

FR

ANNEXE XIII

RAPPORTS SUR LA LIQUIDITÉ (PARTIE 4 sur 5: Échanges de sûretés)

Remarques générales

1. Le présent modèle récapitulatif comprend toutes les informations dont l'ABE a besoin pour évaluer si les opérations de prêt garanties et d'échange de sûretés pour lesquelles des actifs liquides visés à l'article 416, paragraphe 1, points a), b) et c), ont été reçus en échange de sûretés qui ne sont pas éligibles en vertu de l'article 416, paragraphe 1, points a), b) et c) ont été correctement dénouées.

(a) Sous-modèle Échanges de sûretés

i. Instructions spécifiques à chaque ligne

Ligne	Références légales et instructions
<u>1. Échanges de sûretés</u> Article 415(1), paragraphe 2, du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013. Les établissements déclarent tout échange de sûretés pour lequel des actifs liquides visés à l'article 416, points a), b) ou c), ont été reçus en échange de sûretés qui ne sont pas éligibles en vertu de l'article 416, paragraphe 1, points a), b) et c). Les actifs qui ne sont pas éligibles en vertu de l'article 416, paragraphe 1, points a), b) et c) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013 sont dénommés «autres actifs» dans le présent modèle. Les échanges de sûretés dont l'échéance est inférieure ou égale à 30 jours sont déclarés dans les colonnes 010 et 020. Le montant notionnel est déclaré dans la colonne 010. La valeur de marché est déclarée dans la colonne 020. Les échanges de sûretés dont l'échéance est supérieure à 30 jours sont déclarés dans les colonnes 030 et 040. Le montant notionnel est déclaré dans la colonne 030. La valeur de marché est déclarée dans la colonne 040.	
010-060	<u>1,0 Actifs</u>
	<u>1.1 encaisses et expositions sur les banques centrales</u>
010	Article 416(1)(a) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013
	<u>1.2 autres actifs cessibles d'après l'article 416, paragraphe 1, point b)</u>
020	Article 416(1)(b) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013
030-060	<u>1.3 autres actifs cessibles représentant des créances sur, ou garanties par</u>

	<p>Article 416(1)(c) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p> <p>Les sous-catégories suivantes font l'objet d'une déclaration:</p>
030	<p><u>1.3.1 actifs cessibles représentant des créances sur, ou garanties par l'administration centrale d'un État membre, d'une région bénéficiant de l'autonomie fiscale de lever et collecter des impôts ou d'un pays tiers, émises dans la monnaie locale de l'administration centrale ou régionale, si l'établissement est exposé à un risque de liquidité dans cet État membre ou ce pays tiers qu'il couvre en détenant ces actifs liquides</u></p> <p>Article 416(1)(c)(i) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p>
040	<p><u>1.3.2 actifs cessibles représentant des créances sur, ou garanties par, des banques centrales et des entités du secteur public ne relevant pas du gouvernement central, émises dans la monnaie locale de la banque centrale et de l'entité du secteur public</u></p> <p>Article 416(1)(c)(ii) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p>
050	<p><u>1.3.3 actifs cessibles représentant des créances sur, ou garanties par, la Banque des règlements internationaux, le Fonds monétaire international, la Commission et les banques multilatérales de développement</u></p> <p>Article 416(1)(c)(iii) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p>
060	<p><u>1.3.4 actifs cessibles représentant des créances sur, ou garanties par, le Fonds européen de stabilité financière et le Mécanisme européen de stabilité</u></p> <p>Article 416(1)(c)(iv) du RÈGLEMENT (UE) n° 575/2013</p>