

Approche standard relative aux risques de marché

Version préliminaire de juillet 2022

ID	Label	Désignation	Observations et commentaires juridiques
Colonnes			
1	Total	Total	Le cas échéant, le montant total correspond à la somme du delta, du vega et de la courbure.
2	Delta	Delta	Ch. 10.14 MAR, les exigences relatives au calcul et à l'agrégation sont précisées au ch. 21 MAR.
3	Vega	Vega	Ch. 10.15 MAR, les exigences relatives au calcul et à l'agrégation sont précisées au ch. 21 MAR.
4	Curvature	Courbure	Ch. 10.16 MAR, les exigences relatives au calcul et à l'agrégation sont précisées au ch. 21 MAR.
Lignes			
1	Minimum requirements for market risks according to the standardised approach	Exigences minimales de fonds propres en regard du risque de marché selon l'approche standard relative aux risques de marché	Ch. 20.4 MAR, art. 87 OFR en relation avec l'art. 54 OMar-FINMA. La FINMA s'appuie sur le dispositif de Bâle, notamment sur les ch. 20 à 23 MAR.
1.1	Capital requirement under the Sensitivities-based method (SbM)	Exigences de fonds propres selon la méthode des sensibilités (SbM)	Ch. 21 MAR
1.1.1	Low correlations	Faibles corrélations	Ch. 21.6 MAR
1.1.1.1	General interest rate risk	Risque général de taux d'intérêt	
1.1.1.2	Equity risk	Risque de cours des actions	
1.1.1.3	Commodity risk	Risque sur les matières premières	
1.1.1.4	Foreign exchange risk	Risque de change	
1.1.1.5	Credit spread risk – non-securitisations	Risque d'écart de rendement - expositions hors titrisation	
1.1.1.6	Credit spread risk – securitisations (non-correlation trading portfolio)	Risque d'écart de rendement - expositions de titrisation (portefeuille de négociation non corrélé)	
1.1.1.7	Credit spread risk – securitisation (correlation trading portfolio)	Risque d'écart de rendement - expositions de titrisation (portefeuille de négociation corrélé)	
1.1.2	Medium correlations	Corrélations moyennes	Ch. 21.6 MAR
1.1.2.1	General interest rate risk	Risque général de taux d'intérêt	
1.1.2.2	Equity risk	Risque de cours des actions	
1.1.2.3	Commodity risk	Risque sur les matières premières	
1.1.2.4	Foreign exchange risk	Risque de change	
1.1.2.5	Credit spread risk – non-securitisations	Risque d'écart de rendement - expositions hors titrisation	
1.1.2.6	Credit spread risk – securitisations (non-correlation trading portfolio)	Risque d'écart de rendement - expositions de titrisation (portefeuille de négociation non corrélé)	
1.1.2.7	Credit spread risk – securitisation (correlation trading portfolio)	Risque d'écart de rendement - expositions de titrisation (portefeuille de négociation corrélé)	

1.1.3	High correlations	Fortes corrélations	Ch. 21.6 MAR
1.1.3.1	General interest rate risk	Risque général de taux d'intérêt	
1.1.3.2	Equity risk	Risque de cours des actions	
1.1.3.3	Commodity risk	Risque sur les matières premières	
1.1.3.4	Foreign exchange risk	Risque de change	
1.1.3.5	Credit spread risk – non-securitisations	Risque d'écart de rendement - expositions hors titrisation	
1.1.3.6	Credit spread risk – securitisations (non-correlation trading portfolio)	Risque d'écart de rendement - expositions de titrisation (portefeuille de négociation non corrélé)	
1.1.3.7	Credit spread risk – securitisation (correlation trading portfolio)	Risque d'écart de rendement - expositions de titrisation (portefeuille de négociation corrélé)	
1.2	Default risk capital requirement (DRC)	Exigence de fonds propres en regard du risque de défaut (DRC)	Ch. 22 MAR
1.2.1	Non-securitisation	Exposition hors titrisation	Ch. 22.9 à 22.26 MAR
1.2.1.1	Corporates	Entreprises	Ch. 22.22, 22.26 MAR
1.2.1.2	Sovereigns	États	Ch. 22.22, 22.26 MAR
1.2.1.3	Local governments and municipalities	Gouvernements locaux et communes	Ch. 22.22, 22.26 MAR
1.2.2	Securitisation (non-CTP)	Titrisation (non-CTP)	Ch. 22.27 à 22.35 MAR
1.2.3	Securitisation (CTP)	Titrisation (CTP)	Ch. 22.36 à 22.45 MAR
1.3	Residual risk add-on	Majoration pour risques résiduels	Ch. 23 MAR
1.3.1	Exotic underlying	Sous-jacent exotique	Ch. 23.3 MAR ; le montant affiché inclut le coefficient de pondération de 1 % (voir ch. 23.8 (2) (a) MAR).
1.3.2	Non-exotic underlying	Sous-jacents non exotiques	Ch. 23.4 MAR, ch. 23.5 MAR ; le montant affiché inclut le coefficient de pondération de 0,1 % (voir ch. 23.8 (2) (b) MAR).
1.3.2.1	Behavioural risk	Risque de comportement	Ch. 23.5 (3) MAR ; le montant affiché inclut le coefficient de pondération de 0,1 %.
1.3.2.1.1	Pre-payment	Remboursement anticipé	Instruments intégrant une option de remboursement anticipé (ch. 23.5 (3) MAR) ; le montant affiché inclut le coefficient de pondération de 0,1 %.
1.3.2.1.2	Other behavioural	Autres comportements	Instruments intégrant d'autres possibilités d'exercice pour les clients privés que le remboursement anticipé (ch. 23.5 (3) MAR) ; le montant affiché inclut le coefficient de pondération de 0,1 %.
1.3.2.2	Correlation risk (excl. instruments with behavioural risk)	Risque de corrélation (hors instruments avec risque de comportement)	Ch. 23.5 (2) MAR ; mais sans les instruments avec risque de comportement ; le montant affiché inclut le coefficient de pondération de 0,1 %.
1.3.2.3	Gap risk (excl. instruments with correlation risk and / or behavioural risk)	Risque de décalage (hors instruments avec risque de corrélation et/ou de comportement)	Ch. 23.5 (1) MAR ; mais en excluant les instruments avec plusieurs sous-jacents et/ou risques de comportement ; le montant affiché inclut le coefficient de pondération de 0,1 %.
1.3.2.4	Other residual risk with non-exotic underlying	Autre risque résiduel avec des sous-jacents non exotiques	Le montant affiché inclut le coefficient de pondération de 0,1 %.

De plus amples informations peuvent être consultées sur [\[www.finma.ch/...\]](http://www.finma.ch/...) :

- Dernières mises à jour de l'enquête
- Formulaires électroniques à télécharger
- Informations importantes sur le *reporting*
- Interlocuteurs