

S.26.01 – Capital de solvabilité requis – Risque de marché

Observations générales

La présente section concerne la déclaration annuelle demandée aux groupes, ainsi que pour les fonds cantonnés, les portefeuilles sous ajustement égalisateur et la part restante.

Le modèle SR.26.01 doit être complété pour chaque fonds cantonné (FC), chaque portefeuille sous ajustement égalisateur (PAE), ainsi que pour la part restante. Toutefois, lorsqu'un FC/PAE inclut lui-même un FC/PAE, ce dernier fonds doit être traité en tant que fonds distinct. Le modèle doit être complété pour chaque sous-fonds de FC/PAE important, tel qu'identifié dans le deuxième tableau de S.01.03.

Le modèle S.25.03 ne concerne que les FC/PAE d'entreprises consolidées conformément à l'article 335, paragraphe 1, points a), b) et c), du règlement (UE) 2015/35 lorsque la première méthode (consolidation comptable) est utilisée, que ce soit exclusivement ou en combinaison avec la seconde méthode (déduction et agrégation).

Les montants avant et après choc doivent être indiqués en tenant compte des actifs et passifs sujets à ce risque de choc. Pour les passifs, l'évaluation doit être effectuée soit au niveau du contrat, soit au niveau du groupe de risques homogène, selon que l'un ou l'autre offre le plus grand degré de détail. Cela signifie que si un contrat/groupe de risques homogène est sujet à un risque de choc, le montant sujet à ce risque de choc à déclarer est le montant des passifs associés à ce contrat/groupe de risques homogène.

Pour les déclarations du groupe, les exigences spécifiques suivantes doivent être respectées:

- a) cette information s'applique lorsque la première méthode, définie à l'article 230 de la directive 2009/138/CE, est utilisée, que ce soit exclusivement ou en combinaison avec la seconde méthode définie à l'article 233 de ladite directive;
- b) lorsque les deux méthodes sont employées de manière combinée, cette information n'a besoin d'être déclarée que pour la partie du groupe calculée selon la première méthode, définie à l'article 230 de la directive 2009/138/CE;
- c) cette information ne s'applique pas aux groupes lorsque la deuxième méthode, définie à l'article 233 de la directive 2009/138/CE, est utilisée de manière exclusive.

	ÉLÉMENT À DÉCLARER	INSTRUCTIONS
Z0010	Article 112	Indique si les chiffres déclarés le sont en vertu de l'article 112, paragraphe 7, de la directive 2009/138/CE pour fournir une estimation du SCR au moyen de la formule standard. Choisir impérativement l'une des options suivantes: 1 - Déclaration en vertu de l'article 112, paragraphe 7 2 - Déclaration normale
Z0020	Fonds cantonné, portefeuille sous ajustement égalisateur ou part restante	Indique si les chiffres déclarés concernent un fonds cantonné, un portefeuille sous ajustement égalisateur ou la part restante. Choisir impérativement l'une des options suivantes: 1 – FC/PAE 2 – Part restante
Z0030	Numéro du fonds/du portefeuille	Lorsque Z0020 = 1, fournir le numéro d'identification du FC ou du PAE. Ce numéro est attribué par l'entreprise relevant du contrôle de groupe et il doit être cohérent dans le temps et avec le numéro du fonds/du portefeuille déclaré dans d'autres modèles.

R0010/C0010	Simplification risque de spread – obligations et prêts	Indique si une entreprise relevant du contrôle de groupe utilise des simplifications pour le risque de spread en ce qui concerne les obligations et les prêts. Choisir impérativement l'une des options suivantes: 1 - Utilisation de simplifications 2 - Pas d'utilisation de simplifications Si R0010/C0010 = 1, seuls C0060 et C0080 doivent être complétés pour R0410.
R0020/C0010	Simplification entreprises captives – risque de taux d'intérêt	Indique si une entreprise captive relevant du contrôle de groupe a utilisé des simplifications pour le calcul du risque de taux d'intérêt. Choisir impérativement l'une des options suivantes: 1 - Utilisation de simplifications 2 - Pas d'utilisation de simplifications Si R020/C0010 = 1, seuls C0060 et C0080 doivent être complétés pour R0100-R0120.
R0030/C0010	Simplification entreprises captives – risque de spread sur obligations et prêts	Indique si une entreprise captive relevant du contrôle de groupe utilise des simplifications pour le risque de spread en ce qui concerne les obligations et les prêts. Choisir impérativement l'une des options suivantes: 1 - Utilisation de simplifications 2 - Pas d'utilisation de simplifications
R0040/C0010	Simplification entreprises captives – concentration du risque de marché	Indique si une entreprise captive relevant du contrôle de groupe a utilisé des simplifications pour le calcul de la concentration du risque de marché. Choisir impérativement l'une des options suivantes: 1 - Utilisation de simplifications 2 - Pas d'utilisation de simplifications

Risque de taux d'intérêt

R0100/C0060	Valeur absolue après choc – capital de solvabilité requis net – risque de taux d'intérêt	L'exigence de capital nette pour risque de taux d'intérêt, c'est-à-dire après ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques. Si R0020/C0010 = 1, cet élément représente l'exigence de capital nette pour le risque de taux d'intérêt calculé en utilisant des calculs simplifiés pour les entreprises captives relevant du contrôle de groupe.
R0100/C0080	Valeur absolue après choc – capital de solvabilité requis brut – risque de taux d'intérêt	L'exigence de capital brute pour risque de taux d'intérêt, c'est-à-dire avant capacité d'absorption de pertes des provisions techniques. Si R0020/C0010 = 1, cet élément représente l'exigence de capital brute pour le risque de taux d'intérêt calculé en utilisant des calculs simplifiés pour les entreprises captives relevant du contrôle de groupe.
R0110–R0120/ C0020	Valeurs initiales absolues avant choc – Actifs – Risque de taux d'intérêt – Choc haussier/baissier de taux d'intérêt	La valeur totale des actifs sujets aux risques haussiers/baissiers de taux d'intérêt avant le choc. Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0110–R0120/ C0030	Valeurs initiales absolues avant choc – Passifs – Risque de taux d'intérêt – Choc haussier/baissier de taux d'intérêt	La valeur totale des passifs sujets aux risques haussiers/baissiers de taux d'intérêt avant le choc. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.

R0110–R0120/ C0040	Valeurs absolues après choc – Actifs – Risque de taux d'intérêt – Choc haussier/baissier de taux d'intérêt	La valeur absolue des actifs sujets aux risques haussiers/baissiers de taux d'intérêt après le choc. Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0110–R0120/ C0050	Valeurs absolues après choc – Passifs (après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) – Risque de taux d'intérêt – Choc haussier/baissier de taux d'intérêt	La valeur absolue des passifs (après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) sujets aux risques haussiers/baissiers de taux d'intérêt après le choc. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0110–R0120/ C0060	Valeur absolue après choc – Capital de solvabilité requis net – Risque de taux d'intérêt – Choc haussier/baissier de taux d'intérêt	L'exigence de capital nette pour risque haussier/baissier de taux d'intérêt, après ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques. Si $R0020/C0010 = 1$, cet élément représente l'exigence de capital nette pour risque haussier/baissier de taux d'intérêt calculée à l'aide de simplifications.
R0110–R0120/ C0070	Valeurs absolues après choc – Passifs (avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) – Risque de taux d'intérêt – Choc haussier/baissier de taux d'intérêt	La valeur absolue des passifs (avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) sujets aux risques haussiers/baissiers de taux d'intérêt après le choc. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0110–R0120/ C0080	Valeurs absolues après choc – Capital de solvabilité brut – Risque de taux d'intérêt – Choc haussier/baissier de taux d'intérêt	L'exigence de capital brute pour risque haussier/baissier de taux d'intérêt, autrement dit avant ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques. Si $R0020/C0010 = 1$, cet élément représente l'exigence de capital brute pour risque haussier/baissier de taux d'intérêt calculée à l'aide de simplifications.

Risque sur actions

R0200/C0060	Valeur absolue après choc – Capital de solvabilité requis net – Risque sur actions	L'exigence de capital nette pour risque sur actions, c'est-à-dire après ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques.
R0200/C0080	Valeur absolue après choc – Capital de solvabilité requis brut – Risque sur actions	L'exigence de capital brute pour risque sur actions, c'est-à-dire avant capacité d'absorption de pertes des provisions techniques.
R0210/C0020	Valeurs initiales absolues avant choc – Actifs – risque sur actions – actions de type 1	La valeur initiale absolue des actifs sujets à l'exigence pour risque sur actions liée aux actions de type 1. Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0210/C0030	Valeurs initiales absolues avant choc – Passifs – risque sur actions – actions de type 1	La valeur initiale absolue des passifs sujets au risque sur actions lié aux actions de type 1. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0210/C0040	Valeurs absolues après choc – Actifs – risque sur actions – actions de type 1	La valeur absolue des actifs sujets à l'exigence pour risque sur actions de la catégorie actions de type 1, après le choc. Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules

		de titrisation.
R0210/C0050	Valeurs absolues après choc – Passifs (après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) – risque sur actions – actions de type 1	La valeur absolue des passifs sujets à l'exigence pour risque sur actions de la catégorie actions de type 1, après le choc et après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0210/C0060	Valeur absolue après choc – Capital de solvabilité requis net – risque sur actions – actions de type 1	L'exigence de capital nette pour risque sur actions (pour les actions de type 1), c'est-à-dire après ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques.
R0210/C0070	Valeurs absolues après choc – Passifs (avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) – risque sur actions – actions de type 1	La valeur absolue des passifs sujets à l'exigence pour risque sur actions de la catégorie actions de type 1, après le choc mais avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0210/C0080	Valeur absolue après choc – Capital de solvabilité requis brut – risque sur actions – actions de type 1	L'exigence de capital brute pour risque sur actions pour les actions de type 1, c'est-à-dire avant ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques.
R0220–R0240/ C0020	Valeurs initiales absolues avant choc – Actifs – risque sur actions – actions de type 1	La valeur initiale absolue des actifs sujets au risque sur actions (pour chaque type d'action de type 1). Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0220–R0240/ C0040	Valeurs absolues après choc – Actifs – risque sur actions – actions de type 1	La valeur absolue des actifs sujets à l'exigence pour risque sur actions (pour chaque type d'action de type 1), après le choc. Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0250/C0020	Valeurs initiales absolues avant choc – Actifs – risque sur actions – actions de type 2	La valeur initiale absolue des actifs sujets au risque sur actions pour les actions de type 2. Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0250/C0030	Valeurs initiales absolues avant choc – Passifs – risque sur actions – actions de type 2	La valeur initiale absolue des passifs sujets au risque sur actions pour les actions de type 2. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0250/C0040	Valeurs absolues après choc – Actifs – risque sur actions – actions de type 2	La valeur absolue des actifs sujets à l'exigence pour risque sur actions pour les actions de type 2, après le choc. Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.

R0250/C0050	Valeurs absolues après choc – Passifs (après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) – risque sur actions – actions de type 2	La valeur absolue des passifs sujets au risque sur actions (pour les actions de type 2), après le choc et après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0250/C0060	Valeur absolue après choc – Capital de solvabilité requis net – risque sur actions – actions de type 2	L'exigence de capital nette pour risque sur actions (pour les actions de type 2), c'est-à-dire après ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques.
R0250/C0070	Valeurs absolues après choc – Passifs (avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) – risque sur actions – actions de type 2	La valeur absolue des passifs sujets au risque sur actions (pour les actions de type 2), après le choc mais avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0250/C0080	Valeur absolue après choc – Capital de solvabilité requis brut – risque sur actions – actions de type 2	L'exigence de capital brute pour risque sur actions pour les actions de type 2, c'est-à-dire avant ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques.
R0260–R0280/ C0020	Valeurs initiales absolues avant choc – Actifs – risque sur actions – actions de type 2	La valeur des actifs sujets au risque sur actions (pour chaque type d'action de type 2). Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0260–R0280/ C0040	Valeurs absolues après choc – Actifs – risque sur actions – actions de type 2	La valeur absolue des actifs sujets au risque sur actions (pour chaque type d'action de type 2), après le choc. Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0290 / C0020	Valeurs initiales absolues avant choc — Actifs — Risque sur actions — actions infrastructurelles éligibles	La valeur initiale absolue des actifs sujets au risque sur actions pour les actions infrastructurelles éligibles. Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0290 / C0030	Valeurs initiales absolues avant choc — Passifs — Risque sur actions — actions infrastructurelles éligibles	La valeur initiale absolue des passifs sujets au risque sur actions pour les actions infrastructurelles éligibles. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0290 / C0040	Valeurs initiales absolues après choc — Actifs — Risque sur actions — actions infrastructurelles éligibles	La valeur absolue des actifs sujets à l'exigence pour risque sur actions pour les actions infrastructurelles éligibles, après le choc. Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0290 / C0050	Valeurs initiales absolues après choc — Passifs — Risque sur actions — actions infrastructurelles éligibles	La valeur absolue des passifs sujets au risque sur actions (pour les actions infrastructurelles éligibles), après le choc et après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0290 / C0060	Valeur absolue après choc — Capital de solvabilité requis net — Risque sur actions — actions infrastructurelles Éligibles	L'exigence de capital nette pour risque sur actions (pour les actions infrastructurelles éligibles), c'est-à-dire après ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques.

R0290 / C0070	Valeurs absolues après choc — Passifs (avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) — Risque sur actions — actions infrastructurelles éligibles	La valeur absolue des passifs sujets au risque sur actions (pour les actions infrastructurelles éligibles), après le choc mais avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0290 / C0080	Valeur absolue après choc — Capital de solvabilité requis brut — Risque sur actions — actions infrastructurelles éligibles	L'exigence de capital brute pour risque sur actions pour les actions infrastructurelles éligibles, c'est-à-dire avant ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques.

Risque sur actifs immobiliers

R0300/C0020	Valeurs initiales absolues avant choc – Actifs – Risque sur actifs immobiliers	La valeur absolue des actifs sujets au risque sur actifs immobiliers. Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0300/C0030	Valeurs initiales absolues avant choc – Passifs – Risque sur actifs immobiliers	La valeur des passifs sujets à l'exigence pour risque sur actifs immobiliers. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0300/C0040	Valeurs absolues après choc – Actifs – Risque sur actifs immobiliers	La valeur absolue des actifs sujets à l'exigence pour risque sur actifs immobiliers, après le choc. Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0300/C0050	Valeurs absolues après choc – Passifs (après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) – Risque sur actifs immobiliers	La valeur absolue des passifs sous-jacents à l'exigence pour risque sur actifs immobiliers, après le choc et après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0300/C0060	Valeur absolue après choc – Capital de solvabilité requis net – Risque sur actifs immobiliers	L'exigence de capital nette pour risque sur actions, c'est-à-dire après ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques.
R0300/C0070	Valeurs absolues après choc – Passifs (avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) – risque sur actifs immobiliers	La valeur absolue des passifs sous-jacents à l'exigence pour risque sur actifs immobiliers, après le choc mais avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0300/C0080	Valeur absolue après choc – Capital de solvabilité requis brut – Risque sur actifs immobiliers	L'exigence de capital brute pour risque sur actifs immobiliers, c'est-à-dire avant ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques.

Risque de spread

R0400/C0060	Valeur absolue après choc – Capital de solvabilité requis net – Risque de spread	L'exigence de capital nette pour risque de spread, c'est-à-dire après ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques.
-------------	--	---

R0400/C0080	Valeur absolue après choc – Capital de solvabilité requis brut – Risque de spread	L'exigence de capital brute pour risque de spread, avant capacité d'absorption de pertes des provisions techniques.
R0410/C0020	Valeurs initiales absolues avant choc – Actifs – risque de spread – obligations et prêts	La valeur absolue des actifs sujets au risque de spread pour les obligations et les prêts. Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0410/C0030	Valeurs initiales absolues avant choc – Passifs – risque de spread – obligations et prêts	La valeur absolue des passifs sujets au risque de spread pour les obligations et les prêts. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0410/C0040	Valeurs absolues après choc – Actifs – risque de spread – obligations et prêts	La valeur absolue des actifs sujets au risque de spread pour les obligations et les prêts, après le choc. Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0410/C0050	Valeurs absolues après choc – Passifs (après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) – risque de spread – obligations et prêts	La valeur absolue des passifs sous-jacents à l'exigence pour risque de spread pour les obligations et les prêts, après le choc et après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0410/C0060	Valeur absolue après choc – Capital de solvabilité requis net – Risque de spread – obligations et prêts	L'exigence de capital nette pour risque de spread pour les obligations et les prêts, c'est-à-dire après ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques. Si R0010/C0010 = 1, cet élément représente l'exigence de capital nette pour risque de spread pour les obligations et les prêts, calculée à l'aide de simplifications.
R0410/C0070	Valeurs absolues après choc – Passifs (avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) – risque de spread – obligations et prêts	La valeur absolue des passifs sujets au risque de spread pour les obligations et les prêts, après le choc mais avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0410/C0080	Valeur absolue après choc – Capital de solvabilité requis brut – Risque de spread – obligations et prêts	L'exigence de capital brute pour risque de spread pour les obligations et les prêts, c'est-à-dire avant ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques. Si R0010/C0010 = 1, cet élément représente l'exigence de capital brute pour risque de spread pour les obligations et les prêts, calculée à l'aide de simplifications.
R0411/C0020	Valeurs initiales absolues avant choc — Actifs — Risque de spread — obligations et prêts (investissements infrastructurels éligibles)	La valeur initiale absolue des actifs sujets au risque de spread pour les obligations et les prêts qui sont des investissements infrastructurels éligibles. Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.

R0411/C0030	Valeurs initiales absolues avant choc — Passifs — Risque de spread — obligations et prêts (investissements infrastructurels éligibles)	La valeur initiale absolue des passifs sujets au risque de spread pour les obligations et les prêts qui sont des investissements infrastructurels éligibles. Cette valeur doit être déclarée uniquement lorsque la ventilation entre R0411 et R0412 peut être déduite à l'aide de la méthode utilisée pour le calcul. Lorsque la ventilation n'est pas possible, seule la ligne R0410 doit être remplie. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0411/C0040	Valeurs absolues après choc — Actifs — Risque de spread — obligations et prêts (investissements infrastructurels éligibles)	La valeur absolue des actifs sujets au risque de spread pour les obligations et les prêts qui sont des investissements infrastructurels éligibles, après le choc. Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0411/C0050	Valeurs absolues après choc — Passifs (après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) — Risque de spread — obligations et prêts (investissements infrastructurels éligibles)	La valeur absolue des passifs sujets au risque de spread pour les obligations et les prêts qui sont des investissements infrastructurels éligibles, après le choc et après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques. Cette valeur doit être déclarée uniquement lorsque la ventilation entre R0411 et R0412 peut être déduite à l'aide de la méthode utilisée pour le calcul. Lorsque la ventilation n'est pas possible, seule la ligne R0410 doit être remplie. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0411/C0060	Valeur absolue après choc — Capital de solvabilité requis net — Risque de spread — obligations et prêts (investissements infrastructurels éligibles)	L'exigence de capital nette pour risque de spread pour les obligations et les prêts qui sont des investissements infrastructurels éligibles, c'est-à-dire après ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques. Cette valeur doit être déclarée uniquement lorsque la ventilation entre R0411 et R0412 peut être déduite à l'aide de la méthode utilisée pour le calcul. Lorsque la ventilation n'est pas possible, seule la ligne R0410 doit être remplie. Si R0010/C0010 = 1, ne pas déclarer cet élément.
R0411/C0070	Valeurs absolues après choc — Passifs (avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) — Risque de spread — obligations et prêts (investissements infrastructurels éligibles)	La valeur absolue des passifs sujets au risque de spread pour les obligations et les prêts qui sont des investissements infrastructurels éligibles, après le choc mais avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques. Cette valeur doit être déclarée uniquement lorsque la ventilation entre R0411 et R0412 peut être déduite à l'aide de la méthode utilisée pour le calcul. Lorsque la ventilation n'est pas possible, seule la ligne R0410 doit être remplie. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0411/C0080	Valeur absolue après choc — Capital de solvabilité requis brut — Risque de spread — obligations et prêts (investissements infrastructurels éligibles)	L'exigence de capital brute pour risque de spread pour les obligations et les prêts qui sont des investissements infrastructurels éligibles, c'est-à-dire avant capacité d'absorption de pertes des provisions techniques. Cette valeur doit être déclarée uniquement lorsque la ventilation entre R0411 et R0412 peut être déduite à l'aide de la méthode utilisée pour le calcul. Lorsque la ventilation n'est pas possible, seule la ligne R0410 doit être remplie. Si R0010/C0010 = 1, ne pas déclarer cet élément.
R0412/C0020	Valeurs initiales absolues avant choc — Actifs — Risque de spread — obligations et prêts (hors	La valeur initiale absolue des actifs sujets au risque de spread pour les obligations et les prêts autres que des investissements infrastructurels éligibles. Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de

	investissements infrastructurels éligibles)	réassurance et des véhicules de titrisation.
R0412/C0030	Valeurs initiales absolues avant choc — Passifs — Risque de spread — obligations et prêts (hors investissements infrastructurels éligibles)	La valeur initiale absolue des passifs sujets au risque de spread pour les obligations et les prêts autres que des investissements infrastructurels éligibles. Cette valeur doit être déclarée uniquement lorsque la ventilation entre R0411 et R0412 peut être déduite à l'aide de la méthode utilisée pour le calcul. Lorsque la ventilation n'est pas possible, seule la ligne R0410 doit être remplie. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0412/C0040	Valeurs absolues après choc — Actifs — Risque de spread — obligations et prêts (hors investissements infrastructurels éligibles)	La valeur absolue des actifs sujets au risque de spread pour les obligations et les prêts autres que des investissements infrastructurels éligibles, après le choc. Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0412/C0050	Valeurs absolues après choc — Passifs (après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) — Risque de spread — obligations et prêts (hors investissements infrastructurels éligibles)	La valeur absolue des passifs sujets au risque de spread pour les obligations et les prêts autres que des investissements infrastructurels éligibles, après le choc et après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques. Cette valeur doit être déclarée uniquement lorsque la ventilation entre R0411 et R0412 peut être déduite à l'aide de la méthode utilisée pour le calcul. Lorsque la ventilation n'est pas possible, seule la ligne R0410 doit être remplie. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0412/C0060	Valeur absolue après choc — Capital de solvabilité requis net — Risque de spread — obligations et prêts (hors investissements infrastructurels éligibles)	L'exigence de capital nette pour risque de spread pour les obligations et les prêts autres que des investissements infrastructurels éligibles, c'est-à-dire après ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques. Cette valeur doit être déclarée uniquement lorsque la ventilation entre R0411 et R0412 peut être déduite à l'aide de la méthode utilisée pour le calcul. Lorsque la ventilation n'est pas possible, seule la ligne R0410 doit être remplie. Si R0010/C0010 = 1, ne pas déclarer cet élément.
R0412/C0070	Valeurs absolues après choc — Passifs (avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) — Risque de spread — obligations et prêts (hors investissements infrastructurels éligibles)	La valeur absolue des passifs sujets au risque de spread pour les obligations et les prêts autres que des investissements infrastructurels éligibles, après le choc mais avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques. Cette valeur doit être déclarée uniquement lorsque la ventilation entre R0411 et R0412 peut être déduite à l'aide de la méthode utilisée pour le calcul. Lorsque la ventilation n'est pas possible, seule la ligne R0410 doit être remplie. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0412/C0080	Valeur absolue après choc — Capital de solvabilité requis brut — Risque de spread — obligations et prêts (hors investissements infrastructurels éligibles)	L'exigence de capital brute pour risque de spread pour les obligations et les prêts autres que des investissements infrastructurels éligibles, c'est-à-dire avant capacité d'absorption de pertes des provisions techniques. Cette valeur doit être déclarée uniquement lorsque la ventilation entre R0411 et R0412 peut être déduite à l'aide de la méthode utilisée pour le calcul. Lorsque la ventilation n'est pas possible, seule la ligne R0410 doit être remplie. Si R0010/C0010 = 1, ne pas déclarer cet élément.

R0420/C0060	Valeur absolue après choc – Capital de solvabilité requis net – Risque de spread – dérivés de crédit	L'exigence de capital nette pour risque de spread pour les dérivés de crédit, c'est-à-dire après ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques.
R0420/C0080	Valeur absolue après choc – Capital de solvabilité requis brut – Risque de spread – dérivés de crédit	L'exigence de capital brute pour risque de spread pour les dérivés de crédit, c'est-à-dire avant capacité d'absorption de pertes des provisions techniques.
R0430–R0440/ C0020	Valeurs initiales absolues avant choc – Actifs – risque de spread – dérivés de crédit – choc baissier/haussier sur dérivés de crédit	La valeur absolue des actifs sujets au choc baissier/haussier en ce qui concerne le risque de spread pour les dérivés de crédit. Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0430–R0440/ C0030	Valeurs initiales absolues avant choc – Passifs – risque de spread – dérivés de crédit – choc baissier/haussier sur dérivés de crédit	La valeur absolue des passifs sujets au choc baissier/haussier en ce qui concerne le risque de spread pour les dérivés de crédit. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0430–R0440/ C0040	Valeurs absolues après choc – Actifs – risque de spread – dérivés de crédit – choc baissier/haussier sur dérivés de crédit	La valeur absolue des actifs sujets au choc baissier/haussier en ce qui concerne le risque de spread pour les dérivés de crédit, après le choc. Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0430–R0440/ C0050	Valeurs absolues après choc – Passifs (après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) – risque de spread – dérivés de crédit – choc baissier/haussier sur dérivés de crédit	La valeur absolue des passifs sujets au choc baissier/haussier en ce qui concerne le risque de spread pour les dérivés de crédit, après le choc et après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0430–R0440/ C0060	Valeurs absolues après choc – Capital de solvabilité requis net – risque de spread – dérivés de crédit – choc baissier/haussier sur dérivés de crédit	L'exigence de capital nette pour choc baissier/haussier en ce qui concerne le risque de spread pour les dérivés de crédit, c'est-à-dire après ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques.
R0430–R0440/ C0070	Valeurs absolues après choc – Passifs (avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) – risque de spread – dérivés de crédit – choc baissier/haussier sur dérivés de crédit	La valeur absolue des passifs sujets au choc baissier/haussier en ce qui concerne le risque de spread pour les dérivés de crédit, après le choc mais avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0430–R0440/ C0080	Valeurs absolues après choc – Capital de solvabilité requis brut – risque de spread – dérivés de crédit – choc baissier/haussier sur dérivés de crédit	L'exigence de capital brute pour choc baissier/haussier en ce qui concerne le risque de spread pour les dérivés de crédit, c'est-à-dire avant ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques.

R0450/C0020	Valeurs initiales absolues avant choc – Actifs – risque de spread – positions de titrisation	<p>La valeur absolue des actifs sujets au risque de spread pour les positions de titrisation.</p> <p>Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.</p>
R0450/C0030	Valeurs initiales absolues avant choc – Passifs – risque de spread – positions de titrisation	<p>La valeur absolue des passifs sujets au risque de spread pour les positions de titrisation.</p> <p>Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.</p>
R0450/C0040	Valeurs absolues après choc – Actifs – risque de spread – positions de titrisation	<p>La valeur absolue des actifs sujets au risque de spread pour les positions de titrisation, après le choc.</p> <p>Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.</p>
R0450/C0050	Valeurs absolues après choc – Passifs (après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) – risque de spread – positions de titrisation	<p>La valeur absolue des passifs sujets au risque de spread pour les positions de titrisation, après le choc et après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques.</p> <p>Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.</p>
R0450/C0060	Valeur absolue après choc – Capital de solvabilité requis net – Risque de spread – dérivés de crédit – positions de titrisation	L'exigence de capital nette pour risque de spread pour les positions de titrisation, c'est-à-dire après ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques.
R0450/C0070	Valeurs absolues après choc – Passifs (avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) – risque de spread – positions de titrisation	<p>La valeur absolue des passifs sujets au risque de spread pour les positions de titrisation, après le choc mais avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques.</p> <p>Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.</p>
R0450/C0080	Valeur absolue après choc – Capital de solvabilité requis brut – Risque de spread – dérivés de crédit – positions de titrisation	L'exigence de capital brute pour risque de spread pour les positions de titrisation, c'est-à-dire avant ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques.
R0460/C0020	Valeurs initiales absolues avant choc – Actifs – risque de spread – positions de titrisation – type 1	<p>La valeur absolue des actifs sujets au risque de spread pour les positions de titrisation de type 1.</p> <p>Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.</p>
R0460/C0030	Valeurs initiales absolues avant choc – Passifs – risque de spread – positions de titrisation – type 1	<p>La valeur absolue des passifs sujets au risque de spread pour les positions de titrisation de type 1.</p> <p>Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.</p>
R0460/C0040	Valeurs absolues après choc – Actifs – risque de spread – positions de titrisation – type 1	<p>La valeur absolue des actifs sujets au risque de spread pour les positions de titrisation de type 1, après le choc.</p> <p>Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.</p>

R0460/C0050	Valeurs absolues après choc – Passifs (après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) – risque de spread – positions de titrisation – type 1	La valeur absolue des passifs sujets au risque de spread pour les positions de titrisation de type 1, après le choc et après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0460/C0060	Valeur absolue après choc – Capital de solvabilité requis net – Risque de spread – positions de titrisation – type 1	L'exigence de capital nette pour risque de spread pour les positions de titrisation de type 1, c'est-à-dire après ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques.
R0460/C0070	Valeurs absolues après choc – Passifs (avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) – risque de spread – positions de titrisation – type 1	La valeur absolue des passifs sujets au risque de spread pour les positions de titrisation de type 1, après le choc mais avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0460/C0080	Valeur absolue après choc – Capital de solvabilité requis brut – Risque de spread – positions de titrisation – type 1	L'exigence de capital brute pour risque de spread pour les positions de titrisation de type 1, c'est-à-dire avant ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques.
R0470/C0020	Valeurs initiales absolues avant choc – Actifs – risque de spread – positions de titrisation – type 2	La valeur absolue des actifs sujets au risque de spread pour les positions de titrisation de type 2. Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0470/C0030	Valeurs initiales absolues avant choc – Passifs – risque de spread – positions de titrisation – type 2	La valeur absolue des passifs sujets au risque de spread pour les positions de titrisation de type 2. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0470/C0040	Valeurs absolues après choc – Actifs – risque de spread – positions de titrisation – type 2	La valeur absolue des actifs sujets au risque de spread pour les positions de titrisation de type 2, après le choc. Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0470/C0050	Valeurs absolues après choc – Passifs (après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) – risque de spread – positions de titrisation – type 2	La valeur absolue des passifs sujets au risque de spread pour les positions de titrisation de type 2, après le choc et après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0470/C0060	Valeur absolue après choc – Capital de solvabilité requis net – Risque de spread – positions de titrisation – type 2	L'exigence de capital nette pour risque de spread pour les positions de titrisation de type 2, c'est-à-dire après ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques.

R0470/C0070	Valeurs absolues après choc – Passifs (avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) – risque de spread – positions de titrisation – type 2	La valeur absolue des passifs sujets au risque de spread pour les positions de titrisation de type 2, après le choc mais avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0470/C0080	Valeur absolue après choc – Capital de solvabilité requis brut – Risque de spread – positions de titrisation – type 2	L'exigence de capital brute pour risque de spread pour les positions de titrisation de type 2, c'est-à-dire avant ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques.
R0480/C0020	Valeurs initiales absolues avant choc – Actifs – risque de spread – positions de titrisation – retitrisation	La valeur absolue des actifs sujets au risque de spread pour les positions de retitrisation. Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0480/C0030	Valeurs initiales absolues avant choc – Passifs – risque de spread – positions de titrisation – retitrisation	La valeur absolue des passifs sujets au risque de spread pour les positions de retitrisation. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0480/C0040	Valeurs absolues après choc – Actifs – risque de spread – positions de titrisation – retitrisation	La valeur absolue des actifs sujets au risque de spread pour les positions de retitrisation, après le choc. Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0480/C0050	Valeurs absolues après choc – Passifs (après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) – risque de spread – positions de titrisation – retitrisation	La valeur absolue des passifs sujets au risque de spread pour les positions de retitrisation, après le choc et après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0480/C0060	Valeur absolue après choc – Capital de solvabilité requis net – Risque de spread – positions de titrisation – retitrisation	L'exigence de capital nette pour risque de spread pour les positions de retitrisation, c'est-à-dire après ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques.
R0480/C0070	Valeurs absolues après choc – Passifs (avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) – risque de spread – positions de titrisation – retitrisation	La valeur absolue des passifs sujets au risque de spread pour les positions de retitrisation, après le choc mais avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0480/C0080	Valeur absolue après choc – Capital de solvabilité requis brut – Risque de spread – positions de titrisation – retitrisation	L'exigence de capital brute pour risque de spread pour les positions de retitrisation, c'est-à-dire avant ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques.

Risque de concentration

R0500/C0020	Valeurs initiales absolues avant choc – Actifs – concentrations du risque de marché	<p>La valeur absolue des actifs sujets aux concentrations du risque de marché.</p> <p>Pour les entreprises captives relevant du contrôle de groupe, si R0040/C0010 = 1, cet élément représente la valeur absolue des actifs sujets à la concentration du risque de marché, après prise en compte des simplifications autorisées pour les entreprises captives.</p> <p>Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.</p>
R0500/C0060	Valeur absolue après choc – Capital de solvabilité requis net – concentrations du risque de marché	<p>L'exigence de capital nette pour concentrations du risque de marché, c'est-à-dire après ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques, agrégée pour chaque exposition sur signature unique.</p> <p>Pour les entreprises captives relevant du contrôle de groupe, si R0040/C0010 = 1, cet élément représente l'exigence de capital nette pour concentration du risque de marché, calculée en utilisant les calculs simplifiés.</p>
R0500/C0080	Valeur absolue après choc – Capital de solvabilité requis brut – concentrations du risque de marché	<p>L'exigence de capital brute pour concentrations du risque de marché, agrégée pour chaque exposition sur signature unique, avant ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques.</p>

Risque de change

R0600/C0060	Valeurs absolues après choc – Capital de solvabilité requis net (après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) – risque de change	<p>La somme, pour les différentes monnaies, de:</p> <ul style="list-style-type: none"> – l'exigence de capital (après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) pour augmentation de la valeur de la monnaie étrangère par rapport à la monnaie locale; – l'exigence de capital (après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) pour diminution de la valeur de la monnaie étrangère par rapport à la monnaie locale.
R0600/C0080	Valeur absolue après choc – Capital de solvabilité requis brut – Risque de change	<p>La somme, pour les différentes monnaies, de:</p> <ul style="list-style-type: none"> – l'exigence de capital (avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) pour augmentation de la valeur de la monnaie étrangère par rapport à la monnaie locale; – l'exigence de capital (avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) pour diminution de la valeur de la monnaie étrangère par rapport à la monnaie locale;
R0610–R0620/ C0020	Valeurs initiales absolues avant choc – Actifs – Risque de change – augmentation/diminution de la valeur de la monnaie étrangère	<p>La valeur totale des actifs sujets au risque d'augmentation/de diminution de la valeur de la monnaie étrangère, avant le choc.</p> <p>Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.</p>
R0610–R0620/ C0030	Valeurs initiales absolues avant choc – Passifs – Risque de change – augmentation/diminution de la valeur de la monnaie étrangère	<p>La valeur totale des passifs sujets au risque d'augmentation/de diminution de la valeur de la monnaie étrangère, avant le choc.</p> <p>Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.</p>

R0610–R0620/ C0040	Valeurs absolues après choc – Actifs – Risque de change – augmentation/diminution de la valeur de la monnaie étrangère	La valeur absolue des actifs sujets au risque d'augmentation/de diminution de la valeur de la monnaie étrangère, après le choc. Ne pas tenir compte pour cette cellule des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0610–R0620/ C0050	Valeurs absolues après choc – Passifs (après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) – Risque de change – augmentation/diminution de la valeur de la monnaie étrangère	La valeur absolue des passifs (après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) sujets au risque d'augmentation/de diminution de la valeur de la monnaie étrangère, après le choc. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0610–R0620/ C0060	Valeurs absolues après choc – Capital de solvabilité requis net (après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) – Risque de change – augmentation/diminution de la valeur de la monnaie étrangère	L'exigence de capital nette pour risque d'augmentation/de diminution de la valeur de la monnaie étrangère, c'est-à-dire après ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques. En R0610, ne déclarer que les monnaies pour lesquelles le choc de l'augmentation est le plus important; en R0620, ne déclarer que les monnaies pour lesquelles le choc de la diminution est le plus important.
R0610–R0620/ C0070	Valeurs absolues après choc (avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) – Risque de change – augmentation/diminution de la valeur de la monnaie étrangère	La valeur absolue des passifs (avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) sujets au risque d'augmentation/de diminution de la valeur de la monnaie étrangère, après le choc. Le montant des provisions techniques est net des montants recouvrables au titre des contrats de réassurance et des véhicules de titrisation.
R0610–R0620/ C0080	Valeurs absolues après choc – Capital de solvabilité requis brut (avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) – Risque de change – augmentation/diminution de la valeur de la monnaie étrangère	L'exigence de capital brute pour risque d'augmentation/de diminution de la valeur de la monnaie étrangère, c'est-à-dire avant ajustement visant à tenir compte de la capacité d'absorption de pertes des provisions techniques. En R0610, ne déclarer que les monnaies pour lesquelles le choc de l'augmentation est le plus important; en R0620, ne déclarer que les monnaies pour lesquelles le choc de la diminution est le plus important.

Diversification au sein du module «risque de marché»

R0700/C0060	Diversification au sein du module risque de marché – net	L'effet de diversification au sein du module risque de marché suite à l'agrégation des exigences de capital nettes (après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) des différents sous-modules de risque. La diversification est déclarée en tant que valeur négative lorsqu'elle réduit l'exigence de capital.
R0700/C0080	Diversification au sein du module risque de marché – brut	L'effet de diversification au sein du module risque de marché suite à l'agrégation des exigences de capital brutes (avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques) des différents sous-modules de risque. La diversification est déclarée en tant que valeur négative lorsqu'elle réduit l'exigence de capital.

Total capital de solvabilité requis pour risque de marché

R0800/C0060	Total capital de solvabilité requis net pour risque de marché	L'exigence de capital totale nette pour tous les risques de marché, après capacité d'absorption des pertes des provisions techniques, calculée à l'aide de la formule standard.
R0800/C0080	Total capital de solvabilité requis brut pour risque de marché	Le montant brut de l'exigence de capital pour tous les risques de marché, avant capacité d'absorption des pertes des provisions techniques, calculée à l'aide de la formule standard.