

Rapport S 1.3

Bilan statistique mensuel des fonds d'investissement monétaires

Rapport S 2.13

Bilan statistique trimestriel des fonds d'investissement non monétaires

Sommaire

1	Introduction	3
1.1	Population déclarante	3
1.2	Périodicité et délai de communication	3
2	Les différents types de ventilation	4
2.1	Le pays	4
2.2	La devise.....	5
2.3	Le secteur économique.....	6
2.4	L'échéance initiale.....	7

1 Introduction

1.1 Population déclarante

Le rapport S 1.3 est à fournir par tous les fonds d'investissement monétaires.

Le rapport S 2.13 est à fournir par tous les fonds d'investissement non monétaires.

1.2 Périodicité et délai de communication

Le rapport S 1.3 est à fournir mensuellement et doit parvenir à la BCL au plus tard dans les 10 jours ouvrables après la fin de la période à laquelle il se rapporte.

Le rapport S 2.13 est à fournir trimestriellement et doit parvenir à la BCL au plus tard dans les 20 jours ouvrables après la fin de la période à laquelle il se rapporte.

La BCL établit et publie, sur son site Internet, un calendrier de remise des rapports statistiques.

2 Les différents types de ventilation

Les actifs et les passifs sont à ventiler selon:

- Le pays de la contrepartie
- La devise dans laquelle ils sont libellés
- Le secteur économique de la contrepartie
- L'échéance initiale

Les nomenclatures et les codes sont détaillés dans le document «Définitions et concepts pour le reporting statistique des fonds d'investissement».

Toutefois, il est à noter que les actifs et les passifs ne doivent pas nécessairement être ventilés pour l'ensemble des ventilations présentées dans cette nomenclature. Ainsi, seules les ventilations demandées sur le rapport statistique S 1.3 / S 2.13 en annexe aux présentes instructions, sont à rapporter à la BCL.

2.1 Le pays

Les actifs et les passifs sont à ventiler selon le pays de résidence ou du siège social de la contrepartie à l'aide d'un code ISO à deux caractères.

Outre les codes pays ISO, les codes pays spécifiques suivants peuvent être utilisés:

Code	Libellé
XA	Banque centrale européenne
XB	Institutions internationales, hors institutions européennes, ayant leur siège hors du Luxembourg
XC	Institutions internationales, hors institutions européennes, ayant leur siège au Luxembourg
XD	Institutions européennes ayant leur siège au Luxembourg
XE	Banque européenne d'Investissement
XG	Institutions européennes ayant leur siège hors du Luxembourg
XI	Mécanisme européen de stabilité
XJ	Fonds européen de stabilité financière

Remarque.

- Lorsque les montants ne sont pas à ventiler selon le pays de la contrepartie, il y a lieu de renseigner un montant total avec le code pays XX «Non ventilé».
Le code pays XX «Non ventilé» n'est accepté que pour les rubriques mentionnées sur le rapport statistique S 1.3 / S 2.13 en annexe aux présentes instructions.

2.2 La devise

Les actifs et les passifs sont à ventiler selon la devise dans laquelle ils sont libellés à l'aide d'un code ISO à trois caractères.

Remarque.

- Lorsque les montants ne sont pas à ventiler selon la devise, il y a lieu de renseigner un montant total avec le code devise XXX «Non ventilé».
Le code devise XXX «Non ventilé» n'est accepté que pour les rubriques mentionnées sur le rapport statistique S 1.3 / S 2.13 en annexe aux présentes instructions.

2.3 Le secteur économique

Les montants sont à ventiler suivant le secteur économique de la contrepartie à l'aide d'un code à cinq caractères figurant sur la liste suivante.

Code	Libellé
11000	Administration publique centrale
12100	Administrations d'Etats fédérés
12200	Administrations publiques locales
12300	Administrations de sécurité sociale
21000	Sociétés non financières
22110	Ménages - Entreprises individuelles
22120	Ménages - Personnes physiques
22200	Institutions sans but lucratif au service des ménages
31000	Banque centrale
32100	Etablissements de crédit
32200	Autres institutions de dépôt
33000	Fonds d'investissement monétaires
41000	Fonds d'investissement non monétaires
42100	Véhicules de titrisation
42200	Contreparties centrales
42900	Autres intermédiaires financiers
43000	Auxiliaires financiers
44000	Institutions financières captives et les prêteurs non institutionnels
45000	Sociétés d'assurance
46000	Fonds de pension

Remarque.

- Lorsque les montants ne sont pas à ventiler selon le secteur économique de la contrepartie, il y a lieu de renseigner un montant total avec le code secteur 90000 «Non ventilé».

Le code secteur 90000 «Non ventilé» n'est accepté que pour les rubriques mentionnées sur le rapport statistique S 1.3 / S 2.13 en annexe aux présentes instructions.

2.4 L'échéance initiale

Les montants sont à ventiler selon leur échéance initiale à l'aide d'un code à huit caractères figurant sur la liste suivante.

Code	Echéance initiale
I000-01A	Inférieure ou égale à 1 an
I01A-02A	Supérieure à 1 an et inférieure ou égale à 2 ans
I02A-05A	Supérieure à 2 ans et inférieure ou égale à 5 ans
I05A-999	Supérieure à 5 ans

Remarque.

- Lorsque les montants ne sont pas à ventiler selon l'échéance initiale, il y a lieu de renseigner un montant total avec le code échéance «I999-999» Non ventilé.
 Le code échéance «I999-999» Non ventilé n'est accepté que pour les rubriques mentionnées sur le rapport statistique S 1.3 / S 2.13 en annexe aux présentes instructions.