

Manuel de transmission électronique des rapports statistiques des véhicules de titrisation

Sommaire

1	Introduction	3
2	Transmission.....	4
	2.1 Attribution du nom du fichier	4
	2.2 Noms de fichiers actuellement en vigueur.....	5
	2.3 Moyen de transmission	6
3	Schémas XML pour les rapports statistiques	6
4	Identification du reporter et du déclarant	7

1 Introduction

Ce manuel indique les caractéristiques techniques qui devront être utilisées pour la transmission électronique des rapports statistiques par les véhicules de titrisation.

Les instructions relatives au reporting statistique sont décrites dans les documents Instructions et Rapport relatifs aux rapports statistiques des véhicules de titrisation.

L'objet de ce manuel est de décrire les principes fondamentaux du reporting en format XML applicable aux rapports statistiques des 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 contient des contraintes de format sur les données, mais ne précise pas nécessairement la validité d'un code respectant le format. Les nomenclatures et les règles définies dans le présent document doivent être respectées.

2 Transmission

2.1 Attribution du nom du fichier

La structure du nom du fichier est la suivante:

S0000_L1_aaaammjj_Rrrrrrrrrr_Dddddddddd_aaaammjj_nnn

où :

- S0000 représente le code du rapport statistique
 - L1 indique qu'il s'agit du layout 1
 - aaaammjj représente l'année, le mois et le jour auxquels les données se réfèrent
 - R identifie le type de reporter
Le reporter est l'organisme qui envoie les données.
Les valeurs autorisées sont reprises au point 4.
 - rrrrrrrrrr permet d'identifier le reporter
Les numéros d'identification sont ceux attribués par la CSSF. Les chiffres à gauche sont égaux à 0.
 - 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.
 - dddddddddd permet d'identifier le déclarant
Les numéros d'identification sont ceux attribués par la CSSF. Les chiffres à gauche sont égaux à 0.
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
- aaaammjj 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.

2.2 Noms de fichiers actuellement en vigueur

Le tableau suivant fournit un aperçu sur l'ensemble des rapports statistiques actuellement en vigueur.

Rapport	Nom
S 2.14 L1	S0214_L1_aaaamm_Rrrrrrrrr_Dddddddddd_aaaammjj_nnn
S 2.15 L1	S0215_L1_aaaamm_Rrrrrrrrr_Dddddddddd_aaaammjj_nnn
TPTTBS L1	TPTTBS_L1_aaaamm_Rrrrrrrrr_Dddddddddd_aaaammjj_nnn

Exemple 1:

S0214_L1_201412_T000000999_T000123001_20150120_001.xml correspond au premier fichier créé le 20 janvier 2015, envoyé par le véhicule de titrisation numéro 999 dont les données se réfèrent au compartiment 1 du véhicule de titrisation 123 pour le trimestre s'achevant en décembre 2014.

Exemple 2:

S0214_L1_201412_P000000888_T000456000_20150120_002.xml correspond au second fichier créé le 20 janvier 2015, envoyé par le professionnel du secteur financier numéro 888 dont les données se réfèrent aux données agrégées du véhicule de titrisation 456 pour le trimestre s'achevant en décembre 2014.

2.3 Moyen de transmission

La BCL accepte l'utilisation des chemins de transmission électronique actuels offerts par Sofie (SIX Payment Services (Europe) S.A., CETREL Securities) et e-file (Bourse de Luxembourg, Fundsquare).

Toutefois, la BCL reste ouverte à tout nouveau moyen de transmission télématique sécurisé qui sera proposé, en commun par la BCL et les déclarants.

3 Schémas XML pour les rapports statistiques

Les schémas XML ainsi qu'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.

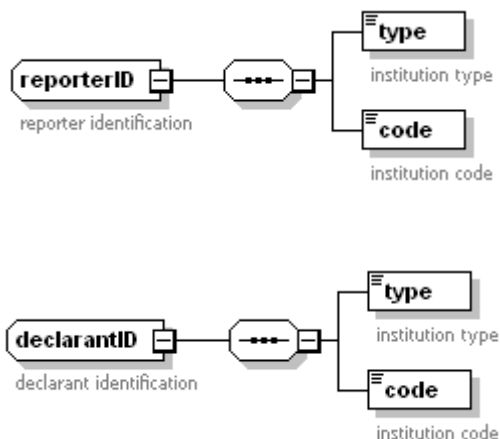
Les données à rapporter doivent satisfaire des contrôles généraux de format ou d'appartenance à des listes de codes.

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 et les règles définies dans ce manuel doivent être respectées.

4 Identification du reporter et du déclarant

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	Code	Dans le nom du fichier
01	Numéro attribué par la CSSF aux autres administrations centrales	1
05	Numéro signalétique attribué par la BCL	5
23	Numéro attribué par la CSSF pour les banques	B
30	Numéro attribué par la CSSF pour les sociétés de gestion	S
32	Numéro attribué par la CSSF pour les professionnels du secteur financier	P
34	Numéro signalétique attribué par la CSSF aux véhicules de titrisation soumis au contrôle prudentiel ou numéro signalétique attribué par la BCL	T
39	Numéro attribué par la BCL pour les assurances, basé sur le numéro du registre du commerce et des sociétés sans le B initial	ASS
40	Numéro attribué par la CSSF pour les gestionnaires de fonds d'investissement alternatifs	A