

Réf.: ST.11-1959

Luxembourg, le 16 décembre 2011

A tous les établissements de crédit

***Concerne: Enquête ad-hoc sur la détention de titres pour compte de tiers non résidents***

Mesdames, Messieurs,

Au cours du mois de novembre 2011 le Conseil des Gouverneurs de la Banque centrale européenne a eu un échange de vues approfondi quant à l'opportunité de collecter, par le biais des Banques centrales nationales, les avoirs en titres de créance et de participation détenus par les banques dépositaires pour compte de clients non-résidents.

L'introduction d'une telle collecte au Luxembourg implique que tous les établissements de crédits résidents au Luxembourg seraient tenus de rapporter toutes les positions en titres détenus pour compte de clients non-résidents avec une fréquence mensuelle et sur une base titre par titre.

Dans ce contexte, le Conseil des Gouverneurs a décidé de conduire, au préalable, une enquête auprès de tous les dépositaires résidents de la zone euro afin de déterminer si une telle collecte est pertinente d'un point de vue statistique. Les résultats recueillis dans cette enquête préliminaire permettront dès lors d'apprécier si les informations recueillies sont de nature à justifier la mise en œuvre d'une nouvelle collecte statistique sur les détentions de titres. Ainsi, l'exploitation des informations reçues dans le cadre de l'enquête ad-hoc serviront de support à la prise de décision finale quant à l'introduction ou non de cette nouvelle collecte sur une base régulière.

Ainsi, la BCL a décidé de solliciter tous les établissements de crédits résidents pour participer à cette enquête afin d'obtenir des informations de qualité en vue d'une prise de décision en la matière.

Nous attirons en particulier l'attention des déclarants sur les points suivants:

- 1 Les positions de titres à rapporter par les déclarants se réfèrent à la situation comptable de fin décembre 2011. Il y a lieu de fournir uniquement les titres identifiés par un code ISIN.
- 2 Les déclarants doivent rapporter les titres de créance et de participation détenus pour compte de clients non-résidents. Les clients non-résidents doivent être identifiés avec le code pays de leurs pays de résidence et le code secteur BCL utilisé dans le cadre du reporting statistique.
- 3 Les définitions à appliquer sont celles en vigueur pour la collecte «Reporting titre par titre des établissements de crédit / Informations sur les avoirs détenus pour compte de tiers – BOB».
- 4 Les déclarants peuvent rapporter au choix:
  - 4.1 des informations agrégées (totaux par type d'instruments, code pays et code secteur du client, code pays de l'émetteur du titre, montant rapporté)
  - 4.2 des informations individuelles (titres identifiés par un code ISIN sur une base titre par titre en définissant le client par son code pays et son code secteur.

La BCL met à disposition, sur son site internet, un fichier Excel reprenant les modèles à utiliser pour la compilation et la transmission de ces données.

- 5 Nous vous prions dès lors de télécharger les fichiers EXCEL via le lien [http://www.bcl.lu/fr/reporting/Etablissements\\_de\\_credit/Lettres\\_circulaires/index.html](http://www.bcl.lu/fr/reporting/Etablissements_de_credit/Lettres_circulaires/index.html) afin d'y saisir les données.

Les informations ainsi enregistrées sont à sauvegarder et à transmettre à la BCL soit :

- 5.1 via CD-ROM
- 5.2 via email en utilisant la transmission électronique mise à disposition par Sofie (canal OTX) ou E-file (Correspondances diverses).

Il convient de respecter impérativement la structure du nom du fichier (OTXREP-B0nnn-TPTBOB\_NR\_20111231\_B0nnn\_20120130\_001.xls où nnn correspond au numéro CSSF de l'établissement de crédit déclarant).

- 6 L'unité de compte pour la transmission des renseignements demandés est l'euro «EUR».

Finalement, nous vous prions de nous retourner les fichiers dûment complétés pour le 29 février 2012 au plus tard et/ou, le cas échéant, d'informer la BCL par courrier si votre établissement de crédit n'a pas de position à renseigner.

Les CD-ROM sont à envoyer à l'adresse suivante:

Banque centrale du Luxembourg  
Département Statistiques  
Section Statistiques extérieures  
2, boulevard Royal  
L-2983 Luxembourg

Pour tous les renseignements concernant l'application de cette lettre-circulaire, nous vous prions de vous adresser directement à la section Statistiques extérieures (e-mail [reporting.bop@bcl.lu](mailto:reporting.bop@bcl.lu)).

Veillez croire, Mesdames, Messieurs, à l'assurance de notre parfaite considération.

BANQUE CENTRALE DU LUXEMBOURG

Roland Nockels  
Chef du département Statistiques

Serge Kolb  
Directeur