

# Description Produit SBS SaaS Regulatory Reporting

---

SBS SaaS Product Description\_Regulatory  
Reporting\_(fr)\_v17032025

---

---

# Table des matières

---

<b>1. Hypothèses d'utilisation</b>	<b>4</b>
<b>2. Principe de version du Produit SBP Regulatory Reporting</b>	<b>4</b>
<b>3. Description des fonctionnalités du Produit SBP Regulatory Reporting</b>	<b>4</b>
3.1. Généralités	4
3.2. Collecte commune des données	4
3.3. Transformation des données	5
3.4. Session de reporting	5
3.5. Contrôles des données d'une session	5
3.6. Analyse et ajustements des données d'une session	6
3.7. Construction des sorties réglementaires à partir des données collectées	6
3.8. Import direct de sorties réglementaires	6
3.9. Contrôles des reportings	6
3.10. Analyse et ajustements des reportings réglementaires	7
3.11. Production des déclarations	7
3.12. Echanges avec les régulateurs	7
3.13. Signature	8
3.14. Conversion rapide	8
3.15. Capacités de Business Intelligence	8
<b>Annexe 1: Description des Services Réglementaires</b>	<b>9</b>
<b>1. Généralités</b>	<b>9</b>
<b>2. Tableaux réglementaires</b>	<b>9</b>
<b>2.1. COREP EBA CRR3</b>	<b>9</b>
2.1.1. EBA Solvency	9
2.1.2. EBA FRTB	11
2.1.3. EBA Leverage ratio	11
2.1.4. EBA G-SII	12
2.1.5. EBA Large exposures	12
<b>2.2. IRRBB</b>	<b>12</b>
<b>2.3. FUNDING PLANS EBA</b>	<b>13</b>
<b>2.4. INSTANT PAYMENT EBA</b>	<b>14</b>
<b>2.5. SRF SRB</b>	<b>14</b>
<b>2.6. SBP EBA</b>	<b>14</b>
<b>2.7. RUBA</b>	<b>14</b>
<b>2.8. RP EBA</b>	<b>18</b>
<b>2.9. REM</b>	<b>19</b>

---

<b>2.10. PROTIDE</b>	<b>19</b>
<b>2.11. OSCAMPS</b>	<b>19</b>
<b>2.12. M_TITTRAN</b>	<b>20</b>
<b>2.13. M_CONTRAN</b>	<b>20</b>
<b>2.14. MRETLAC EBA</b>	<b>20</b>
<b>2.15. LIQUIDITY</b>	<b>21</b>
<b>2.16. LDR SRB</b>	<b>21</b>
<b>2.17. LCB-FT</b>	<b>21</b>
<b>2.18. FINREP NG</b>	<b>22</b>
<b>2.19. FINREP IFRS EBA</b>	<b>23</b>
<b>2.20. CREDITIMMO</b>	<b>24</b>
<b>2.21. BDP</b>	<b>24</b>
<b>2.22. AE EBA</b>	<b>25</b>
<b>2.23. FINANCIAL MARKET INFRA SRB</b>	<b>25</b>
<b>2.24. DIVERSITY BENCHMARKING EBA</b>	<b>25</b>
<b>2.25. CRITICAL FUNCTIONS SRB</b>	<b>25</b>

---

Cette description du produit pour l'Offre "Regulatory Reporting" de SBS constitue une partie intégrante du Contrat entre SBS et le Client. Aux fins de cette description du Produit, le terme "Produit" désigne "Regulatory Reporting". Tous les termes en majuscules non définis dans ce document auront la signification qui leur est donnée dans d'autres parties du Contrat.

## 1. Hypothèses d'utilisation

Les services de production réglementaire s'appuyant sur notre Produit SBP Regulatory Reporting reposent sur les hypothèses communes suivantes :

- Connectivité et Prérequis Client:
  - Accès en HTTPS permettant un accès au Produit (Interface Utilisateur, API).
- Habilitations:
  - La gestion des accès et habilitations des Utilisateurs Autorisés du Client sont de la responsabilité du Client, sur demande la liste des accès peut être fournie au Client.
  - La gestion (création/modification/suppression) se fait par l'outil de ticket auprès de SBS.

## 2. Principe de version du Produit SBP Regulatory Reporting

Le produit SBP Regulatory Reporting suit un cycle ordinaire de release de 3 mois. Ce cycle précise la périodicité générique présente dans la Politique Editeur SaaS qui reste appliquée sur le fond, mais selon un calendrier adapté au contexte réglementaire. La publication de nouvelles versions peut aussi intervenir dans un calendrier plus soutenu dans le cas de modifications d'exigences réglementaires avec une date de mise en œuvre fortement contrainte.

Afin d'offrir à nos clients les dernières améliorations et assurer une utilisation optimale du Produit au quotidien, la période de support et de maintenance est limitée à une version du Produit. Ainsi, pour des publications ordinaires de 3 mois, la période de support et de maintenance est de 3 mois.

En cas de Breaking change, dans un rythme ordinaire de 3 mois la rétrocompatibilité est assurée pour les 2 versions à venir.

## 3. Description des fonctionnalités du Produit SBP Regulatory Reporting

### 3.1. Généralités

Le Produit de SBS permet aux établissements bancaires de produire leurs reportings réglementaires à destination des autorités, tout en répondant aux enjeux actuels des banques en la matière.

Il couvre l'ensemble des étapes nécessaires, de la collecte des données issues des systèmes d'informations du Client, jusqu'à la soumission des fichiers aux autorités, au travers d'un ensemble de fonctionnalités décrites dans les chapitres ci-après.

### 3.2. Collecte commune des données

La collecte commune des données permet de collecter de manière unique l'ensemble des données nécessaires et suffisantes à la production de tous les reportings réglementaires auxquels le Client est abonné.

Les données sont issues du système d'information du Client et injectées via des entrées standardisées au format CSV qui permettent d'assurer une alimentation de la base de données en respectant l'intégrité de cette dernière.

Le Produit est multi-entités et à ce titre, peut recevoir selon le même procédé, les données en provenance des différentes filiales et/ou succursales.

Les Utilisateurs Autorisés ont la possibilité de charger les données et de lancer les traitements de collecte au travers de l'interface utilisateur. Des APIs REST sont également disponibles, permettant notamment d'automatiser les traitements.

Par ailleurs, certaines données peuvent être rejetées lors de la collecte. Il s'agit principalement de données qui ne sont pas lisibles pour des raisons techniques. Le détail des données rejetées de la collecte est consultable. Ce détail inclut la référence du dataset, la liste de ces valeurs d'attributs, ainsi que la raison du rejet.

---

### 3.3. Transformation des données

Le Produit permet aux Utilisateurs Autorisés de définir des règles de transformation ou d'enrichissement des données (attributs) brutes collectées:

- Mapping : définition de règles de transformation des valeurs internes d'un attribut, en valeurs attendues par le Produit (définies dans le dictionnaire du Produit)

Par ailleurs, des règles standards de transformation, allant de règles de déductions et mapping à des algorithmes de calcul plus complexes, sont également incluses. Elles permettent de calculer, à partir des données brutes, d'autres données (dites calculées ou transformées) nécessaires à la production des reportings réglementaires, limitant ainsi les pré-calculs à réaliser par le Client.

### 3.4. Session de reporting

Une session de reporting (ou « session ») est un espace de travail cloisonné permettant d'organiser la production de reportings par période (ou date) de déclaration, société(s) et liste de reportings réglementaires à produire pour chaque société.

Au sein de chaque session, une phase de collecte commune de données va avoir lieu. La session sera en mesure de filtrer les données collectées du Client pour ne sélectionner que celles nécessaires à produire les reportings réglementaires de la session. Ces données seront ensuite préparées, contrôlées et transformées en reportings réglementaires pour être in fine déclarées au format attendu par le régulateur.

La création, modification, suppression des sessions de reporting peut se faire soit par un Utilisateur Autorisé, via l'interface utilisateur, soit par des APIs REST.

Le nombre de sessions en ligne n'est pas techniquement limité par le Produit. Les Conditions Particulières précisent les limites en nombre de sessions pour le Service SaaS souscrit.

Un explorateur de traitement détaillé permet de piloter les traitements lancés sur une session de reporting donnée, et d'en récupérer les résultats.

### 3.5. Contrôles des données d'une session

Afin d'assurer le bon niveau de qualité des données et donc, in fine, des remises réglementaires, des contrôles de plusieurs types sont réalisés sur les données :

- Contrôles d'intégrité des données collectées (format, structure, liens entre datasets, etc.)
- Contrôles de format :
  - Contrôle de la conformité d'une donnée par rapport à un domaine (liste) de valeurs
  - Contrôle de la conformité d'une donnée par rapport à une syntaxe ou un masque (patterns)
- Contrôles de cohérence de plusieurs données entre elles

L'Utilisateur Autorisé peut consulter les résultats des contrôles depuis un écran dédié permettant de:

- Afficher la liste, le nombre et le détail des erreurs,
- Filtrer et trier la liste des erreurs,
- Afficher la répartition des erreurs sous forme de graphiques ou de métriques, et
- Accéder aux données à corriger.

Le Produit fournit également un tableau de bord de la qualité des données qui permet aux Utilisateurs Autorisés du Produit de contrôler la qualité des données au niveau global et selon différents axes d'analyse (dimension de la qualité, institution, date de référence, etc.).

---

### 3.6. Analyse et ajustements des données d'une session

L'Utilisateur Autorisé peut visualiser les données spécifiques à une session, c'est-à-dire les données ayant servi à produire les reportings réglementaires de la session. Si nécessaire, il peut cibler sa recherche de manière dynamique à l'aide de filtres et de tris (sur les dates, sociétés, attributs, etc.).

L'Utilisateur Autorisé dispose de fonctionnalités permettant d'ajuster les données de la session ou de saisir manuellement des nouvelles données:

- Mode unitaire : permet de créer, dupliquer ou supprimer un enregistrement, ou de modifier les valeurs de ses attributs

### 3.7. Construction des sorties réglementaires à partir des données collectées

Le Produit prend en charge, au sein des sessions de reporting, les transformations des données collectées pour les mettre dans un format adapté à chaque sortie réglementaire. Ce format est proche de celui de la déclaration mais adapté pour être éditable directement dans le Produit (sans conversion).

Le format des sorties réglementaires est spécialisé en fonction de la typologie des données à déclarer :

- Modèle relationnel granulaire.
- Modèle hiérarchique d'entités (qui peut être assimilé à une liste de données).
- Liste de données.
- Tableau de synthèse.

Cette fonctionnalité assure également la détection des données à transmettre (en fonction par exemple d'un seuil déclaratif, en fonction des datasets).

La construction des sorties réglementaires de type tableau de synthèse prend en charge les agrégats et ventilations nécessaires. Le format des outputs et les règles d'agrégation et de ventilation définies en langage Json s'appuient directement sur la taxonomie XBRL fournie par le régulateur (pour les remises en XBRL).

A noter que la construction des sorties réglementaires et traitements qui les concernent et qui sont décrits dans la suite du document (calculs, contrôles, etc.) peut être enchaînée automatiquement après la collecte de données afin que les sorties réglementaires soient prêtes et disponibles pour être consultées ou ajustées par les Utilisateurs Autorisés.

Le Produit prend en charge tous les calculs nécessaires à la production des sorties réglementaires y compris les calculs mettant en jeu des cellules de tableaux à l'intérieur d'un tableau ou entre tableaux.

Le Produit identifie parmi les sorties réglementaires celles qui répondent aux règles de remise (de publication) de chaque établissement.

### 3.8. Import direct de sorties réglementaires

Le Produit propose une fonction permettant d'importer directement le contenu de sorties réglementaires.

Pour les sorties réglementaires basées sur des listes de données, cet import s'effectue en Excel.

Pour les tableaux de synthèse cet import s'effectue en format Excel

Ces fonctionnalités d'import peuvent être déclenchées automatiquement (par utilisation des APIs du Produit) ou manuellement.

### 3.9. Contrôles des reportings

Dans le cadre de la veille et de la maintenance réglementaires, l'Editeur prend en charge les contrôles réglementaires définis au niveau des sorties réglementaires pour veiller à une déclaration conforme aux contrôles exigés par les autorités réglementaires.

---

Le Produit inclus pour chaque sortie l'ensemble des contrôles réglementaires définis dans les cahiers des charges des régulateurs (contrôles de format, de complétude, de cohérence, contrôles taxonomiques, etc.).

Les erreurs identifiées lors de l'application de ces contrôles sont restituées de plusieurs manières en fonction des typologies de contrôles :

- Contrôles sur les données granulaires : les erreurs sont restituées selon des modalités identiques à celles décrites au chapitre « e. Contrôles des données d'une session ».
- Contrôles sur le contenu des tableaux :
  - Les erreurs sont restituées via une liste des contrôles en erreur. L'Utilisateur Autorisé peut filtrer cette liste pour cibler les tableaux à corriger.
  - Les erreurs sont également restituées dans l'explorateur de tableaux permettant de voir le nombre et la liste des tableaux en erreur, et le nombre d'erreurs dans les tableaux.

Les erreurs sur ces contrôles sont restituées avec la codification (référence) et la sévérité (avertissement, erreur bloquante) d'origine définie par les régulateurs.

La restitution des contrôles tient compte des sorties réglementaires présentes dans la session et des habilitations de l'Utilisateur Autorisé (sorties réglementaires, sociétés, profil, ...).

### 3.10. Analyse et ajustements des reportings réglementaires

Le Produit propose une fonctionnalité d'ajustement de données, que ces données soient en erreur ou non, adaptée au type de reporting à produire.

Pour les reportings granulaires et listes, c'est-à-dire basés sur des datasets, le Produit propose les mêmes fonctions que celles décrites au chapitre « Analyse et ajustement des données »

Pour les reportings de synthèse en format tableau, le Produit propose un éditeur de tableaux dédié.

### 3.11. Production des déclarations

Le Produit permet de produire les déclarations réglementaires, c'est-à-dire de transformer les données des sorties réglementaires dans le format attendu par les régulateurs (XML, XBRL, SDMX, autre). Aucune modification ou enrichissement par rapport au contenu de la sortie réglementaire n'est réalisé à cette étape, afin que l'Utilisateur Autorisé puisse avoir à tout moment la vision exacte de ce que contient la déclaration.

La production du ou des fichier(s) de déclaration prend en charge toutes les exigences techniques et liées à la taxonomie et les spécificités déclaratives du chaque régulateur.

L'Utilisateur Autorisé a également accès à l'historique des déclarations et à l'historique de l'ensemble des étapes suivantes appliquées sur ces déclarations (signature(s), transfert(s), retour(s)) ainsi qu'au statut (ok ou non ok) à chaque étape.

### 3.12. Echanges avec les régulateurs

Le Produit peut gérer différents échanges et retours des régulateurs (lorsque le régulateur propose ce service au travers de sa plateforme de dépôt). Les retours sont chargés dans la session de reporting qui a généré la déclaration, analysés, et interprétés au travers d'écrans dédiés permettant aux Utilisateurs Autorisés d'accéder directement aux contenus des retours, des éventuelles erreurs ainsi qu'aux détails des données à corriger.

En standard, le Produit couvre notamment les échanges avec le portail OneGate (mode A2A – Application To Application – de la Banque de France).

L'Utilisateur Autorisé a la possibilité de lancer les traitements de génération de la déclaration, d'intégration des retours, soit grâce à l'interface utilisateur ou bien grâce aux APIs REST afin, par exemple, d'automatiser les traitements.

Les résultats des traitements (synthèse des erreurs, statistiques sur les données utilisées, fichier de déclaration, etc.) sont téléchargeables à travers l'interface utilisateur.

---

### 3.13. Signature

Le Produit prend en charge la signature électronique des fichiers de déclaration, quel que soit leur format, dans la mesure où le régulateur exige et spécifie le protocole associé à cette signature (exemple : signature Banque de France).

Il est possible, au moment de la signature, de visualiser le contenu en clair de la déclaration et d'afficher quelques KPIs permettant de récapituler les informations contenues dans la déclaration (exemple : montants actifs / passif pour un bilan).

### 3.14. Conversion rapide

La conversion rapide permet à un Utilisateur Autorisé d'enchaîner les fonctionnalités d'import direct de sorties réglementaires, de contrôles de niveau reporting réglementaire et de déclaration.

Cela lui permet de convertir en temps réel les données d'un tableau, fournies au travers des tableaux ('templates') du régulateur, dans le format de déclaration attendu par le régulateur (par exemple, en XBRL).

### 3.15. Capacités de Business Intelligence

Au travers du Produit, il est possible de questionner, d'explorer et de visualiser les importants volumes de données manipulés, dans le but d'en obtenir une vision d'ensemble et de faciliter des prises de décision métier.

Pour cela, le Produit fonctionne autour de trois concepts clés : les questions, les visualisations et les dashboards (tableaux de bord).

Les questions sont le concept de base du Produit. Ils visent à créer des analyses métier formulées sous forme de questions utilisant les données (dans la limite des données présentes dans le Produit), comme par exemple: « Quel est l'encours total des crédits à la consommation accordés à mes clients résidant en France au T3 2023? ».

La définition et le paramétrage des questions est entièrement à la main des Utilisateurs Autorisés, au travers d'une interface visuelle et intuitive ne nécessitant pas de langage de programmation.

Une fois la ou les questions définies, le Produit dispose de multiples options afin de visualiser les résultats de l'analyse:

- Des tableaux simples et croisés dynamiques.
- Des graphiques: camemberts, cartes, graphiques en barres, en lignes ou combinés, entonnoirs, nuages de points, etc.
- Des KPIs et des compteurs, etc.

De plus, chaque type de visualisation est entièrement personnalisable (affichage, axes, libellés, etc.).

Enfin, le Produit permet de rassembler plusieurs visualisations au sein de dashboards. Les dashboards sont paramétrables par un Utilisateur Autorisé métier, au travers d'une interface. Ils peuvent par ailleurs être rendus dynamiques par l'ajout de filtres qui permettront ensuite, à la volée, de mettre à jour les informations à visualiser. Le choix des filtres, et de leur impact sur les différentes visualisations, est entièrement à la main des Utilisateurs Autorisés du Produit.



## Annexe 1: Description des Services Réglementaires

### 1. Généralités

Concernant les Services Réglementaires de type tableaux, il existe deux modes d'alimentation des tableaux possibles :

- Alimentation automatique : permet une alimentation complète ou partielle (suivant le niveau d'automatisation) des tableaux concernés via les entrées de SBP Regulatory Reporting qui doivent être extraites et générées à partir des systèmes amont du client
- Alimentation directe : permet une alimentation directe des cellules des tableaux du modèle au format texte (format CSV) ou Excel.

Les listes des tableaux réglementaires compris dans les services ainsi que leur mode d'alimentation sont décrites ci-après.

### 2. Tableaux réglementaires

#### 2.1. COREP EBA CRR3

Le Service de Reporting Réglementaire COREP EBA CRR3 est composé des périmètres suivants :

Service	Description du Service	Réglementation
EBA Solvency	Reporting "Solvency Ratio" (Own funds, credit risks, market risks, operational risks) du COREP de l'Autorité Bancaire Européenne	EBA COREP
EBA FRTB	Reporting "Fundamental Review of the Trading Book" (FRTB) du COREP de l'Autorité Bancaire Européenne	EBA COREP
EBA Leverage Ratio	Reporting "Leverage Ratio" du COREP de l'Autorité Bancaire Européenne	EBA COREP
EBA G-SII	Reporting "Global Systemically Important Institutions" de l'Autorité Bancaire Européenne	EBA G-SII
EBA Large exposure	Reporting "Large exposure" du COREP de l'Autorité Bancaire Européenne	EBA COREP

La liste des tableaux réglementaires compris dans le service COREP EBA CRR3 est décrite ci-dessous :

##### 2.1.1. EBA Solvency

	Template		Mode d'alimentation
	<b>CAPITAL ADEQUACY template</b>		
C 01.00	OWN FUNDS	CA1	Automatique
C 02.00	OWN FUNDS REQUIREMENTS	CA2	Automatique
C 03.00	CAPITAL RATIOS	CA3	Manuel
C 04.00	MEMORANDUM ITEMS	CA4	Automatique
	<b>TRANSITIONAL PROVISIONS</b>		
C 05.01	TRANSITIONAL PROVISIONS	CA5.1	Manuel
C 05.02	GRANDFATHERED INSTRUMENTS: INSTRUMENTS NOT CONSTITUING STATE AID	CA5.2	Manuel
	<b>GROUP SOLVENCY</b>		
C 06.01	GROUP SOLVENCY: INFORMATION ON AFFILIATES – TOTAL	GS Total	Automatique
C 06.02	GROUP SOLVENCY: INFORMATION ON AFFILIATES	GS	Automatique
	<b>CREDIT RISK</b>		
C 07.00	CREDIT AND COUNTERPARTY CREDIT RISKS AND FREE DELIVERIES	CR SA	Automatique
C 08.01	CREDIT AND COUNTERPARTY CREDIT RISKS AND FREE DELIVERIES: IRB APPROACH TO CAPITAL REQUIREMENTS	CR IRB 1	Automatique

C 08.02	CREDIT AND COUNTERPARTY CREDIT RISKS AND FREE DELIVERIES: IRB APPROACH TO CAPITAL REQUIREMENTS (Breakdown by obligor grades or pools)	CR IRB 2	Automatique
C 08.03	CREDIT RISK AND FREE DELIVERIES: IRB APPROACH TO CAPITAL REQUIREMENTS: BREAKDOWN BY PD RANGES	CR IRB 3	Automatique
C 08.04	CREDIT RISK AND FREE DELIVERIES: IRB APPROACH TO CAPITAL REQUIREMENTS: RWEA FLOW STATEMENTS	CR IRB 4	Direct
C 08.05	CREDIT RISK AND FREE DELIVERIES: IRB APPROACH TO CAPITAL REQUIREMENTS: BACK-TESTING OF PD	CR IRB 5	Automatique
C 08.05.1	CREDIT RISK AND FREE DELIVERIES: IRB APPROACH TO CAPITAL REQUIREMENTS: BACK-TESTING OF PD IN ACCORDANCE WITH ARTICLE 180(1), POINT (f) OF REGULATION (EU) NO 575/2013 (CR IRB 5B)	CR IRB 5B	Automatique
C 08.06	CREDIT RISK AND FREE DELIVERIES: IRB APPROACH TO CAPITAL REQUIREMENTS: SPECIALISED LENDING SLOTTING APPROACH	CR IRB 6	Automatique
C 08.07	CREDIT RISK AND FREE DELIVERIES: IRB APPROACH TO CAPITAL REQUIREMENTS: SCOPE OF USE OF IRB AND SA APPROACHES	CR IRB 7	Automatique
	<b>GEOGRAPHICAL BREAKDOWN</b>		
C 09.01	Table 9.1 - Geographical breakdown of exposures by residence of the obligor (SA exposures)	CR GB 1	Automatique
C 09.02	Table 9.2 - Geographical breakdown of exposures by residence of the obligor (IRB exposures)	CR GB 2	Automatique
C 09.04	Table 9.4 - Breakdown of credit exposures relevant for the calculation of the countercyclical buffer by country and institution-specific countercyclical buffer rate	CCB	Automatique
	<b>CREDIT RISK: EQUITY - IRB APPROACHES TO CAPITAL REQUIREMENTS</b>		
C 10.00	CREDIT AND COUNTERPARTY CREDIT RISKS AND FREE DELIVERIES: IRB EXPOSURES SUBJECT TO OUTPUT FLOOR	CR IRB OF	Automatique
C 10.01	CREDIT RISK: EQUITY - IRB APPROACHES TO CAPITAL REQUIREMENTS	CR EQU IRB 1	Automatique
C 10.02	CREDIT RISK: EQUITY - IRB APPROACHES TO CAPITAL REQUIREMENTS. BREAKDOWN OF TOTAL EXPOSURES UNDER THE PD/LGD APPROACH BY OBLIGOR GRADES:	CR EQU IRB 2	Automatique
C 11.00	SETTLEMENT/DELIVERY RISK	CR SETT	Automatique
C 13.01	CREDIT RISK: SECURITISATIONS	CR SEC	Automatique
C 14.00	DETAILED INFORMATION ON SECURITISATIONS	CR SEC Details	Automatique
C 14.01	DETAILED INFORMATION ON SECURITISATIONS BY APPROACH	CR SEC Details 2	Automatique
	<b>EXPOSURES AND LOSSES</b>		
C 15.00	EXPOSURES AND LOSSES FROM LENDING COLLATERALISED BY IMMOVABLE PROPERTY	CR IP LOSSES	Automatique
	<b>OPERATIONAL RISK</b>		
C 16.01	OPERATIONAL RISK - OWN Funds Requirements	OPR OF	Automatique
C 17.01	OPERATIONAL RISK: LOSSES AND RECOVERIES BY BUSINESS LINES AND EVENT TYPES IN THE LAST YEAR	OPR DETAILS 1	Automatique
C 17.02	OPERATIONAL RISK: LARGE LOSS EVENTS	OPR DETAILS 2	Automatique
	<b>MARKET RISK</b>		
C 18.01	MARKET RISK: SIMPLIFIED STANDARDISED APPROACH FOR POSITION RISKS IN TRADED DEBT INSTRUMENTS	MKR SSA TDI	Automatique
C 19.01	MARKET RISK: SIMPLIFIED STANDARDISED APPROACH FOR SPECIFIC RISK IN SECURITISATIONS	MKR SSA SEC	Automatique
C 20.01	MARKET RISK: SIMPLIFIED STANDARDISED APPROACH FOR SPECIFIC RISK IN THE CORRELATION TRADING PORTFOLIO	MKR SSA CTP	Automatique
C 21.01	MARKET RISK: SIMPLIFIED STANDARDISED APPROACH FOR POSITION RISK IN EQUITIES	MKR SSA EQU	Automatique
C 22.01	MARKET RISK: SIMPLIFIED STANDARDISED APPROACHES FOR FOREIGN EXCHANGE RISK	MKR SSA FX	Automatique

C 23.01	MARKET RISK: SIMPLIFIED STANDARDISED APPROACHES FOR COMMODITIES	MKR SSA COM	Automatique
C 24.00	MARKET RISK INTERNAL MODELS	MKR IM	Automatique
C 25.01	CREDIT VALUE ADJUSTMENT RISK	CVA	Automatique
	<b>PRUDENT VALUATION</b>		
C 32.01	PRUDENT VALUATION: FAIR-VALUED ASSETS AND LIABILITIES	PRUVAL 1	Automatique
C 32.02	PRUDENT VALUATION: CORE APPROACH	PRUVAL 2	Automatique
C 32.03	PRUDENT VALUATION: MODEL RISK AVA	PRUVAL 3	Automatique
C 32.04	PRUDENT VALUATION: CONCENTRATED POSITIONS AVA	PRUVAL 4	Automatique
	<b>GENERAL GOVERNMENTS EXPOSURES</b>		
C 33.00	GENERAL GOVERNMENTS EXPOSURES BY COUNTRY OF THE COUNTERPARTY	GOV	Automatique
	<b>COUNTERPARTY CREDIT RISK</b>		
C 34.01	COUNTERPARTY CREDIT RISK: SIZE OF THE DERIVATIVE BUSINESS	CCR 1	Manuel
C 34.02	COUNTERPARTY CREDIT RISK: CCR EXPOSURES BY APPROACH	CCR 2	Automatique
C 34.03	COUNTERPARTY CREDIT RISK: CCR EXPOSURES TREATED WITH STANDARDISED APPROACHES: SA-CCR or SIMPLIFIED SA-CCR	CCR 3	Automatique
C 34.04	COUNTERPARTY CREDIT RISK: CCR EXPOSURES TREATED WITH THE THE ORIGINAL EXPOSURE METHOD (OEM)	CCR 4	Automatique
C 34.05	COUNTERPARTY CREDIT RISK: CCR EXPOSURES TREATED WITH THE INTERNAL MODEL METHOD (IMM)	CCR 5	Automatique
C 34.06	COUNTERPARTY CREDIT RISK: TOP TWENTY COUNTERPARTIES	CCR 6	Automatique
C 34.07	COUNTERPARTY CREDIT RISK: IRB APPROACH – CCR EXPOSURES BY EXPOSURE CLASS AND PD SCALE	CCR 7	Automatique
C 34.08	COUNTERPARTY CREDIT RISK: COMPOSITION OF COLLATERAL FOR CCR EXPOSURES	CCR 8	Automatique
C 34.09	COUNTERPARTY CREDIT RISK: CREDIT DERIVATIVES EXPOSURES	CCR 9	Automatique
C 34.10	COUNTERPARTY CREDIT RISK: EXPOSURES TO CCPs	CCR 10	Automatique
C 34.11	COUNTERPARTY CREDIT RISK: RWEA FLOW STATEMENTS OF CCR EXPOSURES UNDER THE IMM	CCR 11	Manuel
	<b>NPE LOSS COVERAGE</b>		
C 35.01	NPE LOSS COVERAGE: THE CALCULATION OF DEDUCTIONS FOR NON-PERFORMING EXPOSURES	NPE LC1	Automatique
C 35.02	NPE LOSS COVERAGE: MINIMUM COVERAGE REQUIREMENTS AND EXPOSURE VALUES OF NON-PERFORMING EXPOSURES EXCLUDING FORBORNE EXPOSURES THAT FALL UNDER ARTICLE 47C (6) OF REGULATION (EU) NO 575/2013	NPE LC2	Automatique
C 35.03	NPE LOSS COVERAGE: MINIMUM COVERAGE REQUIREMENTS AND EXPOSURE VALUES OF NON-PERFORMING FORBORNE EXPOSURES THAT FALL UNDER ARTICLE 47C (6) OF REGULATION (EU) NO 575/2013	NPE LC3	Automatique
	<b>CRYPTO ASSETS</b>		
C 36.00	EXPOSURES TO CRYPTO ASSETS	CRYPTO	Manuel

### 2.1.2. EBA FRTB

	Template		Mode d'alimentation
C24.01	TRADING BOOK-BANKING BOOK BOUNDARY: RECLASSIFICATIONS BETWEEN BOOKS	MKR MOV	Manuel
C90.00	TRADING BOOK THRESHOLDS	TBT	Manuel
C90.05	BOUNDARY: TRADING BOOK	BOU1	Manuel
C91.00	TRADING BOOK AND MARKET RISK THRESHOLDS (TBT)	MKR ASA SUM	Direct

### 2.1.3. EBA Leverage ratio

	Template		Mode d'alimentation
C 40.00	Alternative treatment of the exposure measure	LR1	Automatique

C 43.00	Alternative breakdown of leverage ratio exposure measure components	LR4	Automatique
C 44.00	General information	LR5	Manuel
C 47.00	Leverage ratio calculation	LRCalc	Automatique
C 48.01	Leverage ratio volatility: Mean value for the reporting period	LR6.1	Manuel
C 48.02	Leverage ratio volatility: Leverage ratio volatility: daily values for the reporting period	LR6.2	Manuel

#### 2.1.4. EBA G-SII

	Template		Mode d'alimentation
G 01.00	G-SII indicators and ebu items	GSII	Manuel

#### 2.1.5. EBA Large exposures

	Template		Mode d'alimentation
C 26.00	Large exposure limits	LE limits	Manuel
C 27.00	Identification of the counterparty	LE1	Automatique
C 28.00	Exposures in the non-trading and trading book	LE2	Automatique
C 29.00	Detail of the exposures to individual clients within groups of connected clients	LE3	Automatique

## 2.2. IRRBB

Code	Libellé du tableau	Périodicité de remise	Mode de remise
J01.00	EVALUATION OF THE IRRBB: EVE/NII SOT AND MV CHANGES	Trimestrielle	Direct
J02.00	BREAKDOWN OF SENSITIVITY ESTIMATE	Trimestrielle	Direct
J03.00	BREAKDOWN OF SENSITIVITY ESTIMATES (SIMPLIFIED FOR 'OTHER' INSTITUTIONS)	Trimestrielle	Direct
J04.00	BREAKDOWN OF SENSITIVITY ESTIMATES (SIMPLIFIED FOR SNCIS)	Trimestrielle	Direct
J05.00	REPRICING CASH FLOWS	Trimestrielle	Direct
J06.00	REPRICING CASH FLOWS (SIMPLIFIED FOR 'OTHER' INSTITUTIONS)	Trimestrielle	Direct
J07.00	REPRICING CASH FLOWS (SIMPLIFIED FOR SNCIS)	Trimestrielle	Direct
J08.00	ELEVANT PARAMETERS	Trimestrielle	Direct
J09.00	RELEVANT PARAMETERS (SIMPLIFIED FOR SNCIS AND 'OTHER' INSTITUTIONS)	Trimestrielle	Direct

J10.01	GENERAL QUALITATIVE INFORMATION	Annuelle	Direct
J10.02	QUALITATIVE INFORMATION "CURRENCY BY CURRENCY"	Annuelle	Direct
J11.01	GENERAL QUALITATIVE INFORMATION (SIMPLIFIED FOR SNCIS AND 'OTHER' INSTITUTIONS)	Annuelle	Direct
J11.02	QUALITATIVE INFORMATION "CURRENCY BY CURRENCY" (SIMPLIFIED FOR SNCIS AND 'OTHER' INSTITUTIONS)	Annuelle	Direct

### 2.3. FUNDING PLANS EBA

Code	Libellé du tableau	Périodicité de remise	Mode d'alimentation
P 01	Balance Sheet		
P.01.01	Assets	Annuelle	Direct
P 01.02	Liabilities	Annuelle	Direct
P 01.03	Forecast of Liquidity Ratios	Annuelle	Direct
P 02-2A	Funding reliances - Section 2A Specific Funding reliances		
P 02.01	Insured and uninsured deposits and uninsured deposit-like financial instruments	Annuelle	Direct
P 02.02	Public sector and Central Bank sources of funding	Annuelle	Direct
P 02.03	Public sector and Central Bank sources of funding	Annuelle	Direct
P 02-2B	Funding reliances - Section 2B Pricing		
P 02.04	Pricing: Loan Assets	Annuelle	Direct
P 02.05	Pricing: Deposit and other Liabilities	Annuelle	Direct
P.02-2C	Funding reliances - Section 2C Assets and Liabilities in Foreign and Reporting Currency		
P 02.06	Two Largest Significant Currencies and Reporting Currency	Annuelle	Direct
P 02-2D	Funding reliances - Section 2D Assets and Liabilities Restructuring Plans		
P 02.07	Loan Assets Acquisitions, Run-Offs and Disposals Plans	Annuelle	Direct
P 02.08	Deposit Liabilities Acquisition and Disposal Plans	Annuelle	Direct
P 04	Statement of profit or loss		
P 04.01	Statement of profit or loss	Annuelle	Direct
P 04.02	Statement of profit or loss for small and non complex credit institutions	Annuelle	Direct
P 05	Debt securities: issuances and redemptions		
P 05.00	Debt securities: issuances and redemptions	Annuelle	Direct

Ce reporting adresse les établissements de crédit ou assimilés.

## 2.4. INSTANT PAYMENT EBA

Code	Libellé du tableau	Périodicité de remise	Mode d'alimentation
<b>S 01</b>	<b>NUMBER AND VALUE OF CREDIT TRANSFER</b>		
S.01.00	NUMBER AND VALUE OF CREDIT TRANSFER AND INSTANT CREDIT TRANSFER	Annuelle	Direct
<b>S 02</b>	<b>CHARGES FOR CREDIT TRANSFERS</b>		
S 02.00	CHARGES FOR CREDIT TRANSFERS AND INSTANT CREDIT TRANSFERS	Annuelle	Direct
<b>S 03</b>	<b>PAYMENT ACCOUNTS</b>		
S 03.00	NUMBER OF PAYMENT ACCOUNTS AND TOTAL CHARGES	Annuelle	Direct
<b>S 04</b>	<b>REJECTED TRANSACTIONS</b>		
S 04.00	NUMBER OF REJECTED TRANSACTIONS	Annuelle	Direct

## 2.5. SRF SRB

Code	Libellé	Périodicité de remise	Mode d'alimentation
EA01	01 - General information	Annuelle	Direct
EA02	02 - Basic annual contribution	Annuelle	Direct
EA03	03 - Deductions	Annuelle	Direct
EA04	04 - Risk adjustment	Annuelle	Direct

## 2.6. SBP EBA

Code	Libellé	Périodicité de remise	Mode d'alimentation
C101	Low Default Portfolio Counterparties	Annuelle	Direct
C102	Details on exposures in Low Default Portfolios	Annuelle	Direct
C103	Details on exposures in High Default Portfolios	Annuelle	Direct
C105	Internal models	Annuelle	Direct
C106	Initial Market Valuation	Annuelle	Direct
C107	Var, SVar and PV	Annuelle	Direct
C108	Profit & loss time series	Annuelle	Direct
C109	Incremental Risk Change	Annuelle	Direct
C110	Correlation Trading	Annuelle	Direct
C111	Details on exposures in Low Default Portfolios by counterparty	Annuelle	Direct
C112	Details on exposures in Low Default Portfolios by counterparty by economic scenario	Annuelle	Direct
C113	Details on exposures in Low Default Portfolios by counterparty by facility	Annuelle	Direct
C114	Details on macroeconomic scenarios per country	Annuelle	Direct
C115	Details on exposures in High Default Portfolios	Annuelle	Direct
C116	Details on exposures in High Default Portfolios by economic scenario	Annuelle	Direct
C117	Details on exposures in High Default Portfolios by staging	Annuelle	Direct
C118	Details on macroeconomic scenarios per GDP Area code	Annuelle	Direct
C120	SBM	Annuelle	Direct

## 2.7. RUBA

Code	Nom Court	Libellé du tableau	Périodicité de remise	Mode d'alimentation
R011	INFO_LIQ	Prévisions de trésorerie	Trimestrielle	Automatique
R021	SITUATION_FRANCE	Situation - France	Trimestrielle	Automatique
R022	SITUATION_TZ	Situation - Toutes zones	Trimestrielle	Automatique

R023	SITUATION_RDM	Situation - Reste du monde	Trimestrielle	Automatique
R024	SITUATION_ZIEDOM	Situation - ziedom	Trimestrielle	Automatique
R025	SITUATION_ZIEOM	Situation - zieom	Trimestrielle	Automatique
R031	TIT_TRANS_FRANCE	Opérations sur titres de transaction, op. diverses et valeurs immobilisées - France	Trimestrielle	Automatique
R032	TIT_TRANS_TZ	Opérations sur titres de transaction, op. diverses et valeurs immobilisées - Toutes zones	Trimestrielle	Automatique
R033	TIT_TRANS_RDM	Opérations sur titres de transaction, op. diverses et valeurs immobilisées - Reste du monde	Trimestrielle	Automatique
R041	ITB_RESID	Opérations interbancaires avec les résidents	Trimestrielle	Automatique
R051	ITB_NRESI	Opérations interbancaires avec les non-résidents	Trimestrielle	Automatique
R061	CLIENT_RE_FRANCE	Opérations avec la clientèle résidente - France	Trimestrielle	Automatique
R062	CLIENT_RE_ZIEDOM	Opérations avec la clientèle résidente - ziedom	Trimestrielle	Automatique
R063	CLIENT_RE_ZIEOM	Opérations avec la clientèle résidente - zieom	Trimestrielle	Automatique
R071	CLIENT_NR_FRANCE	Opérations avec la clientèle non-résidente - France	Trimestrielle	Automatique
R072	CLIENT_NR_ZIEDOM	Opérations avec la clientèle non-résidente - ziedom	Trimestrielle	Automatique
R073	CLIENT_NR_ZIEOM	Opérations avec la clientèle non-résidente - zieom	Trimestrielle	Automatique
R081	PENS_LIVR	Pensions livrées	Trimestrielle	Automatique
R091	TITRE_PTF	Portefeuille titres et titres émis	Trimestrielle	Automatique
R101	IFT_ResNR	Instruments conditionnels par résidence de contrepartie	Trimestrielle	Automatique
R111	M_SITMENS	Situation Mensuelle	Mensuelle	Automatique
R121	M_AGENTnR	Opérations avec les agents non résidents	Mensuelle	Automatique
R131	M_CLIENRE	Opérations avec la clientèle résidente - monétaires	Mensuelle	Automatique
R141	M_CLIENnR	Opérations avec la clientèle non-résidente	Mensuelle	Automatique
R151	M_PENLIVR	Pensions livrées sur titres	Mensuelle	Automatique
R161	M_OPETITR	Portefeuille titres et titres émis - monétaires	Mensuelle	Automatique
R171	M_CREDOUT	Dépréciations sur créances douteuses	Mensuelle	Automatique
R181	M_CREANCE	Abandons et cessions de créances	Mensuelle	Automatique
R191	M_LIGNCRE	Lignes de crédit par résidence de contrepartie - hors bilan	Mensuelle	Automatique
R201	M_CESSCRE	Encours de crédit titrisés	Mensuelle	Automatique
R211	M_ELECTRO	Encours de monnaie électronique	Trimestrielle	Automatique
R226	DEVI_SITU_RFR_EUR	DEVI_SITU - France - Emplois et ressources par devises et par pays - EUR / Résident France	Trimestrielle	Automatique
R227	DEVI_SITU_RFR_DEV	DEVI_SITU - France - Emplois et ressources par	Trimestrielle	Automatique

		devises et par pays - Devises hors Euro / Résident France		
R228	DEVI_SITU_NR_EUR	DEVI_SITU - France - Emplois et ressources par devises et par pays - EUR / Non résident France	Trimestrielle	Automatique
R229	DEVI_SITU_NR_DEV	DEVI_SITU - France - Emplois et ressources par devises et par pays - Devises hors Euro / Non résident France	Trimestrielle	Automatique
R231	RESER_OBL	Réserves obligatoires	Mensuelle	Automatique
R241	M_TITPRIM	Portefeuille titres (valor. prix marché)	Trimestrielle	Automatique
R251	M_TITVALC	Portefeuille titres (valorisation comptable)	Trimestrielle	Automatique
R261	M_INTENCO	Elts calcul tx intérêt apparents sur les encours	Mensuelle	Automatique
R271	M_INTDEPO	Elts cal.tx int.apparents/dép.à vue, remb., découverts et op. assimilées	Mensuelle	Automatique
R281	M_INTNOUA	Taux d'intérêt des contrats nouveaux agrégés	Mensuelle	Automatique
R291	M_FLUDINT	Flux d'intérêts Trimestrielles	Trimestrielle	Automatique
R301	CANTONNEM	Cantonement des fonds de la clientèle des entreprises d'investissement	Trimestrielle	Automatique
R311	CANTON_EP	Cantonement des fonds de la clientèle des établissements de paiement	Trimestrielle	Automatique
R321	CANTO_EME	Cantonement des fonds de la clientèle des établissements de monnaie électronique	Trimestrielle	Direct
R331	VOLUME_EP_FRANCE	Volume des paiements, en montants et en nombre de transactions - France	Trimestrielle	Direct
R332	VOLUME_EP_ETRANGER	Volume des paiements, en montants et en nombre de transactions - Etranger	Trimestrielle	Direct
R341	VOLUM_EME	Ventilation de monnaie électronique	Mensuelle	Direct
R351	COEF_LIQ	Eléments de calcul du coefficient de liquidité	Trimestrielle	Automatique
R361	RESU_INFI	Résultats des opérations sur instruments financiers	Trimestrielle	Automatique
R371	C_IMPAYES	Créances impayées	Trimestrielle	Automatique
R381	CAPITAUXP	Provisions, capitaux propres et assimilés	Semestrielle	Automatique
R391	INTRA_GPE	Opérations avec le groupe	Semestrielle	Automatique
R401	IFT_ENGAG	Instruments conditionnels et engagements sur IFT négociés de gré a gré	Trimestrielle	Automatique
R411	CLIENT_CB	Opérations de crédit-bail et opérations assimilées	Semestrielle	Automatique
R421	MATURITES_TZ_EUR_DEV	Répartition emplois, ress., engag.h.b., selon durée r.a.c. - ttes zones - euros devises	Trimestrielle	Automatique
R422	MATURITES_TZ_TTES_MONNAIES	Répartition emplois, ress., engag.h.b., selon durée	Trimestrielle	Automatique



		r.a.c. - ttes zones - ttes monnaies		
R423	MATURITES_ZIEDOM_EUR_DEV	Répartition emplois, ress., engag.h.b., selon durée r.a.c. - ziedom - euros devises	Trimestrielle	Automatique
R424	MATURITES_ZIEDOM_TTES_MONNAIES	Répartition emplois, ress., engag.h.b., selon durée r.a.c. - ziedom - ttes monnaies	Trimestrielle	Automatique
R425	MATURITES_ZIEOM_EUR_DEV	Répartition emplois, ress., engag.h.b., selon durée r.a.c. - zieom - euros devises	Trimestrielle	Automatique
R426	MATURITES_ZIEOM_TTES_MONNAIES	Répartition emplois, ress., engag.h.b., selon durée r.a.c. - zieom - ttes monnaies	Trimestrielle	Automatique
R441	ORDRE_SRD	Ordres stipulés à règlement livraison différé	Trimestrielle	Automatique
R451	MON_ELECT	Monnaie électronique	Trimestrielle	Direct
R461	M_CREBAIL	Opérations de crédit-bail et assimilées	Semestrielle	Automatique
R471	M_RESEAug	Op. des guichets des banques à réseau	Annuelle	Automatique
R481	M_APULRES	Opérations avec les administrations publiques résidentes	Trimestrielle	Automatique
R491	M_CATRESI	Opérations sur les comptes à terme	Trimestrielle	Automatique
R501	ENGAG_INT	Risques liés a l'activité bancaire internationale	Trimestrielle	Automatique
R511	CAEFP_EME_SOCIAL	Exigences de fonds propres spécifiques aux établissements de monnaie électronique - social	Trimestrielle	Direct
R521	IMPLANTAT_SOCIAL Annuelle	Cartographie des implantations - social Annuelle	Annuelle	Direct
R522	IMPLANTAT_CONSO Annuelle	Cartographie Annuelle - conso normes FR	Annuelle	Direct
R523	IMPLANTAT_CONSO SEMESTRIELLE	Cartographie Semestrielle - conso normes FR	Semestrielle	Direct
R531	EFFECTIFS_FRANCE	Indicateurs d'activité : effectifs,comptes - France	Annuelle	Direct
R532	EFFECTIFS_TZ	Indicateurs d'activité : effectifs,comptes - Toutes zones	Annuelle	Direct
R533	EFFECTIFS_ZIEDOM	Indicateurs d'activité : effectifs,comptes - ziedom	Annuelle	Direct
R534	EFFECTIFS_ZIEOM	Indicateurs d'activité : effectifs,comptes - zieom	Annuelle	Direct
R541	RESU_IFT	Résultats des opérations sur instruments financiers à terme	Semestrielle	Automatique
R551	BILA_CONS	Bilan consolidé	Semestrielle	Automatique
R561	RESU_CONS	Compte de résultat consolidé	Semestrielle	Automatique
R571	CPTÉ_RESU_FRANCE	Compte de résultat - France	Semestrielle	Automatique
R572	CPTÉ_RESU_TZ	Compte de résultat - Toutes zones	Semestrielle	Automatique
R573	CPTÉ_RESU_ZIEDOM	Compte de résultat - ziedom	Semestrielle	Automatique
R574	CPTÉ_RESU_ZIEOM	Compte de résultat - zieom	Semestrielle	Automatique
R582	SCF_RCOUV	Eléments de calcul du ratio de couverture et de contrôle des limites	Trimestrielle	Direct

R592	SCF_TRESO	Éléments de calcul couverture des besoins de trésorerie (article R. 513-7 du code monétaire et financier)	Trimestrielle	Direct
R602	SCF_DVIMO	Éléments de calcul de l'écart de durée de vie moyenne entre actifs et passifs	Trimestrielle	Direct
R611	PLAN_COUV	Plan de couverture des ress. privilégiées et éltis de calcul du niveau de couverture des ress. privilégiées	Trimestrielle	Direct
R621	RESU_REPA	Affectation du résultat	Annuelle	Direct
R631	I_AGENRES	IEOM - Operations avec la clientèle résidente ventilation dans/hors du territoire	Trimestrielle	Automatique
R641	I_CREDEF	IEOM - Opérations avec la clientèle résidente, crédits refinancables ieom	Trimestrielle	Automatique
R651	I_EPARGCOL	Epargne collectée OM pour le compte d'autres établissements	Trimestrielle	Automatique
R661	I_OPECRES	Opérations de financement avec les établissements résidents	Trimestrielle	Automatique
R671	I_VALMPTF	Portefeuille de valeurs mobilières et assurance vie	Trimestrielle	Automatique
R681	I_CLIENRE	IEDOM/IEOM Opérations avec la clientèle non financière résidente	Trimestrielle	Automatique
R691	I_DEVISIT	Emplois et ressources par devises et par pays	Trimestrielle	Automatique
R701	I_RESOBLI	Réserves obligatoires - Outre-mer	Trimestrielle	Automatique
R711	M_CASHPLG	ash pooling	Mensuelle	Automatique
R721	CA_EP	Fonds propres des établissements de paiement	Trimestrielle	Direct
RSCX	M_CESSCRESNFAPU	Encours de crédits aux SNF ou aux APU titrisés ou cédés	Mensuelle	Automatique
R731	DEPOTS ET CREDITS	Centralisation des dépôts et crédits	Mensuelle	Automatique
R741	NOMBRE DE COMPTES	Centralisation annuelle du nombre de comptes	Annuelle	Automatique
R751	CREDIT NOUVEAUX A L'HABITAT	Centralisation trimestrielle de crédits nouveaux à l'habitat consentis aux ménages	Trimestrielle	Direct
R761	OBLIGATIONS GARANTIES	Éléments permettant l'octroi et le contrôle du label « obligation garantie européenne de qualité supérieure »	Trimestrielle	Direct

## 2.8. RP EBA

Code	Libellé	Périodicité de remise	Mode d'alimentation
Z01	Z01 - Organisational structure	Annuelle	Direct
Z02	Z02 - Own funds requirements	Annuelle	Direct
Z03	Z03 - Own funds requirements	Annuelle	Direct
Z04	Z04 - Intragroup financial interconnections	Annuelle	Direct
Z05	Z05 - Major counterparties	Annuelle	Direct
Z06	Z06 - Deposit insurance	Annuelle	Direct
Z07	Z07 - Critical functions and core business lines	Annuelle	Direct

Z08	Z08 - Critical services	Annuelle	Direct
Z09	Z09 - FMI services - providers and users	Annuelle	Direct
Z10	Z10 - Information systems	Annuelle	Direct

## 2.9. REM

Code	Libellé	Périodicité de remise	Mode d'alimentation
R01	General information and information on remuneration of all staff	Annuelle	Direct
R02	Information on remuneration of identified staff	Annuelle	Direct
R03	Information on identified staff remunerated EUR 1 million or more per financial year	Annuelle	Direct
R05	Derogations from the application of requirements to pay out parts of variable remuneration deferred and in instruments	Annuelle	Direct
R09	Remuneration awarded for the financial year	Annuelle	Direct
R10	Special payments to staff whose professional activities have a material impact on institutions risk profile	Annuelle	Direct
R11	Deferred remuneration	Annuelle	Direct
R12	Information on remuneration of staff whose professional activities have a material impact on institutions risk profile	Annuelle	Direct
R04	Information on the remuneration of high earners	Annuelle	Direct
R06	Information on the gender pay gap	Annuelle	Direct
R07	Approved higher ratios between variable and fixed remuneration – institutions	Annuelle	Direct

## 2.10. PROTIDE

Code	Libellé	Périodicité de remise	Mode d'alimentation
P01	Encours titres agrégés	Trimestrielle	Automatique
P03	Encours titre par titre	Trimestrielle	Automatique
P03M	Encours titre par titre (Mensuel)	Mensuelle	Automatique

## 2.11. OSCAMPS

Code	Libellé	Périodicité de remise	Mode d'alimentation
OS11	A71DSP2	Mensuelle	Direct
C1	Dénombrement des cartes et supports de monnaie électronique par fonctions et types associés	Semestrielle	Automatique
C10	Commentaires ventilés par moyen de paiement	Semestrielle	Direct
C1A	Dénombrement des cartes par réseau	Semestrielle	Automatique
C2A	Dénombrement des contrats commerçants d'acceptation cartes	Semestrielle	Automatique
C3	Dénombrement des terminaux de paiement selon leurs fonctions, par zone géographique et pays associés	Semestrielle	Automatique
C4B	Agrégats ventilés par moyen de paiement et type d'opération par zone géographique et pays	Semestrielle	Automatique
C5	Opérations de retrait à partir de cartes ventilées par pays, schéma de paiement et fonction de la carte	Semestrielle	Automatique
C6	Paiements en monnaie électronique et paiements initiés en tant que PSIP	Semestrielle	Automatique
C6A	Paiements par cartes ventilés par pays et type de canal	Semestrielle	Automatique
C6B	Paiements par cartes et virements ventilés par pays, schéma de paiement et type d'authentification	Semestrielle	Automatique
C6C	Paiements par cartes ventilés par pays, schéma de paiement et fonction de la carte	Semestrielle	Automatique
C7	Agrégats ventilés par moyen de paiement, type d'opération et système d'échange toutes zones	Semestrielle	Automatique
C8	Paiements par monnaie électronique et virements émis ventilés par pays et type de canal	Semestrielle	Automatique

C9	Prélèvements émis ventilés par pays et type de canal	Semestrielle	Automatique
F10	Agrégats fraude en valeur ventilés par moyen de paiement et porteur du préjudice	Semestrielle	Automatique
F11	Fraude sur chèques et LCRBOR émis ventilés par origine de la fraude	Semestrielle	Automatique
F12	Commentaires	Semestrielle	Direct
F1A	Agrégats ventilés par moyen de paiement, type de transaction, type d'authentifications et origine de la fraude	Semestrielle	Automatique
F1B	Agrégats ventilés par moyen de paiement, type de transaction, type d'authentification et origine de la fraude	Semestrielle	Automatique
F2	Fraude sur paiements par cartes ventilés par pays et type de canal	Semestrielle	Automatique
F2AA	Fraude sur paiements par cartes émises par l'établissement par réseau, type d'authentification et origine de la fraude	Semestrielle	Automatique
F2AB	Fraude sur paiements par cartes acquis par l'établissement par réseau, type d'authentification et origine de la fraude	Semestrielle	Automatique
F2AC	Fraude sur virements émis par schéma de paiement, type d'authentification et origine de la fraude	Semestrielle	Automatique
F2B	Fraude sur paiements par cartes ventilés par schéma de paiement et fonction de la carte	Semestrielle	Automatique
F3	Fraude sur opérations de retrait à partir de cartes ventilés par schéma de paiement et pays	Semestrielle	Automatique
F3A	Fraude sur opérations de retrait à partir de cartes ventilés par schéma de paiement et origine de la fraude	Semestrielle	Automatique
F4	Fraude sur virements émis ventilés par type de canal	Semestrielle	Automatique
F6	Fraude sur prélèvements émis ventilés par schéma de paiement et origine de la fraude	Semestrielle	Automatique
F8	Fraude sur paiements en monnaie électronique émis par type d'authentification et origine de la fraude	Semestrielle	Automatique
F9	Paiements en monnaie électronique et initiés par un PSIP ventilés par pays et type d'authentification	Semestrielle	Automatique
CT1	Opérations impliquant des non-IFM effectuées en virements	Trimestrielle	Automatique
CT2	Opérations impliquant des non-IFM effectuées à partir de cartes	Trimestrielle	Automatique
CT3	Opérations impliquant des non-IFM effectuées en monnaie électronique, chèques ou prélèvements	Trimestrielle	Automatique

## 2.12. M\_TITTRAN

Code	Nom court	Libellé	Périodicité de remise	Mode d'alimentation
RS01	M_TITTRAN	Recensement des contrats nouveaux	Mensuelle	Automatique

## 2.13. M\_CONTRAN

Code	Nom court	Libellé	Périodicité de remise	Mode d'alimentation
RS02	M_CONTRAN	Recensement des contrats nouveaux	Trimestrielle	Automatique

## 2.14. MRELTAC EBA

Code	Libellé	Périodicité de remise	Mode d'alimentation
M01	MREL and TLAC key metrics (resolution groups / entities) (KM2)	Trimestrielle	Direct
M02	MREL and TLAC capacity and composition (resolution groups / entities) (TLAC1)	Trimestrielle	Direct
M03	Internal MREL and internal TLAC (ILAC)	Trimestrielle	Direct
M04	Funding structure of eligible liabilities (LIAB MREL)	Trimestrielle	Direct
M05	Creditor ranking (entity that is not a resolution entity) (TLAC2)	Trimestrielle	Direct
M06	Creditor ranking (resolution entities) (TLAC3)	Trimestrielle	Direct
M07	Instruments governed by third-country law (MTCI)	Trimestrielle	Direct

## 2.15. LIQUIDITY

Code	Libellé	Périodicité de remise	Mode d'alimentation
<b>Liquidity - Delegated Act</b>			
C72	LIQUIDITY COVERAGE - LIQUID ASSETS	Mensuelle	Automatique
C73	LIQUIDITY COVERAGE - OUTFLOWS	Mensuelle	Automatique
C74	LIQUIDITY COVERAGE - INFLOWS	Mensuelle	Automatique
C75	LIQUIDITY COVERAGE - COLLATERAL SWAPS	Mensuelle	Direct
C76	LIQUIDITY COVERAGE - CALCULATIONS	Mensuelle	Direct
C77	LIQUIDITY COVERAGE - PERIMETER	Mensuelle	Direct
C80	NSFR - REQUIRED STABLE FUNDING	Trimestrielle	Automatique
C81	NSFR - AVAILABLE STABLE FUNDING	Trimestrielle	Automatique
C82	NSFR - SIMPLIFIED REQUIRED STABLE FUNDING	Trimestrielle	Automatique
C83	NSFR - SIMPLIFIED AVAILABLE STABLE FUNDING	Trimestrielle	Automatique
C84F	NSFR Summary (Fully-fledged NSFR)	Trimestrielle	Direct
C84S	NSFR Summary (Simplified NSFR)	Trimestrielle	Direct
<b>Additional liquidity monitoring metrics</b>			
C66	MATURITY LADDER	Mensuelle	Automatique
C67	CONCENTRATION OF FUNDING BY COUNTERPARTY	Mensuelle	Direct
C68	Concentration of funding by product type	Mensuelle	Direct
C69	PRICES FOR VARIOUS LENGTHS OF FUNDING	Mensuelle	Direct
C70	ROLL OVER FUNDING	Mensuelle	Direct
C71	CONCENTRATION OF COUNTERBALANCING CAPACITY BY ISSUER/COUNTERPARTY	Mensuelle	Direct

## 2.16. LDR SRB

Code	Libellé	Périodicité de remise	Mode d'alimentation
T01	T01 - Liability Structure	Annuelle	Direct
T02	T02 - Own Funds	Annuelle	Direct
T03	T03 - Intragroup Liabilities	Annuelle	Direct
T04	T04 - Securities (including CET1, AT1 & Tier 2 instruments; excluding intragroup)	Annuelle	Direct
T05	T05 - All deposits (excluding intra-group)	Annuelle	Direct
T06	T06 - Other financial Liabilities (not included in other tabs, excluding intragroup)	Annuelle	Direct
T07	T07 - Derivatives	Annuelle	Direct
T08	T 08 - Secured finance, excluding intragroup	Annuelle	Direct
T09	T09 - Other non-Financial Liabilities (not included in other tabs, excluding intragroup)	Annuelle	Direct
T12	T12 - Major off-balance sheet counterparties	Annuelle	Direct
T99	T 99 - Identification of the report	Annuelle	Direct

## 2.17. LCB-FT

Code	Nom court	Libellé	Périodicité de remise	Mode d'alimentation
B000	B0 QLB APPLICABLE	Détermination du questionnaire applicable banque	Annuelle	Direct
B001	B0 QLB GENERAL	Contenu de la remise - QLB général banque (hors B4)	Annuelle	Direct
B004	B0 QLB ALLEGE 1	Contenu de la remise - QLB allégé banque 1 (hors B4)	Annuelle	Direct

B005	B0 QLB ALLEGE 2	Contenu de la remise - QLB allégé banque 2 (hors B4)	Annuelle	Direct
B006	B0 QLB GROUPE	Contenu de la remise - Approche groupe (B4)	Annuelle	Direct
B009	B0 QLB Mensuel ou Trimestriel	Contenu de la remise - QLB Mensuel ou Trimestriel (tableau technique non déclaré)	Mensuelle	Direct
B011	B1 INFO GENERALES	Informations générales sur l'activité et classification des risques par l'organisme	Annuelle	Direct
B021	B2-1 IDENTITES	Identité des responsables, déclarants et correspondants	Annuelle	Direct
B022	B2-2 ORGANISATION	Organisation du dispositif LCB-FT	Annuelle	Direct
B031	B3 CONTROLE INTERNE	Contrôle interne du dispositif LCB-FT et du dispositif d'identification des clients, des comptes et des personnes	Annuelle	Direct
B041	B4 APPROCHE GROUPE	Approche groupe	Annuelle	Direct
B051	B5 MESURES DE VIGILANCE	Mesures de vigilance adaptées aux risques BC-FT et détection des opérations suspectes	Annuelle	Direct
B061	B6 GEL DES AVOIRS	Gel des avoirs et mesures restrictives	Annuelle	Direct
B071	B7-1 PSP ET PSI	Questionnaire sectoriel PSP et PSI	Annuelle	Direct
B081	B8 STATISTIQUES	Données statistiques	Annuelle	Direct
B091	B9 PSP DEFAILLANT PAIEMENT	Déclaration PSP défaillant intervenant dans la chaîne de paiement	Annuelle	Direct
B101	B10 COMMENTAIRES	Commentaires libres	Annuelle	Direct

## 2.18. FINREP NG

Code	Libellé	Périodicité de remise	Mode d'alimentation
<b>FinRep NGAAP BAD (IFRS9)</b>			
BF01	Balance Sheet Statement (Statement of Financial Position)	Trimestrielle	Automatique
BF02	Statement of profit or loss	Trimestrielle	Automatique
BF03	Statement of comprehensive income	Trimestrielle	Automatique
BF04	Breakdown of financial assets by instrument and by counterparty sector	Trimestrielle	Automatique
BF05	Breakdown of non-trading loans and advances by product	Trimestrielle	Automatique
BF06	Breakdown of non-trading loans and advances to non-financial corporations by NACE codes	Trimestrielle	Automatique
BF07	Financial assets subject to impairment that are past due	Trimestrielle	Automatique
BF08	Breakdown of financial liabilities	Trimestrielle	Automatique
BF09	Loan commitments, financial guarantees and other commitments	Trimestrielle	Automatique
BF10	Derivatives - Trading and economic hedge	Trimestrielle	Automatique
BF11	Hedge accounting	Trimestrielle	Automatique
BF12	Movements in allowances and provisions for credit losses	Trimestrielle	Automatique
BF13	Collateral and guarantees received	Trimestrielle	Automatique
BF14	Fair value hierarchy: financial instruments at fair value	Trimestrielle	Automatique
BF15	Derecognition and financial liabilities associated with transferred financial assets	Trimestrielle	Automatique
BF16	Breakdown of selected statement of profit or loss items	Trimestrielle	Automatique
BF17	Reconciliation between Accounting and CRR scope of consolidation: Balance Sheet	Trimestrielle	Automatique
BF18	Information on performing and non-performing exposures	Trimestrielle	Automatique
BF19	Information forborne exposures	Trimestrielle	Automatique
BF20	Geographical breakdown	Trimestrielle	Automatique

BF21	Tangible and intangible assets: assets subject to operating lease	Trimestrielle	Automatique
BF22	Asset management, custody and other service functions	Trimestrielle	Automatique
BF23	Loans and advances: additional information	Trimestrielle	Automatique
BF24	Loans and advances - Flows of non performing exposures, impairment & write offs since the end of the last financial year	Trimestrielle	Automatique
BF25	Collateral obtained by taking possession and execution processes	Trimestrielle	Automatique
BF26	Forbearance management and quality of forbearance	Trimestrielle	Automatique
BF30	Off-balance sheet activities: Interests in unconsolidated structured entities	Semestrielle	Automatique
BF31	Related parties	Semestrielle	Automatique
BF40	Group structure	Annuelle	Automatique
BF41	Fair value	Annuelle	Automatique
BF42	Tangible and intangible assets: carrying amount by measurement method	Annuelle	Automatique
BF43	Provisions	Annuelle	Automatique
BF44	Defined benefit plans and employee benefits	Annuelle	Direct
BF45	Breakdown of selected items of statement of profit or loss	Annuelle	Automatique
BF46	Statement of changes in equity	Annuelle	Automatique
BF47	Loans and advances: Average duration and recovery periods	Annuelle	Direct
<b>FinRep NGAAP BAD Data Point (IFRS9)</b>			
BD01	Balance Sheet Statement (Statement of Financial Position)	Trimestrielle	Automatique
BD02	Statement of profit or loss	Trimestrielle	Automatique
BD05	Breakdown of non-trading loans and advances by product	Trimestrielle	Automatique
BD08	Breakdown of financial liabilities	Trimestrielle	Automatique
BD10	Derivatives - Trading and economic hedge	Trimestrielle	Automatique
BD11	Hedge accounting	Trimestrielle	Automatique
BD18	Information on performing and non-performing exposures	Trimestrielle	Automatique
BD19	Information forborne exposures	Trimestrielle	Automatique

## 2.19. FINREP IFRS EBA

Code	Libellé	Périodicité de remise	Mode d'alimentation
F01	Balance Sheet Statement (Statement of Financial Position)	Trimestrielle	Automatique
F02	Statement of profit or loss	Trimestrielle	Automatique
F03	Statement of comprehensive income	Trimestrielle	Automatique
F04	Breakdown of financial assets by instrument and by counterparty sector	Trimestrielle	Automatique
F05	Breakdown of non-trading loans and advances by product	Trimestrielle	Automatique
F06	Breakdown of non-trading loans and advances to non-financial corporations by NACE codes	Trimestrielle	Automatique
F07	Financial assets subject to impairment that are past due	Trimestrielle	Automatique
F08	Breakdown of financial liabilities	Trimestrielle	Automatique
F09	Loan commitments, financial guarantees and other commitments	Trimestrielle	Automatique
F10	Derivatives - Trading and economic hedge	Trimestrielle	Automatique
F11	Hedge accounting	Trimestrielle	Automatique
F12	Movements in allowances and provisions for credit losses	Trimestrielle	Automatique
F13	Collateral and guarantees received	Trimestrielle	Automatique
F14	Fair value hierarchy: financial instruments at fair value	Trimestrielle	Automatique

F15	Derecognition and financial liabilities associated with transferred financial assets	Trimestrielle	Automatique
F16	Breakdown of selected statement of profit or loss items	Trimestrielle	Automatique
F17	Reconciliation between Accounting and CRR scope of consolidation: Balance Sheet	Trimestrielle	Automatique
F18	Information on performing and non-performing exposures	Trimestrielle	Automatique
F19	Information forborne exposures	Trimestrielle	Automatique
F20	Geographical breakdown	Trimestrielle	Automatique
F21	Tangible and intangible assets: assets subject to operating lease	Trimestrielle	Automatique
F22	Asset management, custody and other service functions	Trimestrielle	Automatique
F23	Loans and advances: additional information	Trimestrielle	Automatique
F24	Loans and advances - Flows of non performing exposures, impairment & write offs since the end of the last financial year	Trimestrielle	Automatique
F25	Collateral obtained by taking possession and execution processes	Trimestrielle	Automatique
F26	Forbearance management and quality of forbearance	Trimestrielle	Automatique
F30	Off-balance sheet activities: Interests in unconsolidated structured entities	Semestrielle	Automatique
F31	Related parties	Semestrielle	Automatique
F40	Group structure	Annuelle	Automatique
F41	Fair value	Annuelle	Automatique
F42	Tangible and intangible assets: carrying amount by measurement method	Annuelle	Automatique
F43	Provisions	Annuelle	Automatique
F44	Defined benefit plans and employee benefits	Annuelle	Direct
F45	Breakdown of selected items of statement of profit or loss	Annuelle	Automatique
F46	Statement of changes in equity	Annuelle	Automatique
F47	Loans and advances: Average duration and recovery periods	Annuelle	Direct

## 2.20. CREDITIMMO

Code	Nom court	Libellé	Périodicité de remise	Mode d'alimentation
H011	CREDITHAB	Indicateurs mensuels de suivi de la distribution du crédit à l'habitat en France	Mensuelle	Direct
H021	RENTIMMO1	Indicateurs de suivi de la rentabilité des crédits immobiliers en France - Nouveaux crédits mis en force	Trimestrielle	Direct
H031	RENTIMMO2	Indicateurs de suivi de la rentabilité des crédits immobiliers en France - Renégociations	Trimestrielle	Direct
H041	RENTIMMO3	Indicateurs de suivi de la rentabilité des crédits immobiliers en France - Encours	Semestrielle	Direct

## 2.21. BDP

Code	Libellé court	Libellé	Périodicité de remise	Mode d'alimentation
RPC	RPC	Collecte sur les paiements transfrontaliers des établissements de crédit et de paiement pour compte de la clientèle	Mensuelle	Automatique
A1	FID_A1	Compte rendu d'investissement direct ou immobilier français à l'étranger	Aucune	Direct
A2	FID_A2	Compte rendu de désinvestissement direct ou immobilier français à l'étranger	Aucune	Direct
B1	FID_B1	Compte rendu d'investissement direct ou immobilier étrangers en France	Aucune	Direct
B2	FID_B2	Compte rendu de désinvestissement direct ou immobilier étrangers en France	Aucune	Direct
HIFD	CRTHPFD	Compte-rendu de transaction des intermédiaires financiers - Hors Instruments Financiers Dérivés	Mensuelle	Automatique



IFDF	CRTPFDF	Compte-rendu de transaction des intermédiaires financiers - Flux sur Instruments Financiers Dérivés	Mensuelle	Automatique
IFDS	CRTPFDS	Compte-rendu de transaction des intermédiaires financiers - Stock d'Instruments Financiers Dérivés	Trimestrielle	Automatique
SID	SFP_SID	Stocks d'investissements directs à l'étranger des intermédiaires financiers résidents	Annuelle	Direct

## 2.22. AE EBA

Code	Libellé	Périodicité de remise	Mode d'alimentation
F32	ENCUMBRANCE OVERVIEW	Trimestrielle	Automatique
F33	MATURITY DATA	Trimestrielle	Automatique
F34	CONTINGENT ENCUMBRANCE	Annuelle	Automatique
F35	COVERED BONDS ISSUANCE	Trimestrielle	Automatique
F36	ADVANCE DATA	Semestrielle	Automatique

## 2.23. FINANCIAL MARKET INFRA SRB

Code	Libellé	Périodicité de remise	Mode d'alimentation
T30.00	FMI services - Providers and Users	Annuelle	Direct
T31.00	FMI services - Mapping to Critical Functions	Annuelle	Direct
T32.00	FMI services - Mapping to core business lines	Annuelle	Direct
T33.00	FMI services - Key metrics	Annuelle	Direct

## 2.24. DIVERSITY BENCHMARKING EBA

Code	Libellé	Périodicité de remise	Mode d'alimentation
R13.00	Corporate information	Annuelle	Direct
R14.00	Executive directors age and gender	Annuelle	Direct
R15.00	Composition of specific committees of the management body in its supervisory function	Annuelle	Direct
R16.00	Non executive directors age and gender	Annuelle	Direct
R17.00	Newly appointed executive directors (including CEO)	Annuelle	Direct
R18.00	Newly appointed non-executive directors (including Chairperson)	Annuelle	Direct
R19.00	Business regions/Geographical provenance	Annuelle	Direct
R20.00	Educational background of members of the management body	Annuelle	Direct
R21.00	Professional background of members of the management body	Annuelle	Direct
R22.01	Diversity policy. Nomination and gender diversity	Annuelle	Direct
R22.02	Diversity policy. Quantitative targets set within the diversity policy	Annuelle	Direct
R22.03	Diversity policy. Other aspects than gender included in the diversity policy	Annuelle	Direct
R23.00	Gender Pay Gap Benchmarking	Annuelle	Direct

## 2.25. CRITICAL FUNCTIONS SRB

Code	Libellé	Périodicité de remise	Mode d'alimentation
T98.00	Critical Functions - General information	Annuelle	Direct

---

T20.01	Critical Functions – Deposits	Annuelle	Direct
T20.02	Critical Functions - Lending	Annuelle	Direct
T20.03	Critical Functions - Payments, Cash, Settlement, Clearing, Custody	Annuelle	Direct
T20.04	Critical Functions - Capital Markets	Annuelle	Direct
T20.05	Critical Functions - Wholesale funding	Annuelle	Direct