

Risque découlant de transactions non exécutées

Version préliminaire de juillet 2022

ID	Label	Désignation	Observations et commentaires juridiques
Colonnes			
01	Exposure due to unsettled transactions	Positions découlant de transactions non exécutées	Art. 77f OFR Différence entre le prix de compensation contractuel et la valeur de marché courante
02	Risk-weighted Assets	Positions pondérées en fonction du risque	Montant des positions découlant de transactions non exécutées, pondérées en fonction du risque, après application des pondérations du risque énoncées ci-dessous.
Lignes			
01	Total unsettled transactions	Total des transactions non exécutées	Art. 77f al. 1 OFR
	Settled via a DvP or Pvp system, of which:	Exécutées par le biais d'un système LcP ou PcP, dont :	Art. 77f al. 2 OFR Positions qui sont exécutées par le biais d'un système « livraison contre paiement » ou « paiement contre paiement ».
02	Transactions unsettled between 5 and 15 days	Transactions non exécutées entre 5 et 15 jours ouvrables bancaires après la date d'exécution convenue	Ces positions se voient appliquer un coefficient de pondération de 100 %.
03	Transactions unsettled between 16 and 30 days	Transactions non exécutées entre 16 et 30 jours ouvrables bancaires après la date d'exécution convenue	Ces positions se voient appliquer un coefficient de pondération de 625 %.
04	Transactions unsettled between 31 and 45 days	Transactions non exécutées entre 31 et 45 jours ouvrables bancaires après la date d'exécution convenue	Ces positions se voient appliquer un coefficient de pondération de 937,5 %.
05	Transactions unsettled for 46 days or more	Transactions non exécutées 46 jours ouvrables bancaires ou plus après la date d'exécution convenue	Ces positions se voient appliquer un coefficient de pondération de 1250 %.
	Settled not via a DvP or Pvp system, of which:	Non exécutées par le biais d'un système LcP ou PcP :	Art. 77f al. 3 OFR Positions qui ne sont pas exécutées par le biais d'un système « livraison contre paiement » ou « paiement contre paiement ».
xx	Bank delivered, waiting for counterparty to deliver (up to four banking days after agreed settlement date)	La banque a livré et attend la livraison de la contrepartie (jusqu'à quatre jours ouvrables bancaires après la date d'exécution convenue)	Ces positions se voient appliquer un coefficient de pondération de 100 %.
xx	Bank delivered, waiting for counterparty to deliver: five or more banking days after agreed settlement date	La banque a livré et attend la livraison de la contrepartie depuis cinq jours ouvrables bancaires ou plus après la date d'exécution convenue	Ces positions se voient appliquer un coefficient de pondération de 1250 %.

De plus amples informations peuvent être consultées sur Internet à l'adresse www.finma.ch/...

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