

**Manuel de transmission électronique
du reporting titre par titre des
établissements de crédit
Informations sur les avoirs détenus
pour compte de clients - BOB**

Sommaire

1	Introduction	3
2	Transmission.....	4
2.1	Attribution du nom du fichier.....	4
2.2	Moyen de transmission	5
3	Visualisation du schéma XML pour le reporting titre par titre	6
3.1	Entête	6
3.1.1	Les attributs.....	7
3.1.2	La branche Header.....	7
3.1.3	La ligne.....	10
3.1.4	Titres identifiés par un numéro ISIN.....	12
3.1.5	Titres identifiés par un numéro autre que l'ISIN	14
4	Format des variables dans le fichier XML.....	17
<u>1</u>	<u>Introduction</u>	<u>3</u>
<u>2</u>	<u>Transmission.....</u>	<u>4</u>
<u>2.1</u>	<u>Attribution du nom du fichier.....</u>	<u>4</u>
<u>2.2</u>	<u>Moyen de transmission</u>	<u>5</u>
<u>3</u>	<u>Visualisation du schéma XML pour le reporting titre par titre</u>	<u>6</u>
<u>3.1</u>	<u>Entête</u>	<u>6</u>
<u>3.1.1</u>	<u>Les attributs.....</u>	<u>7</u>
<u>3.1.2</u>	<u>La branche Header.....</u>	<u>7</u>
<u>3.1.3</u>	<u>La ligne.....</u>	<u>10</u>
<u>3.1.4</u>	<u>Titres identifiés par un numéro ISIN.....</u>	<u>12</u>
<u>3.1.5</u>	<u>Titres identifiés par un numéro autre que l'ISIN</u>	<u>14</u>
<u>4</u>	<u>Format des variables dans le fichier XML.....</u>	<u>17</u>

1 Introduction

Ce guide indique les caractéristiques techniques qui devront être utilisées pour la transmission informatique des données du reporting titre par titre relatif aux données sur les avoirs détenus pour compte de tiers des établissements de crédit.

Les instructions relatives à la collecte sont décrites dans le document Reporting titre par titre relatif aux données sur les avoirs détenus pour compte de tiers des établissements de crédit.

L'objet de ce document est de décrire les principes généraux du reporting au format XML. Le schéma XML et une documentation technique sont disponibles au téléchargement sur le site internet de la BCL. Il est important de retenir que la conception informatique du reporting XML est basée sur une structure arborescente.

Les données à rapporter doivent satisfaire à des contrôles généraux de format ou d'appartenance à des listes de codes. Les possibilités de codes dépendent aussi de l'endroit où se situe la donnée dans l'arborescence du schéma.

Le schéma inclut des contraintes de format sur les données, mais ne précise pas nécessairement la validité d'un code respectant le format. Les nomenclatures doivent être respectées ainsi que les règles définies dans le présent document.

2 Transmission

2.1 Attribution du nom du fichier

La structure du nom du fichier est la suivante:

TPTBOB_aaaamm_Rrrrrrrrr_Dddddddddd_aaaammdd_nnn

où :

- TPT (Titre Par Titre) identifie la collecte titre par titre
- BOB (Bank Off Balance sheet) identifie les données sur les avoirs détenus pour compte de tiers
- aaaamm représente l'année et le mois auxquels les données se réfèrent
- R identifie le type de reporter
Le reporter est l'organisme qui envoie les données. Les banques doivent utiliser la lettre B.
- rrrrrrrrr permet d'identifier le reporter
Les numéros d'identification sont ceux attribués par la CSSF. Les chiffres à gauche sont égaux à 0.
Exemple: la banque no 999 est identifiée par 000000999.
- D identifie le type de déclarant
Le déclarant est l'organisme auquel se réfèrent les données. Les banques doivent utiliser la lettre B.
- dddddddd permet d'identifier le déclarant
Les numéros d'identification sont ceux attribués par la CSSF. Les chiffres à gauche sont égaux à 0.
Exemple: la banque no 999 est identifiée par 000000999.
- aaaammdd est la date de création du fichier
- nnn est le numéro de séquence du fichier
Le numéro de séquence permet de distinguer les fichiers créés le même jour pour le même reporting. A noter que le numéro de séquence du fichier recommence à 001 chaque jour; le numéro 000 n'est pas utilisé.

Exemple 1:

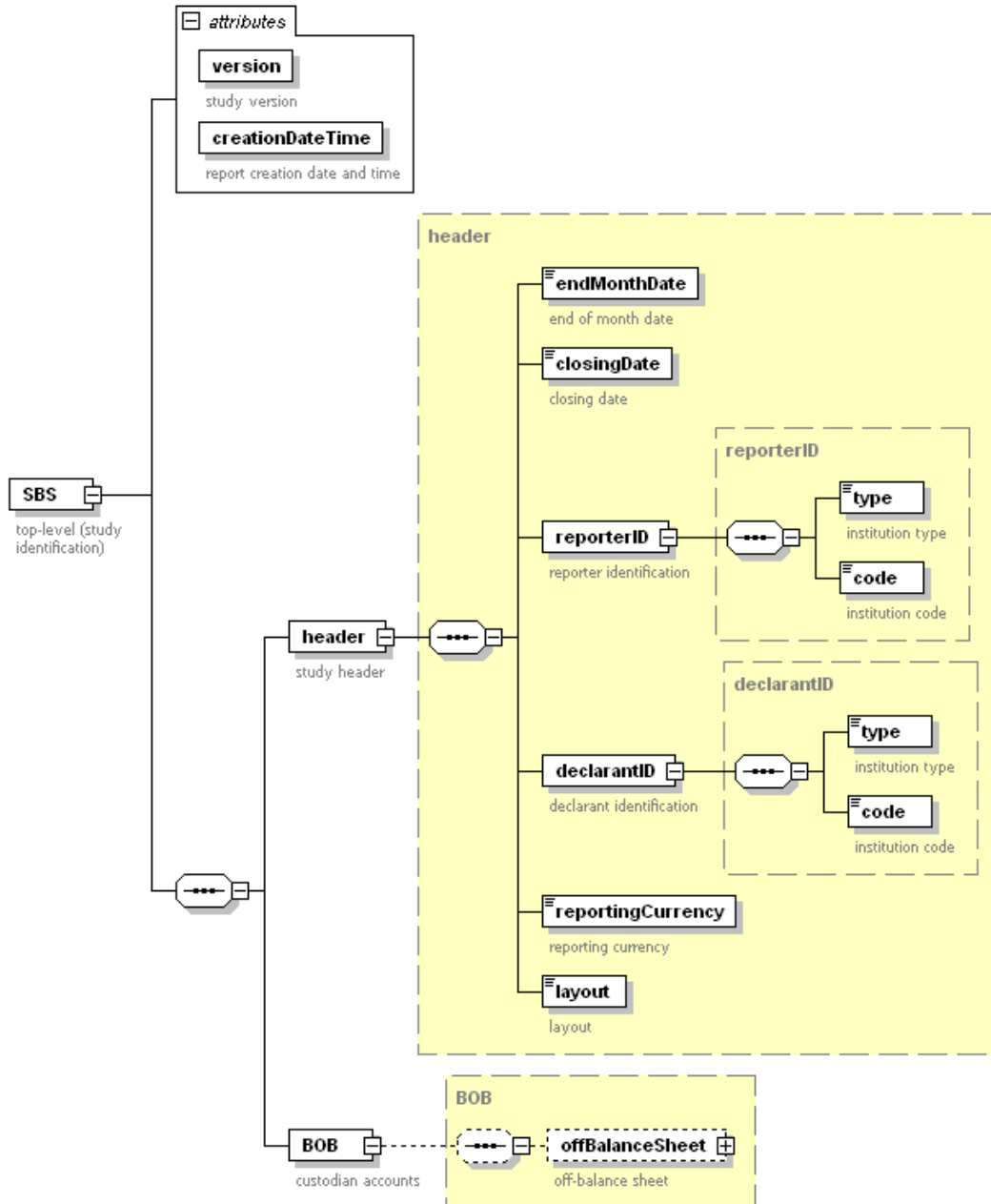
TPTBOB_201006_B000000999_B000000999_20100720_001.xml correspond au premier fichier créé le 20 juillet 2010, envoyé par l'établissement de crédit numéro 999 dont les données se réfèrent à l'établissement de crédit 999 pour le mois de juin 2010.

2.2 Moyen de transmission

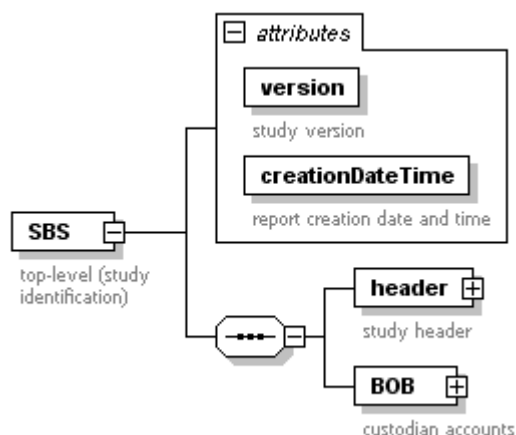
La BCL accepte l'utilisation des chemins de transmission électronique actuels offerts par Cetrel et Finesti, mais reste ouverte à tout nouveau moyen de transmission télématique sécurisé qui sera proposé, en commun par la BCL et les déclarants.

3 Visualisation du schéma XML pour le reporting titre par titre

3.1 Entête

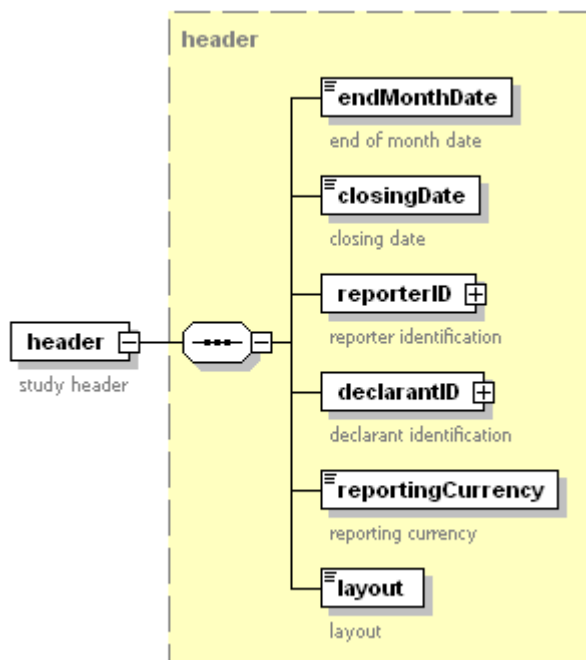


3.1.1 Les attributs



L'attribut (*version*) identifie la version du schéma XML utilisé pour le reporting.
 L'attribut (*creationDate Time*) identifie la date et l'heure de création du rapport.

3.1.2 La branche Header



La date de fin de mois de référence (*endMonthDate*) correspond au dernier jour du mois auquel se rapportent les données.

La date de clôture (*closingDate*) correspond à la date à laquelle sont établies les données.

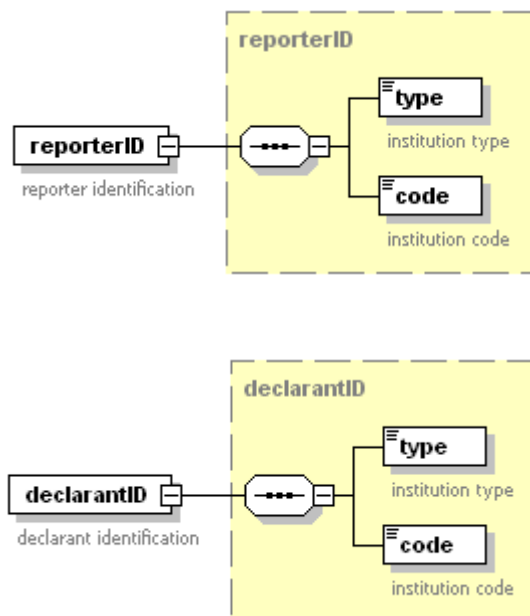
Exemple:

Ainsi, à titre d'exemple, pour le reporting titre par titre d'octobre 2010:

- la date de fin de mois est le 31.10.2010
- la date de clôture est par exemple le 29.10.2010

En effet, le 31 octobre 2010 étant un dimanche, les données sont en principe établies le dernier jour ouvrable précédant le 31 octobre 2010.

Les identifications du reporter (*reporterID*) et du déclarant (*declarantID*) comportent chacune le type de numéro d'identification (*type*) et le numéro d'identification (*code*).



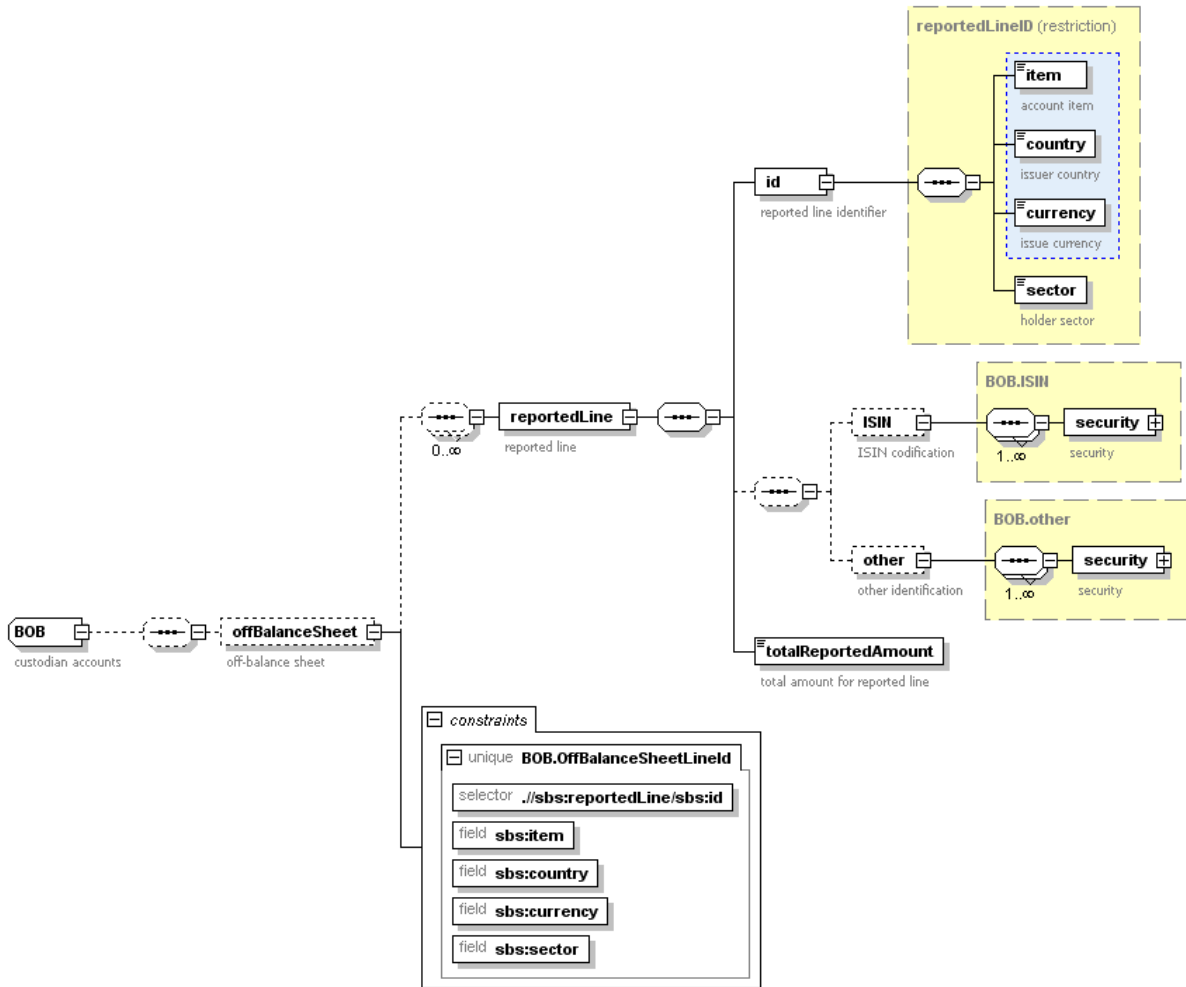
L'association des types de numéros et des valeurs autorisées sont:

Type de	Code
23	Numéro attribué par la CSSF pour les banques

La devise de reporting (*reportingCurrency*) doit être la devise dans laquelle sont libellés les comptes - c'est-à-dire la devise du bilan de l'établissement de crédit.

Le layout (*layout*) indique le numéro de version du rapport titre par titre. Le rapport titre par titre qui entrera ~~est actuellement~~ en vigueur en juin 2010 sera la seconde ~~est la première~~ version, ce qui implique qu'il s'agit du layout «10».

3.1.3 La ligne



La ligne (*reportedLine*) est identifiée par la rubrique comptable (*item*), le pays (*country*) et la devise (*currency*), le secteur (*sector*).

Identification de la ligne:

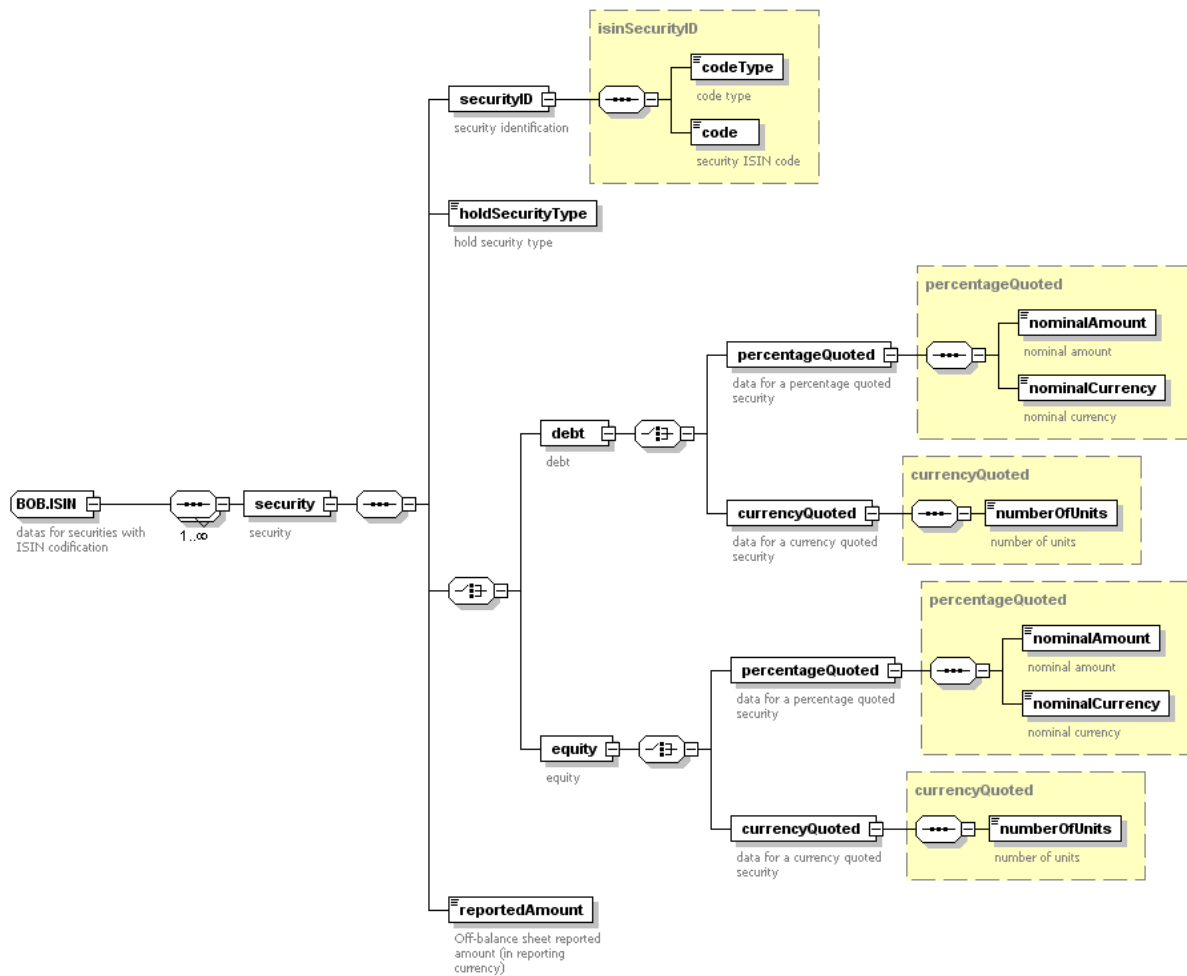
- la rubrique comptable qui est 3-070 par défaut
- le code pays qui est par défaut «XX»
- le code devise qui est par défaut «XXX»
- le code secteur qui suit la nomenclature définie par la BCL

Il convient de se référer aux instructions relatives au reporting titre par titre des avoirs détenus pour compte de clients et de n'utiliser que les rubriques comptables ainsi que les codes pays, devise et secteur exigés pour le reporting titre par titre des avoirs détenus pour compte de clients.

Le montant total rapporté (*totalReportedAmount*) correspond à la somme des montants (*reportedAmount*) des titres individuels inscrits au hors bilan sous un même identifiant de ligne. Il est exprimé dans la devise de reporting du bilan (*reportingCurrency*).

Les développements des branches «ISIN» et «Other» sont présentés dans les paragraphes suivants

3.1.4 Titres identifiés par un numéro ISIN



Dans le cas des titres identifiés par un numéro ISIN, l'identification du titre (*securityID*) est composée du:

- type de code (*codeType*) qui prend obligatoirement la valeur 1
- du code ISIN.

Le numéro ISIN doit satisfaire à un format (2 lettres, 9 caractères alphanumériques et 1 chiffre) dont le contrôle est effectué au travers du schéma XML. Ce numéro ISIN doit aussi satisfaire à un contrôle via sa clé.

Les types de détention (*holdSecurityType*) suivants peuvent être utilisés:

- 01
- 02
- 03
- 05

Le capital nominal (*nominalAmount*) est exprimé dans la devise du nominal (*nominalCurrency*) qui suit la codification ISO 4217.

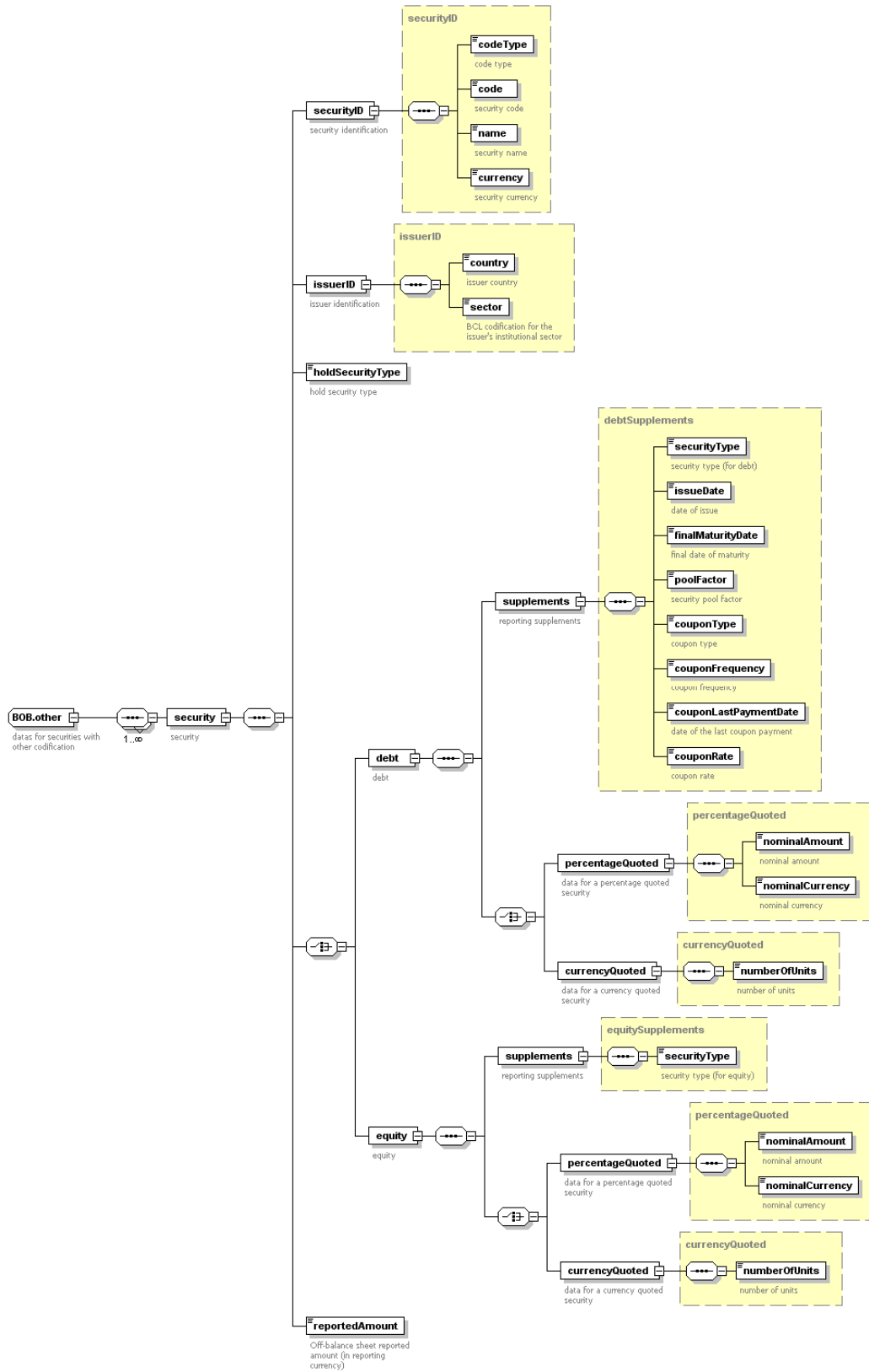
Le nombre d'unités (*numberOfUnits*) correspond au nombre de titres individuels, indépendamment des quotités de négociation.

Le montant rapporté (*reportedAmount*) est exprimé dans la devise du bilan (*reportingCurrency*). Ce montant est toujours positif sauf pour les titres renseignés avec le type de détention «05».

Remarque:

- Dans le cas des titres vendus à découvert, le montant nominal du nombre d'unités doit également être négatif

3.1.5 Titres identifiés par un numéro autre que l'ISIN



Dans le cas des titres identifiés par un code autre que le numéro ISIN, l'identification du titre (*securityID*) est composée du:

- type de code (*codeType*) qui prend obligatoirement la valeur 2
- du code interne utilisé par le déclarant pour identifier le titre (*code*)
- du nom du titre (*name*)
- de la devise du titre (*currency*).

Les types de détention (*holdSecurityType*) suivants peuvent être utilisés:

- 01
- 02
- 03
- 05

Le capital nominal (*nominalAmount*) est exprimé dans la devise du nominal (*nominalCurrency*) qui suit la codification ISO 4217.

Le nombre d'unités (*numberOfUnits*) correspond au nombre de titres individuels, indépendamment des quotités de négociation.

Le montant rapporté (*reportedAmount*) est exprimé dans la devise du bilan (*reportingCurrency*). Ce montant est toujours positif sauf pour les titres renseignés avec le type de détention «05».

Remarque:

- Dans le cas des titres vendus à découvert, le montant nominal du nombre d'unités doit également être négatif

Les caractéristiques de l'émetteur (*issuerID*) sont:

- le pays de l'émetteur
Le code du pays de résidence de l'émetteur du titre doit suivre la codification ISO 3166, complétée par les codes déterminés par la BCL pour les institutions

supranationales dans le document «Définitions et concepts pour le reporting statistique des établissements de crédit».

Il importe de noter que l'utilisation du code «XX» Non ventilé est interdite.

- le secteur économique de l'émetteur

Le code du secteur économique de l'émetteur doit suivre la classification reprise dans la liste qui figure à la page 53 dans le document «Définitions et concepts pour le reporting statistique des établissements de crédit».

Il importe de noter que l'utilisation du code «90000» Non ventilé est interdite.

Les données complémentaires pour la branche des titres de créance (*debt*):

- Le type de titre (*SecurityType*) prend obligatoirement la valeur F.33
- La date d'émission (*issueDate*) doit être antérieure à la date de maturité finale (*finalMaturityDate*)
- Le «*pool factor*» prend une valeur supérieure ou égale à 0. Lorsque les intérêts courus sont inclus, il est possible que le «*pool factor*» prenne une valeur supérieure à 1. Sa valeur diminue au fur et à mesure des remboursements jusqu'à 0 à l'échéance finale. Lorsque le «*pool factor*» ne s'applique pas à un titre de créance, la valeur par défaut à renseigner est 1.
- Lorsqu'aucun paiement de coupon n'est survenu, la date de paiement du dernier coupon (*couponLastPaymentDate*) est la date d'émission.
- Le taux du coupon (*couponRate*) est celui en vigueur à la date du reporting.

Les données complémentaires pour la branche des titres de participation (*equity*):

- Le type de titre (*SecurityType*) peut prendre les valeurs
 - F.511 pour les actions cotées
 - F.512 pour les actions non cotées
 - F.52 pour les parts d'OPC

4 Format des variables dans le fichier XML

Variables	format xml	Maximum	Pattern / Facets	Exemple
creationDateTime	datetime		YYYY-MM-DDThh:mm:ss	2010-10-29T23:59:59
<u>header</u>				
endMonthDate	date		YYYY-MM-DD	2010-10-31
closingDate	date		YYYY-MM-DD	2010-10-29
reporterID/type	string	2 caractères	[0-9]{2}	23
reporterID/code	string	30 caractères		999
declarantID/type	string	2 caractères	[0-9]{2}	23
declarantID/code	string	30 caractères		999
reportingCurrency	string	3 caractères	[A-Z]{3}	EUR
<u>reportedLine/Id</u>				
item	string	5 caractères	3-070 par défaut	3-070
country	string	2 caractères	XX par défaut	XX
currency	string	3 caractères	XXX par défaut	XXX
sector	string	5 caractères	[0-9]{5}	42212
<u>reportedLine/ISIN</u>				
securityID/codeType	integer		1, 2	1



Variables	format xml	Maximum	Pattern / Facets	Exemple
securityID/code	string	12 caractères	[A-Z]{2}[A-Z0-9]{9}[0-9]{1}	US870200CA83
holdSecurityType	string	2 caractères	[0-9]{2} 01, 02, 03, 05	01
percentageQuoted/nominalAmount	decimal	5 décimales		1000000
percentageQuoted/nominalCurrency	string	3 caractères	[A-Z]{3}	USD
currencyQuoted/numberOfUnits	decimal	5 décimales		7000
reportedAmount	decimal	5 décimales		1234567.89012
<u>reportedLine/other</u>				
securityID/codeType	integer		1, 2	2
securityID/code	string	20 caractères		CD0001
securityID/name	string	1024 caractères		Certificat dépôt 1.5% 10/2010
securityID/currency	string	3 caractères	[A-Z]{3}	USD
issuerID/country	string	2 caractères	[A-Z]{2}	US
issuerID/sector	string	5 caractères	[0-9]{5}	42220
holdSecurityType	string	2 caractères	[0-9]{2} 01, 02, 03, 05	01
percentageQuoted/nominalAmount	decimal	5 décimales		1000000
percentageQuoted/nominalCurrency	string	3 caractères	[A-Z]{3}	USD



BANQUE CENTRALE DU LUXEMBOURG

EUROSYSTÈME

Variables	format xml	Maximum	Pattern / Facets	Exemple
currencyQuoted/numberOfUnits	decimal	5 décimales		7000
reportedAmount	decimal	5 décimales		1234567.89012
<u>debt/supplements</u>				
securityType	string	5 caractères	F.33	F.33
issueDate	date		YYYY-MM-DD	2005-03-31
finalMaturityDate	date		YYYY-MM-DD	2025-03-31
poolFactor	percentage	9 décimales	>= 0	1
couponType	string	2 caractères	[0-9]{2} 01, 02, 03, 04, 05, 99	01
couponFrequency	string	2 caractères	[0-9]{2} 01, 02, 03, 04, 06, 12, 24, 99	01
couponLastPaymentDate	date		YYYY-MM-DD	2009-06-30
couponRate	decimal	9 décimales		3.125
<u>equity/Supplements</u>				
securityType	string	5 caractères	F.511, F.512, F.52	F.511
totalreportedAmount	decimal	5 décimales		25562485.256

Le format *datetime* est utilisé pour spécifier une date et une heure:

YYYY-MM-DDThh:mm:ss

où

YYYY indique l'année, MM indique le mois, DD indique le jour

T indique le début de la section requise pour l'heure

hh indique l'heure, mm indique la minute, ss indique la seconde

Le format *date* est utilisé pour spécifier une date: YYYY-MM-DD

où

YYYY indique l'année, MM indique le mois, DD indique le jour

Des informations détaillées sur le standard xml sont disponibles sur le site internet sous l'adresse: <http://www.w3schools.com/>