

SPV.03.02 - Instruments de dette ou autres mécanismes de financement - Taxonomie Solvabilité II
AEAPP 2.7.0

Observations générales:

La présente annexe donne des instructions supplémentaires pour l'emploi des modèles figurant à l'annexe II du présent règlement. La première colonne des tableaux précise les éléments à déclarer; l'intitulé des cellules correspond aux modèles de l'annexe II.

Lorsque le véhicule de titrisation est invité à fournir une justification particulière en complément d'informations quantitatives, il ne doit pas présenter ces explications à l'aide du modèle mais les inclure dans la partie descriptive de la déclaration à transmettre à l'autorité de contrôle.

	ÉLÉMENT À DÉCLARER	INSTRUCTIONS
R0010/C0030	Total - Montant de la dette émise ou des autres mécanismes de financement mis en place dans le cadre d'accords	Valeur totale des titres de créance émis SPV.03.02.C0030/R0010 = Somme (C0030/R0020) = SPV.02.01. C0010/R0120
R0020/C0010	Accord	Dans le cas de véhicules de titrisation multiaccords, les informations demandées doivent être fournies pour chaque accord (c'est-à-dire pour chaque risque séparable pris en charge). Indiquer ici le code de l'accord. Il s'agit soit du code attribué par l'autorité de contrôle, soit, à défaut, d'un code attribué par le véhicule de titrisation; ce code doit systématiquement être utilisé d'une année sur l'autre et ne peut être recyclé. Le nombre de lignes doit être égal au nombre indiqué sous SPV.01.02 à la rubrique C0010/R0080.
R0020/C0020	Instruments de dette ou autres mécanismes de financement 1	Décrire la dette émise ou les autres mécanismes de financement mis en place dans le cadre d'accords, en indiquant la référence de l'opération. Pour chaque accord, utiliser autant de lignes que nécessaire pour rendre compte de chaque titre de créance émis.
R0020/C0030	Montant de la dette émise ou des autres mécanismes de financement mis en place dans le cadre d'accords	Valeur de chaque émission de dette ou de chaque mécanisme de financement d'un autre type