

FR
ANNEXE XIII
**RAPPORT SUR LA LIQUIDITÉ (PARTIE 5 SUR 5: FINANCEMENT
STABLE)**

2. Éléments nécessitant un financement stable

2.1. Remarques générales

1. Le présent modèle récapitulatif comprend des informations sur les éléments nécessitant un financement stable. Les éléments qui ne doivent pas être remplis par les établissements sont grisés.
2. Tous les actifs figurant au bilan d'un établissement sont déclarés ici. Le montant total déclaré reflète donc l'ensemble des fonds propres et passifs.
3. Traitement des échéances:
 - (i) Conformément à l'article 428, paragraphe 2 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013, les éléments sont présentés dans cinq catégories comme suit:
 - (a) les actifs dont la date d'échéance ou date contractuelle d'exigibilité du remboursement, si celle-ci est antérieure, tombe dans les trois mois suivant la date de déclaration, sont déclarés dans les colonnes 010, 060 ou 110 selon la catégorie appropriée.
 - (b) les actifs dont la date d'échéance ou date contractuelle d'exigibilité du remboursement, si celle-ci est antérieure, tombe dans les trois à six mois suivant la date de déclaration, sont déclarés dans les colonnes 020, 070 ou 120 selon la catégorie appropriée.
 - (c) les actifs dont la date d'échéance ou date contractuelle d'exigibilité du remboursement, si celle-ci est antérieure, tombe dans les 6 à 9 mois suivant la date de déclaration, sont déclarés dans les colonnes 030, 080 ou 130 selon la catégorie appropriée.
 - (d) les actifs dont la date d'échéance ou date contractuelle d'exigibilité du remboursement, si celle-ci est antérieure, tombe dans les 9 à 12 mois suivant la date de déclaration, sont déclarés dans les colonnes 040, 090 ou 140 selon la catégorie appropriée.
 - (e) les actifs dont la date d'échéance ou date contractuelle d'exigibilité du remboursement, si celle-ci est antérieure, tombe plus d'un an après la date de déclaration, sont déclarés dans les colonnes 050, 100 ou 150 selon la catégorie appropriée.
 - (ii) Pour les options qui peuvent être exercées à la discrétion de l'établissement, les établissements tiendront compte des facteurs de risque de réputation qui peuvent limiter la capacité à ne pas exercer l'option. L'établissement tiendra compte d'un tel comportement aux fins de la déclaration des actifs dans le présent modèle, notamment si des tiers prévoient qu'une option ne sera pas exercée.
 - (iii) Les actifs sont déclarés en fonction de leur échéance de contrat résiduelle et non d'hypothèses comportementales.

ANNEXE XIII – partie 5 sur 5

4. Conformément à l'article 510 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013, en vue d'effectuer un suivi du Financement stable, les établissements fourniront, pour chaque catégorie d'actifs déclarés dans le modèle de financement stable requis, une ventilation distincte des charges pesant sur les actifs comme suit:
 - (i) Le montant des actifs déclarés non grevés est déclaré dans la première sous-catégorie.
 - (ii) Le montant des actifs grevés est déclaré dans la sous-rubrique pertinente selon la durée durant laquelle les actifs sont grevés, comme suit:
 - i. pour une période allant jusqu'à trois mois
 - ii. pour une période comprise entre trois et 6 mois
 - iii. pour une période comprise entre 6 et 9 mois
 - iv. pour une période comprise entre 9 et 12 mois
 - v. pour une période supérieure à 12 mois
5. Traitements des actifs reçus ou prêtés dans les opérations de prêts garanties et les opérations ajustées aux conditions du marché conformément à l'article 192 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013:
 - (i) Les établissements excluent les actifs qu'ils ont empruntés dans le cadre d'opérations de prêts garanties et d'opérations ajustées aux conditions du marché conformément à l'article 192 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013 (telles que les opérations de prise en pension et échanges de sûretés) dont ils ne sont pas propriétaires bénéficiaires.
 - (ii) Les établissements déclarent les actifs qu'ils ont prêtés dans le cadre d'opérations de prêts garanties et d'opérations ajustées aux conditions du marché conformément à l'article 192 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013 (telles que les opérations de mise en pension ou échanges de sûretés) dont ils sont propriétaires bénéficiaires.
 - (iii) Lorsqu'un établissement dispose de titres grevés dans le cadre d'opérations de pension qui résultent d'opérations de prêts garanties et d'opérations ajustées aux conditions du marché conformément à l'article 192 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013, que l'établissement a conservé la propriété bénéficiaire et que les titres restent inscrits à son bilan, alors l'établissement affecte lesdits titres à la catégorie appropriée de financement stable requis.
6. Traitement des dettes et créances sur produits dérivés:
 - (i) En général, le bilan d'un établissement présente à la fois des passifs dérivés nets (c.-à-d. des montants à payer) et des actifs dérivés nets (c.-à-d. des montants à recevoir). Les établissements les calculent en fonction des règles de compensation réglementaires, et non des règles comptables, et déclarent les montants en conséquence dans les modèles 1.1. «Financement requis» et 1.2 «Financement stable».

2.2. Éléments nécessitant un financement stable

2.2.1. Instructions concernant les lignes spécifiques

Ligne	Références légales et instructions
010-1320	<p><u>1 ÉLÉMENTS NÉCESSITANT UN FINANCEMENT STABLE</u></p> <p>Le total des actifs est déclaré comme suit:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Dans les colonnes P-T pour les actifs qui ne sont pas déclarés en tant qu'actifs liquides aux fins du modèle Couverture des besoins de liquidité. 2. Dans les colonnes F-J pour les actifs qui sont considérés comme des actifs d'une liquidité et d'une qualité de crédit extrêmement élevées aux fins des colonnes du modèle Couverture des besoins de liquidité 3. Dans les colonnes K-O pour les actifs qui sont considérés comme des actifs d'une liquidité et d'une qualité de crédit élevées aux fins du modèle Couverture des besoins de liquidité. <p>Les actifs sont déclarés en fonction, soit de leur date d'échéance, soit du premier jour où leur remboursement peut être contractuellement exigé, si cette date est antérieure.</p>
010-470	<p><u>1.1 Actifs considérés comme liquides conformément à l'article 416</u></p> <p>Article 428(1)(a) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Le total des actifs visés à l'article 416 est déclaré dans la(les) sous-rubrique(s) et colonne(s) appropriée(s)</p>
010	<p><u>1.1.1 Encaisses</u></p> <p>Articles 416(1)(a)</p> <p>Montant total des encaisses, y compris les pièces et billets /monnaie.</p>
020	<p><u>1.1.2 Expositions sur les banques centrales</u></p> <p>Articles 416(1)(a)</p> <p>Montant total des dépôts auprès des banques centrales.</p>
030	<p><u>1.1.2.1 Dont: expositions qui peuvent être retirées en période de tensions</u></p> <p>Article 416(1)(a)</p> <p>Montant total des dépôts auprès des banques centrales dans la mesure où ces dépôts peuvent être retirés en période de tensions.</p>
040-050	<p><u>1.1.3 Actifs cessibles représentant des créances sur, ou</u></p>

	<p><u>garanties par, l'administration centrale d'un État membre ou d'un pays tiers, 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></p> <p>Article 416(1)(c)(i) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Montant total des actifs cessibles visés à l'article 416, paragraphe 1, point c) (i) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p>
040	<u>1.1.3.1 représentant des créances</u>
050	<u>1.1.3.2 garanties par</u>
060-070	<p><u>1.1.4 Actifs cessibles représentant des créances sur, ou garanties par, des banques centrales et des entités du secteur public ne relevant pas du gouvernement central, émises dans la monnaie locale de la banque centrale et de l'entité du secteur public</u></p> <p>Article 416(1)(c)(ii) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p>
060	<u>1.1.4.1 représentant des créances</u>
070	<u>1.1.4.2 garanties par</u>
080-150	<p><u>1.1.5 Actifs cessibles représentant des créances sur, ou garanties par, la Banque des règlements internationaux, le Fonds monétaire international, la Commission européenne et les banques multilatérales de développement</u></p> <p>Article 416(1)(c)(iii) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p>
080	<u>1.1.5.1 (a) représentant des créances</u>
090	<u>1.1.5.2 (a) garanties par</u>
100	<u>1.1.5.1 (b) montant non grevé</u>
110	<u>1.1.5.2 (b) grevé pour une période allant jusqu'à trois mois</u>
120	<u>1.1.5.3 (b) grevé pour une période comprise entre trois et six mois</u>
130	<u>1.1.5.4 (b) grevé pour une période comprise entre six et neuf mois</u>
140	<u>1.1.5.5 (b) grevé pour une période comprise entre neuf et douze mois</u>
150	<u>1.1.5.6 (b) grevé pour une période supérieure à douze mois</u>
152-153	<p><u>1.1.6 Actifs cessibles représentant des créances sur, ou garanties par, le Fonds européen de stabilité financière et le Mécanisme européen de stabilité</u></p> <p>Article 416(1)(c)(iii) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p>

152	<u>1.1.6.1 représentant des créances</u>
153	<u>1.1.6.2 garanties par</u>
160-230	<u>1.1.7 Total des parts ou actions d'OPC avec actifs sous-jacents visés à l'article 416, paragraphe 1</u> Article 416(6) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013 Valeur de marché totale des parts ou actions d'OPC visées à l'article 416, paragraphe 6 du RÈGLEMENT (UE) n°575/2013
160	<u>1.1.7.1 (a) actifs sous-jacents visés à l'article 416, paragraphe 1, point a)</u>
170	<u>1.1.7.2 (a) actifs sous-jacents visés à l'article 416, paragraphe 1, points b) et c)</u>
175	<u>1.1.7.3 (a) actifs sous-jacents visés à l'article 416, paragraphe 1, point d)</u>
180	<u>1.1.7.1 (b) montant non grevé</u>
190	<u>1.1.7.2 (b) montant grevé pour une période allant jusqu'à trois mois</u>
200	<u>1.1.7.3 (b) montant grevé pour une période comprise entre trois et 6 mois</u>
210	<u>1.1.7.4 (b) montant grevé pour une période comprise entre 6 et 9 mois</u>
220	<u>1.1.7.5 (b) montant grevé pour une période comprise entre 9 et 12 mois</u>
230	<u>1.1.7.6 (b) montant grevé pour une période supérieure à 12 mois</u>
232-233	<u>1.1.8 Dépôts auprès de l'établissement de crédit central et autres formes de financement liquide statutairement ou contractuellement disponibles en provenance d'un 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 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013, dans la mesure où ce financement n'est pas garanti par des actifs liquides</u>
232	<u>1.1.8.1 Dépôts</u>
233	<u>1.1.8.2 Financement disponible, en vertu de dispositions contractuelles</u>
234	<u>1.1.9 Actifs émis par un établissement de crédit institué par l'administration centrale ou une administration régionale d'un État membre lorsqu'au moins l'une des conditions de l'article</u>

	<u>416, paragraphe 2, point a)(iii) est remplie</u>
240-290	<u>1.1.10 Autres actifs cessibles non mentionnés ailleurs</u>
240	<u>1.1.10.1 montant non grevé</u>
250	<u>1.1.10.2 montant grevé pour une période allant jusqu'à trois mois</u>
260	<u>1.1.10.3 montant grevé pour une période comprise entre trois et 6 mois</u>
270	<u>1.1.10.4 montant grevé pour une période comprise entre 6 et 9 mois</u>
280	<u>1.1.10.5 montant grevé pour une période comprise entre 9 et 12 mois</u>
290	<u>1.1.10.6 montant grevé pour une période supérieure à 12 mois</u>
300-350	<u>1.1.11 Obligations d'entreprises non financières</u> <u>Article 416(1)(b) ou (d) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</u>
300	<u>1.1.11.1 montant non grevé</u>
310	<u>1.1.11.2 montant grevé pour une période allant jusqu'à trois mois</u>
320	<u>1.1.11.3 montant grevé pour une période comprise entre trois et 6 mois</u>
330	<u>1.1.11.4 montant grevé pour une période comprise entre 6 et 9 mois</u>
340	<u>1.1.11.5 montant grevé pour une période comprise entre 9 et 12 mois</u>
350	<u>1.1.11.6 montant grevé pour une période supérieure à 12 mois</u>
351	<u>1.1.12 Instruments adossés à des créances hypothécaires non résidentielles 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 3, 4 et 5 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</u>
352	<u>1.1.12.1 montant non grevé</u>
353	<u>1.1.12.2 montant grevé pour une période allant jusqu'à trois mois</u>
354	<u>1.1.12.3 montant grevé pour une période comprise entre trois et 6 mois</u>

355	<u>1.1.12.4 montant grevé pour une période comprise entre 6 et 9 mois</u>
356	<u>1.1.12.5 montant grevé pour une période comprise entre 9 et 12 mois</u>
357	<u>1.1.12.6 montant grevé pour une période supérieure à 12 mois</u>
358	<u>1.1.13 Instruments adossés à des créances hypothécaires résidentielles 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 3, 4 et 5 du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</u>
359	<u>1.1.13.1 montant non grevé</u>
360	<u>1.1.13.2 montant grevé pour une période allant jusqu'à trois mois</u>
361	<u>1.1.13.3 montant grevé pour une période comprise entre trois et 6 mois</u>
362	<u>1.1.13.4 montant grevé pour une période comprise entre 6 et 9 mois</u>
363	<u>1.1.13.5 montant grevé pour une période comprise entre 9 et 12 mois</u>
364	<u>1.1.13.6 montant grevé pour une période supérieure à 12 mois</u>
365	<u>1.1.14 Obligations éligibles au traitement énoncé à l'article 129, paragraphe 4 ou 5, qui remplissent les critères de l'article 416, paragraphe 2, point a) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</u>
366	<u>1.1.14.1 montant non grevé</u>
370	<u>1.1.14.2 montant grevé pour une période allant jusqu'à trois mois</u>
380	<u>1.1.14.3 montant grevé pour une période comprise entre trois et 6 mois</u>
390	<u>1.1.14.4 montant grevé pour une période comprise entre 6 et 9 mois</u>
400	<u>1.1.14.5 montant grevé pour une période comprise entre 9 et 12 mois</u>
410	<u>1.1.14.6 montant grevé pour une période supérieure à 12 mois</u>
420-470	<u>1.1.15 Obligations visées à l'article 52, paragraphe 4, de la directive 2009/65/CE, autres que celles visées en 1.1.9</u>

420	<u>1.1.15.1 montant non grevé</u>
430	<u>1.1.15.2 montant grevé pour une période allant jusqu'à trois mois</u>
440	<u>1.1.15.3 montant grevé pour une période comprise entre trois et 6 mois</u>
450	<u>1.1.15.4 montant grevé pour une période comprise entre 6 et 9 mois</u>
460	<u>1.1.15.5 montant grevé pour une période comprise entre 9 et 12 mois</u>
470	<u>1.1.15.6 montant grevé pour une période supérieure à 12 mois</u>
480-530	<p><u>1.2 Titres et instruments du marché monétaire non déclarés en 1.1, bénéficiant de l'échelon 1 de qualité de crédit en vertu de l'article 122</u></p> <p>Article 428(1)(b)(i) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Total des titres et instruments du marché monétaire non déclarés en 1.1</p> <p>Valeur de marché totale des obligations telles que définies à l'article 428, paragraphe 1, point b) (i) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p>
480	<u>1.2.1 montant non grevé</u>
490	<u>1.2.2 montant grevé pour une période allant jusqu'à trois mois</u>
500	<u>1.2.3 montant grevé pour une période comprise entre trois et 6 mois</u>
510	<u>1.2.4 montant grevé pour une période comprise entre 6 et 9 mois</u>
520	<u>1.2.5 montant grevé pour une période comprise entre 9 et 12 mois</u>
530	<u>1.2.6 montant grevé pour une période supérieure à 12 mois</u>
540-590	<p><u>1.3 Titres et instruments du marché monétaire non déclarés en 1.1, pouvant bénéficier de l'échelon 2 de qualité de crédit en vertu de l'article 122</u></p> <p>Valeur de marché totale des obligations telles que définies à l'article 428, paragraphe 1, point b) (ii) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p>
540	<u>1.3.1 montant non grevé</u>
550	<u>1.3.2 montant grevé pour une période allant jusqu'à trois mois</u>
560	<u>1.3.3 montant grevé pour une période comprise entre trois et 6</u>

	<u>mois</u>
570	<u>1.3.4 montant grevé pour une période comprise entre 6 et 9 mois</u>
580	<u>1.3.5 montant grevé pour une période comprise entre 9 et 12 mois</u>
580	<u>1.3.6 montant grevé pour une période supérieure à 12 mois</u>
600-650	<u>1.4 Autres titres et instruments du marché monétaire non déclarés ailleurs</u> Valeur de marché totale des obligations telles que définies à l'article 428, paragraphe 1, point b) (iii) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013
600	<u>montant non grevé</u>
610	<u>montant grevé pour une période allant jusqu'à trois mois</u>
620	<u>montant grevé pour une période comprise entre trois et 6 mois</u>
630	<u>montant grevé pour une période comprise entre 6 et 9 mois</u>
640	<u>montant grevé pour une période comprise entre 9 et 12 mois</u>
650	<u>montant grevé pour une période supérieure à 12 mois</u>
660-710	<u>1.5 Actions d'entités non financières cotées sur un indice boursier majeur</u> Article 428(1)(c) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013 Total des actions d'entités non financières cotées sur un indice boursier majeur
660	<u>1.5.1 montant non grevé</u>
670	<u>1.5.2 montant grevé pour une période allant jusqu'à trois mois</u>
680	<u>1.5.2 montant grevé pour une période comprise entre trois et 6 mois</u>
690	<u>1.5.3 montant grevé pour une période comprise entre 6 et 9 mois</u>
700	<u>1.5.3 montant grevé pour une période comprise entre 9 et 12 mois</u>
710	<u>1.5.4 montant grevé pour une période supérieure à 12 mois</u>
720-770	<u>1.6 Autres actions</u> Article 428(1)(d) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013 Total des actions non déclarées en 1.3

720	<u>1.6.1 montant non grevé</u>
730	<u>1.6.2 montant grevé pour une période allant jusqu'à trois mois</u>
740	<u>1.6.3 montant grevé pour une période comprise entre trois et 6 mois</u>
750	<u>1.6.4 montant grevé pour une période comprise entre 6 et 9 mois</u>
760	<u>1.6.5 montant grevé pour une période comprise entre 9 et 12 mois</u>
770	<u>1.6.6 montant grevé pour une période supérieure à 12 mois</u>
780-830	<u>1.7 Or</u> Article 428(1)(e) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013
780	<u>1.7.1 montant non grevé</u>
790	<u>1.7.2 montant grevé pour une période allant jusqu'à trois mois</u>
800	<u>1.7.3 montant grevé pour une période comprise entre trois et 6 mois</u>
810	<u>1.7.4 montant grevé pour une période comprise entre 6 et 9 mois</u>
820	<u>1.7.5 montant grevé pour une période comprise entre 9 et 12 mois</u>
830	<u>1.7.6 montant grevé pour une période supérieure à 12 mois</u>
840-890	<u>1.8 Autres métaux précieux</u> Article 428(1)(f) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013 Total des détentions de métaux précieux autres que l'or [Remarque: l'argent ou le platine par exemple. En revanche, l'or est déclaré en 1.5.]
840	<u>1.8.1 montant non grevé</u>
850	<u>1.8.2 montant grevé pour une période allant jusqu'à trois mois</u>
860	<u>1.8.3 montant grevé pour une période comprise entre trois et 6 mois</u>
870	<u>1.8.4 montant grevé pour une période comprise entre 6 et 9 mois</u>
880	<u>1.8.5 montant grevé pour une période comprise entre 9 et 12</u>

	<u>mois</u>
890	<u>1.8.6 montant grevé pour une période supérieure à 12 mois</u>
900-1250	<p><u>1.9 Prêts non renouvelables et créances</u></p> <p>Article 428(1)(g) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Le total des prêts non renouvelables et des créances tels que visés à l'article 428, paragraphe 1, point g) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013 est déclaré dans la(les) sous-rubrique(s) et colonne(s) appropriée(s)</p>
900-950	<p><u>1.9.1 dont les emprunteurs sont des personnes physiques autres que des entreprises individuelles et des partenariats</u></p> <p>Article 428(1)(g)(i) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Total des prêts non renouvelables et créances lorsque les emprunteurs sont des personnes physiques et lorsque les montants totaux placés en dépôt par client ou groupe de clients liés sont inférieurs à 1 million d'euros.</p>
900	<u>1.9.1.1 montant non grevé</u>
910	<u>1.9.1.2 montant grevé pour une période allant jusqu'à trois mois</u>
920	<u>1.9.1.3 montant grevé pour une période comprise entre trois et 6 mois</u>
930	<u>1.9.1.4 montant grevé pour une période comprise entre 6 et 9 mois</u>
940	<u>1.9.1.5 montant grevé pour une période comprise entre 9 et 12 mois</u>
960	<u>1.9.1.6 montant grevé pour une période supérieure à 12 mois</u>
960-1010	<p><u>1.9.2 dont les emprunteurs sont des petites et moyennes entreprises qui relèvent de la catégorie des expositions sur la clientèle de détail dans le cadre de l'application de la méthode standard ou de l'approche NI pour le risque de crédit ou une entreprise éligible au traitement énoncé à l'article 153, paragraphe 4 et dont les dépôts sont inférieurs à 1 million d'euros au total par client ou groupe de clients liés.</u></p> <p>Article 428(1)(g)(ii) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Total des prêts non renouvelables et créances dont les emprunteurs sont des petites et moyennes entreprises qui relèvent de la catégorie des expositions sur la clientèle de détail dans le cadre de l'application de la méthode standard ou de l'approche NI pour le risque de crédit ou une entreprise éligible au traitement énoncé à l'article 153, paragraphe 4 et dont les dépôts sont inférieurs à 1 million d'euros au total par client ou groupe de clients liés.</p>

960	<u>1.9.2.1 montant non grevé</u>
970	<u>1.9.2.2 montant grevé pour une période allant jusqu'à trois mois</u>
980	<u>1.9.2.3 montant grevé pour une période comprise entre trois et 6 mois</u>
990	<u>1.9.2.4 montant grevé pour une période comprise entre 6 et 9 mois</u>
1000	<u>1.9.2.5 montant grevé pour une période comprise entre 9 et 12 mois</u>
1010	<u>1.9.2.6 montant grevé pour une période supérieure à 12 mois</u>
1020-1070	<p><u>1.9.3 dont les emprunteurs sont des emprunteurs souverains, des banques centrales et des entités du secteur public (ESP)</u></p> <p>Article 428(1)(g)(iii) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Total des prêts non renouvelables et créances dont les emprunteurs sont des emprunteurs souverains, des banques centrales et des entités du secteur public (ESP)</p>
1020	<u>1.9.3.1 montant non grevé</u>
1030	<u>1.9.3.2 montant grevé pour une période allant jusqu'à trois mois</u>
1040	<u>1.9.3.3 montant grevé pour une période comprise entre trois et 6 mois</u>
1050	<u>1.9.3.4 montant grevé pour une période comprise entre 6 et 9 mois</u>
1060	<u>1.9.3.5 montant grevé pour une période comprise entre 9 et 12 mois</u>
1070	<u>1.9.3.6 montant grevé pour une période supérieure à 12 mois</u>
1080-1130	<p><u>1.9.4 dont les emprunteurs ne sont pas déclarés en 1.9.1, 1.9.2 ou 1.9.3, à l'exclusion des clients financiers</u></p> <p>Article 428(1)(g)(iv) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Total des prêts non renouvelables et créances dont les emprunteurs ne sont pas mentionnés en 1.7.1, 1.7.2 ou 1.7.3, à l'exclusion des clients financiers.</p>
1080	<u>1.9.4.1 montant non grevé</u>

1090	<u>1.9.4.2 montant grevé pour une période allant jusqu'à trois mois</u>
1100	<u>1.9.4.3 montant grevé pour une période comprise entre trois et 6 mois</u>
1110	<u>1.9.4.4 montant grevé pour une période comprise entre 6 et 9 mois</u>
1120	<u>1.9.4.5 montant grevé pour une période comprise entre 9 et 12 mois</u>
1130	<u>1.9.4.6 montant grevé pour une période supérieure à 12 mois</u>
1140-1190	<u>1.9.5 dont les emprunteurs sont des établissements de crédit</u> Article 428(1)(g)(v) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013 Total des prêts non renouvelables et créances dont les emprunteurs sont des établissements de crédit.
1140	<u>1.9.5.1 montant non grevé</u>
1150	<u>1.9.5.2 montant grevé pour une période allant jusqu'à trois mois</u>
1160	<u>1.9.5.3 montant grevé pour une période comprise entre trois et 6 mois</u>
1170	<u>1.9.5.4 montant grevé pour une période comprise entre 6 et 9 mois</u>
1180	<u>1.9.5.5 montant grevé pour une période comprise entre 9 et 12 mois</u>
1190	<u>1.9.5.6 montant grevé pour une période supérieure à 12 mois</u>
1200-1250	<u>1.9.6 dont les emprunteurs sont des clients financiers (non mentionnés en 1.9.1, 1.9.2 ou 1.9.3) autres que des établissements de crédit</u> Article 428(1)(g)(v) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013 Total des prêts non renouvelables et créances dont les emprunteurs sont des clients financiers.
1200	<u>1.9.6.1 montant non grevé</u>
1210	<u>1.9.6.2 montant grevé pour une période allant jusqu'à trois mois</u>

1220	<u>1.9.6.3 montant grevé pour une période comprise entre trois et 6 mois</u>
1230	<u>1.9.6.4 montant grevé pour une période comprise entre 6 et 9 mois</u>
1240	<u>1.9.6.5 montant grevé pour une période comprise entre 9 et 12 mois</u>
1250	<u>1.9.6.6 montant grevé pour une période supérieure à 12 mois</u>
1260-1280	<u>1.10 Prêts non renouvelables et créances déclarés en 1.7 considérés comme des biens immobiliers</u> Article 428(1)(h) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013
1260	<u>1.10.1 Garantis par des biens immobiliers commerciaux</u> Article 428(1)(h)(i) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013
1270	<u>1.10.2 Garantis par des biens immobiliers résidentiels</u> Article 428(1)(h)(ii) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013
1280	<u>1.10.3 Financés pour un montant égal (transfert) via des obligations qui remplissent les conditions du traitement énoncé à l'article 129, paragraphe 4 ou 5, ou via des obligations visées à l'article 52, paragraphe 4, de la directive 2009/65/CE</u> Article 428(1)(h)(iii) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013
1290	<u>1.11 Montants à recevoir sur produits dérivés</u> Article 428(1)(i) du règlement (UE) n° 575/2013 Total net des montants à recevoir sur produits dérivés
1300	<u>1.12 Tous les autres actifs</u> Article 428(1)(j) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013 Tous les autres actifs non déclarés en 1.1.1-1.8 ci-dessus Remarque: les actifs déduits des fonds propres sont déclarés en 1.10.
1310	<u>1.13 Actifs déduits des fonds propres ne nécessitant pas de financement stable</u>

	<p>Article 428(1) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Tous les actifs, déduits des fonds propres aux fins du respect des règles en matière de fonds propres du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p>
1320	<p><u>1.14 Facilités de crédit confirmées non prélevées</u></p> <p>Article 428(1)(k) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Facilités de crédit telles que visées à l'article 428(1)(k) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p>