

## Participations à des fortunes collectives gérées (participations FCG)

Version préliminaire de juillet 2022

ID	Label	Désignation	Observations et commentaires juridiques
<b>Lignes</b>			
001	Look-through Approach (LTA)	Approche par transparence (ALT)	Art. 59a al. 1 let. a OFR Art. 118 al. 1, art. 120, 121 et 129 OCre-FINMA
	all funds under LTA	Toutes les participations FCG selon l'approche par transparence	Toutes les participations FCG qui sont traitées selon l'ALT, conformément à la hiérarchie des approches énoncée à l'art. 118 OCre-FINMA
002	of which: funds under LTA managed by the bank itself	dont : fortunes collectives gérées par la banque elle-même selon l'ALT	Parmi les participations FCG déclarées à la ligne 001, uniquement celles qui sont gérées par la banque elle-même
	Mandate Based Approach (MBA)	Approche basée sur un mandat (ABM)	Art. 59a al. 1 let. b OFR Art. 122 à 126 et art. 129 OCre-FINMA
003	all funds under MBA	Toutes les participations FCG selon l'ABM	Toutes les participations FCG qui sont traitées selon l'ABM, conformément à la hiérarchie des approches énoncée à l'art. 118 OCre-FINMA
	of which: funds under MBA managed by the bank itself	dont : fortunes collectives gérées par la banque elle-même selon l'ABM	Parmi les participations FCG déclarées à la ligne 003, uniquement celles qui sont gérées par la banque elle-même
004	Fallback Approach (FBA)	Approche de repli (AFB)	Art. 59a al. 1 let. c OFR Art. 127 et 129 OCre-FINMA
	all funds under FBA	Toutes les participations FCG selon l'AFB	Toutes les participations FCG qui sont traitées selon l'AFB, conformément à la hiérarchie des approches énoncée à l'art. 127 OCre-FINMA
005	of which: funds under FBA managed by the bank itself	dont : fortunes collectives gérées par la banque elle-même selon l'AFB	Parmi les participations FCG déclarées à la ligne 005, uniquement celles qui sont gérées par la banque elle-même.
	Simplified Approach	Approche simplifiée	Art. 59a al. 1 let. d OFR Art. 128 et art. 129 al. 4 OCre-FINMA
007	all funds under Simplified Approach with 300%	Toutes les participations FCG dans le cadre de l'approche simplifiée avec 300 %	Toutes les participations FCG qui sont traitées selon l'approche simplifiée conformément à la hiérarchie des approches à l'art. 118 OCre-FINMA et donc la pondération-risque s'élève à 300 % (art. 128, al. 2 let. a OCre-FINMA)
	of which: funds managed by the bank itself	dont : fortunes collectives gérées par la banque elle-même	Parmi les participations FCG déclarées à la ligne 007, uniquement celles qui sont gérées par la banque elle-même.

024	all funds under Simplified Approach with 500%	Toutes les participations FCG dans le cadre de l'approche simplifiée avec 500 %	Toutes les participations FCG qui sont traitées selon l'approche simplifiée conformément à la hiérarchie des approches à l'art. 118 OCre-FINMA et donc la pondération-risque s'élève à 500% (art. 128, al. 2 let. b OCre-FINMA)
025	of which: funds managed by the bank itself	dont : fortunes collectives gérées par la banque elle-même	Parmi les participations FCG déclarées à la ligne 024, uniquement celles qui sont gérées par la banque elle-même.
009 - 013	LTA Exposure by weighted average risk weight applied	Position ALT selon la pondération-risque moyenne pondérée	Pour les positions déclarées à la ligne 001 : ventilation dans les fourchettes de pondération-risque selon la pondération-risque moyenne pondérée, appliquée aux participations FCG dans le cadre de l'ALT.
014 - 018	MBA Exposure by weighted average risk weight applied	Position ABM selon la pondération-risque moyenne pondérée	Pour les positions déclarées à la ligne 001 : ventilation dans les fourchettes de pondération-risque selon la pondération-risque moyenne pondérée, appliquée aux participations FCG dans le cadre de l'ABM.
019	Simplified Approach 300% risk weight	Approche simplifiée Pondération-risque de 300 %	Mêmes positions que celles déclarées à la ligne 007
xx	of which: having synthetic risk indicator value of 1 to 4	dont : avec un indicateur de risque synthétique de valeur 1 à 4	Parmi les positions déclarées à la ligne 019, celles avec un indicateur de risque synthétique de valeur 1 à 4 selon l'annexe 9 ch. 4.2 de l'ordonnance du 6 novembre 2019 sur les services financiers (OSFin)
xx	of which: having synthetic risk indicator value of 5 to 7	dont : avec un indicateur de risque synthétique de valeur 5 à 7	Parmi les positions déclarées à la ligne 019, celles avec un indicateur de risque synthétique de valeur 5 à 7 selon l'annexe 9 ch. 4.2 de l'OSFin
029	Simplified Approach 500% risk weight	Approche simplifiée Pondération-risque de 500 %	Mêmes positions que celles déclarées à la ligne 024
xx	of which: having synthetic risk indicator value of 1 to 4	dont : avec un indicateur de risque synthétique de valeur 1 à 4	Parmi les positions déclarées à la ligne 029, celles avec un indicateur de risque synthétique de valeur 1 à 4 selon l'annexe 9 ch. 4.2 de l'OSFin
xx	of which: having synthetic risk indicator value of 5 to 7	dont : avec un indicateur de risque synthétique de valeur 5 à 7	Parmi les positions déclarées à la ligne 029, celles avec un indicateur de risque synthétique de valeur 5 à 7 selon l'annexe 9 ch. 4.2 de l'OSFin
<b>Colonnes</b>			
01	Number of funds	Nombre de fortunes collectives gérées	Nombre de fortunes collectives gérées dont la banque détient des participations Lorsqu'une fortune collective gérée est traitée selon plus d'une approche, elle doit être comptabilisée sous chacune des approches.
02	Credit equivalent for CCR of SFT	Équivalent-crédit pour le risque de crédit de contrepartie des SFT	Équivalent-crédit pour le risque de crédit de contrepartie au titre des opérations de financement de titres (art. 62 OFR et art. 38 et 65 à 82 OCre-FINMA)
03	Credit equivalent for CCR of derivatives	Équivalent-crédit pour le risque de crédit de contrepartie des dérivés	Équivalent-crédit pour le risque de crédit de contrepartie au titre des dérivés (art. 56 à 58 OFR et art. 3 à 39 OCre-FINMA)

04	Risk weighted exposure amount for CCR of SFT and derivatives (incl. CVA)	Position pondérée en fonction des risques pour le risque de crédit de contrepartie de SFT et de dérivés (y compris CVA)	Montant qui résulte de la multiplication des équivalents-crédit déclarés aux colonnes 02 et 03 avec leurs pondérations-risque afférentes
05	Total (net) exposure before risk weighting	Position (nette) totale avant pondération-risque	Position (nette) totale qui résulte des participations FCG Elle inclut les équivalents-crédit pour le risque de crédit de contrepartie qui ont été déclarés aux colonnes 02 et 03
06	Risk weighted exposure amount	Position pondérée en fonction des risques	Montant qui résulte de la multiplication de la position (nette) totale à la colonne 05 par la pondération-risque afférente