

S.23.01 - Fonds propres - Taxonomie Solvabilité II AEAPP 2.7.0

Observations générales:

La présente annexe fournit des instructions supplémentaires pour l'emploi des modèles figurant à l'annexe I du présent règlement. La première colonne des tableaux précise les éléments à déclarer; les numéros de colonne et de ligne indiqués correspondent aux modèles de l'annexe I.

Cette section concerne les déclarations trimestrielles en matière de stabilité financière demandées aux groupes.

Le modèle s'applique aux trois méthodes de calcul du capital de solvabilité requis du groupe. La plupart des éléments s'appliquant à la partie du groupe couverte par la première méthode, les éléments applicables lors de l'utilisation de la déduction et de l'agrégation, exclusivement ou en combinaison avec la première méthode, sont clairement identifiées dans les instructions.

	ÉLÉMENT À DÉCLARER	INSTRUCTIONS
R0140/C0010	Passifs subordonnés - total	Le montant total de tous les passifs subordonnés.
R0140/C0030	Passifs subordonnés - niveau 1 restreint	Le montant des passifs subordonnés qui répondent aux critères applicables aux éléments de niveau 1 restreint.
R0140/C0040	Passifs subordonnés - niveau 2	Le montant des passifs subordonnés qui répondent aux critères applicables aux éléments de niveau 2.
R0140/C0050	Passifs subordonnés - niveau 3	Le montant des passifs subordonnés qui répondent aux critères applicables aux éléments de niveau 3.
R0290/C0010	Total fonds propres de base après déductions - total	Le montant total des éléments de fonds propres de base après déductions.
R0290/C0020	Total fonds propres de base après déductions - niveau 1 non restreint	Le montant des éléments de fonds propres de base après déductions qui répondent aux critères applicables aux éléments de niveau 1 non restreint.
R0290/C0030	Total fonds propres de base après déductions - niveau 1 restreint	Le montant des éléments de fonds propres de base après déductions qui répondent aux critères applicables aux éléments de niveau 1 restreint.
R0290/C0040	Total fonds propres de base après déductions - niveau 2	Le montant des éléments de fonds propres de base après déductions qui répondent aux critères applicables aux éléments de niveau 2.
R0290/C0050	Total fonds propres de base après déductions - niveau 3	Le montant des éléments de fonds propres de base après déductions qui répondent aux critères applicables aux éléments de niveau 3.
R0570/C0010	Total des fonds propres éligibles pour couvrir le minimum de capital de solvabilité requis du groupe sur base consolidée - total	Le total des fonds propres éligibles pour couvrir le minimum de capital de solvabilité requis du groupe sur base consolidée.
R0570/C0020	Total des fonds propres éligibles pour couvrir le minimum de capital de solvabilité requis du groupe sur base consolidée - niveau 1 non restreint	Le total des fonds propres éligibles pour couvrir le minimum de capital de solvabilité requis du groupe sur base consolidée, et qui répondent aux critères applicables aux éléments de niveau 1 non restreint.
R0570/C0030	Total des fonds propres éligibles pour couvrir le minimum de capital de solvabilité requis du groupe sur base consolidée - niveau 1 restreint	Le total des fonds propres éligibles pour couvrir le minimum de capital de solvabilité requis du groupe sur base consolidée, et qui répondent aux critères applicables aux éléments de niveau 1 restreint.
R0570/C0040	Total des fonds propres éligibles pour couvrir le minimum de capital de solvabilité requis du groupe sur base consolidée - niveau 2	Le total des fonds propres éligibles pour couvrir le minimum de capital de solvabilité requis du groupe sur base consolidée, et qui répondent aux critères applicables aux éléments de niveau 2.

R0660/C0010	Total des fonds propres éligibles servant à couvrir le capital de solvabilité requis du groupe (y compris fonds propres des autres secteurs financiers et entreprises incluses par déduction et agrégation) - total	Le total des fonds propres éligibles, y compris les fonds propres des autres secteurs financiers et des entreprises incluses par déduction et agrégation, pour couvrir le capital de solvabilité total du groupe.
R0660/C0020	Total des fonds propres éligibles servant à couvrir le capital de solvabilité requis du groupe (y compris fonds propres des autres secteurs financiers et entreprises incluses par déduction et agrégation) - niveau 1 non restreint	Le total des fonds propres éligibles, y compris les fonds propres des autres secteurs financiers et des entreprises incluses par déduction et agrégation, pour couvrir le capital de solvabilité total du groupe, qui répondent aux critères applicables aux éléments de niveau 1 non restreint.
R0660/C0030	Total des fonds propres éligibles servant à couvrir le capital de solvabilité requis du groupe (y compris fonds propres des autres secteurs financiers et entreprises incluses par déduction et agrégation) - niveau 1 restreint	Le total des fonds propres éligibles, y compris les fonds propres des autres secteurs financiers et des entreprises incluses par déduction et agrégation, pour couvrir le capital de solvabilité total du groupe, qui répondent aux critères applicables aux éléments de niveau 1 restreint.
R0660/C0040	Total des fonds propres éligibles servant à couvrir le capital de solvabilité requis du groupe (y compris fonds propres des autres secteurs financiers et entreprises incluses par déduction et agrégation) - niveau 2	Le total des fonds propres éligibles, y compris les fonds propres des autres secteurs financiers et des entreprises incluses par déduction et agrégation, pour couvrir le capital de solvabilité total du groupe, qui répondent aux critères applicables aux éléments de niveau 2.
R0660/C0050	Total des fonds propres éligibles servant à couvrir le capital de solvabilité requis du groupe (y compris fonds propres des autres secteurs financiers et entreprises incluses par déduction et agrégation) - niveau 3	Le total des fonds propres éligibles, y compris les fonds propres des autres secteurs financiers et des entreprises incluses par déduction et agrégation, pour couvrir le capital de solvabilité total du groupe, qui répondent aux critères applicables aux éléments de niveau 3.