

		a
		T
	Fonds propres disponibles (montants)	
1	Fonds propres de base de catégorie 1 (CET1)	-
2	Fonds propres de catégorie 1	3 026,00
3	Fonds propres totaux	3 026,00
	Montants d'exposition pondérés	
4	Montant total d'exposition au risque	5 874,00
	Ratios de fonds propres (en pourcentage du montant d'exposition pondéré)	
5	Ratio de fonds propres de base de catégorie 1 (%)	-
6	Ratio de fonds propres de catégorie 1 (%)	51,52%
7	Ratio de fonds propres totaux (%)	51,52%
	Exigences de fonds propres supplémentaires pour faire face aux risques autres que le risque de levier excessif (en pourcentage du montant d'exposition pondéré)	
EU 7a	Exigences de fonds propres supplémentaires pour faire face aux risques autres que le risque de levier excessif (%)	10,50%
EU 7b	dont: à satisfaire avec des fonds propres CET1 (points de pourcentage)	4,50%
EU 7c	dont: à satisfaire avec des fonds propres de catégorie 1 (points de pourcentage)	6,00%
EU 7d	Exigences totales de fonds propres SREP (%)	10,50%
	Exigence globale de coussin et exigence globale de fonds propres (en pourcentage du montant d'exposition pondéré)	
8	Coussin de conservation des fonds propres (%)	2,50%
EU 8a	Coussin de conservation découlant du risque macroprudentiel ou systémique constaté au niveau d'un État membre (%)	0,00%
9	Coussin de fonds propres contracyclique spécifique à l'établissement (%)	0,00%
EU 9a	Coussin pour le risque systémique (%)	0,00%
10	Coussin pour les établissements d'importance systémique mondiale (%)	0,00%
EU 10a	Coussin pour les autres établissements d'importance systémique (%)	0,00%
11	Exigence globale de coussin (%)	
EU 11a	Exigences globales de fonds propres (%)	
12	Fonds propres CET1 disponibles après le respect des exigences totales de fonds propres SREP (%)	
	Ratio de levier	
13	Mesure de l'exposition totale	5 874,00
14	Ratio de levier (%)	51,52%
	Exigences de fonds propres supplémentaires pour faire face au risque de levier excessif (en pourcentage de la mesure de l'exposition totale)	
EU 14a	Exigences de fonds propres supplémentaires pour faire face au risque de levier excessif (%)	
EU 14b	dont: à satisfaire avec des fonds propres CET1 (points de pourcentage)	
EU 14c	Exigences de ratio de levier SREP totales (%)	
	Exigence de coussin lié au ratio de levier et exigence de ratio de levier globale (en pourcentage de la mesure de l'exposition totale)	
EU 14d	Exigence de coussin lié au ratio de levier (%)	
EU 14e	Exigence de ratio de levier globale (%)	
	Ratio de couverture des besoins de liquidité	
15	Actifs liquides de qualité élevée (HQLA) totaux (valeur pondérée -moyenne)	
EU 16a	Sorties de trésorerie — Valeur pondérée totale	24,00
EU 16b	Entrées de trésorerie — Valeur pondérée totale	-
16	Sorties de trésorerie nettes totales (valeur ajustée)	24,00
17	Ratio de couverture des besoins de liquidité (%)	4775,40%
	Ratio de financement stable net	
18	Financement stable disponible total	6 194,00
19	Financement stable requis total	6 121,00
20	Ratio NSFR (%)	101,20

Les établissements appliquent les instructions fournies ci-dessous dans la présente annexe pour compléter le modèle EU KM1 présenté à l'annexe I du présent règlement d'exécution, en application de l'article 447, points a) à g), du CRR, et de l'article 438, point b), du CRR.

Références juridiques et instructions	
Numéro de la colonne	Explication
a - e	<p>Les périodes de publication T, T-1, T-2, T-3 et T-4 sont définies comme des périodes trimestrielles et seront remplies selon la fréquence fixée par les articles 433 bis, 433 ter et 433 quater du CRR.</p> <p>Les établissements qui publient les informations indiquées dans ce modèle sur une base trimestrielle fournissent des données pour les périodes T, T-1, T-2, T-3 et T-4; les établissements qui publient les informations indiquées dans ce modèle deux fois par an fournissent des données pour les périodes T, T-2 et T-4; et les établissements qui publient les informations indiquées dans ce modèle chaque année fournissent des données pour les périodes T et T-4.</p> <p>Les établissements indiquent les dates correspondant aux périodes de publication.</p> <p>La publication de données relatives à des périodes antérieures n'est pas nécessaire lorsque les données sont publiées pour la première fois.</p>
Références juridiques et instructions	
Numéro de la ligne	Explication
1	<p>Fonds propres de base de catégorie 1 (CET1)</p> <p>Le montant des fonds propres CET1 est le montant communiqué par les établissements à l'annexe VII du présent règlement d'exécution (ligne 29 du modèle EU CC1 Composition des fonds propres)</p>
2	<p>Fonds propres de catégorie 1</p> <p>Le montant des fonds propres de catégorie 1 est le montant communiqué par les établissements à l'annexe VII du présent règlement d'exécution (ligne 45 du modèle EU CC1 Composition des fonds)</p>
3	<p>Fonds propres totaux</p> <p>Le montant du total des fonds propres est le montant communiqué par les établissements à l'annexe VII du présent règlement d'exécution (ligne 59 du modèle EU CC1 Composition des fonds propres)</p>
4	<p>Montant total d'exposition au risque</p> <p>Le montant du total d'exposition au risque (TREA) est le montant communiqué par les établissements à l'annexe VII du présent règlement d'exécution (ligne 60 du modèle EU CC1 Composition des fonds)</p>
5	<p>Ratio de fonds propres de base de catégorie 1 (%)</p> <p>Le ratio de fonds propres CET1 est la valeur communiquée par les établissements à l'annexe VII du présent règlement d'exécution (ligne 61 du modèle EU CC1 Composition des fonds propres)</p>
6	<p>Ratio de fonds propres de catégorie 1 (%)</p> <p>Le ratio de fonds propres de catégorie 1 est la valeur communiquée par les établissements à l'annexe VII du présent règlement d'exécution (ligne 62 du modèle EU CC1 Composition des fonds propres)</p>
7	<p>Ratio de fonds propres totaux (%)</p> <p>Le ratio du total des fonds propres est la valeur communiquée par les établissements à l'annexe VII du présent règlement d'exécution (ligne 63 du modèle EU CC1 Composition des fonds propres)</p>
EU 7a	<p>Exigences de fonds propres supplémentaires pour faire face aux risques autres que le risque de levier excessif (%)</p> <p>Exigences de fonds propres supplémentaires pour faire face aux risques autres que le risque de levier excessif imposées par l'autorité compétente en vertu de l'article 104, paragraphe 1, point a), de la CRD,</p>
EU 7b	<p>dont: à satisfaire avec des fonds propres CET1 (points de pourcentage)</p> <p>La partie des exigences de fonds propres supplémentaires pour faire face aux risques autres que le risque de levier excessif imposées par l'autorité compétente en vertu de l'article 104, paragraphe 1,</p>
EU 7c	<p>dont: à satisfaire avec des fonds propres de catégorie 1 (points de pourcentage)</p> <p>La partie des exigences de fonds propres supplémentaires pour faire face aux risques autres que le risque de levier excessif imposées par l'autorité compétente en vertu de l'article 104, paragraphe 1,</p>
EU 7d	<p>Exigences totales de fonds propres SREP (ratio TSCR) (%)</p> <p>La somme des valeurs déterminées aux points i) et ii) comme suit:</p>

8	<p>(i) le ratio de fonds propres total (8 %) visé à l'article 92, paragraphe 1, point c), du CRR;</p> <p>(ii) les exigences de fonds propres supplémentaires pour faire face aux risques autres que le risque de levier excessif (exigences du pilier 2) imposées par l'autorité compétente en vertu de l'article 104, paragraphe 1, point a), de la CRD et déterminées conformément aux critères visés dans les Orientations révisées de l'ABE sur les procédures et les méthodologies communes à appliquer dans le cadre du processus de contrôle et d'évaluation prudentiels et des tests de résistance prudentiels (2) (Orientations SREP de l'ABE), exprimées en pourcentage du total des RWEA.</p> <p>Cet élément doit correspondre à l'exigence de fonds propres SREP totale (ratio TSCR) telle que communiquée à l'établissement par l'autorité compétente. Le TSCR est défini à la section 1.2 des Si l'autorité compétente n'a pas communiqué d'exigence de fonds propres supplémentaire pour faire face aux risques autres que le risque de levier excessif, seul l'élément indiqué au point i) doit être fourni.</p>
EU 8a	<p>Coussin de conservation des fonds propres (%)</p> <p>Montant des fonds propres que les établissements sont tenus de détenir conformément aux articles 128, paragraphe 1, et 129 de la CRD, exprimé en pourcentage du total des RWEA.</p>
9	<p>Coussin de conservation découlant du risque macroprudentiel ou systémique constaté au niveau d'un État membre (%)</p> <p>Montant du coussin de conservation lié au risque macroprudentiel ou systémique constaté au niveau</p>
EU 9a	<p>Coussin de fonds propres contracyclique spécifique à l'établissement (%)</p> <p>Montant des fonds propres que les établissements sont tenus de détenir conformément aux articles 128, paragraphe 2, à l'article 130 et aux articles 135 à 140 de la CRD, exprimé en pourcentage du total Ce pourcentage reflète le montant de fonds propres nécessaire pour satisfaire aux exigences respectives</p>
EU 9a	<p>Coussin pour le risque systémique (%)</p> <p>Montant des fonds propres que les établissements sont tenus de détenir, conformément à l'article 128, paragraphe 5, et aux articles 133 et 134 de la CRD, exprimé en pourcentage du total des RWEA. Ce pourcentage reflète le montant de fonds propres nécessaire pour satisfaire aux exigences respectives</p>
10	<p>Coussin pour les établissements d'importance systémique mondiale (%)</p> <p>Montant des fonds propres que les établissements sont tenus de détenir conformément aux articles 128, paragraphe 3, et 131 de la CRD, exprimé en pourcentage du total des RWEA. Ce pourcentage reflète le montant de fonds propres nécessaire pour satisfaire aux exigences respectives</p>
EU 10a	<p>Coussin pour les autres établissements d'importance systémique (%)</p> <p>Montant des fonds propres que les établissements sont tenus de détenir conformément aux articles 128, paragraphe 4, et 131 de la CRD, exprimé en pourcentage du total des RWEA. Ce pourcentage reflète le montant de fonds propres nécessaire pour satisfaire aux exigences respectives de coussin de fonds propres à la date de déclaration.</p>
11	<p>Exigence globale de coussin (%)</p> <p>Conformément à l'article 128, point 6), de la CRD, exprimé en pourcentage du total des RWEA.</p>
EU 11a	<p>Exigences globales de fonds propres (OCR) (%)</p> <p>La somme des points i) et ii) suivants:</p> <p>(i) le ratio TSCR visé à la ligne EU 7d;</p> <p>(ii) dans la mesure où elle est légalement applicable, l'exigence globale de coussin de fonds propres visée à l'article 128, point 6), de la CRD.</p>
12	<p>Cet élément doit correspondre à l'exigence globale de fonds propres (OCR) telle que définie à la section 1.2 des orientations SREP de l'ABE.</p> <p>Si aucune exigence de coussin n'est applicable, seul l'élément visé au point i) est communiqué.</p>
13	<p>Fonds propres CET1 disponibles après le respect des exigences totales de fonds propres SREP (%)</p> <p>Mesure de l'exposition totale</p> <p>Mesure de l'exposition totale correspondant au montant communiqué par les établissements à l'annexe XI du présent règlement d'exécution (ligne 24 du modèle EU LR2 - LRCom: Ratio de levier — déclaration commune)</p>
14	<p>Ratio de levier (%)</p> <p>Ratio de levier correspondant à la valeur communiquée par les établissements à l'annexe XI du présent règlement d'exécution (ligne 25 du modèle EU LR2 - LRCom: Ratio de levier — déclaration commune)</p>
EU 14a	<p>Exigences de fonds propres supplémentaires pour faire face au risque de levier excessif (%)</p> <p>Les exigences de fonds propres supplémentaires pour faire face au risque de levier excessif imposées</p>

	<p>Les exigences de fonds propres supplémentaires pour faire face au risque de levier excessif imposées par l'autorité compétente en vertu de l'article 104, paragraphe 1, point a), de la CRD, exprimées en pourcentage de la mesure totale d'exposition.</p> <p>Exigences de fonds propres supplémentaires correspondant à la valeur communiquée par les établissements à l'annexe XI du présent règlement d'exécution (ligne EU-26a du modèle EU LR2 - LRCom: Ratio de levier — déclaration commune).</p>
EU 14b	<p>dont: à satisfaire avec des fonds propres CET1 (points de pourcentage)</p> <p>La partie des exigences de fonds propres supplémentaires pour faire face au risque de levier excessif imposées par l'autorité compétente en vertu de l'article 104, paragraphe 1, point a), de la CRD, qui doit être couverte par des fonds propres CET1 conformément aux premier et troisième alinéas de l'article 104 bis, paragraphe 4.</p> <p>Exigences de fonds propres supplémentaires correspondant à la valeur communiquée par les établissements à l'annexe XI du présent règlement d'exécution (ligne EU-26b du modèle EU LR2 - LRCom: Ratio de levier — déclaration commune).</p>
EU 14c	<p>Exigences de ratio de levier SREP totales (%)</p> <p>La somme des points i) et ii) suivants:</p> <p>(i) l'exigence minimale de ratio de levier tel que visée à l'article 92, paragraphe 1, point d), du CRR ou l'exigence de ratio de levier ajustée calculée conformément à l'article 429 bis, paragraphe 7, du CRR, selon le cas;</p> <p>(ii) les exigences de fonds propres supplémentaires pour faire face au risque de levier excessif (exigences du pilier 2) imposées par l'autorité compétente en vertu de l'article 104, paragraphe 1, point a), de la CRD, exprimées en pourcentage de la mesure totale d'exposition.</p> <p>Cet élément correspond à l'exigence de ratio de levier SREP total (TSLRR) communiquée à l'établissement par l'autorité compétente.</p> <p>Si l'autorité compétente n'impose pas d'exigence de fonds propres supplémentaire pour faire face au risque de levier excessif, seul l'élément visé au point i) est communiqué.</p>
EU 14d	<p>Exigence de coussin lié au ratio de levier (%)</p> <p>Article 92, paragraphe 1 bis, du CRR</p> <p>Coussin de ratio de levier applicable correspondant à la valeur communiquée par les établissements à l'annexe XI du présent règlement d'exécution (ligne 27 du modèle EU LR2 — LRCom: Ratio de levier — déclaration commune)</p>
EU 14e	<p>Exigence de ratio de levier globale (%)</p> <p>Somme des lignes EU 14c et EU 14d</p>
15	<p>Actifs liquides de qualité élevée (HQLA) totaux (valeur pondérée -moyenne)</p> <p>Les établissements déclarent comme valeur pondérée la valeur de leurs actifs liquides au sens de l'article 9 du règlement délégué (UE) 2015/61 de la Commission (3), avant l'application du mécanisme d'ajustement prévu à l'article 17, paragraphe 2, du règlement délégué (UE) 2015/61.</p>
EU 16a	<p>Sorties de trésorerie — Valeur pondérée totale</p> <p>Les établissements déclarent la somme de la valeur pondérée de leurs sorties de trésorerie, tel qu'indiquée à l'annexe XIII (ligne 16 du modèle EU LIQ1 - Informations quantitatives sur le ratio de couverture des besoins de liquidité (LCR)).</p>
EU 16b	<p>Entrées de trésorerie — Valeur pondérée totale</p> <p>Les établissements déclarent la somme de la valeur pondérée de leurs entrées de trésorerie, tel qu'indiquée à l'annexe XIII (ligne 20 du modèle EU LIQ1 — Informations quantitatives sur le ratio de couverture des besoins de liquidité (LCR)).</p> <p>Sorties de trésorerie nettes totales (valeur ajustée)</p>
16	<p>Les établissements déclarent comme valeur ajustée leurs sorties nettes de trésorerie, qui sont égales au total de leurs sorties de trésorerie, moins la réduction correspondant aux entrées de trésorerie entièrement exemptées, moins la réduction correspondant aux entrées de trésorerie soumises au plafond de 90 %, moins la réduction correspondant aux entrées de trésorerie soumises au plafond de 75 %.</p> <p>Ratio de couverture des besoins de liquidité (%)</p>

17	<p>Les établissements déclarent comme valeur ajustée le pourcentage de l'élément «ratio de couverture des besoins de liquidité (%)» au sens de l'article 4, paragraphe 1, du règlement délégué (UE) 2015/61.</p> <p>Le ratio de couverture des besoins de liquidité est égal au ratio entre le coussin de liquidité de l'établissement de crédit et ses sorties nettes de trésorerie sur une période de tensions de 30 jours calendaires, et est exprimé en pourcentage.</p>
18	<p>Financement stable disponible total</p> <p>Les établissements déclarent le montant du financement stable disponible, calculé conformément à la sixième partie, titre IV, chapitre 3, du CRR, tel qu'indiqué à l'annexe XIII (ligne 14 du modèle EU LIQ2 – ratio de financement stable net).</p>
19	<p>Financement stable requis total</p> <p>Les établissements déclarent le montant du financement stable requis, calculé conformément à la sixième partie, titre IV, chapitre 4, du CRR, tel qu'indiqué à l'annexe XIII (ligne 33 du modèle EU LIQ2 – ratio de financement stable net).</p>
20	<p>Ratio NSFR (%)</p> <p>Ratio NSFR calculé conformément à l'article 428 ter du CRR.</p>