SIX TELEKURS

# Enquête de la BNS sur les portefeuilles de titres réalisée grâce aux données financières de SIX Telekurs

Fin 2008, la Banque Nationale Suisse (BNS) établira pour la première fois un relevé statistique détaillé des produits structurés. Grâce à ses informations financières fiables, SIX Telekurs aide les banques soumises à l'obligation de déclarer, dans le cadre du reporting, ces nouvelles catégories de placements. Pour ce faire, elle propose les classifications correspondantes permettant la saisie automatique de toutes les autres catégories de titres dans les statistiques globales.

Une des tâches légales qui incombent à la Banque Nationale Suisse est la collecte des données statistiques concernant de nombreux domaines relatifs aux opérations financières réalisées en Suisse. Elle est également chargée d'établir le relevé statistique des portefeuilles de titres. Toutes les institutions financières domiciliées en Suisse doivent fournir à la Banque Nationale Suisse en fin d'année, ou dans certains cas à la fin de chaque mois, des statistiques détaillées concernant les portefeuilles de titres qu'elles détiennent à cette date. A compter du 31 décembre 2008, et pour la première fois, la Banque Nationale Suisse collectera des données détaillées sur les produits structurés. Pour procéder à leur classification, la BNS se base sur les catégories de produits définies par l'Association Suisse des Produits Structurés (ASPS).

En tant que division de SIX Group SA, SIX Telekurs SA apporte son soutien au marché financier suisse dans sa volonté de fournir à ses acteurs des services haut de gamme. SIX Telekurs SA propose ainsi aux banques un service de données structurées et pouvant être traitées de manière automatisée, ce qui aide les banques soumises à l'obligation de reporting à répondre aux exigences de la Banque Nationale Suisse :

- Pour les titres sauvegardés dans sa base de données, SIX Telekurs fournit aux banques des classifications supplémentaires. Celles-ci correspondent à l'ensemble des catégories de titres apparaissant dans les statistiques de la Banque Nationale Suisse. Les banques soumises à l'obligation de reporting peuvent ainsi remplir aisément et automatiquement les champs de données correspondants dans le formulaire correspondant de la BNS.
- SIX Telekurs répertorie tous les produits structurés selon les catégories principales de l'ASPS, à savoir pour les instruments négociés en Suisse, mais aussi pour les produits structurés négociés sur d'autres places boursières telles que l'Allemagne, les Pays-Bas et la France.

## Avantages des données fournies par SIX Telekurs destinées au reporting à la BNS

- Reporting uniforme et efficace pour toutes les catégories de titres, y compris les sous-catégories, conformément aux nouvelles conditions exigées par la Banque Nationale Suisse.
- Traitement automatisé des données et assistance supplémentaire par le biais des produits de visualisation.
- Les produits structurés des places boursières hors de Suisse sont également classés selon les catégories principales préconisées par l'ASPS.

Banque nationale suisse
Statistique
Case postale
8022 Zurich
Téléphone 044 631 31 11
Téléfax 044 631 81 12

# Stocks de titres en fin de mois/d'année

en milliers de francs

Etat au: _____

Des précisions sur la répartition par secteurs des titulaires des dépôts et sur la délimitation des catégories de titres sont données **dans les commentaires**.



Indiquez votre code s.v.p.

| **CHF** **Titres en francs suisses** | Dépôts dont les titulaires sont domiciliés **en Suisse** | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Etablissements non financiers | Etablissements financiers (sans les banques) | | | | | | Collectivités publiques | Assurances sociales |
| | | Total | Autres activités financières et de gestion de fortune | | Assurances et caisses de pensions | | Services auxiliaires des activités financières et des assurances | | |
| | | | Total | dont: établissements de placements collectifs selon LPCC | Total | dont: caisses de pensions | | | |
| | col. 01 | col. 03 | col. 20 | col. 22 | col. 07 | col. 08 | col. 21 | col. 09 | col. 10 |
| **Emetteurs en Suisse** | | | | | | | | | |
| Papiers monétaires | 01 | 01 | 01 | 01 | 01 | 01 | 01 | 01 | 01 |
| Obligations de caisse | 02 | 02 | 02 | 02 | 02 | 02 | 02 | 02 | 02 |
| Obligations | 03 | 03 | 03 | 03 | 03 | 03 | 03 | 03 | 03 |
| dont: obligations de collectivités publiques | 04 | 04 | 04 | 04 | 04 | 04 | 04 | 04 | 04 |
| dont: obligations de la Confédération | 05 | 05 | 05 | 05 | 05 | 05 | 05 | 05 | 05 |
| Actions | 06 | 06 | 06 | 06 | 06 | 06 | 06 | 06 | 06 |
| Parts de placements collectifs (lignes 24+26) | 23 | 23 | 23 | 23 | 23 | 23 | 23 | 23 | 23 |
| Selon LPCC | 24 | 24 | 24 | 24 | 24 | 24 | 24 | 24 | 24 |
| dont: «open-end» | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 |
| Autres | 26 | 26 | 26 | 26 | 26 | 26 | 26 | 26 | 26 |
| dont: «open-end» | 27 | 27 | 27 | 27 | 27 | 27 | 27 | 27 | 27 |
| dont: stratégie «papiers monétaires» | 28 | 28 | 28 | 28 | 28 | 28 | 28 | 28 | 28 |
| Produits structurés (lignes 32 à 36) | 21 | 21 | 21 | 21 | 21 | 21 | 21 | 21 | 21 |
| Produits à effet de levier | 32 | 32 | 32 | 32 | 32 | 32 | 32 | 32 | 32 |
| Produits de participation | 33 | 33 | 33 | 33 | 33 | 33 | 33 | 33 | 33 |
| Produits d'optimisation de la performance | 34 | 34 | 34 | 34 | 34 | 34 | 34 | 34 | 34 |
| Produits avec protection du capital | 35 | 35 | 35 | 35 | 35 | 35 | 35 | 35 | 35 |
| Autres | 36 | 36 | 36 | 36 | 36 | 36 | 36 | 36 | 36 |
| Autres titres (sans dérivés) | 09 | 09 | 09 | 09 | 09 | 09 | 09 | 09 | 09 |
| Total | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 |
| **Emetteurs à l'étranger** | | | | | | | | | |
| Papiers monétaires | 11 | 11 | 11 | 11 | 11 | 11 | 11 | 11 | 11 |
| Obligations | 12 | 12 | 12 | 12 | 12 | 12 | 12 | 12 | 12 |
| dont: obligations de collectivités publiques | 13 | 13 | 13 | 13 | 13 | 13 | 13 | 13 | 13 |
| Actions | 14 | 14 | 14 | 14 | 14 | 14 | 14 | 14 | 14 |
| Parts de placements collectifs | 29 | 29 | 29 | 29 | 29 | 29 | 29 | 29 | 29 |
| dont: «open-end» | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 | 30 |
| dont: stratégie «papiers monétaires» | 31 | 31 | 31 | 31 | 31 | 31 | 31 | 31 | 31 |
| Produits structurés (lignes 37 à 41) | 22 | 22 | 22 | 22 | 22 | 22 | 22 | 22 | 22 |
| Produits à effet de levier | 37 | 37 | 37 | 37 | 37 | 37 | 37 | 37 | 37 |
| Produits de participation | 38 | 38 | 38 | 38 | 38 | 38 | 38 | 38 | 38 |
| Produits d'optimisation de la performance | 39 | 39 | 39 | 39 | 39 | 39 | 39 | 39 | 39 |
| Produits avec protection du capital | 40 | 40 | 40 | 40 | 40 | 40 | 40 | 40 | 40 |
| Autres | 41 | 41 | 41 | 41 | 41 | 41 | 41 | 41 | 41 |
| Autres titres (sans dérivés) | 17 | 17 | 17 | 17 | 17 | 17 | 17 | 17 | 17 |
| Total | 18 | 18 | 18 | 18 | 18 | 18 | 18 | 18 | 18 |

Les classifications correspondent à l'ensemble des catégories de titres apparaissant dans les statistiques de la Banque Nationale Suisse. Ainsi, les banques soumises à l'obligation de reporting peuvent remplir aisément et automatiquement les champs de données correspondants.

## Tout ce que vous devez savoir sur les données fournies par SIX Telekurs en vue du reporting à la BNS

### Dans quels produits Telekurs les données nécessaires au reporting à la BNS sont-elles disponibles ?

Des données supplémentaires en vue du reporting à la BNS sont mises à disposition des clients de Valordata Feed (VDF). Ces données peuvent être également visualisées dans Telekurs iD.

### Quelles données Valordata Feed (VDF) peut-il me fournir ?

- Domicile de l'émetteur
- Catégorie des titres, par exemple, obligations d'émetteurs suisses
- Sous-catégorie, par exemple, obligations d'émetteurs suisses, pouvoirs publics

### Dois-je commander séparément les données nécessaires au reporting à la BNS ?

Nous proposons les données nécessaires au reporting à la BNS aux clients de VDF comme un service optionnel.

### A quelle date les données nécessaires au reporting à la BNS seront-elles disponibles ?

A partir du 4e trimestre 2008, pour les clients de VDF. Les utilisateurs de Telekurs iD pourront également consulter les données VDF dans leur produit de visualisation.

Nos conseillers clientèle Telekurs locaux se tiennent à votre disposition pour toute information concernant le reporting à la BNS. N'hésitez pas à les contacter.

**SIX Telekurs Ltd**
Hardturmstrasse 201
P.O. Box
CH-8021 Zürich

P +41 44 279 5111
F +41 44 279 5112
info@six-telekurs.com
www.six-telekurs.com

**SIX Telekurs SA**
Route de Meyrin 49
Case postale 260
1211 Genève 28

P +41 22 827 7711
F +41 22 827 7735
info@six-telekurs.com
www.six-telekurs.com

**SIX Telekurs SA**
Via Cantonale 1
CH-6901 Lugano

P +41 91 924 7111
F +41 91 924 7112
info@six-telekurs.com
www.six-telekurs.com