

Tabellen 04.90 t/m 04.92

(aanduiden met x)

04.90	04.91	04.92

GEDETAILLEERDE INVENTARIS VAN DE BAISSEPOSITIE EFFECTEN (00/222.2)

1. Rapporterende kredietinstelling : code

Naam :

2. Positie waarover wordt gerapporteerd (aanduiden met x) :

- territoriale positie

3. a. Rapporteringdatum : (jaar) (maand) (dag)

c. Frequentie van de rapportering :
- elk maandultimo

b. Nummer van de informatiedrager :

4. Munten waarover en waarin gerapporteerd wordt :

- alle munten : in elk van de
betrokken munt

5. Grootheid waarin de bedragen zijn uitgedrukt :

duizenden

Toelichting bij tabellen 04.90 t/m 04.92 : zie de tekst die volgt op de tabellen.

Tabellen 04.90 - I. BAISSEPOSITIE IN SCHULDBEWIJZEN OP TEN HOOGSTE EEN JAAR

Code	Nummer van de subpost v/d boekhoudstaat waarin de effecten zijn opgenomen	Identificatie van de effecten			Munt (ISO-4217 code)	Nominale waarde ⁽¹⁾	Bedrag ⁽¹⁾ waarvoor de effecten zijn opgenomen in de betrokken subpost van de boekhoudstaat	Marktwaarde ⁽¹⁾	ID
		Code	ID	Benaming					
	05	10	11	15	40	50	60	70	71
001									
002									
003									

⁽¹⁾ Bedrag in de betrokken munt.

Tabellen 04.91 - II. BAISSEPOSITIE IN SCHULDBEWIJZEN OP MEER DAN EEN JAAR

	Nummer van de subpost v/d boekhoudstaat waarin de effecten zijn opgenomen	Identificatie van de effecten			Munt (ISO-4217 code)	Nominale waarde ⁽¹⁾	Bedrag ⁽¹⁾ waarvoor de effecten zijn opgenomen in de betrokken subpost van de boekhoudstaat	Markt-waarde ⁽¹⁾	ID
		Code	ID	Benaming					
Code	05	10	11	15	40	50	60	70	71
001									
002									
003									

⁽¹⁾ Bedrag in de betrokken munt.

Tabellen 04.92 - III. BAISSEPOSITIE IN AANDELEN EN GELIJKGESTELDE EFFECTEN

Code	Nummer van de subpost v/d boekhoudstaat waarin de effecten zijn opgenomen	Identificatie van de effecten			Aantal ⁽¹⁾	Munt (ISO-4217 code)	Bedrag ⁽²⁾ waarvoor de effecten zijn opgenomen in de betrokken subpost van de boekhoudstaat	Marktwaarde ⁽²⁾	ID
		Code	ID	Benaming					
	05	10	11	15	25	40	60	70	71
001									
002									
003									

⁽¹⁾ In eenheden.

⁽²⁾ Bedrag in de betrokken munt.

Toelichting bij tabellen 04.90 t/m 04.92**GEDETAILLEERDE INVENTARIS VAN DE BAISSEPOSITIE EFFECTEN**

1. In deze tabellen wordt nominatief opgave gedaan van de passiva opgenomen in de post 222.2 van de boekhoudstaat.
2. In kolom 10 (Code) wordt met code bij voorrang de ISIN-code bedoeld. In kolom 11 (ID = Identificatie) wordt aangegeven of de code in kolom 10 de ISIN-code is ("ISIN") dan wel, bij gebrek hieraan, een andere code ("CUSIP", "SEDOL", "COMMON", enz.).
3. De kredietinstellingen met kantoren in het buitenland moeten enkel rapporteren over de territoriale positie (positiecode 10).
4. In kolom 71 (ID = Identificatie) wordt met een cijfer aangegeven of de marktwaarde in kolom 70, een reële marktwaarde in clean price is ("1") dan wel, bij gebrek hieraan, de beste schatting ("2").

Validatieregels voor de tabellen 04.90 t/m 04.92

Tabellen 04.90 t/m 04.92 "Gedetailleerde inventaris van de baissepositie effecten"

De rapporterende instellingen moeten enkel de territoriale positie (positiecode 10) van de tabellen 04.90 t/m 04.92 meedelen.

1 Territoriale positie

1.1 *Intra-consistentie*

De intra-validatie bestaat uitsluitend uit de controle van de ingebrachte codes voor de kolommen van

001 002 003	tabel 04.90 :	05 = 222.2 10 = ISIN-code; indien geen enkele ISIN-code bestaat, andere code; bij gebrek aan enige code zijn blancos toegelaten maar deze zullen opgevolgd worden 11 = identificatie van het codetype opgenomen in kolom 10; de waarden moeten ofwel uit de vooraf vastgestelde tabel komen ofwel een benaming zijn voor codetypes die niet in de vooraf vastgestelde tabel voorkomen, ofwel blancos zijn ingeval geen enkele code vermeld is in kolom 10 40 = bestaande ISO-muntcode 71 = identificatie van het type marktwaarde die voorkomt in kolom 70; de waarden zijn ofwel "1" voor een reële marktwaarde in clean price ofwel bij gebrek hieraan, "2" voor de beste schatting; een blanco is niet toegelaten Controle op het formaat van de effectencode en op het uniek zijn van de sleutel "rubriek" (kol.05) en "effectencode" (kol.10) kol.50 ≠ 0, kol.60 ≠ 0 De inter-consistentie tussen de meegedeelde ISO-muntcodes per rapporterende instelling en die gebruikt worden door de NBB voor een zelfde effect
001 002 003	tabel 04.91 :	05 = 222.2 10 = ISIN-code; indien geen enkele ISIN-code bestaat, andere code; bij gebrek aan enige code zijn blancos toegelaten maar deze zullen opgevolgd worden 11 = identificatie van het codetype opgenomen in kolom 10; de waarden moeten ofwel uit de vooraf vastgestelde tabel komen ofwel een benaming zijn voor codetypes die niet in de vooraf vastgestelde tabel voorkomen, ofwel blancos zijn ingeval geen enkele code vermeld is in kolom 10 40 = bestaande ISO-muntcode 71 = identificatie van het type marktwaarde die voorkomt in kolom 70; de waarden zijn ofwel "1" voor een reële marktwaarde in clean price ofwel bij gebrek hieraan, "2" voor de beste schatting; een blanco is niet toegelaten Controle op het formaat van de effectencode en op het uniek zijn van de sleutel "rubriek" (kol.05) en "effectencode" (kol.10) kol.50 ≠ 0, kol.60 ≠ 0 De inter-consistentie tussen de meegedeelde ISO-muntcodes per rapporterende instelling en die gebruikt worden door de NBB voor een zelfde effect
	tabel 04.92 :	05 = 222.2 10 = ISIN-code; indien geen enkele ISIN-code bestaat, andere code; bij gebrek aan enige code zijn blancos toegelaten maar deze zullen opgevolgd worden 11 = identificatie van het codetype opgenomen in kolom 10; de waarden moeten ofwel uit de vooraf vastgestelde tabel komen ofwel een benaming zijn voor

	codetypes die niet in de vooraf vastgestelde tabel voorkomen, ofwel blancs zijn ingeval geen enkele code vermeld is in kolom 10
	40 = bestaande ISO-muntcode
	71 = identificatie van het type marktwaarde die voorkomt in kolom 70; de waarden zijn ofwel "1" voor een reële marktwaarde in clean price ofwel bij gebrek hieraan, "2" voor de beste schatting; een blanco is niet toegelaten
001	Controle op het formaat van de effectencode en op het uniek zijn van de sleutel "rubriek" (kol.05), "effectencode" (kol.10) en muntcode (kol.40)
002	kol.25 ≠ 0, kol.60 ≠ 0
003	De inter-consistentie tussen de meegeedeelde ISO-muntcodes per rapporterende instelling en die gebruikt worden door de NBB voor een zelfde effect

Bij overeenkomst wordt bij afwezigheid van enige boekwaarde een "1" ingevuld in de kolom 60.

1.2 Inter-consistentie

Per tabel 04.90 t/m 04.92 moet de som van de bedragen, in tegenwaarde EUR, van de kolom "Bedrag waarvoor de effecten zijn opgenomen in de betrokken subpost van de boekhoudstaat" kleiner zijn dan of gelijk zijn aan de waarde in de overeenstemmende balanspost (222.2) van de passiefstaat op territoriale positie.

Voor elke van de tabellen 04.90 t/m 04.92 geldt:

code 222.2 in kolom 05 :

- | | |
|-----|--|
| 501 | - muntcode ISO is gelijk aan EUR: som van de geselecteerde gegevens in kolom 60, is gelijk aan of kleiner dan de waarde van [(222.2),(10)] uit de passiefstaat op territoriale positie ; |
| 502 | - muntcode ISO is verschillend van EUR: som van de geselecteerde gegevens in kolom 60, geconverteerd naar EUR, is gelijk aan of kleiner dan de waarde van [(222.2),(15)] uit de passiefstaat op territoriale positie ; |

Voor de tabellen 04.90 t/m 04.92 samen moet de som van de bedragen, in tegenwaarde EUR, van de kolom "Bedrag waarvoor de effecten zijn opgenomen in de betrokken subpost van de boekhoudstaat" gelijk zijn aan de waarde in de overeenstemmende balanspost (222.2) van de passiefstaat op territoriale positie.

Voor alle tabellen 04.90 t/m 04.92 samen geldt:

code 222.2 in kolom 05 :

- | | |
|-----|--|
| 503 | - muntcode ISO is gelijk aan EUR: som van de geselecteerde gegevens in kolom 60, is gelijk aan de waarde van [(222.2),(10)] uit de passiefstaat op territoriale positie; |
| 504 | - muntcode ISO is verschillend van EUR: som van de geselecteerde gegevens in kolom 60, geconverteerd naar EUR, is gelijk aan de waarde van [(222.2),(15)] uit de passiefstaat op territoriale positie; |

Bovendien voor elke individuele tabel :

- | | |
|-----|---------------------------------------|
| | tabel 04.90 : |
| 505 | Cf. Bijlage 2.2 ("NIHIL"-verklaring). |
| | tabel 04.91 : |
| 505 | Cf. Bijlage 2.2 ("NIHIL"-verklaring). |

505 tabel 04.92 :
Cf. Bijlage 2.2 ("NIHIL"-verklaring).

Per tabel 04.9N en per effect, zal de impliciete koers van het effect berekend worden; de waarschijnlijkheid ervan zal beoordeeld worden door vergelijking met de Centralised Securities Data Base van de Europese Centrale Bank.

“NIHIL-VERKLARING” (EFFECTENPORTEFEUILLE)

Volgende tabellen van de effectenportefeuille mogen NOOIT NIHIL verklaard worden als bepaalde rubrieken uit de boekhoudstaat waarden bevatten

Te verwerpen NIHIL-verklaring
Portefeuille-tabel

506	T.03.90	indien	[(131.1)(05)] <> 0 of [(131.2)(05)] <> 0 of [(131.3)(05)] <> 0 of [(131.4)(05)] <> 0
507	hetzij T.03.90 hetzij T.03.91	indien	[(131.6)(05)] <> 0
506	T.03.91	indien	[(131.5)(05)] <> 0
506	T.03.92	indien	[(132.9)(05)] <> 0
506	T.03.93	indien	[(133.9)(05)] <> 0
506	T.03.94	indien	[(134.1)(05)] <> 0 of [(134.2)(05)] <> 0 of [(134.3)(05)] <> 0 of [(134.51)(05)] <> 0
506	T.03.95	indien	[(134.4)(05)] <> 0 of [(134.52)(05)] <> 0
506	T.03.96	indien	[(135.1)(05)] <> 0 of [(135.2)(05)] <> 0 of [(135.3)(05)] <> 0 of [(135.51)(05)] <> 0
506	T.03.97	indien	[(135.41)(05)] <> 0 of [(135.42)(05)] <> 0 of [(135.52)(05)] <> 0
506	T.03.98	indien	[(171.29)(05)] <> 0 of [(171.39)(05)] <> 0 of [(171.41)(05)] <> 0
505	hetzij T.04.90 hetzij T.04.91 hetzij T.04.92	indien	[(222.2)(05)] <> 0
505	T.04.93	indien	[(231.1)(05)] <> 0 of indien [(232.1)(05)] <> 0

506	hetzij T.04.93 hetzij T.04.94	indien	[(232.3)(05)] <> 0 of
		indien	[(233.1)(05)] <> 0 of
		indien	[(233.2)(05)] <> 0 of
		indien	[(271)(05)] <> 0 of
		indien	[(272)(05)] <> 0
505	T.04.94	indien	[(231.2)(05)] <> 0 of
		indien	[(232.2)(05)] <> 0
503	T.04.95	indien	[(281.9)(05)] <> 0
505	hetzij T.05.90 hetzij T.05.91 hetzij T.05.92	indien	[(371.1)(05)] <> 0 of
		indien	[(371.2)(05)] <> 0 of
		indien	[(371.3)(05)] <> 0 of
		indien	[(371.4)(05)] <> 0
