RÈGLEMENT D'EXÉCUTION (UE) 2015/79 DE LA COMMISSION

du 18 décembre 2014

Modèle: AE-MAT. Données relatives aux échéances

3.2.1. Instructions par ligne

Ligne	Références juridiques et instructions
010	**Actifs grevés** Aux fins de ce modèle, les actifs grevés comprennent l'ensemble des éléments suivants: (a) les actifs de l'établissement déclarant (voir les instructions pour la ligne 010 du modèle AE-ASS), qui sont déclarés à leur valeur comptable; (b) les propres titres de créance émis autres que des obligations garanties ou des titrisations (voir les instructions pour la ligne 240 du modèle AE-COL), qui sont déclarés à leur juste valeur. Ces montants sont répartis entre les différentes catégories d'échéance résiduelle précisées dans les colonnes en fonction de l'échéance résiduelle de la source de la charge grevant les actifs (passif correspondant, passif éventuel ou opération de prêt de titres).
020	**Sûretés reçues réutilisées (jambe réception)** Voir les instructions pour la ligne 130 du modèle AE-COL et la colonne 040 du modèle AE-SOU. Les montants sont déclarés à leur juste valeur et répartis entre les différentes catégories d'échéance résiduelle précisées dans les colonnes en fonction de l'échéance résiduelle de la transaction dont résulte, pour l'entité, la réception de la sûreté qui est réutilisée (jambe réception).
030	**Sûretés reçues réutilisées (jambe réutilisation)** Voir les instructions pour la ligne 130 du modèle AE-COL et la colonne 040 du modèle AE-SOU. Ces montants sont déclarés à leur juste valeur et répartis entre les différentes catégories d'échéance résiduelle précisées dans les colonnes en fonction de l'échéance résiduelle de la source de la charge grevant les actifs (jambe réutilisation): passif correspondant, passif éventuel ou opération de prêt de titres.

3.2.2. Instructions par colonne

Colonne	Références juridiques et instructions
010	**Échéance ouverte** À vue, sans échéance spécifique

020	**À un jour** Date d'échéance inférieure ou égale à 1 jour
030	**> 1 jour <= 1 sem.** Date d'échéance supérieure à 1 jour et inférieure ou égale à 1 semaine
040	**> 1 sem. <= 2 sem.** Date d'échéance supérieure à 1 semaine et inférieure ou égale à 2 semaines
050	**> 2 sem. <= 1 mois** Date d'échéance supérieure à 2 semaines et inférieure ou égale à 1 mois
060	**> 1 mois <= 3 mois** Date d'échéance supérieure à 1 mois et inférieure ou égale à 3 mois
070	**> 3 mois <= 6 mois** Date d'échéance supérieure à 3 mois et inférieure ou égale à 6 mois
080	**> 6 mois <= 1 an** Date d'échéance supérieure à 6 mois et inférieure ou égale à 1 an
090	**> 1 an <= 2 ans** Date d'échéance supérieure à 1 an et inférieure ou égale à 2 ans
100	**> 2 ans <= 3 ans** Date d'échéance supérieure à 2 ans et inférieure ou égale à 3 ans
110	**> 3 ans <= 5 ans** Date d'échéance supérieure à 3 ans et inférieure ou égale à 5 ans
120	**> 5 ans <= 10 ans** Date d'échéance supérieure à 5 ans et inférieure ou égale à 10 ans
130	**> 10 ans** Date d'échéance supérieure à 10 ans