SPV.03.01 - Risques pris en charge - Taxonomie Solvabilité II AEAPP 2.6.0

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/C0070	Total - Exposition maximale agrégée par accord	Montant total de l'exposition maximale agrégée du véhicule de titrisation C0070/R0010 = Somme (C0070/R0020)
R0010/C0080	Total - Actifs détenus par risque séparable	Valeur totale des actifs détenus SPV.03.01 C0080/R0010 = Somme (C0080/R0020) = SPV.02.01. C0010/R0100
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	Date d'émission	Code ISO 8601 (AAAA-MM-JJ) de la date d'émission pour chaque accord de transfert de risque séparable.
R0020/C0030	Émissions/utilisations ayant débuté avant la mise en oeuvre de la directive 2009/138/CE	Préciser si l'accord a été conclu avant le 31 décembre 2015, en choisissant impérativement l'une des options suivantes: 1-avant le 31 décembre 2015; 2-après le 31 décembre 2015.
R0020/C0040	Nom de la cédante	Nom de l'entreprise d'assurance ou de réassurance qui transfère des risques au véhicule de titrisation
R0020/C0050	Code de la cédante	Identifier la cédante par l'un des codes suivants (par ordre de priorité): — identifiant d'entité juridique «Legal Entity Identifier» (LEI); — code spécifique. Code spécifique: — pour les entreprises d'assurance et de réassurance de l'EEE, le code d'identification, attribué par l'autorité de contrôle nationale, qui est utilisé sur le marché local; — pour les entreprises hors EEE et les entreprises non réglementées, le code d'identification attribué par le véhicule de titrisation. Le code d'identification attribué à chaque entreprise hors EEE ou non réglementée doit systématiquement respecter le format suivant: code d'identification de l'entreprise + code ISO 3166-1 alpha-2 du pays de l'entreprise + 5 chiffres

R0020/C0060	Type de code	Indiquer le type de code utilisé dans la rubrique «Code de la cédante» (C0050), en choisissant impérativement l'une des options suivantes: 1-LEI; 2-code spécifique.
R0020/C0070	Exposition maximale agrégée par accord	Valeur de l'exposition maximale agrégée par accord
R0020/C0080	Actifs détenus par risque séparable	Valeur totale des actifs détenus, par accord
R0020/C0090	Respect de l'exigence de financement en totalité pour l'accord sur toute la période de déclaration	Indiquer si l'exigence de financement en totalité a été respectée depuis la dernière période de déclaration, en choisissant impérativement l'une des options suivantes: 1-respect de l'exigence de financement en totalité; 2-non-respect de l'exigence de financement en totalité.
R0020/C0100	Durée	Durée de validité restante de l'accord, en mois.