

DÉCLARATION CONCERNANT L'EXIGENCE MINIMALE DE FONDS PROPRES ET D'ENGAGEMENTS ÉLIGIBLES

MODÈLES MREL ET TLAC			
Numéro du modèle	Code du modèle	Nom du modèle/groupe de modèles	Nom abrégé
		MONTANTS: INDICATEURS CLÉS POUR LA MREL ET LA TLAC	
1	M 01.00	Indicateurs clés pour la MREL et la TLAC (groupes / entités de résolution)	KM2
		COMPOSITION ET ÉCHÉANCE	
2	M 02.00	MREL et TLAC: capacité et composition (groupes / entités de résolution)	TLAC1
3	M 03.00	MREL interne et TLAC interne	ILAC
4	M 04.00	Structure financière des engagements éligibles	LIAB-MREL
		RANG DES CRÉANCIERS	
5	M 05.00	Rang des créanciers (entités qui ne sont pas des entités de résolution)	TLAC2
6	M 06.00	Rang des créanciers (entités de résolution)	TLAC3
		INFORMATIONS SPÉCIFIQUES AU CONTRAT	
7	M 07.00	Instruments régis par le droit d'un pays tiers	MTCI

FR
ANNEXE I

M 01.00 - Indicateurs clés pour la MREL et la TLAC (groupes / entités de résolution)(KM2)

		Exigence minimale de fonds propres et d'engagements éligibles (MREL)	Exigence de fonds propres et d'engagements éligibles applicable aux FTSm (TLAC)
		0010	0020
	Montant total d'exposition au risque et mesure de l'exposition totale		
0100	MONTANT TOTAL D'EXPOSITION AU RISQUE (TREA)		
0110	MESURE DE L'EXPOSITION TOTALE (TEM)		
	Fonds propres et engagements éligibles		
0200	FONDS PROPRES ET ENGAGEMENTS ÉLIGIBLES		
0210	Dont: fonds propres et engagements subordonnés		
0220	dont: régis par le droit d'un pays tiers		
0230	dont: contenant une clause de dépréciation et de conversion au sens de l'article 55 de la directive 2014/59/UE		
	Autres engagements utilisables pour un renflouement interne		
0250	AUTRES ENGAGEMENTS UTILISABLES POUR UN RENFOUEMENT INTERNE		
0260	dont: régis par le droit d'un pays tiers		
0270	dont: contenant une clause de dépréciation et de conversion au sens de l'article 55 de la directive 2014/59/UE		
0280	Échéance résiduelle < 1 an		
0285	Échéance résiduelle >= 1 an et < 2 ans		
0290	Échéance résiduelle >= 2 ans		
	Ratios et exemptions de subordination		
0300	FONDS PROPRES ET ENGAGEMENTS ÉLIGIBLES EN POURCENTAGE DU TREA		
0310	Dont: fonds propres et engagements subordonnés		
0320	FONDS PROPRES ET ENGAGEMENTS ÉLIGIBLES EN POURCENTAGE DE LA TEM		
0330	dont: fonds propres et engagements subordonnés		
0340	L'exemption de subordination prévue par l'article 72 <i>ter</i> , paragraphe 4, du règlement (UE) n° 575/2013 s'applique-t- elle? (exemption de 5 %)		
0350	Montant agrégé d'instruments d'engagements éligibles non subordonnés autorisés si l'exemption de subordination prévue par l'article 72 <i>ter</i> , paragraphe 3, du règlement (UE) n° 575/2013 est appliquée (exemption de 3.5 % max.)		
0360	Part du total des engagements non subordonnés qui est incluse dans les fonds propres et les engagements éligibles		

FR
ANNEXE I

M 02.00 - MREL et TLAC: capacité et composition (groupes / entités de résolution)(TLAC1)				
		Exigence minimale de fonds propres et d'engagements éligibles (MREL)	Exigence de fonds propres et d'engagements éligibles applicables aux EISm (TLAC)	Pour mémoire: Montants éligibles aux fins de la MREL, mais pas de la TLAC
		0010	0020	0030
0010	FONDS PROPRES ET ENGAGEMENTS ÉLIGIBLES			
0020	Fonds propres (éligibles)			
0030	Fonds propres de base de catégorie 1			
0040	Fonds propres additionnels de catégorie 1 (éligibles)			
0050	Fonds propres de catégorie 2 (éligibles)			
0060	Engagements éligibles			
0070	Éléments d'engagements éligibles avant ajustements			
0080	dont: engagements éligibles considérés comme structurellement subordonnés			
0090	Engagements éligibles subordonnés à des engagements exclus			
0100	Instruments d'engagements éligibles émis directement par l'entité de résolution (ne bénéficiant pas d'une clause d'antériorité)			
0110	Instruments d'engagements éligibles émis par d'autres entités au sein du groupe de résolution (ne bénéficiant pas d'une clause d'antériorité)			
0120	Instruments d'engagements éligibles émis avant le 27 juin 2019			
0130	Instruments de fonds propres de catégorie 2 ayant une échéance résiduelle d'au moins un an, dans la mesure où ils ne sont pas éligibles en tant qu'éléments de fonds propres de catégorie 2			
0132	(-) Propres instruments d'engagements éligibles subordonnés à des engagements exclus			
0135	(-) dont: montants sous autorisation préalable inutilisés			
0140	Engagements éligibles non subordonnés à des engagements exclus			
0150	Engagements éligibles non subordonnés à des engagements exclus (ne bénéficiant pas d'une clause d'antériorité, avant plafonnement)			
0160	Engagements éligibles qui ne sont pas subordonnés à des engagements exclus émis avant le 27 juin 2019 (avant plafonnement)			
0162	(-) Propres instruments d'engagements éligibles non subordonnés à des engagements exclus			
0165	(-) dont: montants sous autorisation préalable inutilisés			
0170	Montants éligibles après application du plafond de l'article 72 <i>ter</i> , paragraphe 3, du règlement (UE) n° 575/2013 (ne bénéficiant pas d'une clause d'antériorité)			
0180	Montants éligibles après application du plafond de l'article 72 <i>ter</i> , paragraphe 3, du règlement (UE) n° 575/2013, consistant en des éléments émis avant le 27 juin 2019			
0190	(-) Déductions			
0200	(-) Expositions entre groupes de résolution à points d'entrée multiples			
0211	(-) Investissements dans d'autres instruments d'engagements éligibles			
0220	Montant de déductions à opérer sur les engagements éligibles qui excède les engagements éligibles (déduit de la catégorie 2)			
POUR MÉMOIRE				
0400	Fonds propres CET1 (en %) disponibles une fois remplies les exigences applicables à l'entité			
0410	Exigence globale de coussin de fonds propres (en %)			
0420	dont: exigence de coussin de conservation de fonds propres			
0430	dont: exigence de coussin de fonds propres contracyclique			
0440	dont: exigence de coussin pour le risque systémique			
0450	dont: coussin pour établissement d'importance systémique mondiale (EISm) ou pour autre établissement d'importance systémique (autre EIS)			
0460	Investissements dans des engagements éligibles subordonnés d'autres établissements			
0470	Investissements dans des engagements éligibles subordonnés d'EISm			
0480	Investissements dans des engagements éligibles subordonnés d'autres EIS			
0490	Investissements dans des engagements éligibles subordonnés d'autres établissements			
0500	Engagements exclus			

FR
ANNEXE I

M 03.00 - MREL interne et TLAC interne (ILAC)

		MREL interne	TLAC interne
		0010	0020
0010	Niveau d'application		
	Montant total d'exposition au risque et mesure de l'exposition totale		
0100	Montant total d'exposition au risque (TREA)		
0110	Mesure de l'exposition totale (TEM)		
	Fonds propres éligibles et engagements éligibles		
0200	Fonds propres éligibles et engagements éligibles		
0210	Fonds propres éligibles		
0220	Fonds propres de base de catégorie 1 (CET1)		
0230	Fonds propres additionnels de catégorie 1 éligibles		
0240	Fonds propres de catégorie 2 éligibles		
0250	Engagements et garanties éligibles		
0260	Engagements éligibles (à l'exclusion des garanties)		
0265	(-) Propres instruments d'engagements éligibles: montants sous autorisation préalable inutilisés		
0270	Garanties fournies par l'entité de résolution et autorisées par l'autorité de résolution		
0280	Pour mémoire: Partie de la garantie couverte par des sûretés		
0290	(-) Instruments de fonds propres et instruments d'engagements éligibles émis par des entités autres que de résolution du même groupe de résolution		
0293	(-) dont: Instruments de fonds propres émis par des entités vouées à la liquidation		
0295	Montant de déductions à opérer sur les engagements éligibles qui excède les engagements éligibles		
	Ratios de fonds propres éligibles et d'engagements éligibles		
0400	Fonds propres et engagements éligibles en pourcentage du TREA		
0410	dont: garanties autorisées		
0420	Fonds propres et engagements éligibles en pourcentage de la TEM		
0430	dont: garanties autorisées		
0440	Fonds propres CET1 (en %) disponibles une fois remplies les exigences applicables à l'entité		
	Pour mémoire		
0500	Exigence globale de coussin de fonds propres (en %)		
0510	dont: exigence de coussin de conservation de fonds propres		
0520	dont: exigence de coussin de fonds propres contracyclique		
0530	dont: exigence de coussin pour le risque systémique		
0540	dont: coussin pour établissement d'importance systémique mondiale (EISm) ou pour autre établissement d'importance systémique (autre EIS)		
0550	Autres engagements utilisables pour un renflouement interne		
0560	dont: régis par le droit d'un pays tiers		
0570	dont: contenant une clause de dépréciation et de conversion au sens de l'article 55 de la directive 2014/59/UE		
0580	Échéance résiduelle < 1 an		
0590	Échéance résiduelle >= 1 an et < 2 ans		
0600	Échéance résiduelle >= 2 ans		
0610	Engagements exclus		
0620	Instruments de fonds propres émis par des entités vouées à la liquidation du même groupe de résolution		
0630	Ratio de détentions d'instruments de fonds propres émis par des entités vouées à la liquidation par rapport aux fonds propres éligibles et aux engagements éligibles		

M 04.00 - Structure financière des engagements éligibles (LIAB MREL)		
		Montant éligible pour la MREL / MREL interne
		0010
0100	ENGAGEMENTS ÉLIGIBLES	
0200	Dépôts, non couverts et non préférentiels >= 1 an	
0210	dont: échéance résiduelle >= 1 an et < 2 ans	
0220	dont: échéance résiduelle >= 2 ans	
0230	dont: émis par des filiales	
0300	Engagements garantis non assortis de sûretés >= 1 an	
0310	dont: échéance résiduelle >= 1 an et < 2 ans	
0320	dont: échéance résiduelle >= 2 ans	
0330	dont: émis par des filiales	
0400	Titres structurés >= 1 an	
0410	dont: échéance résiduelle >= 1 an et < 2 ans	
0420	dont: échéance résiduelle >= 2 ans	
0430	dont: émis par des filiales	
0500	Engagements de premier rang non garantis >= 1 an	
0510	dont: échéance résiduelle >= 1 an et < 2 ans	
0520	dont: échéance résiduelle >= 2 ans	
0530	dont: émis par des filiales	
0600	Engagements de premier rang non privilégiés >= 1 an	
0610	dont: échéance résiduelle >= 1 an et < 2 ans	
0620	dont: échéance résiduelle >= 2 ans	
0630	dont: émis par des filiales	
0700	Engagements subordonnés (non reconnus en tant que fonds propres) >= 1 an	
0710	dont: échéance résiduelle >= 1 an et < 2 ans	
0720	dont: échéance résiduelle >= 2 ans	
0730	dont: émis par des filiales	
0800	Autres engagements éligibles MREL >= 1 an	
0810	dont: échéance résiduelle >= 1 an et < 2 ans	
0820	dont: échéance résiduelle >= 2 ans	
0830	dont: émis par des filiales	

FR
ANNEXE I

M 05.00 - Rang des créanciers (entité qui n'est pas une entité de résolution)(TLAC2)											
Rang en cas d'insolvabilité	Type de créancier	Description du rang en cas d'insolvabilité	Engagements et fonds propres		Engagements et fonds propres moins les engagements exclus						
			dont: engagements exclus		dont: fonds propres et engagements éligibles aux fins de la MREL interne	dont: avec une échéance résiduelle de				dont: titres à durée indéterminée	
						≥ 1 an < 2 ans	≥ 2 ans < 5 ans	≥ 5 ans < 10 ans	≥ 10 ans		
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120

FR
ANNEXE I

M 06.00 - Rang des créanciers (entités de résolution) (TLAC3)										
Rang en cas d'insolvabilité	Description du rang en cas d'insolvabilité	Engagements et fonds propres		Engagements et fonds propres moins les engagements exclus						
			dont: engagements exclus		dont: fonds propres et engagements éligibles potentiellement éligibles pour satisfaire à la MREL	dont: avec une échéance résiduelle de				dont: titres à durée indéterminée
						≥ 1 an < 2 ans	≥ 2 ans < 5 ans	≥ 5 ans < 10 ans	≥ 10 ans	
						0070	0080	0090	0100	
0010	0020	0030	0040	0050	0060					0110

M 07.00 - Instruments régis par le droit d'un pays tiers (MTCI)													
Entité émettrice			Identifiant du contrat	Droit applicable (pays tiers)	Reconnaissance contractuelle des pouvoirs de dépréciation et de conversion	Traitement réglementaire		Montant	Rang lors de procédures normales d'insolvabilité		Échéance	(Première) date de rachat	Rachat réglementaire (O/N)
Nom	Code	Type de code				Type de fonds propres ou d'engagements éligibles	Type d'instrument		Droit applicable	Rang en cas d'insolvabilité			
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120	0130	0140