

Manuel de transmission électronique du rapport S 1.5 «Informations sur les taux d'intérêt en EUR»

Banque centrale du Luxembourg

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 rapport S 1.5	6
	3.1 Les attributs	6
	3.2 La branche Header	7
	3.3 Le contenu	9
	3.3.1 Encours – Actifs	10
	3.3.2 Encours - Passifs.....	11
	3.3.3 Nouveaux contrats – Passifs	12
	3.3.4 Nouveaux contrats – Actifs	14
4	Format des variables dans le fichier XML.....	17

1 Introduction

Ce guide indique les caractéristiques techniques qui devront être utilisées pour la transmission informatique des données du rapport S 1.5 «Informations sur les taux d'intérêt en EUR».

Les instructions relatives à la collecte sont décrites dans les documents Instructions et Rapport relatifs au rapport S 1.5 «Informations sur les taux d'intérêt en EUR».

L'objet de ce document est de décrire les principes généraux du reporting au format XML pour le rapport S 1.5 «Informations sur les taux d'intérêt en EUR». Le schéma 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 aux 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:

S0105_aaaamm_Rrrrrrrr_Dddddddd_aaaammdd_nnn

où :

- S0105 représente le code du rapport statistique S 1.5
- 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.
- rrrrrrrr 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:

S0105_201006_B000000999_B000000999_20100714_001.xml correspond au premier fichier créé le 14 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.

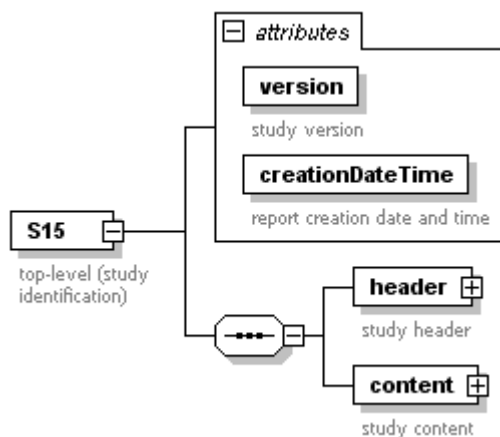
2.2 Moyen de transmission

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 rapport S 1.5

Le schéma entier peut être téléchargé du site Internet de la BCL (www.bcl.lu).

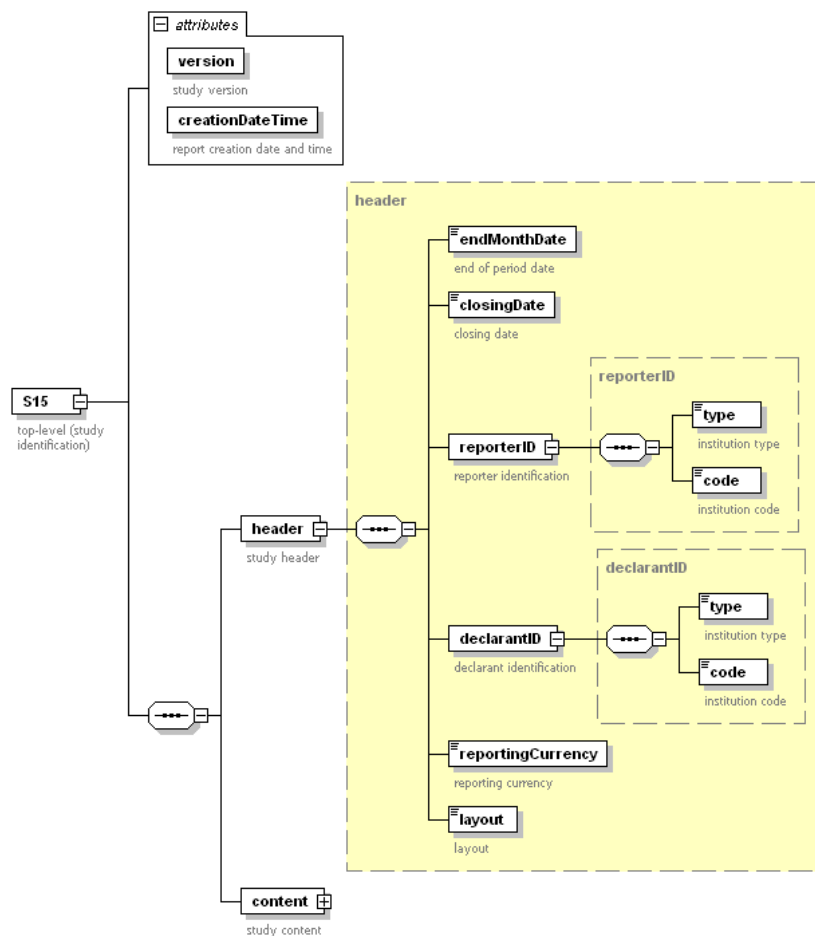
3.1 Les attributs



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.

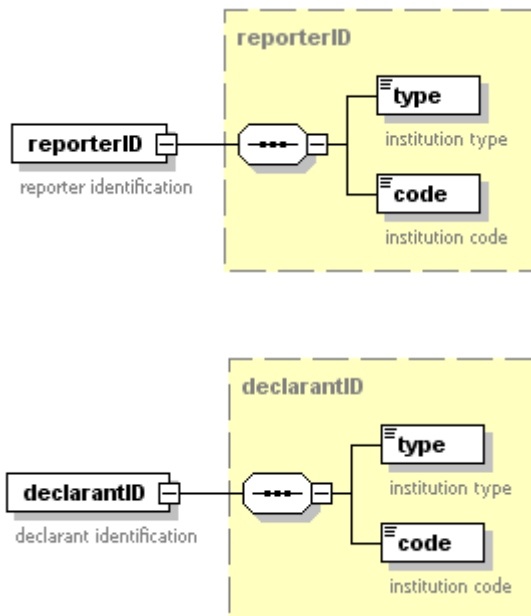
Exemple:

Ainsi, à titre d'exemple, pour le rapport S 1.5 «Informations sur les taux d'intérêt en EUR» 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:

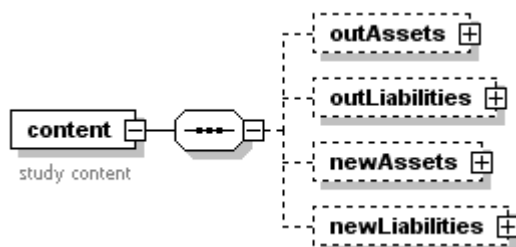
Type de	Code
23	Numéro signalétique attribué par la CSSF pour les banques

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 S 1.5. Le rapport S 1.5 qui entrera en vigueur en juin 2010 sera la deuxième version, ce qui implique qu'il s'agira du layout «1».

3.3 Le contenu

Le rapport S 1.5 «Informations sur les taux d'intérêt en EUR» contient quatre branches.



Le contenu se répartit en 4 branches différentes qui sont présentées ci-dessous.

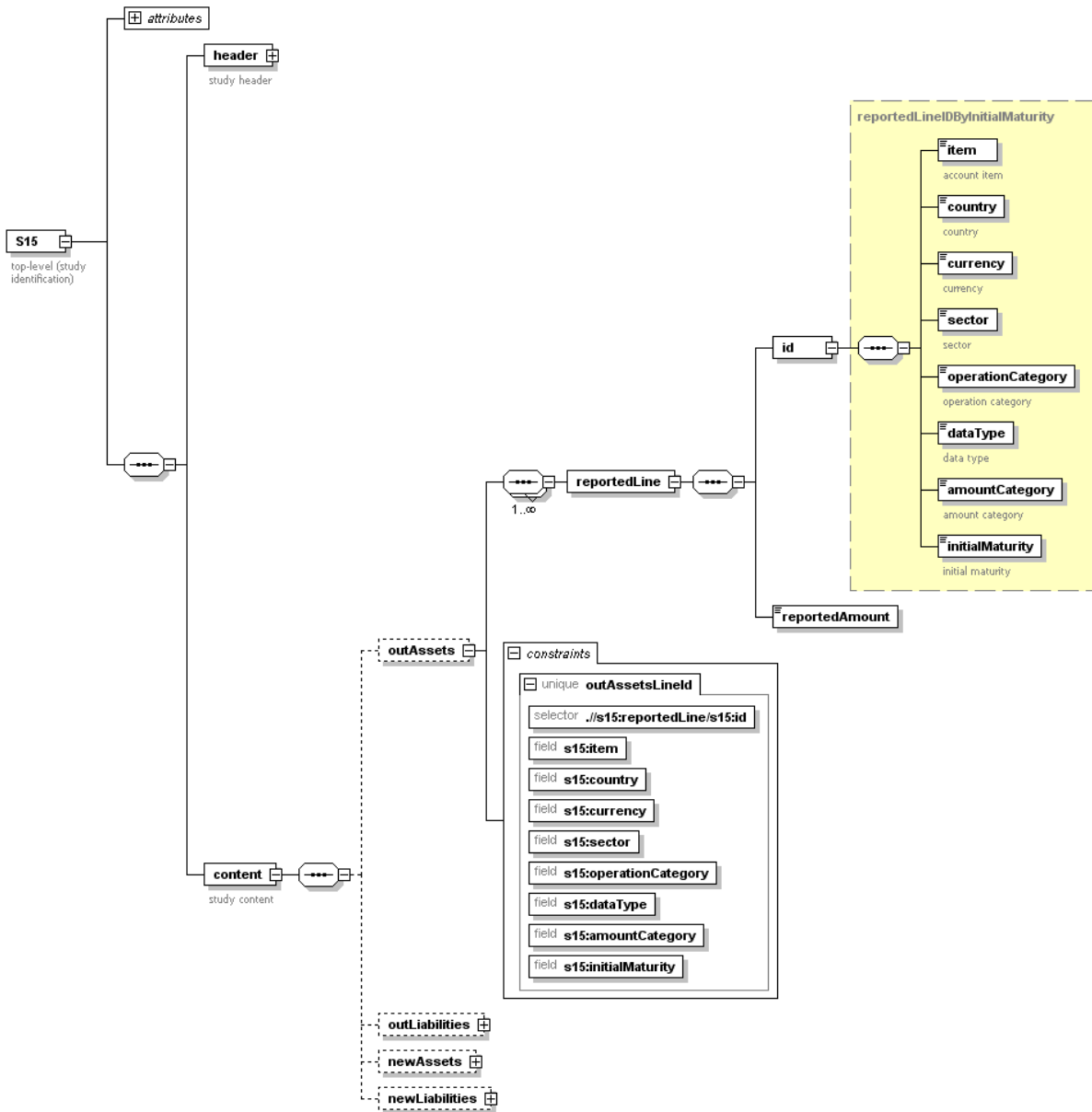
Il importe de mentionner que les 3 branches suivantes ont la même structure:

- Encours – Actifs
- Encours – Passifs
- Nouveaux contrats - Passifs

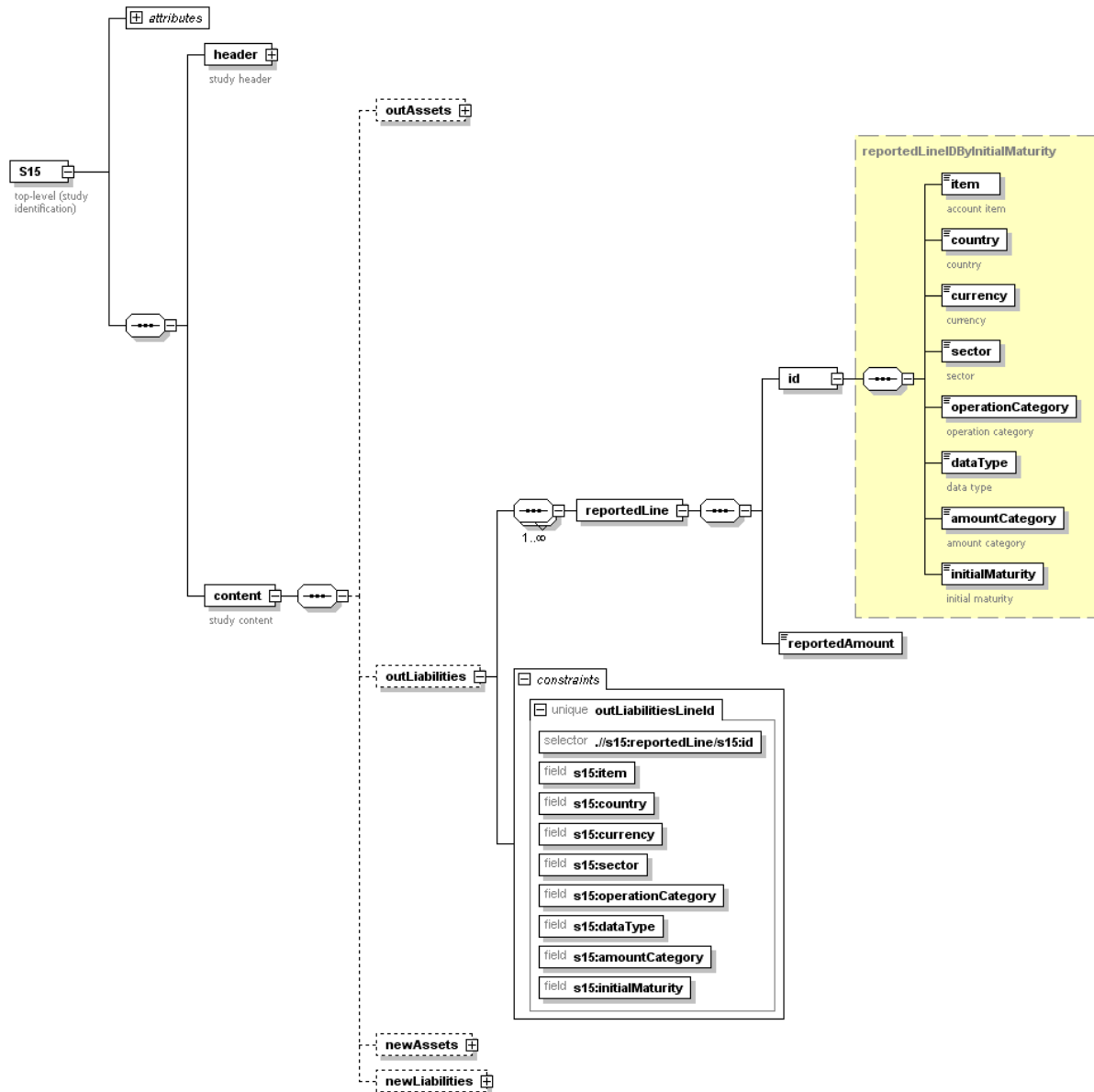
Par contre, la branche suivante a une structure différente:

- Nouveaux contrats - Actifs

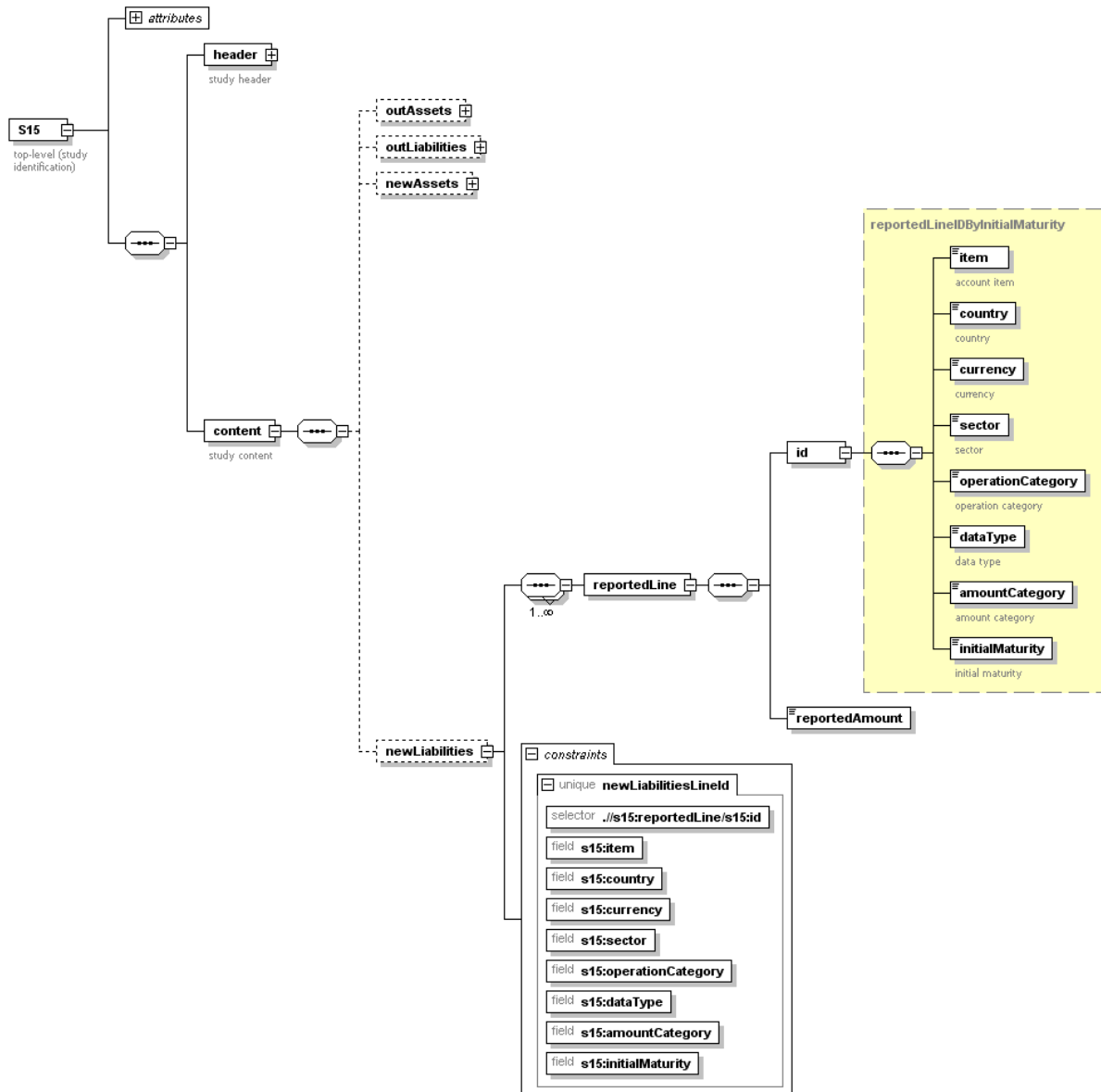
3.3.1 Encours – Actifs



3.3.2 Encours - Passifs



3.3.3 Nouveaux contrats – Passifs



La ligne du bilan (*reportedLine*) est identifiée par:

- la rubrique comptable (*item*)
- le pays (*country*)
- la devise (*currency*),
- le secteur (*sector*)
- la catégorie d'opérations (*operationsCategory*)
- le type de données (*dataType*)
- la catégorie de montant (*amountCategory*)
- 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 débuter par un:

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

Identification de la ligne du bilan:

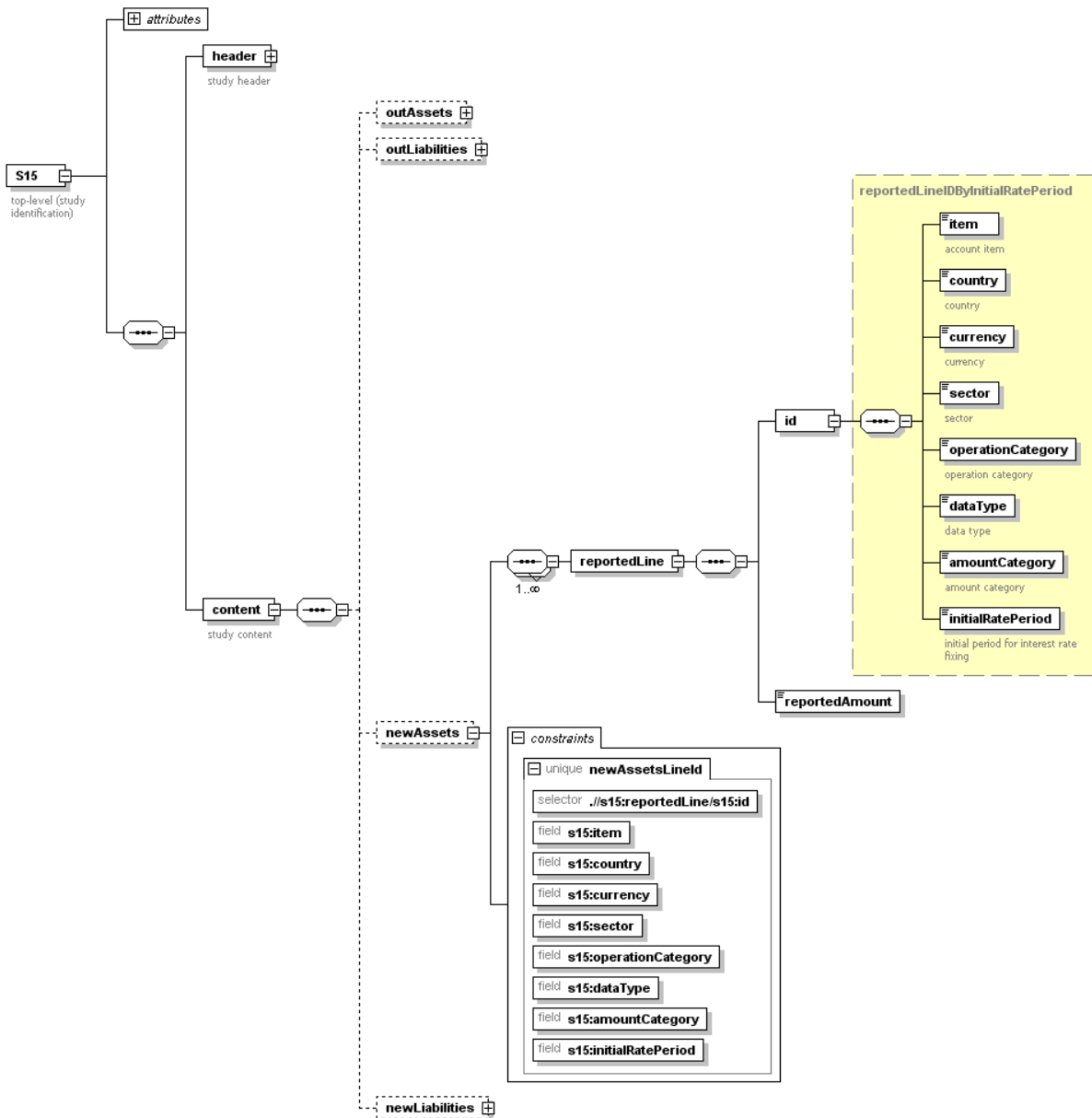
- le pays doit être codé suivant la codification ISO 3166, complétée par les codes de zone géographique définis par la BCL
- la devise doit être codée suivant la codification ISO 4217, complétée par les codes de zone devise définis par la BCL
- le code secteur suit la nomenclature définie par la BCL
- la catégorie d'opérations suit la nomenclature définie par la BCL
- le type de données suit la nomenclature définie par la BCL
- la catégorie de montant 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 1.5 «Informations sur les taux d'intérêt en EUR» et de n'utiliser que les rubriques comptables ainsi que les codes pays, devise, secteur et échéance initiale exigés pour le rapport S 1.5 «Informations sur les taux d'intérêt en EUR».

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*) pour le type de données (*dataType*) «AMT».
- il est exprimé en pourcentage pour le type de données (*dataType*) «TCA»

3.3.4 Nouveaux contrats – Actifs



La ligne du bilan (*reportedLine*) est identifiée par:

- la rubrique comptable (*item*)
- le pays (*country*)
- la devise (*currency*),
- le secteur (*sector*)
- la catégorie d'opérations (*operationsCategory*)
- le type de données (*dataType*)
- la catégorie de montant (*amountCategory*)
- la période initiale de fixation du taux d'intérêt (*initialRatePeriod*).

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 débuter 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
- la catégorie d'opérations suit la nomenclature définie par la BCL
- le type de données suit la nomenclature définie par la BCL
- la catégorie de montant suit la nomenclature définie par la BCL
- la période initiale de fixation du taux d'intérêt suit la nomenclature définie par la BCL

Il y a lieu de se référer aux instructions relatives au rapport S 1.5 «Informations sur les taux d'intérêt en EUR» et de n'utiliser que les rubriques comptables ainsi que les codes pays, devise, secteur et échéance initiale exigés pour le rapport S 1.5 «Informations sur les taux d'intérêt en EUR».

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*) pour les types de données (*dataType*) «AMT» et «AMG».
- il est exprimé en pourcentage pour les types de données (*dataType*) «TCA» et «TCG» et «TAE»

4 Format des variables dans le fichier XML

Variables	format xml	Maximum	Pattern	Exemple
creationDateTime	datetime		YYYY-MM-DDThh:mm:ss	2010-10-29T23:59:59
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			999
declarantID/type	string	2 caractères	[0-9]{2}	23
declarantID/code	string			999
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
operationCategorie	string	2 caractères	[0-9][A-Z]	1E
dataType	string	3 caractères	[A-Z]{3}	AMT



BANQUE CENTRALE DU LUXEMBOURG

EUROSYSTÈME

Variables	format xml	Maximum	Pattern	Exemple
amountCategory	string	3 caractères	[A-Z]{3}	TOT
initialMaturity	string	3 caractères	[A-Z]{3}	BRB
initialRatePeriod	string	3 caractères	[A-Z]{3}	CRA
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/>