit</u></b>   |
| 320     | <b><u>1.2.2.6.3 échelon 3 de qualité de crédit</u></b>   |
| 330-350 | <p><b><u>1.2.2.7 Instruments adossés à des créances hypothécaires résidentielles déclarés en 1.10.1, 1.10.2, 1.10.3 du modèle Actifs liquides</u></b></p> <p>Article 416(2)(a)(i) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Ces éléments sont déclarés d'après leur qualité de crédit conformément au titre 2, chapitre 5 et aux articles 123, 124, 125, 126 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013, et conformément au point 1.2.2 ci-dessus, dans la sous-catégorie appropriée</p> |
| 330     | <b><u>1.2.2.7.1 échelon 1 de qualité de crédit</u></b>   |
| 340     | <b><u>1.2.2.7.2 échelon 2 de qualité de crédit</u></b>   |
| 350     | <b><u>1.2.2.7.3 échelon 3 de qualité de crédit</u></b>   |
| 360-380 | <p><b><u>1.2.2.8 Obligations visées à l'article 52, paragraphe 4, de la directive 2009/65/CE, autres que celles visées en 1.9</u></b></p> <p>Article 416(2)(a)(ii) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Ces éléments sont déclarés d'après leur qualité de crédit conformément à l'article 129, paragraphe 4 ou paragraphe 5 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013, et conformément au point 1.2.2 ci-dessus, dans la sous-catégorie appropriée</p>                            |
| 360     | <b><u>1.2.2.8.1 échelon 1 de qualité de crédit</u></b>   |
| 370     | <b><u>1.2.2.8.2 échelon 2 de qualité de crédit</u></b>   |
| 380     | <b><u>1.2.2.8.3 échelon 3 de qualité de crédit</u></b>   |
| 390-410 | <p><b><u>1.2.2.9 Autres actifs cessibles d'une liquidité et d'une qualité de crédit extrêmement élevées</u></b></p> <p>Article 416,1(b) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Ces éléments sont déclarés d'après leur qualité de crédit</p>   |

|                       |  |
|-----------------------|--|
|                       | <p>conformément à la troisième partie, titre 2, chapitre 2 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013, et conformément au point 1.2.2 ci-dessus, dans la sous-catégorie appropriée.</p> <p>Seuls les éléments non mentionnés précédemment sont déclarés ici.</p>  |
| <b><u>390</u></b>     | <b><u>1.2.2.9.1 échelon 1 de qualité de crédit</u></b>   |
| <b><u>400</u></b>     | <b><u>1.2.2.9.2 échelon 2 de qualité de crédit</u></b>   |
| <b><u>410</u></b>     | <b><u>1.2.2.9.3 échelon 3 de qualité de crédit</u></b>   |
| 420-440               | <p><b><u>1.2.2.10 Autres actifs cessibles d'une liquidité et d'une qualité de crédit élevées</u></b></p> <p>Article 416.1(d) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Ces éléments sont déclarés d'après leur qualité de crédit conformément à la troisième partie, titre 2, chapitre 2 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013, et conformément au point 1.2.2 ci-dessus, dans la sous-catégorie appropriée.</p> <p>Seuls les éléments non mentionnés précédemment sont déclarés ici.</p> |
| 420                   | <b><u>1.2.2.10.1 échelon 1 de qualité de crédit</u></b>  |
| 430                   | <b><u>1.2.2.10.2 échelon 2 de qualité de crédit</u></b>  |
| 440                   | <b><u>1.2.2.10.3 échelon 3 de qualité de crédit</u></b>  |
| <b><u>450-460</u></b> | <p><b><u>1.2.2.11</u></b></p> <p><b><u>ACTIFS QUI SATISFONT LES EXIGENCES DE L'ARTICLE 416, PARAGRAPHE 1, POINTS b) ET d) MAIS QUI NE SATISFONT PAS LES EXIGENCES DE L'ARTICLE 417 POINTS b) ET c) DU RÈGLEMENT (UE) N° 575/2013</u></b></p> <p>Ces éléments sont déclarés ici conformément au point 1.2.2 ci-dessus, dans la sous-catégorie appropriée.</p>   |
| 450                   | <p><b><u>1.2.2.11.1 Actifs non soumis à une fonction de gestion de la liquidité</u></b></p> <p>Article 417(c) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p>  |
| 460                   | <b><u>1.2.2.11.2 Actifs dont la liquidation présente un obstacle juridique ou pratique, au cours des 30 jours suivants, soit par</u></b>   |

|         |   |
|---------|---|
|         | <p><b><u>une vente, soit par une mise en pension simple sur un marché de mise en pension approuvé</u></b></p> <p>Article 417(b) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p>   |
| 480-680 | <p><b><u>1.2.2.12 Éléments soumis aux exigences d'information complémentaire relatives aux actifs liquides</u></b></p> <p>Les établissements déclarent les actifs soumis aux exigences d'information complémentaire relatives aux actifs liquides dans le strict respect de l'annexe III du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013. Tous les éléments, à l'exception de ceux visés dans les sections 3.1, 3.2 et 3.9, doivent remplir les conditions énoncées dans le dernier paragraphe de cette annexe.</p> <p>Ces éléments sont déclarés ici conformément au point 1.2.2 ci-dessus, dans la sous-catégorie appropriée.</p> <p>Seuls les éléments non mentionnés ailleurs dans le modèle sont déclarés ici.</p> |
| 480     | <p><b><u>1.2.2.12.1 Encaisses</u></b></p> <p>Annexe III, point 1 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Montant total des encaisses, y compris les pièces et billets /monnaie. Seules les encaisses qui ne remplissent pas au moins l'une des conditions énoncées aux points c), d) et e) et qui ne peuvent donc pas être déclarées en 1.1 sont déclarées.</p> <p>Remarque: les dépôts en espèces effectués auprès d'autres établissements ne sont pas déclarés ici et sont en revanche déclarés dans la catégorie sûretés du modèle «Entrées de trésorerie» s'ils sont considérés comme des montants à recevoir au cours des 30 jours suivants.</p>  |
| 490     | <p><b><u>1.2.2.12.2 Expositions sur les banques centrales, dans la mesure où il peut y être fait appel en période de tensions</u></b></p> <p>Annexe III, point 2 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Montant total des expositions sur les banques centrales dans la mesure où ces expositions peuvent être retirées en période de tensions. Seules les expositions qui ne remplissent pas au moins l'une des conditions énoncées aux points c), d) et e) et qui ne peuvent donc pas être déclarées en rubrique 1.3 sont déclarées.</p>  |
| 500-540 | <p><b><u>1.2.2.12.3 Titres cessibles avec une pondération de risque de 0 % et qui ne constituent pas une obligation d'un établissement ou de l'une de ses filiales</u></b></p> <p>Annexe III, point 3 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Titres avec une pondération de risque de 0% qui représentent des créances sur, ou garanties par l'administration centrale d'un État</p>  |

|         |  |
|---------|--|
|         | membre ou d'un pays tiers tels que visés à l'annexe III, point 5.<br>Dont:   |
| 500     | <b><u>1.2.2.12.3.1 représentant des créances sur des emprunteurs souverains</u></b><br><br>Annexe III, point 3 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013   |
| 510     | <b><u>1.2.2.12.3.2 créances garanties par des emprunteurs souverains</u></b><br><br>Annexe III, point 3 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013  |
| 520     | <b><u>1.2.2.12.3.3 représentant des créances sur, ou garanties par, des banques centrales</u></b><br><br>Annexe III, point 3 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013   |
| 530     | <b><u>1.2.2.12.3.4 représentant des créances sur, ou des créances garanties par, des entités du secteur public décentralisées, des régions bénéficiant de l'autonomie fiscale de lever et à collecter des impôts et des autorités locales</u></b><br><br>Annexe III, point 3 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013   |
| 540     | <b><u>1.2.2.12.3.5 représentant des créances sur, ou des créances garanties par, la Banque des règlements internationaux, le Fonds monétaire international, l'Union européenne, le Fonds européen de stabilité financière, le Mécanisme européen de stabilité ou des banques multilatérales de développement</u></b><br><br>Annexe III, point 3 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013  |
| 550     | <b><u>1.2.2.12.4 titres cessibles autres que ceux visés en 3.3 représentant des créances sur, ou garanties par, des emprunteurs souverains ou des banques centrales, émis dans la monnaie locale par l'emprunteur souverain ou la banque centrale, dans la monnaie et le pays dans lequel le risque de liquidité est pris, ou en monnaie étrangère, dans la mesure où la détention de telles créances correspond aux besoins de liquidité aux fins des opérations de la banque dans ce pays tiers</u></b><br><br>Annexe III, point 4 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013 |
| 570-610 | <b><u>1.2.2.12.5 titres cessibles avec une pondération de risque de 20 % et qui ne constituent pas une obligation d'un établissement ou de l'une de ses filiales</u></b><br><br>Annexe III, point 5 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013<br><br>Titres avec une pondération de risque de 20 % qui représentent des créances sur, ou garanties par l'administration centrale d'un État membre ou d'un pays tiers tels que visés à l'annexe III, point 5.<br>Dont:  |

|     |  |
|-----|--|
| 570 | <b><u>1.2.2.12.5.1 représentant des créances sur des emprunteurs souverains</u></b><br>Annexe III, point 5 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013   |
| 580 | <b><u>1.2.2.12.5.2 créances garanties par des emprunteurs souverains</u></b><br>Annexe III, point 5 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013  |
| 590 | <b><u>1.2.2.12.5.3 représentant des créances sur, ou garanties par, des banques centrales</u></b><br>Annexe III, point 5 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013   |
| 600 | <b><u>1.2.2.12.5.4 représentant des créances sur, ou des créances garanties par, des entités du secteur public décentralisées, des régions bénéficiant de l'autonomie fiscale de lever et à collecter des impôts et des autorités locales</u></b><br>Annexe III, point 5 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013   |
| 610 | <b><u>1.2.2.12.5.5 représentant des créances sur, ou des créances garanties par, la Banque des règlements internationaux, le Fonds monétaire international, l'Union européenne, le Fonds européen de stabilité financière, le Mécanisme européen de stabilité ou des banques multilatérales de développement</u></b><br>Annexe III, point 5 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013  |
| 620 | <b><u>1.2.2.12.6 titres cessibles autres que ceux visés aux points 3.3 à 3.5.6 qui reçoivent une pondération de 20 % ou mieux en vertu de la troisième partie, titre II, chapitre 2, ou qui, dans le cadre d'une notation interne, sont évalués comme ayant une qualité de crédit équivalente, et qui remplissent l'une des conditions énoncées au point 6 de l'annexe III du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</u></b><br>Annexe III, point 6 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013    |
| 630 | <b><u>1.2.2.12.7 titres cessibles autres que ceux visés aux points 3.3 à 3.6 qui reçoivent une pondération de 50 % ou mieux en vertu de la troisième partie, titre II, chapitre 2, ou qui, dans le cadre d'une notation interne, sont évalués comme ayant une qualité de crédit équivalente, et qui ne constituent pas une créance sur une entité de titrisation, un établissement ou l'une de ses filiales</u></b><br>Annexe III, point 7 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013 |
| 640 | <b><u>1.2.2.12.8 titres cessibles autres que ceux visés aux points 3.3 à 3.7 qui sont garantis par des actifs qui reçoivent une pondération de 35 % ou mieux en vertu de la troisième partie, titre II, chapitre 2, ou qui, dans le cadre d'une notation interne, sont évalués comme ayant une qualité de crédit</u></b>   |

|   |   |
|---|---|
|   | <p><b><u>équivalente, et qui sont pleinement garantis par une hypothèque sur un bien immobilier résidentiel conformément à l'article 125</u></b></p> <p>Annexe III, point 8 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p>   |
| 650   | <p><b><u>1.2.2.12.9 facilités de crédit de soutien accordées par des banques centrales dans le cadre de la politique monétaire, dans la mesure où ces facilités ne sont pas garanties par des actifs liquides et à l'exclusion de l'aide d'urgence en cas de crise de liquidité</u></b></p> <p>Annexe III, point 9 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Montant total des facilités de crédit de soutien accordées par des banques centrales dans le cadre de la politique monétaire, dans la mesure où ces facilités ne sont pas garanties par des actifs liquides et à l'exclusion de l'aide d'urgence en cas de crise de liquidité.</p>                  |
| 660   | <p><b><u>1.2.2.12.10 dépôts légaux ou réglementaires minimaux auprès de l'établissement de crédit central et autres formes de financement liquide statutairement ou contractuellement disponibles en provenance de l'établissement de crédit central ou d'établissements qui sont membres du réseau visé à l'article 113, paragraphe 7, ou qui sont éligibles à l'exemption prévue à l'article 10, dans la mesure où ce financement n'est pas garanti par des actifs liquides, si l'établissement de crédit appartient à un réseau en vertu de dispositions légales ou réglementaires</u></b></p> <p>Annexe III, point 10 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> |
| 670   | <p><b><u>1.2.2.12.11 actions ordinaires cotées faisant l'objet d'une compensation centrale, liées à un indice boursier majeur, qui sont libellées dans la monnaie nationale de l'État membre et qui ne sont pas émises par un établissement ou l'une de ses filiales</u></b></p> <p>Annexe III, point 11 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p>  |
| 680   | <p><b><u>1.2.2.12.12 or coté sur un marché reconnu, détenu sous dossier</u></b></p> <p>Annexe III, point 12 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p>   |
| <b><u>690</u></b><br>=<br><b><u>920</u></b> | <p><b><u>1.2.2.13 ACTIFS QUI NE SATISFONT PAS LES EXIGENCES DE L'ARTICLE 416 DU RÈGLEMENT (UE) N° 575/2013 mais qui satisfont encore les exigences de l'article 417 points b) et c)</u></b></p>   |

|         |  |
|---------|--|
|         | <p><b><u>du RÈGLEMENT (UE) N° 575/2013</u></b></p> <p>Ces éléments sont déclarés ici conformément au point 1.2.2 ci-dessus, dans la sous-catégorie appropriée.</p>   |
| 690-710 | <p><b><u>1.2.2.13.1 obligations d'entreprises financières</u></b></p> <p>Article 416(2) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Ces éléments sont déclarés d'après leur qualité de crédit conformément à l'article 120, paragraphe 1 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p>          |
| 690     | <b><u>1.2.2.13.1.1 échelon 1 de qualité de crédit</u></b>  |
| 700     | <b><u>1.2.2.13.1.2 échelon 2 de qualité de crédit</u></b>  |
| 710     | <b><u>1.2.2.13.1.3 échelon 3 de qualité de crédit</u></b>  |
| 720-740 | <p><b><u>1.2.2.13.2 émissions propres</u></b></p> <p>Article 416(3)(b) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Ces éléments sont déclarés d'après leur qualité de crédit conformément à l'article 120, paragraphe 1 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p>                           |
| 720     | <b><u>1.2.2.13.2.1 échelon 1 de qualité de crédit</u></b>  |
| 730     | <b><u>1.2.2.13.2.2 échelon 2 de qualité de crédit</u></b>  |
| 740     | <b><u>1.2.2.13.2.3 échelon 3 de qualité de crédit</u></b>  |
| 750-770 | <p><b><u>1.2.2.13.3 émissions d'établissement de crédit non garanties</u></b></p> <p>Article 416 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Ces éléments sont déclarés d'après leur qualité de crédit conformément à l'article 120, paragraphe 1 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> |
| 750     | <b><u>1.2.2.13.3.1 échelon 1 de qualité de crédit</u></b>  |
| 760     | <b><u>1.2.2.13.3.2 échelon 2 de qualité de crédit</u></b>  |
| 770     | <b><u>1.2.2.13.3.3 échelon 3 de qualité de crédit</u></b>  |
| 780-800 | <p><b><u>1.2.2.13.3.4 titres adossés à des actifs non déclarés aux points 1.10 à 1.11.3</u></b></p> <p>Article 416(4)(b) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Ces éléments sont déclarés d'après leur qualité de crédit en vertu de</p>                                      |



|         |   |
|---------|---|
|         | la troisième partie, titre 2, chapitre 5 et de l'article 125 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013  |
| 780     | <b><u>1.2.2.13.4.1 échelon 1 de qualité de crédit</u></b>   |
| 790     | <b><u>1.2.2.13.4.2 échelon 2 de qualité de crédit</u></b>   |
| 800     | <b><u>1.2.2.13.4.3 échelon 3 de qualité de crédit</u></b>   |
| 810-830 | <b><u>1.2.2.13.5 titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles non déclarés aux points 1.10 à 1.11.3</u></b><br><br>Article 509(3) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013<br><br>Ces éléments sont déclarés d'après leur qualité de crédit en vertu de la troisième partie, titre 2, chapitre 5 et de l'article 125 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013 |
| 810     | <b><u>1.2.2.13.5.1 échelon 1 de qualité de crédit</u></b>   |
| 820     | <b><u>1.2.2.13.5.2 échelon 2 de qualité de crédit</u></b>   |
| 830     | <b><u>1.2.2.13.5.3 échelon 3 de qualité de crédit</u></b>   |
| 840     | <b><u>1.2.2.13.6 actions cotées sur un marché reconnu et instruments de fonds propres liées à un indice boursier majeur, non par l'établissement ou par des établissements financiers</u></b><br><br>Article 509(3)(c) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013  |
| 850     | <b><u>1.2.2.13.7 or</u></b><br><br>Article 509(3)(c) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013  |
| 860     | <b><u>1.2.2.13.8 obligations garanties non déclarées précédemment</u></b><br><br>Article 509(3)(c) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013  |
| 870     | <b><u>1.2.2.13.9 obligations sécurisées non déclarées précédemment</u></b><br><br>Article 509(3)(c) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013   |
| 880     | <b><u>1.2.2.13.10 obligations d'entreprise non déclarées précédemment</u></b><br><br>Article 509(3)(c) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013  |
| 890     | <b><u>1.2.2.13.11 fonds basés sur les actifs déclarés en 4.5 - 4.10</u></b><br><br>Article 509(3)(c) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013  |
| 900-920 | <b><u>1.2.2.13.12 autres catégories de titres ou de prêts éligibles auprès de la banque centrale</u></b>  |

|         |  |
|---------|--|
|         | Article 509(3)(b) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013  |
| 900     | <b><u>1.2.2.13.12.1 obligations des administrations locales</u></b><br>Article 509(3)(b) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013   |
| 910     | <b><u>1.2.2.13.12.2 billets de trésorerie</u></b><br>Article 509(3)(b) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013   |
| 920     | <b><u>1.2.2.13.12.3 créances privées</u></b><br>Article 416(4)(c) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013  |
| 930-950 | <b><u>1.2.2.14 Déclaration des actifs compatibles avec la charia comme actifs alternatifs en vertu de l'article 509, paragraphe 2, point i)</u></b><br><br>Articles 419(2)(a) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013 et 509(2)(i)<br><br>Ces éléments sont déclarés ici conformément au point 1.2.2 ci-dessus, dans la sous-catégorie appropriée. |
| 930     | <b><u>1.2.2.14.1 échelon 1 de qualité de crédit</u></b>  |
| 940     | <b><u>1.2.2.14.2 échelon 2 de qualité de crédit</u></b>  |
| 950     | <b><u>1.2.2.14.3 échelon 3 de qualité de crédit</u></b>  |

|         |   |
|---------|---|
|         | <b><u>1.2.3 Dépôts qui doivent être maintenus par le déposant</u></b><br>Article 422(3) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013<br><br>Le montant total des dépôts, y compris les dépôts à vue et les dépôts à terme, qui doivent être maintenus par le déposant, est déclaré dans les sous-catégories suivantes, colonne 010 «Montant déposé par des clients qui <u>sont</u> des clients financiers» et colonne 30 «Montant déposé par des clients qui <u>ne sont pas</u> des clients financiers» en fonction du type de contrepartie: |
| 960-990 | <b><u>1.2.3.1 afin de pouvoir bénéficier des services de compensation, de banque dépositaire ou de gestion de trésorerie (hors services de correspondant bancaire ou de courtage privilégié)</u></b><br>Article 422(3)(a) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013<br><br>Le montant total des dépôts qui doivent être maintenus par le  |

|         |   |
|---------|---|
|         | <p>déposant afin de pouvoir bénéficier des services de compensation, de banque dépositaire ou de gestion de trésorerie fournis par l'établissement (hors services de correspondant bancaire ou de courtage privilégié) est déclaré dans les sous-catégories correspondantes comme suit:</p> <p>[Remarque: La compensation, dans ce contexte, fait référence à un accord de service permettant à des clients de transférer des fonds (ou titres) à des destinataires finaux, indirectement par l'intermédiaire de participants directs aux systèmes de règlement locaux. De tels services sont limités aux activités suivantes: transmission, rapprochement et confirmation des ordres de paiement; découvert intra-journalier, financement à un jour et tenue des soldes après règlement; et détermination des positions de règlement intra-journalier et final. Les services de compensation et services connexes doivent être fournis dans le cadre d'un accord juridiquement contraignant auprès de clients institutionnels (règles de Bâle III en matière de liquidité, paragraphe 75).</p> <p>La banque dépositaire, dans ce contexte, fait référence à la conservation, à la déclaration et au traitement d'actifs et/ou à l'organisation des éléments opérationnels et administratifs d'activités connexes pour le compte des clients dans le cadre de la négociation et de la conservation de leurs actifs financiers. Les services liés aux dépôts doivent être fournis dans le cadre d'un accord de services de dépositaire ou autre accord équivalent, juridiquement contraignant auprès de clients institutionnels. De tels services sont limités au règlement d'opérations sur titres, au transfert de paiements contractuels, au traitement de sûretés, à l'exécution d'opérations en devises étrangères, à la détention de soldes en espèces liés, et à la fourniture de services auxiliaires de gestion de la trésorerie. Cela comprend également la réception de dividendes et d'autres revenus, les souscriptions et remboursements de clients, les distributions planifiées des fonds des clients et le paiement d'honoraires, de taxes et autres dépenses. Les services de dépôt peuvent en outre s'étendre à l'administration d'actifs et aux services fiduciaires aux entreprises, aux services de trésorerie, de séquestre, de transfert de fonds, de transfert de stocks et d'agence, y compris les services de paiement et de règlement (hors services de correspondant bancaire), au financement des échanges commerciaux et aux certificats représentatifs (règles de Bâle III en matière de liquidité, paragraphe 76).</p> <p>La gestion de trésorerie, dans ce contexte, fait référence à la fourniture d'une gestion de trésorerie et de services connexes aux clients. Gestion de trésorerie et services connexes]</p> |
| 960-970 | <p><b><u>1.2.3.1.1 couverts par un système de garantie des dépôts conformément à la directive 94/19/CE ou un système de garantie des dépôts équivalent d'un pays tiers</u></b></p> <p>Le montant total des dépôts qui doivent être maintenus par le dépositaire afin de pouvoir bénéficier des services de compensation, de banque dépositaire ou de gestion de trésorerie fournis par l'établissement (hors services de correspondant bancaire ou de courtage privilégié) qui sont couverts par un système de garantie des dépôts conformément à la directive 94/19/CE ou un système de garantie des dépôts équivalent d'un pays tiers est déclaré dans les</p>  |

|         |  |
|---------|--|
|         | sous-catégories ci-après comme suit:   |
| 960     | <p><b><u>1.2.3.1.1.1 pour lesquels il existe des éléments montrant que le client ne peut retirer des montants légalement dus dans un délai de 30 jours sans compromettre son fonctionnement opérationnel</u></b></p> <p>Le montant total des dépôts qui doivent être maintenus par le déposant afin de pouvoir bénéficier des services de compensation, de banque dépositaire ou de gestion de trésorerie fournis par l'établissement (hors services de correspondant bancaire ou de courtage privilégié) qui sont couverts par un système de garantie des dépôts conformément à la directive 94/19/CE ou un système de garantie des dépôts équivalent d'un pays tiers et pour lesquels il existe des éléments montrant que le client ne peut retirer des montants légalement dus dans un délai de 30 jours sans compromettre son fonctionnement opérationnel.</p>   |
| 970     | <p><b><u>1.2.3.1.1.2 pour lesquels il n'existe aucun élément montrant que le client ne peut retirer des montants légalement dus dans un délai de 30 jours sans compromettre son fonctionnement opérationnel</u></b></p> <p>Le montant total des dépôts qui doivent être maintenus par le déposant afin de pouvoir bénéficier des services de compensation, de banque dépositaire ou de gestion de trésorerie fournis par l'établissement (hors services de correspondant bancaire ou de courtage privilégié) qui sont couverts par un système de garantie des dépôts conformément à la directive 94/19/CE ou un système de garantie des dépôts équivalent d'un pays tiers, et pour lesquels il n'existe cependant aucun élément montrant que le client ne peut retirer des montants légalement dus dans un délai de 30 jours sans compromettre son fonctionnement opérationnel, est déclaré dans les sous-catégories ci-après, comme suit:</p> |
| 980-990 | <p><b><u>1.2.3.1.2 non couverts par un système de garantie des dépôts conformément à la directive 94/19/CE ou un système de garantie des dépôts équivalent d'un pays tiers</u></b></p> <p>Le montant total des dépôts qui doivent être maintenus par le déposant afin de pouvoir bénéficier des services de compensation, de banque dépositaire ou de gestion de trésorerie fournis par l'établissement (hors services de correspondant bancaire ou de courtage privilégié) qui ne sont pas couverts par un système de garantie des dépôts conformément à la directive 94/19/CE ou un système de garantie des dépôts équivalent d'un pays tiers est déclaré dans les sous-catégories correspondantes comme suit:</p>   |
| 980     | <p><b><u>1.2.3.1.2.1 pour lesquels il existe des éléments montrant que le client ne peut retirer des montants légalement dus dans un délai de 30 jours sans compromettre son fonctionnement opérationnel</u></b></p> <p>Le montant total des dépôts qui doivent être maintenus par le déposant afin de pouvoir bénéficier des services de compensation, de banque dépositaire ou de gestion de trésorerie fournis par l'établissement (hors services de correspondant bancaire ou de courtage privilégié) qui ne sont pas couverts par un système de garantie des dépôts conformément à la directive 94/19/CE ou un</p>  |

|      |   |
|------|---|
|      | <p>système de garantie des dépôts équivalent d'un pays tiers et pour lesquels il existe des éléments montrant que le client ne peut retirer des montants légalement dus dans un délai de 30 jours sans compromettre son fonctionnement opérationnel.</p>  |
| 990  | <p><b><u>1.2.3.1.2.2 pour lesquels il n'existe aucun élément montrant que le client ne peut retirer des montants légalement dus dans un délai de 30 jours sans compromettre son fonctionnement opérationnel</u></b></p> <p>Le montant total des dépôts qui doivent être maintenus par le déposant afin de pouvoir bénéficier des services de compensation, de banque dépositaire ou de gestion de trésorerie fournis par l'établissement (hors services de correspondant bancaire ou de courtage privilégié) qui ne sont pas couverts par un système de garantie des dépôts conformément à la directive 94/19/CE ou un système de garantie des dépôts équivalent d'un pays tiers, et pour lesquels il n'existe aucun élément montrant que le client ne peut retirer des montants légalement dus dans un délai de 30 jours sans compromettre son fonctionnement opérationnel, est déclaré dans les sous-catégories ci-après, comme suit:</p> |
| 1000 | <p><b><u>1.2.3.2 dans le cadre d'une relation opérationnelle établie autre que celle déclarée en 1.2.3.1.1 et 1.2.3.1.2</u></b></p> <p>Article 422(3)(c)</p> <p>Montant total des dépôts qui doivent être maintenus par le déposant dans le cadre d'une relation opérationnelle établie autre que celle déclarée en 1.2.3.1.1 et 1.2.3.1.2.</p>   |
| 1010 | <p><b><u>1.2.3.2.1 dont des services de correspondant bancaire ou de courtage privilégié</u></b></p> <p>Montant total des dépôts qui doivent être maintenus par le déposant dans le cadre d'une relation opérationnelle établie autre que celle déclarée en 1.2.3.1.1 et 1.2.3.1.2 qui sont des dépôts relatifs à des services de correspondant bancaire ou de courtage privilégié.</p>   |
| 1020 | <p><b><u>1.2.3.4 conformément aux modalités générales de partage des tâches prévues par un système de protection institutionnel ou en tant que dépôt légal ou statutaire minimum d'une autre entité qui est un membre du même système de protection institutionnel</u></b></p> <p>Article 422(3)(b) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Montant total des dépôts qui doivent être maintenus par le déposant conformément aux modalités générales de partage des tâches prévues par un système de protection institutionnel ou en tant que dépôt légal ou statutaire minimum d'une autre entité qui est un membre du même système de protection institutionnel.</p>   |
| 1030 | <p><b><u>1.2.3.5 afin d'obtenir des services de compensation en espèces et d'établissement de crédit central, et lorsque l'établissement de crédit appartient à un réseau en vertu de dispositions légales ou statutaires;</u></b></p> <p>Article 422(3)(d) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p>   |

|           |   |
|-----------|---|
|           | <p>Montant total des dépôts qui doivent être maintenus par le déposant afin d'obtenir des services de compensation en espèces et d'établissement de crédit central, et lorsque l'établissement de crédit appartient à un réseau en vertu de dispositions légales ou statutaires;</p>  |
| 1040      | <p><b><u>1.2.4 Dépôts placés par des établissements de crédit auprès d'établissements de crédit centraux qui sont considérés comme des actifs liquides conformément à l'article 416, paragraphe 1, point f)</u></b></p> <p>Article 422(3) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013, dernier paragraphe</p> <p>Montant total des dépôts placés par des établissements de crédit auprès d'établissements de crédit centraux qui sont considérés comme des actifs liquides conformément à l'article 416, paragraphe 1, point f)</p>   |
| 1050      | <p><b><u>1.2.5 Lignes de liquidité pour les actifs visés à l'article 416, paragraphe 1),point f)</u></b></p> <p>Article 416, paragraphe 1, point f)</p> <p>Montant total des lignes de liquidité pour les actifs visés à l'article 416, paragraphe 1),point f)</p>  |
| 1060-1070 | <p><b><u>1.2.6 Passifs non déclarés en 1.2.2 ou 1.2.5 qui résultent des dépôts de clients autres que des clients financiers</u></b></p> <p>Article 422(5) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Montant total des passifs non déclarés en 1.2.2 ou 1.2.5 qui résultent des dépôts de clients autres que des clients financiers.</p>  |
| 1060      | <p><b><u>1.2.6.1 qui sont couverts par un système de garantie des dépôts conformément à la directive 94/19/CE ou un système de garantie des dépôts équivalent d'un pays tiers</u></b></p>   |
| 1070      | <p><b><u>1.2.6 qui ne sont pas couverts par un système de garantie des dépôts conformément à la directive 94/19/CE ou un système de garantie des dépôts équivalent d'un pays tiers</u></b></p>  |
| 1060      | <p><b><u>1.2.7 sommes nettes à acquitter découlant des contrats visés à l'annexe II (nettes des sûretés à recevoir éligibles en tant qu'actifs liquides en vertu de l'article 416)</u></b></p> <p>Article 422(6) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Sommes nettes à acquitter à l'horizon de 30 jours qui découlent de contrats énumérés à l'annexe II.</p> <p>Les montants:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>– sont pris en compte sur une base nette pour toutes les contreparties</li> <li>– sont nets des sûretés à recevoir éligibles en tant qu'actifs liquides en vertu de l'article 416</li> <li>– ne sont pas évalués au prix du marché, car la valeur de marché inclut également des estimations des entrées et sorties de trésorerie éventuelles et peut inclure des flux de trésorerie qui se réaliseront au-delà de l'horizon de 30 jours</li> </ul> |

|           |  |
|-----------|--|
|           | <p>Remarque: le montant net à recevoir est déclaré sous 1.3 «Entrées de trésorerie», point 1.1.6 (montant net à recevoir découlant des contrats énumérés à l'annexe II (net des sûretés à recevoir éligibles en tant qu'actifs liquides en vertu de l'article 416)).</p>   |
| 1090-1100 | <p><b><u>1.2.8 Passifs pour lesquels l'autorité compétente a déterminé une moindre sortie de trésorerie</u></b></p> <p>Article 422(8) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Le montant total des passifs pour lesquels l'autorité compétente a déterminé une moindre sortie de trésorerie au cas par cas est déclaré dans les sous-catégories ci-après comme suit:</p>  |
| 1090      | <p><b><u>1.2.8.1 lorsque toutes les conditions de l'article 422, paragraphe 8, points a), b), c) et d) sont remplies</u></b></p> <p>Montant total des passifs pour lesquels l'autorité compétente a autorisé l'utilisation d'une sortie de trésorerie moindre au cas par cas et lorsque toutes les conditions de l'article 422, paragraphe 8, point a), b) c) et d) sont remplies.</p>   |
| 1100      | <p><b><u>1.2.8.2 lorsque toutes les conditions de l'article 422, paragraphe 8, point a), b) et c) sont remplies aux fins d'appliquer le traitement intragroupe visé à l'article 20, paragraphe 1, point b), relatif aux établissements qui ne sont pas soumis à l'exemption de l'article 8</u></b></p> <p>Montant total des passifs pour lesquels l'autorité compétente a autorisé l'utilisation d'une sortie de trésorerie moindre au cas par cas et lorsque toutes les conditions de l'article 422, paragraphe 8, point a), b) et c) sont remplies aux fins d'appliquer le traitement intragroupe visé à l'article 20, paragraphe 1, point b), relatif aux établissements qui ne sont pas soumis à l'exemption de l'article 8.</p> |
| 1110-1120 | <p><b><u>1.2.9 Passifs, y compris tout dispositif contractuel créant des engagements de hors bilan et de financement éventuel, pour lesquels l'autorité compétente a déterminé une sortie de trésorerie supérieure suite à l'évaluation prévue à l'article 420, paragraphe 2, du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</u></b></p> <p>Article 420(1)(e) et 420(2) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Montant total des passifs, y compris tout dispositif contractuel créant des engagements de hors bilan et de financement éventuel, pour lequel l'autorité compétente a déterminé une sortie de trésorerie supérieure suite à l'évaluation prévue à l'article 420, paragraphe 2, du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013.</p>                        |
| 1110      | <p><b><u>1.2.9 Passifs, y compris tout dispositif contractuel créant des engagements de hors bilan et de financement éventuel, pour lesquels l'autorité compétente a déterminé une sortie de trésorerie supérieure suite à l'évaluation prévue à l'article 420, paragraphe 2, du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</u></b></p>  |

|           |   |
|-----------|---|
| 1120      | <p><b><u>1.2.9 Passifs, y compris tout dispositif contractuel créant des engagements de hors bilan et de financement éventuel, pour lesquels l'autorité compétente a déterminé une sortie de trésorerie supérieure suite à l'évaluation prévue à l'article 420, paragraphe 2, du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</u></b></p>   |
| 1130      | <p><b><u>1.2.10 Tous les autres passifs</u></b></p> <p>Article 422(7) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Montant total de tous les autres passifs.</p>  |
| 1140-1210 | <p><b><u>1.3 Sorties de trésorerie supplémentaires</u></b></p> <p>Le montant total des sorties de trésorerie supplémentaires est déclaré dans les sous-catégories ci-après comme suit:</p>  |
| 1140      | <p><b><u>1.3.1 Pour les sûretés autres que les actifs visés à l'article 416, paragraphe 1, points a) à c), fournies par l'établissement pour les contrats énumérés à l'annexe II</u></b></p> <p>Article 423(1) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Le montant total de toutes les sorties de trésorerie supplémentaires pour les sûretés autres que les actifs visés à l'article 416, paragraphe 1, points a) à c), fournies par l'établissement pour les contrats énumérés à l'annexe II, est déclaré dans les sous-catégories ci-après comme suit:</p> |
| 1150      | <p><b><u>1.3.2 Correspondant aux besoins supplémentaires en sûretés résultant d'une dégradation significative de la qualité de crédit de l'établissement</u></b></p> <p>Article 423(2) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Montant total des sorties de trésorerie correspondant aux besoins supplémentaires en sûretés résultant d'une dégradation significative de la qualité de crédit de l'établissement.</p>  |
| 1160      | <p><b><u>1.3.3 Correspondant à des besoins supplémentaires en sûretés qui résulteraient d'un scénario de marché défavorable en ce qui concerne les opérations sur dérivés, les opérations de financement et autres contrats conclus par l'établissement, si ces opérations ont une importance significative</u></b></p> <p>Article 423(3) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Montant total des sorties de trésorerie correspondant à des besoins supplémentaires en sûretés qui résulteraient d'un scénario de marché défavorable.</p>                  |



|                    |  |
|--------------------|--|
| 1170               | <p><b><u>1.3.4 Correspondant à la valeur de marché des titres ou des autres actifs vendus à découvert et devant être livrés dans un délai de 30 jours, sauf si l'établissement détient les titres à livrer ou qu'il les a empruntés à des conditions qui ne prévoient une restitution qu'au-delà de 30 jours et si les titres ne font pas partie de ses actifs liquides</u></b></p> <p>Article 423(4) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Montant total des sorties de trésorerie correspondant à la valeur de marché des titres ou des autres actifs vendus à découvert et devant être livrés dans un délai de 30 jours, sauf si l'établissement détient les titres à livrer ou qu'il les a empruntés à des conditions qui ne prévoient une restitution qu'au-delà de 30 jours et si les titres ne font pas partie de ses actifs liquides.</p> |
| <b><u>1180</u></b> | <p><b><u>1.3.5 Correspondant aux sûretés excédentaires détenues par l'établissement et dont la contrepartie peut contractuellement à tout moment réclamer la restitution</u></b></p> <p>Article 423(5)(a) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Montant total des sorties de trésorerie correspondant aux sûretés excédentaires détenues par l'établissement et dont la contrepartie qui peut à tout moment contractuellement réclamer la restitution</p>   |
| <b><u>1190</u></b> | <p><b><u>1.3.6 Correspondant aux sûretés devant être restituées à une contrepartie</u></b></p> <p>Article 423(5)(b) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Montant total des sorties de trésorerie correspondant aux sûretés devant être restituées à une contrepartie</p>   |
| <b><u>1200</u></b> | <p><b><u>1.3.7 Pour les sûretés correspondant à des actifs éligibles en tant qu'actifs liquides aux fins de l'article 416 qui peuvent être substitués à des actifs correspondant à des actifs non éligibles en tant qu'actifs liquides aux fins de l'article 416 sans l'accord de l'établissement.</u></b></p> <p>Article 423(5)(c) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Montant total des sorties de trésorerie pour les sûretés correspondant à des actifs éligibles en tant qu'actifs liquides aux fins de l'article 416 qui peuvent être substitués à des actifs correspondant à des actifs non éligibles en tant qu'actifs liquides aux fins de l'article 416 sans l'accord de l'établissement.</p>   |
| <b><u>1210</u></b> | <p><b><u>1.3.8 Dépôts reçus à titre de sûreté</u></b></p> <p>Article 423(6) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Montant total des sorties de trésorerie correspondant aux dépôts reçus à titre de sûreté</p>  |
| 1220-1370          | <p><b><u>1.4 Sorties de trésorerie relatives à des facilités de crédit et de caisse</u></b></p>  |

|           |  |
|-----------|--|
|           | <p>Le montant total maximum pouvant être prélevé des facilités de caisse et de crédit non prélevées est déclaré dans les sous-catégories ci-après comme suit:</p> <p>[Remarque: Ce montant maximum pouvant être prélevé peut être évalué net de la valeur, conformément à l'article 418, des sûretés à fournir si l'établissement peut réutiliser les sûretés et si les sûretés prennent la forme d'actifs liquides conformément à l'article 416. Les sûretés devant être fournies ne peuvent pas être des actifs émis par la contrepartie de la facilité ou par l'une de ses entités affiliées. Dans le cas où les informations correspondantes sont disponibles pour l'établissement, le montant maximum pouvant être prélevé au titre de facilités de crédit et de caisse octroyées à une entité de titrisation est défini comme le montant maximum susceptible d'être prélevé eu égard aux obligations auxquelles est exposée l'entité de titrisation qui sont exigibles au cours des 30 jours suivants.]</p>  |
| 1220      | <p><b><u>1.4.1 Montant maximum pouvant être prélevé au niveau des facilités de crédit confirmées non prélevées et des facilités de caisse confirmées non prélevées pour les clients de détail</u></b></p> <p>Article 424(2)(c) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Montant total maximum pouvant découler de facilités de crédit confirmées non prélevées et de facilités de caisse <b><u>confirmées non prélevées</u></b> pour les clients de détail s'ils relèvent de la catégorie des expositions sur la clientèle de détail dans le cadre de l'application de l'approche standard ou de l'approche NI pour le risque de crédit.</p>   |
| 1230-1240 | <p><b><u>1.4.2 Montant maximum pouvant être prélevé au niveau des facilités de crédit confirmées non prélevées et des facilités de caisse confirmées non prélevées pour les clients autres que les clients de détail et financiers</u></b></p> <p>Article 424(3) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Montant total maximum pouvant découler de facilités de crédit confirmées non prélevées et de facilités de caisse <b><u>confirmées non prélevées</u></b> pour les clients autres que les clients de détail et clients financiers, lorsqu'elles remplissent les conditions suivantes:</p> <p>a) elles ne relèvent pas de la catégorie des expositions sur la clientèle de détail dans le cadre de l'application de l'approche standard ou de l'approche NI pour le risque de crédit;</p> <p>b) elles ont été octroyées à des clients autres que des clients financiers;</p> <p>(c) elles n'ont pas été fournies afin d'apporter au client un financement dans une situation où celui-ci n'est pas en mesure de satisfaire ses exigences de financement sur les marchés financiers.</p> |
| 1230      | <p><b><u>1.4.2.1 – facilités de crédit confirmées non prélevées</u></b></p> <p>Montant total en 1.4.2 représentant des facilités de crédit confirmées non prélevées</p>  |
| 1240      | <p><b><u>1.4.2.2 – facilités de caisse confirmées non prélevées</u></b></p> <p>Montant total en 1.4.2 représentant des facilités de caisse confirmées</p>  |

|           |  |
|-----------|--|
|           | non prélevées  |
| 1250      | <p><b><u>1.4.3 Montant maximum pouvant être prélevé au niveau des facilités de caisse non prélevées qui a été octroyé à une entité de titrisation afin que celle-ci puisse acheter des actifs autres que des titres auprès de clients autres que des clients financiers et qui dépasse le montant d'actifs en cours d'achat auprès de clients et lorsque le montant maximal qui peut être prélevé est contractuellement limité au montant des actifs en cours d'achat</u></b></p> <p>Article 424(4) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Montant total maximum pouvant résulter de facilités de caisse non prélevées ayant été octroyé à une entité de titrisation afin que celle-ci puisse acheter des actifs autres que des titres auprès de clients qui ne sont pas des clients financiers.</p> |
| 1260-1270 | <p><b><u>1.4.4 Montant maximum pouvant être prélevé au niveau des autres facilités de crédit confirmées non prélevées et des facilités de caisse confirmées non prélevées non déclarées en 1.4.1, 1.4.2 ou 1.4.3</u></b></p> <p>Article 424(5) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Montant total maximum pouvant résulter de facilités de crédit et de caisse non prélevées auprès de clients, autres que celles déclarées en 1.4.1, 1.4.2 ou 1.4.3. Cela comprend les:</p> <p>a) facilités de caisse que l'établissement a octroyées à l'entité de titrisation;</p> <p>b) arrangements en vertu desquels l'établissement a l'obligation d'acheter des actifs d'une entité de titrisation ou d'échanger des actifs avec elle.</p>   |
| 1260      | <p><b><u>1.4.4.1 éléments octroyés à des entités de titrisation autres que ceux déclarés en 1.4.3</u></b></p> <p>Article 424(5), point (a) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Montant total reporté en 1.4.4 correspondant aux éléments octroyés à des entités de titrisation autres que ceux déclarés en 1.4.3</p>  |
| 1270      | <p><b><u>1.4.4.2 arrangements en vertu desquels l'établissement a l'obligation d'acheter des actifs d'une entité de titrisation ou d'échanger des actifs avec elle</u></b></p> <p>Article 424(5), point (b) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Montant total reporté en 1.4.4 correspondant aux arrangements en vertu desquels l'établissement a l'obligation d'acheter des actifs d'une entité de titrisation ou d'échanger des actifs avec elle</p>  |
| 1280-1290 | <p><b><u>1.4.4.3 éléments octroyés aux établissements de crédit</u></b></p> <p>Article 424(5), point (c) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Montant total reporté en 1.4.4 correspondant aux éléments octroyés aux établissements de crédit</p>  |

|                    |  |
|--------------------|--|
| 1280               | <p><b><u>1.4.4.3.1 facilités de crédit confirmées non prélevées</u></b></p> <p>Montant total reporté en 1.4.4.3 relatif aux facilités de crédit confirmées non prélevées</p>   |
| 1290               | <p><b><u>1.4.4.3.2 facilités de caisse confirmées non prélevées</u></b></p> <p>Montant total reporté en 1.4.4.3 relatif aux facilités de caisse confirmées non prélevées</p>   |
| 1300-1310          | <p><b><u>1.4.4.4 éléments octroyés aux établissements financiers et aux entreprises d'investissement</u></b></p> <p>Article 424(5), point (d) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Montant total reporté en 1.4.4 correspondant aux éléments octroyés aux établissements financiers et aux entreprises d'investissement à l'exclusion des établissements de crédit</p>   |
| 1300               | <p><b><u>1.4.4.4.1 facilités de crédit confirmées non prélevées</u></b></p> <p>Montant total reporté en 1.4.4.4 relatif aux facilités de crédit confirmées non prélevées</p>   |
| 1310               | <p><b><u>1.4.4.4.2 facilités de caisse confirmées non prélevées</u></b></p> <p>Montant total reporté en 1.4.4.4 relatif aux facilités de caisse confirmées non prélevées</p>   |
| <b><u>1320</u></b> | <p><b><u>1.4.4.5 éléments octroyés aux autres clients</u></b></p> <p>Montant total reporté en 1.4.4 correspondant aux éléments octroyés aux autres clients</p>   |
| 1330               | <p><b><u>1.4.4.6 éléments octroyés aux entités intragroupe</u></b></p> <p>Montant total reporté en 1.4.4 correspondant aux éléments octroyés aux entités intragroupe d'après le RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p>   |
| 1340               | <p><b><u>1.4.5 Montant maximum pouvant être prélevé au niveau des facilités de crédit et de caisse non prélevées octroyées dans le but de financer des prêts incitatifs</u></b></p> <p>Article 424(6) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Montant total maximum pouvant résulter de facilités de crédit et de caisse non prélevées octroyées aux établissements dans l'unique but de financer directement ou indirectement des prêts incitatifs qui relèvent des catégories d'expositions visées aux paragraphes 2 et 3. Ces prêts incitatifs ne sont octroyés qu'à des personnes autres que des clients financiers, sur une base non concurrentielle et dans un but non lucratif, et visent à promouvoir des objectifs de politique publique de l'administration centrale ou régionale de l'État membre concerné. Le recours à ces facilités ne doit être possible que suite à une demande de prêt incitatif et jusqu'à concurrence du montant de cette demande.</p> |

|      |   |
|------|---|
|      |   |
| 1350 | <p><b><u>1.4.6 Montant maximum pouvant être prélevé de tous les autres engagements éventuels</u></b></p> <p>Montant total maximum pouvant découler de tous les autres engagements éventuels. Ces obligations de financement éventuel peuvent être contractuelles ou non contractuelles et ne constituent pas des engagements de prêt. Les obligations de financement éventuel non contractuelles comprennent des références à, ou le soutien de, produits vendus ou services fournis qui peuvent nécessiter le soutien ou la prolongation des fonds à l'avenir dans des conditions de tension. Les obligations non contractuelles peuvent être incorporées dans les produits et instruments financiers vendus, sponsorisés ou générés par l'établissement, ce qui peut entraîner une croissance non prévue de son bilan du fait du soutien apporté pour des considérations liées au risque de réputation.</p> |
| 1360 | <p><b><u>1.4.6.1 éléments octroyés aux entités intragroupe</u></b></p> <p>Montant reporté en 1.4.6 octroyé aux entités intragroupe d'après le RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p>  |
| 1370 | <p><b><u>1.4.7 Sorties de trésorerie d'après l'article 105 de la directive sur les exigences de fonds propres (CRD)</u></b></p> <p>Total des sorties de trésorerie découlant des facteurs de risque mentionnés aux points a) et d) de l'article 105 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013 dans la mesure où elles sont censées se produire à l'horizon de 30 jours.</p>   |