

Approche des modèles relative aux risques de marché

Version préliminaire de juillet 2022

ID	Label	Désignation	Observations et commentaires juridiques
Rubriques			
1	Value	Valeur	
2	Most recent value	Valeur la plus récente	
3	Average over last quarter	Moyenne du dernier trimestre	
4	Highest value of last quarter	Valeur la plus élevée du dernier trimestre	
5	Lowest value of last quarter	Valeur la plus basse du dernier trimestre	
Lignes			
1.	Minimum requirements for market risks according to the internal models approach	Exigences minimales de fonds propres en regard du risque de marché selon l'approche des modèles relative aux risques de marché	Ch. 33.43 MAR. L'utilisation de l'approche des modèles relative aux risques de marché implique de respecter l'art. 88 OFR en relation avec les art. 55 à 60 OMar-FINMA. La FINMA s'appuie sur le dispositif de Bâle, notamment sur les ch. 30 à 33 MAR.
1.1	IMA _{G,A} (MAR33.43)	IMA _{G,A} (ch. 33.43 MAR)	Total de l'exigence de fonds propres pour les pupitres de négociation approuvés et autorisés (zone verte et jaune), y compris la DRC et sans le volant de fonds propres supplémentaires pour les pupitres jaunes. Total de 1.1.1 et 1.1.2.
1.1.1	CA: Aggregate (non-DRC) capital requirement for those trading desks approved and eligible for the IMA (MAR33.41)	CA : exigence de fonds propres globale (hors DRC) pour les pupitres de négociation autorisés et éligibles pour l'approche des modèles relative aux risques de marché (ch. 33.41 MAR).	Seules les positions de pupitres de négociation approuvés et autorisés sont prises en compte dans le calcul de cette position et de toutes les sous-positions.
1.1.1.1	IMCC (0.5*Unconstrained ES+0.5*constrained risk class ES)	IMCC (0,5*ES illimité + 0,5*ES limité des catégories de risque)	Exigence de fonds propres pour les facteurs de risque modélisables, ch. 33.13-15 MAR.
1.1.1.1.1	Unconstrained expected shortfall	Déficit attendu (<i>expected shortfall</i> , ES) illimité	Ch. 33.13 MAR
1.1.1.1.2	Constrained expected shortfall	Déficit attendu (<i>expected shortfall</i> , ES) limité	Somme des positions 1.1.1.1.2.1 à 1.1.1.1.2.5, ch. 33.14 MAR.
1.1.1.1.2.1	ES for general interest rate risk	ES pour le risque général de taux d'intérêt	
1.1.1.1.2.2	ES for equity risk	ES pour le risque de cours des actions	
1.1.1.1.2.3	ES for commodity risk	ES pour le risque sur matières premières	
1.1.1.1.2.4	ES for foreign exchange risk	ES pour le risque de change	
	ES for credit spread risk	ES pour le risque d'écart de rendement	
1.1.1.2	Capital requirement for non-modellable risk factors; Stressed Expected Shortfall (SES)	Exigence de fonds propres pour les facteurs de risque non modélisables ; <i>stressed expected shortfall</i> (SES)	Ch. 33.16, 17 MAR
1.1.1.3	Multiplication factor	Facteur de multiplication	Ch. 33.42 MAR ; le facteur de multiplication est appliqué à l'exigence de fonds propres moyenne pour les facteurs de risque modélisables.

1.1.1.3.1	Number of backtesting exceptions	Nombre d'exceptions du contrôle <i>ex post</i>	Les exceptions du contrôle <i>ex post</i> augmentent le facteur de multiplication en conformité avec le ch. 32.9 MAR.
1.1.2	Default risk capital (DRC) requirement (MAR33.22)	Exigence à l'égard du capital pour risque de défaillance (DRC) (ch. 33.22 MAR)	Ch. 33.18-39 MAR
1.1.2.1	Default risk capital requirement model measure	Mesure du modèle pour l'exigence de fonds propres relative au risque de défaillance	
1.2	SA _{G,A} (MAR33.45)	SA _{G,A} (ch. 33.45 MAR)	Besoin de fonds propres lors de l'application de l'approche standard relative aux risques de marché à des pupitres de négociation approuvés et autorisés (zone verte et jaune)
1.3	Total SA Capital requirements for trading desks ineligible to use the IMA as reported in P_MKR_BIS_SA.MELD	Exigences de fonds propres globales selon l'approche standard relative aux risques de marché pour les pupitres de négociation qui ne sont pas autorisés à utiliser l'approche des modèles relative aux risques de marché, comme annoncé dans le formulaire P_MKR_BIS_SA.MELD.	Ch. 33.40 MAR
1.4	SA capital requirements for all trading desks (including those subject to IMA)	Exigences standards de fonds propres pour tous les pupitres de négociation (y compris ceux qui relèvent du champ d'application de l'approche des modèles relative aux risques de marché)	
1.5	Capital surcharge for amber trading desks	Majoration des fonds propres pour les pupitres de négociation en zone orange	La majoration utilise 1.1 et 1.2 comme entrées ; ch. 33.45 MAR
1.5.1	k (MAR33.45)	k (ch. 33.45 MAR)	
1.6	Capital requirements for green and amber trading desks (including capital surcharge)	Exigences de fonds propres pour les pupitres de négociation dans la zone verte et jaune (y compris majoration des fonds propres)	Somme des points 1.1 et 1.5
1.7	Difference in capital requirements under the IMA and SA for green and amber trading desks	Différentes exigences de fonds propres selon l'approche des modèles relative aux risques de marché et l'approche standard relative aux risques de marché pour les pupitres de négociation de la zone verte et jaune.	Différence entre les points 1.1 et 1.2.

De plus amples informations peuvent être consultées sur www.finma.ch/...

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