

BCL ANACREDIT

NEWSLETTER



L'équipe AnaCredit de la Banque centrale du Luxembourg (BCL) vous remercie pour votre participation à la réunion d'information AnaCredit organisée dans les locaux de la BCL le 28 février 2020, dont vous retrouverez les principales informations dans la rubrique « Nouvelles » ci-dessous.

Nouvelles

Mise en place des DQI et seuils applicables

La BCL a commencé la dissémination aux agents déclarants des data quality indicators (DQI) par agent observé, calculés par la BCE. Cette dissémination aura lieu en plusieurs vagues. La première vague concerne les mois de septembre 2018 à août 2019. Si tous les DQI de ces mois de référence sont en-dessous des seuils de tolérance de 3 % (10 % pour la comparaison iBSI), alors la deuxième vague, concernant les mois de septembre 2019 à décembre 2019, est analysée. Dès que les mois de référence des deux premières vagues sont en-dessous des seuils applicables, la BCL analysera les DQI des soumissions à partir de janvier 2020 en disséminant aux agents déclarants les DQI d'un mois de référence au plus tôt 3 mois après la deadline de reporting et uniquement si les mois précédents sont tous en dessous des seuils. Ainsi, les DQI relatifs au mois de référence de janvier 2020 seront disséminés au plus tôt à partir de mi-mai et uniquement si les deux premières vagues sont en-dessous des seuils applicables. Les DQI applicables à partir de la date de référence de janvier 2020 seront accompagnés d'une diminution des seuils de tolérance de 3 % à 2 % (de 10 % à 5 % pour iBSI).

Veillez également noter que, pour le moment, la BCL continue à envoyer aux agents déclarants les feedbacks relatifs aux soumissions de septembre 2019 à décembre 2019 même si les mois en question sont en-dessous des seuils minimaux de qualité. Bien qu'il ne soit pas nécessaire de resoumettre vos fichiers pour les mois dont la qualité a atteint les seuils minimaux, les feedbacks vous permettent d'anticiper et de corriger des erreurs pour les dates de référence futures.

Fichiers avec erreurs XSD bloqués au niveau des canaux de transmission

Suite à des discussions menées avec les fournisseurs de solutions de reporting le 29 février 2020, il a été convenu que les canaux de transmission s'occuperont en amont de la validation XSD des rapports AnaCredit. Les rapports qui ne sont pas valides d'un point de vue XSD ne seront pas transmis à la BCL et l'agent déclarant saura immédiatement qu'il n'est pas en conformité avec les exigences de la BCL.

Ce blocage des fichiers ayant des erreurs XSD sera mis en place progressivement par les canaux de transmission au cours de l'année 2020.



BANQUE CENTRALE DU LUXEMBOURG

EUROSYSTÈME

Comparaisons avec d'autres rapports statistiques

Comme indiqué lors de la réunion d'information, la BCE et les BCN sont actuellement en train de développer et de mettre en place des comparaisons entre les rapports AnaCredit et les rapports issus d'autres collectes statistiques. Il s'agit notamment des rapports sur les statistiques bilantaires (BSI / S1.1 et S2.5), sur les taux d'intérêt (MIR / S1.5) et sur les rapports prudentiels COREP/FINREP. Ces nouveaux contrôles sont prévus pour 2020. Une fois les spécificités techniques communiquées par la BCE, la BCL mettra à jour la documentation y relative sur son site internet. Selon un accord entre l'EBF (European Banking Federation) et la BCE, les spécificités seront également envoyées aux associations bancaires nationales (au Luxembourg : ABBL).

Clarification sur la déclaration des FIAR

Les contreparties rapportées en tant que FIAR (forme légale LU27) doivent être rapportées avec un code RIAD pour être conformes à la règle de validation CS0050. Dans ce cas, il est très important d'utiliser la structure « LU_NOTAP » pour rapporter l'identifiant national et de rapporter le code LEI en « non-applicable » (NEVS=0), même si vous êtes en possession de ces informations.

FAQ

Comment le Brexit affecte-t-il le reporting AnaCredit ?

L'accord de retrait entre l'Union européenne et le Royaume-Uni est devenu effectif au 1er février 2020. Par conséquent, les règles CS0021 et CS0140 ne s'appliquent plus aux contreparties résidant au Royaume-Uni. Ainsi, les formes juridiques commençant par EU ne peuvent plus être utilisées. A contrario, les formes juridiques commençant par RW sont acceptées pour le Royaume-Uni pour tous les rapports depuis février 2020.

Cette adaptation sera implémentée dans le logiciel de la BCL dès que possible. Entre-temps, si un feedback sur les règles de validation génère une des erreurs susmentionnées sans justification, nous vous saurions gré de l'ignorer.

Si ce code RIAD n'est pas disponible dans les fichiers de la BCE (disponibles sur le site internet de la BCE : Statistics > List of financial institutions > Investments funds), les agents déclarants sont invités à contacter directement la BCL.

Suivi de la conférence AnaCredit

Faisant suite à la séance d'information fin février, la BCL a envoyé un plan d'action basé sur l'approche IDA (Issue-Decision-Action) à tous ses agents déclarants. Ce plan contient des mesures à entreprendre par les déclarants, les fournisseurs de solutions informatiques et la BCL. Nous vous serions reconnaissants de prendre note de ces mesures et de mettre en place celles qui vous concernent.



Où faut-il consulter les taux de change historiques ?

Le site internet de la BCE est la source primaire pour la consultation des taux de change journaliers.^[1] Les taux de change historiques sont disponibles dans le datawarehouse de la BCE.^[2] Au cas où un taux de change n'est pas disponible auprès de ces sources primaires, les agents déclarants peuvent également consulter les autres fournisseurs de ce type d'information (p.ex. Bloomberg, Reuters etc.).

A quelle date doivent être converties les valeurs monétaires ?

En règle générale, toute valeur rapportée dans le cadre d'AnaCredit doit être convertie selon le taux de change applicable le dernier jour du mois de référence.



Cependant, certaines exceptions existent et sont répertoriées dans le manuel AnaCredit II, plus précisément dans la section 2.3, tableau 3.

Quel est l'impact de la crise du Covid-19 sur le reporting AnaCredit ?

Nous informons les agents déclarants que dans le cadre de la pandémie mondiale Covid-19, la BCL s'attend toujours à recevoir le reporting AnaCredit dans les délais impartis. En effet, la Banque centrale européenne (BCE) n'a pas modifié le calendrier de remise des rapports car il est essentiel de disposer d'informations statistiques fiables particulièrement en temps de crise. En cas de difficultés majeures pour produire les rapports AnaCredit, les établissements concernés sont priés de prendre contact avec la BCL avant les dates de remise des rapports. La BCL tâchera, dans la mesure du possible, de se montrer pragmatique dans la gestion d'éventuelles difficultés, sans préjudice des consignes de la BCE actuellement en vigueur. Par ailleurs, nous vous informons que l'équipe AnaCredit de la BCL travaille désormais en priorité sur l'envoi des rapports des agents déclarants à la BCE. Par conséquent, les échanges et la communication seront restreints avec les agents déclarants pendant toute la durée de la crise.



Rappel

Prochaines dates de remise des rapports AnaCredit :

- 23 avril 2020 (données mensuelles relatives à la date de référence de mars 2020)
- 15 mai 2020 (données trimestrielles relatives à la date de référence de mars 2020)
- 25 mai 2020 (données mensuelles relatives à la date de référence d'avril 2020)
- 22 juin 2020 (données mensuelles relatives à la date de référence de mai 2020)

Contact

reporting.anacredit@bcl.lu
sig@bcl.lu

