

**Manuel de transmission électronique
du rapport S 2.15 «Informations sur les
transactions effectuées par les
véhicules de titrisation»**

Sommaire

1	Introduction	4
2	Transmission.....	5
2.1	Attribution du nom du fichier.....	5
2.2	Moyen de transmission	7
3	Visualisation du schéma XML pour le rapport S 2.15	8
3.1	Les attributs	10
3.2	La branche Header	10
3.3	Le contenu du bilan.....	14
3.4	Les Actifs (Assets) et les Passifs (<i>Liabilities</i>).....	14
4	Format des variables dans le fichier XML.....	18
1	Introduction	4
2	Transmission.....	5
2.1	Attribution du nom du fichier.....	5
2.2	Moyen de transmission	7
3	Visualisation du schéma XML pour le rapport S 2.15	8
3.1	Les attributs	10
3.2	La branche Header	10
3.3	Le contenu du bilan.....	14
3.3.1	Les Actifs (Assets) et les Passifs (<i>Liabilities</i>).....	14
4	Format des variables dans le fichier XML.....	17
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 rapport S 2.15	6
3.1	Les attributs	8
3.2	La branche Header	8
3.3	Le contenu du bilan.....	12
3.3.1	Les Actifs (Assets) et les Passifs (<i>Liabilities</i>).....	12
4	Format des variables dans le fichier XML.....	15
1	Introduction	3



<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 rapport S 2.15</u>	<u>6</u>
<u>3.1</u>	<u>Les attributs</u>	<u>7</u>
<u>3.2</u>	<u>La branche Header</u>	<u>7</u>
<u>3.3</u>	<u>Le contenu du bilan</u>	<u>10</u>
<u>3.3.1</u>	<u>Les Actifs (<i>Assets</i>) et les Passifs (<i>Liabilities</i>)</u>	<u>10</u>
<u>4</u>	<u>Format des variables dans le fichier XML</u>	<u>13</u>

1 Introduction

Ce guide indique les caractéristiques techniques qui devront être utilisées pour la transmission informatique des données du rapport S 2.15 «Informations sur les transactions effectuées par les véhicules de titrisation».

Les instructions relatives à la collecte sont décrites dans les documents Définitions et concepts et Rapport relatifs au rapport S 2.15 «Informations sur les transactions effectuées par les véhicules de titrisation».

L'objet de ce document est de décrire les principes généraux du reporting au format XML pour le rapport S 2.15 «Informations sur les transactions effectuées par les véhicules de titrisation». 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 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:

S0215_aaaamm_Rrrrrrrr_Dddddddd_aaaammdd_nnn

où :

- S0215 représente le code du rapport statistique S 2.15
- 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 lettres utilisées pour les entités soumises à la surveillance de la CSSF sont B (Banque), O (OPC), P (Professionnel du secteur financier) et S (Société de gestion) et T (Véhicules de titrisation).

Pour toute autre entité, il y a lieu d'utiliser le code «5».

- rrrrrrrr permet d'identifier le reporter

Les numéros d'identification sont ceux attribués par la CSSF et/ou la BCL. Les chiffres à gauche sont égaux à 0.

Exemple: le véhicule de titrisation 999 est identifiée par 000000999.

- D identifie le type de déclarant
- Le déclarant est l'organisme auquel se réfèrent les données. Les véhicules de titrisation doivent utiliser la lettre T.
- dddddddd permet d'identifier le déclarant

Le numéro d'identification attribué par la CSSF et/ou la BCL est utilisé: 6 chiffres pour le numéro de l'organisme de titrisation et 3 chiffres pour le numéro de compartiment au cas où il y a des compartiments. Les chiffres à gauche sont égaux à des zéros. Au cas où il n'y a pas de compartiment il y a lieu d'utiliser 3 zéros.

Exemples:

- le compartiment no 999 de l'organisme de titrisation 123456 est identifié par 123456999
- l'organisme de titrisation 123456 qui n'a pas de compartiment est identifié par 123456000

~~Les numéros d'identification sont ceux attribués par la CSSF et/ou la BCL. Les chiffres à gauche sont égaux à 0.~~

~~Exemple: le véhicule de titrisation 999 est identifié 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:

S0215_200812_T000000999_T000123001000000999_20090120_001.xml correspond au premier fichier créé le 20 janvier 2009, envoyé par le véhicule de titrisation numéro 123999 dont les données se réfèrent au compartiment 1 du véhicule de titrisation 123999 pour le mois de décembre 2008.

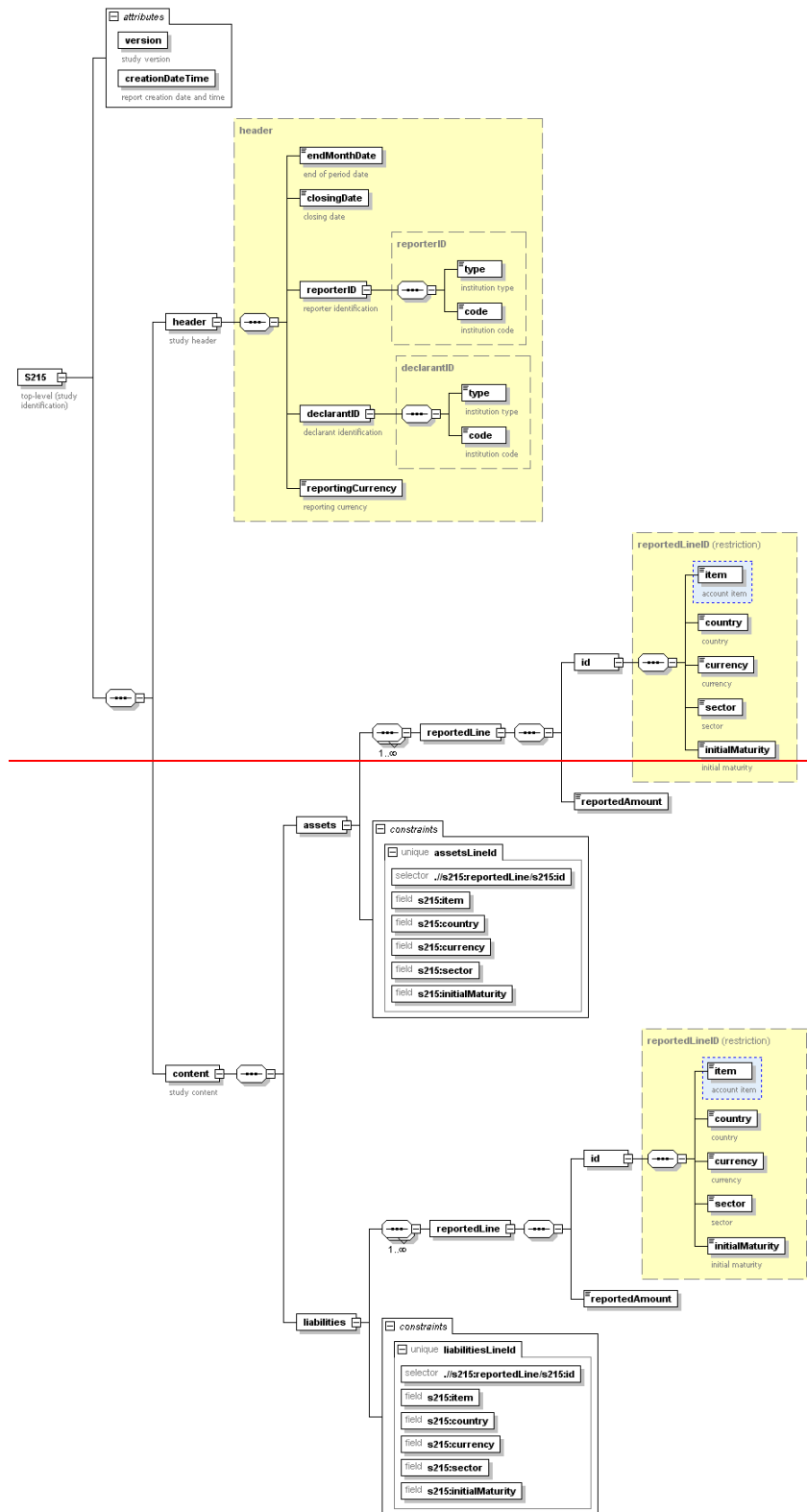
Exemple 2:

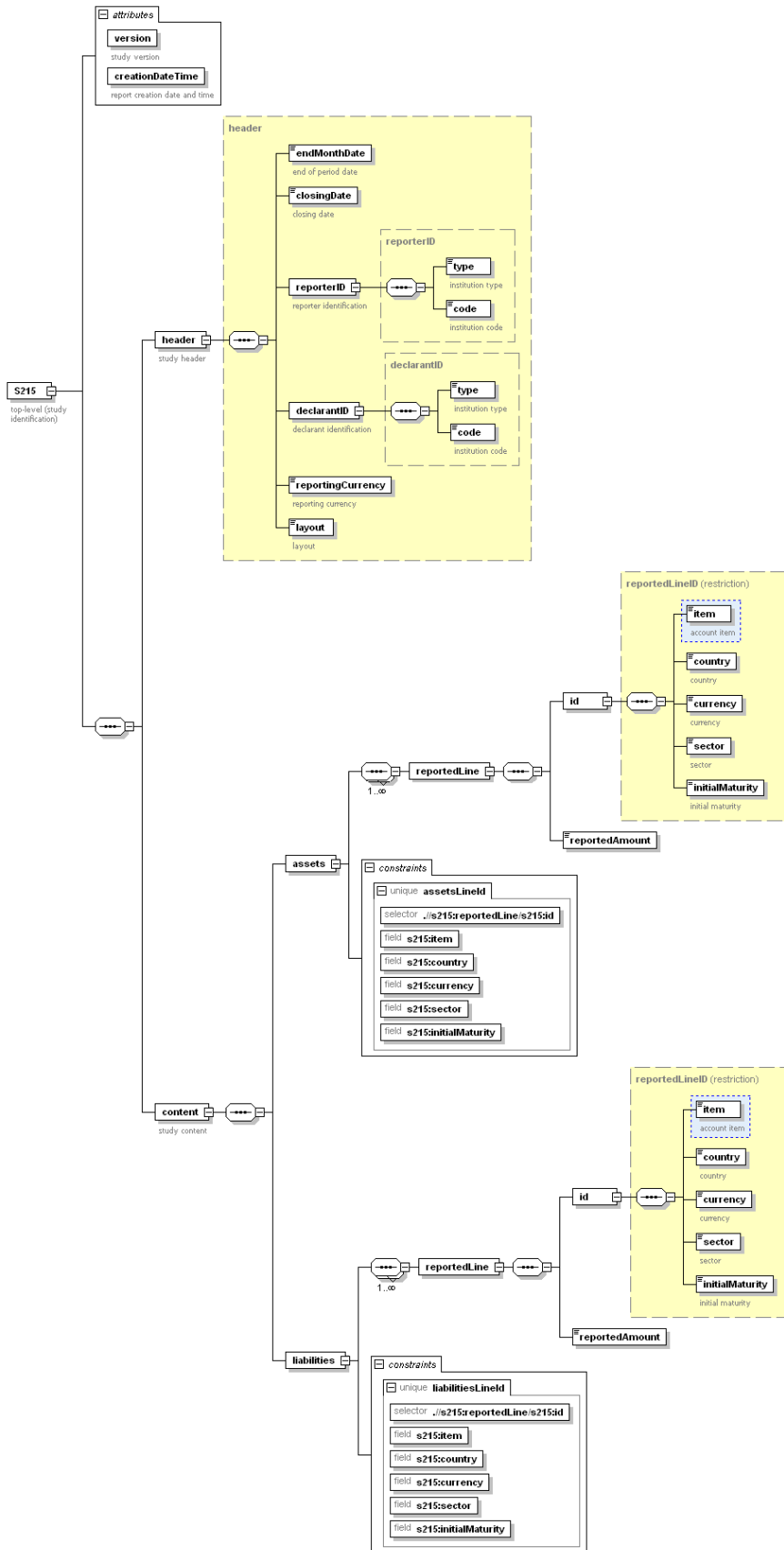
S0215_200812_D000000888_T000456000000000999_20090120_001.xml correspond au premier fichier créé le 20 janvier 2009, envoyé par le domiciliataire numéro 888 dont les données se réfèrent au véhicule de titrisation 456999 pour le mois de décembre 2008.

2.2 Moyen de transmission

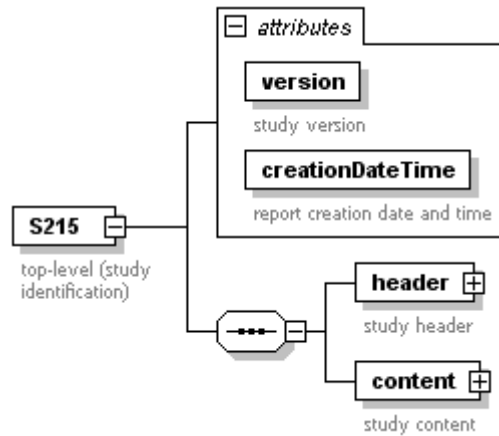
La BCL accepte l'utilisation des chemins de transmission électronique actuels offerts par Cetrel et Finesti, mais reste ouverte à tout nouveau moyen de transmission télématique sécurisé qui sera agréé en commun par la BCL et les déclarants.

3 Visualisation du schéma XML pour le rapport S 2.15



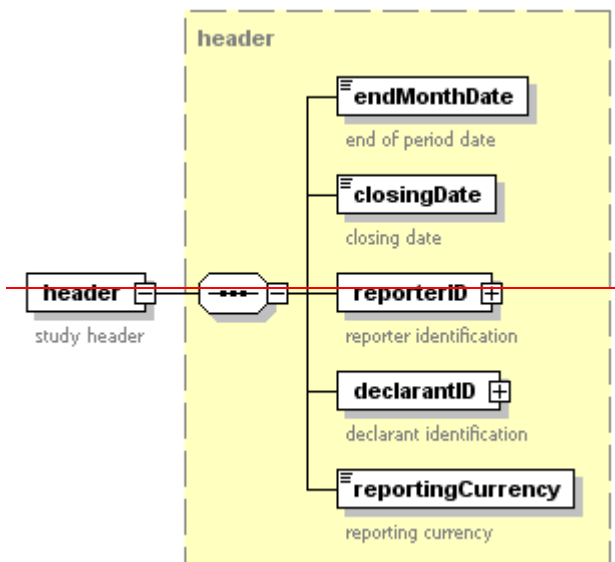


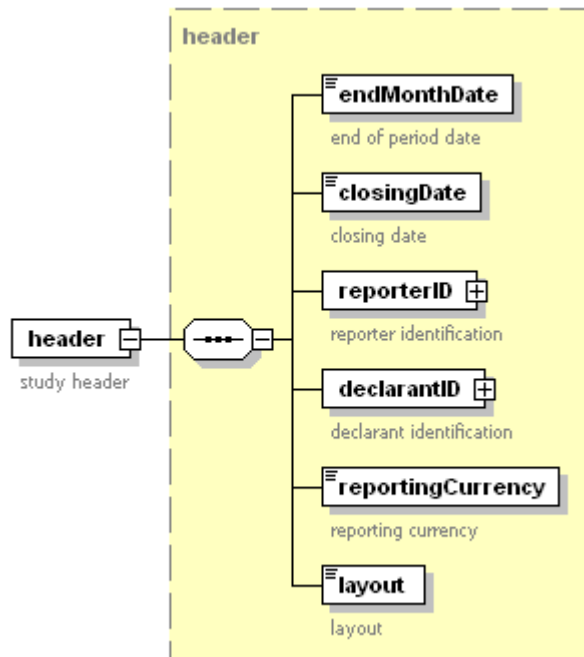
3.1 Les attributs



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

3.2 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.

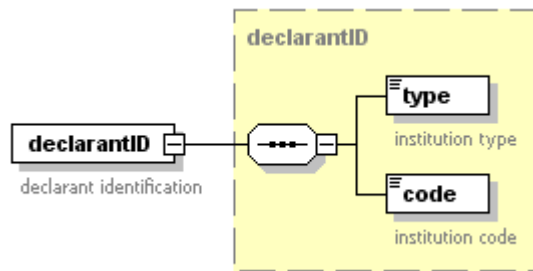
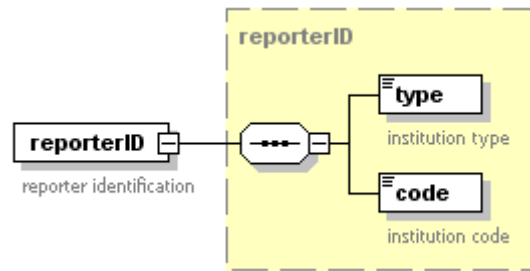
Exemple:

Ainsi, à titre d'exemple, pour le rapport S 2.15 «Informations sur les transactions effectuées par les véhicules de titrisation» de mars 2012:

- la date de fin de mois est le 31.03.2012
- la date de clôture est par exemple le 30.03.2012

En effet, le 31 mars 2012 étant un samedi, les données sont en principe établies le dernier jour ouvrable précédant le 31 mars 2012.

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:

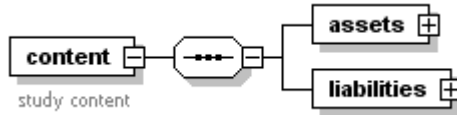
Entité CSSF	Type	Code
B	23	Numéro signalétique attribué par la CSSF aux banques
O	26	Numéro signalétique attribué par la CSSF aux OPC (5 digits) et aux compartiments (4 digits).
S	30	Numéro signalétique attribué par la CSSF aux sociétés de gestion
P	32	Numéro signalétique attribué par la CSSF aux professionnels du secteur financier
T	34	Numéro signalétique attribué par la CSSF aux véhicules de titrisation soumis au contrôle prudentiel ou numéro signalétique attribué par la BCL
	05	Numéro signalétique attribué par la BCL

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

Le layout (*layout*) indique le numéro de version du rapport S 2.15. Le rapport S 2.15 qui entrera en vigueur en janvier 2010 sera la première version, ce qui implique qu'il s'agira du layout «0».

3.3 Le contenu du bilan

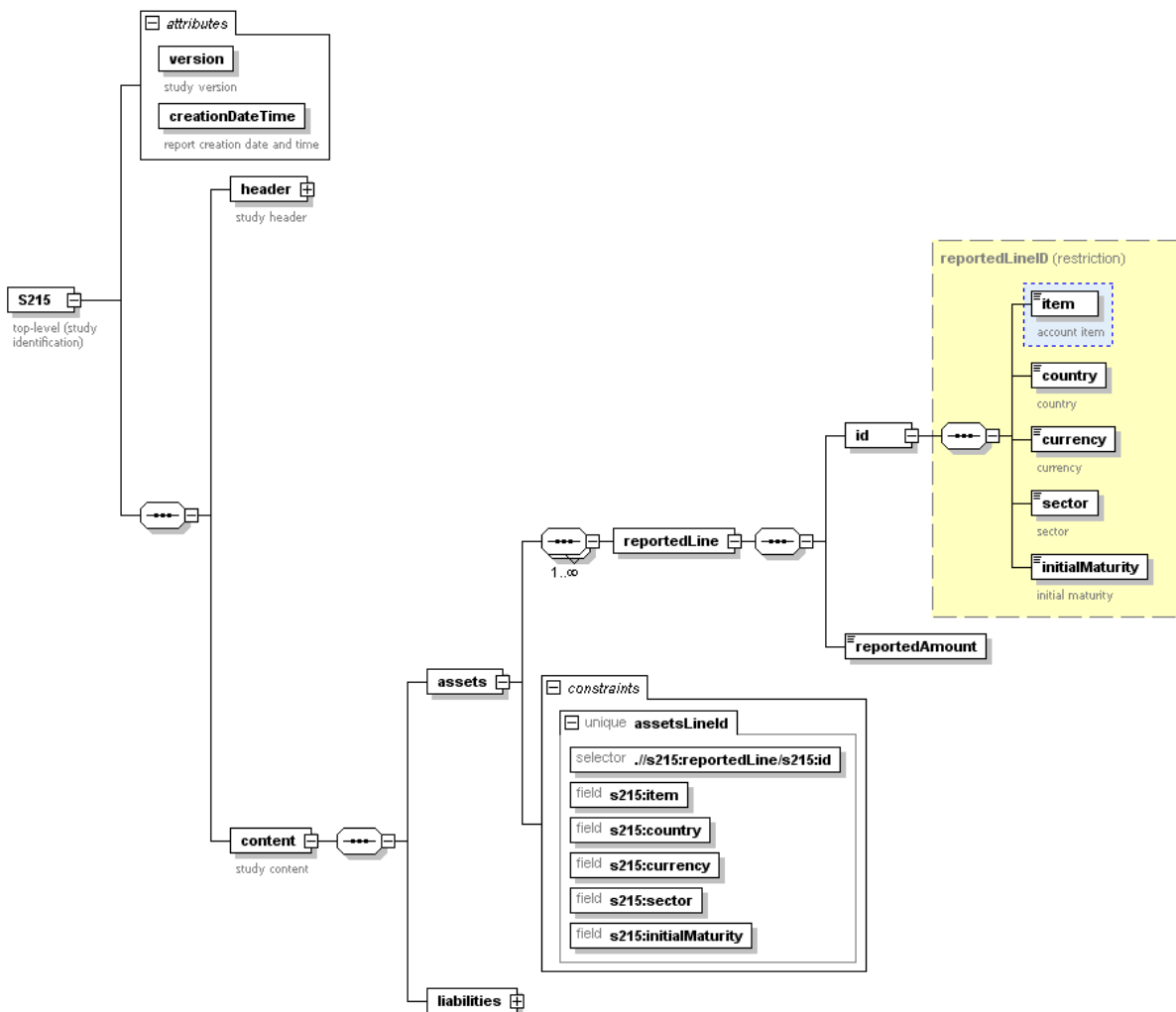
Le bilan statistique contient des actifs et des passifs.



3.3.13.4 Les Actifs (Assets) et les Passifs (Liabilities)

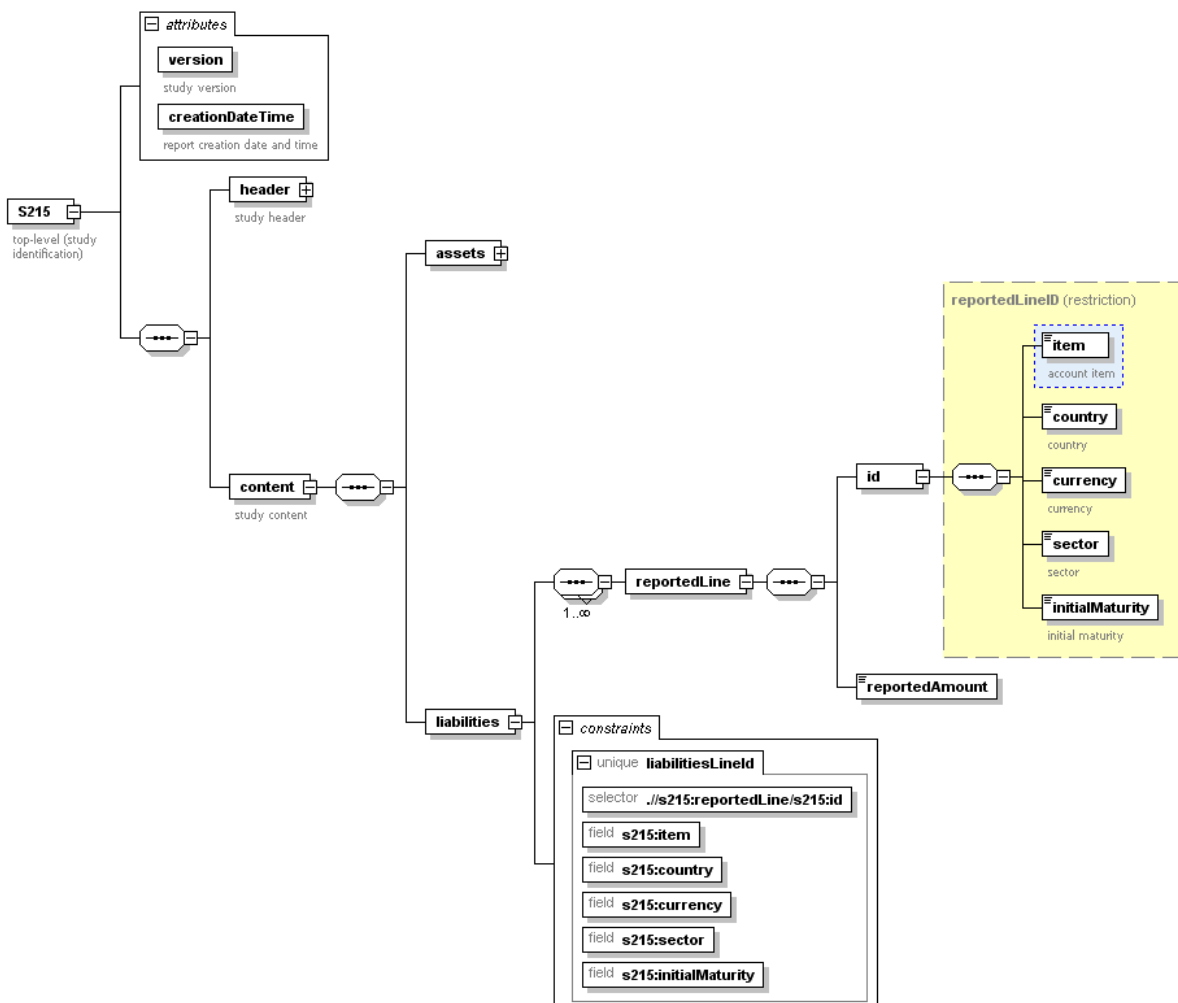
Les Actifs et les Passifs ont la même structure

Les Actifs:





Les Passifs:



La ligne du bilan (*reportedLine*) est identifiée par la rubrique comptable (*item*), le pays (*country*), la devise (*currency*), le secteur (*sector*) et l'échéance initiale (*initialMaturity*).

Dans le schéma XML, le fait de se trouver dans la branche «actifs» (*assets*) ou «passifs» (*liabilities*) restreint le choix de la rubrique comptable (*item*).

La valeur prise par la rubrique comptable (*item*) doit obligatoirement débiter par un:

- «1» dans le cas de l'actif (*assets*)
- «2» dans le cas du passif (*liabilities*)

Identification de la ligne du bilan:

- le pays doit être codé suivant la codification ISO 3166, complétée par les codes de zone géographique définis par la BCL
- la devise doit être codée suivant la codification ISO 4217, complétée par les codes de zone devise définis par la BCL
- le code secteur suit la nomenclature définie par la BCL
- le code de l'échéance initiale suit la nomenclature définie par la BCL

Il y a lieu de se référer aux instructions relatives au rapport S 2.15 «Informations sur les transactions effectuées par les véhicules de titrisation» et de n'utiliser que les rubriques comptables ainsi que les codes pays, devise, secteur et échéance initiale exigés pour le rapport S 2.15 «Informations sur les transactions effectuées par les véhicules de titrisation».

Le montant rapporté (*reportedAmount*) correspond au montant inscrit au bilan sous un même identifiant de ligne du bilan. Il est exprimé dans la devise de reporting du bilan (*reportingCurrency*).

4 Format des variables dans le fichier XML

Variables	format xml	Maximum	Pattern	Exemple
creationDateTime	datetime		YYYY-MM-DDThh:mm:ss	2009-12-24T23:59:59
endMonthDate	date		YYYY-MM-DD	2009-12-31
closingDate	date		YYYY-MM-DD	2009-12-24
reporterID/type	string	2 caractères	[0-9]{2}	23
reporterID/code	string			999999
declarantID/type	string	2 caractères	[0-9]{2}	23
declarantID/code	string			999999
reportingCurrency	string	3 caractères	[A-Z]{3}	EUR
item	string	5 caractères	[1-3]-[0-9A-Z]{3}	1-020
country	string	2 caractères	[A-Z]{2} ou X[AZ0-9]	LU ou X4
currency	string	3 caractères	[A-Z]{3} ou XX[A-Z0-9]	EUR ou XX2
sector	string	5 caractères	[0-9]{5}	00000
initialMaturity	string	3 caractères	[A-Z]{3}	BRX
reportedAmount	decimal	5 décimales		562485.256

- 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/>