
Collecte statistique relative au marché des titres négociables à court et moyen terme

SPECIFICATIONS FONCTIONNELLES ET TECHNIQUES

DES

FLUX ECHANGÉS ENTRE LES DOMICILIATAIRES

ET LA

BANQUE DE FRANCE (APPLICATION NORIA)

VERSION 4.2^(*)
applicable à compter du 23/06/2016



DGSO – DMPM – Service des Titres de Créances Négociables (STCN)
DGSO – DIROM – Service d’Assistance et de Maîtrise d’Ouvrage (SAMOA)
OI - DOD – Service des Projets Titres et Marchés (SPTIM)

^(*) Les modifications apportées par rapport à la version 4.1 sont surlignées en jaune dans le document.

Table des matières

1. CORRESPONDANTS À LA BANQUE DE FRANCE	3
2. CADRE RÉGLEMENTAIRE.....	3
3. PÉRIODE TRANSITOIRE SUITE À L'ENTRÉE EN VIGUEUR DE LA RÉFORME DU MARCHÉ LE 1^{ER} JUIN 2016	3
4. PRÉSENTATION GÉNÉRALE DES ÉCHANGES	4
4.1. FLUX ÉCHANGÉS, PÉRIODICITÉ ET DÉLAI DE REMISE	4
4.1.1 <i>Sens domiciliaire vers la Banque de France</i>	4
4.1.2 <i>Sens Banque de France vers Domiciliaire</i>	5
4.2. MODALITÉS DE TRANSMISSION	5
5. RÈGLES DE PRÉSENTATION DES FICHIERS ÉCHANGÉS	6
5.1. PARTIE ARBORESCENCE	6
5.2. PARTIE DICTIONNAIRE	7
5.3. CONVENTIONS GÉNÉRALES SUR LES FICHIERS ÉCHANGÉS	8
5.4. CONVENTIONS GÉNÉRALES SUR LES DONNÉES REQUISES.....	8
6. ÉCHANGES : DOMICILIATAIRE VERS BANQUE DE FRANCE	9
6.1. LA DÉCLARATION DES TITRES, MOUVEMENTS ET ENCOURS.....	9
6.1.1 <i>Arborescence Déclaration des titres, mouvements et encours</i>	9
6.1.2 <i>Dictionnaire Déclaration des titres, mouvements et encours</i>	10
6.2. LA DEMANDE DE SITUATION D'ENCOURS D'UN ÉMETTEUR	14
6.2.1 <i>Arborescence Demande de situation</i>	14
6.2.2 <i>Dictionnaire Demande de situation</i>	15
7. ÉCHANGES : BANQUE DE FRANCE VERS DOMICILIATAIRE	16
7.1. LE COMPTE-RENDU D'ANOMALIE TECHNIQUE	16
7.1.1 <i>Arborescence compte rendu d'anomalie technique</i>	16
7.1.2 <i>Dictionnaire compte rendu d'anomalie technique</i>	17
7.2. LE COMPTE RENDU DE TRAITEMENT DÉCLARATION TITRES, MOUVEMENT ET ENCOURS.....	17
7.2.1 <i>Arborescence compte rendu de traitement déclaration TCN</i>	18
7.2.2 <i>Dictionnaire Compte rendu de traitement déclaration TCN</i>	18
7.3. LA SITUATION D'UN ÉMETTEUR	22
7.3.1 <i>Arborescence Situation d'un émetteur</i>	22
7.3.2 <i>Dictionnaire Situation d'un émetteur</i>	23
8. ANNEXES.....	26
8.1. LISTE DES CODES ET TYPES DE TCN.....	26
8.2. LISTE DES CODES DE SOUSCRIPTEURS	27
8.3. LISTE DES CODES TAUX	29
8.4. LISTE DES CODES ANOMALIES TRANSMIS DANS LES COMPTES-RENDUS.....	30

1. Correspondants à la Banque de France

Direction Générale de la Stabilité financière et des Opérations

Direction de la Mise en œuvre de la Politique Monétaire

Service des Titres de Créances Négociables – Pôle Déclarations et Statistiques

stcn.collecte@banque-france.fr

2. Cadre réglementaire

La Banque de France veille au respect par les émetteurs de titres de créances négociables des conditions d'émission (article L.213-4 et article D. 213-2) et assure régulièrement la diffusion des informations statistiques sur les titres émis qui lui sont communiquées par les émetteurs (article D. 213-14).

Conformément à l'article 3 de la Décision n° 2012-01 du 29 juin 2012 du Gouverneur de la Banque de France relative aux modalités d'exercice des missions de la Banque de France sur le marché des titres de créances négociables, modifiée par la Décision n°2016-04 du 31 mai 2016, le contenu détaillé des informations statistiques que les émetteurs doivent communiquer à la Banque de France, ainsi que la fréquence de la fourniture de ces informations et les moyens techniques de leur communication sont précisés dans le présent document.

3. Période transitoire suite à l'entrée en vigueur de la réforme du marché le 1^{er} juin 2016

Les modifications induites par la récente réforme du marché des titres de créances négociables vont progressivement modifier les modalités de déclaration à la Banque de France.

La fusion des anciens *certificats de dépôt* et *billets de trésorerie* dorénavant réunis sous la dénomination « *titres négociables à court terme* », ainsi que le changement d'appellation des anciens *bons à moyen terme négociable (BMTN)* en « *titres négociables à moyen terme* » ont rendu nécessaire la création de nouveaux codes pour définir ces nouvelles dénominations de titres (cf. annexe 8.1).

Afin de permettre aux domiciliataires d'adapter leurs systèmes informatiques à cette nouvelle codification, ils bénéficient d'une **période transitoire** durant laquelle il leur est possible d'effectuer leurs déclarations **dans les 2 types de codes, anciens et nouveaux**. Dans le cas de déclaration avec les anciens codes, la Banque de France se charge de les transcoder dans la nouvelle nomenclature.

Au terme de cette période – date restant à définir –, seuls les nouveaux codes seront acceptés dans les déclarations à la Banque de France.

4. Présentation générale des échanges

4.1. Flux échangés, périodicité et délai de remise

4.1.1 Sens domiciliaire vers la Banque de France

Tous les flux en provenance des domiciliataires alimentent l'application NORIA (Titres de créances Négociables Refonte Informatique et organisationnelle) de la Banque de France.

Trois flux distincts sont transmis :

- **Les déclarations de titres, mouvements et encours (DTM) :**

Dès lors que le domiciliataire a connaissance, pour les émetteurs de son périmètre, de l'émission d'un nouveau titre ou d'un mouvement sur un titre existant, une déclaration DTM doit être transmise à la Banque de France dans la journée (à J). Ces flux doivent donc être transmis au fil de l'eau.

En revanche, si aucun des émetteurs de son périmètre n'a effectué d'opération au cours de la journée, le domiciliataire n'a aucune déclaration à faire, mais il est invité à le signaler à la Banque de France par mél.

A chaque émission de titres nouveaux (nouvel ISIN), le domiciliataire transmet à la Banque de France au sein d'une même déclaration :

- les caractéristiques des titres (type de titres, code ISIN, libellé... détails cf. §6.1.2.4). Ces informations ne sont déclarées qu'une seule et unique fois ;
- les mouvements d'émissions associés avec toutes les informations requises (montants, valeur du taux... détails cf. §6.1.2.5) ;
- l'encours totalisé par l'émetteur à la date de déclaration, sur le(s) type(s) de titres déclaré(s) et sur chacune des devises d'émission déclarées.

Par la suite, le domiciliataire transmet au fil de l'eau les mouvements associés aux titres précédemment déclarés (émission, rachat, ventes, rachat-portage), ainsi que les encours correspondants.

Conformément à la réglementation (Art. 1^{er} de l'Arrêté du 30 mai 2016), le montant minimal déclaré pour chaque mouvement doit respecter les conditions suivantes :

- Tout mouvement d'émission – et par conséquent tout mouvement de rachat - doit être supérieur ou égal à 150 000 euros ou son équivalent en devise ;
- En cas de rachat partiel sur un titre, l'encours résiduel de ce titre doit être supérieur ou égal à 150 000 euros ou son équivalent en devise ;
- Tout mouvement de rachat-portage et de vente-portage doit respecter les conditions précisées dans les [spécifications complémentaires sur les flux de rachats-portage](#).

Si la documentation financière est établie dans une langue autre que le français, le seuil des 150 000 euros est porté à 200 000 euros.

Pour les émetteurs accédant pour la première fois au marché, aucune déclaration DTM ne sera acceptée sans validation préalable de leur Documentation Financière¹ par la Banque De France.

- **Les demandes de situation d'encours d'un émetteur (SPE)**

La périodicité d'échange est ponctuelle, à l'initiative du domiciliataire.

Cette demande permet à un domiciliataire de connaître, pour un émetteur de son périmètre, le montant de son encours par type de titres et par devise, avec l'ensemble des mouvements associés tels qu'ils ont été réceptionnés dans l'application NORIA de la Banque de France.

La situation de l'émetteur sera celle à la date demandée.

4.1.2 Sens Banque de France vers Domiciliataire

Les flux décrits au paragraphe 4.1.1 donnent lieu à des flux retours de la Banque de France vers le domiciliataire. On distingue ainsi :

- **Les comptes rendus suite aux déclarations de titres, mouvements et encours**

Le traitement et le contrôle des flux DTM par l'application réceptrice NORIA donne lieu à un compte rendu transmis au domiciliataire, et dont le descriptif figure aux points 7.1 et 7.2 de ce document. Les déclarations au format incorrect sont rejetées et génèrent un compte rendu d'anomalie technique, tandis que les erreurs sont communiquées au moyen d'un compte rendu de traitement. Le domiciliataire doit alors faire le nécessaire pour renvoyer les déclarations corrigées au plus tôt dans la journée.

- **La situation d'un émetteur (retour SPE)**

En réponse à la demande du domiciliataire, l'application NORIA lui renvoie, pour l'émetteur souhaité ainsi que par type de titres et par devise, le montant global de l'encours et les mouvements de titres associés disponibles dans l'applicatif à la date de la demande.

4.2. Modalités de transmission

Les flux transmis par les domiciliataires à la Banque de France peuvent se faire au choix par :

- Télétransmission basée sur une infrastructure réseau IP et supportant les protocoles Pesit Hors SIT (réseau EAI qui est un système de transfert de fichiers conçu et géré par la BDF pour ses échanges entre ses applications internes et ses partenaires externes) ;
- Le guichet d'échanges de Fichiers sur Internet (GFIN).

¹ Les Documentations Financières sont validées par le pôle « Emetteurs » du Service des titres de créances négociables, qui s'assure du respect par l'émetteur des conditions d'accès au marché. Pour le contacter : stcn.dpf@banque-france.fr

La préconisation de la Banque de France est de privilégier le lien EAI déjà implanté dans la plupart des établissements.

Les horaires d'ouverture des serveurs de fichiers de la Banque de France sont les suivants :

- EAI : du lundi au dimanche de 00h30 à 23h30
- GFIN : 7 jours/7 de 2h30 à 23h50

Quel que soit le mode de transmission, toute nouvelle demande d'accès à ces services ainsi que toute modification, donnera lieu à transmission à la Banque de France :

- soit d'un formulaire d'abonnement précisant les paramètres techniques pour les télétransmissions via EAI,
- soit de bordereaux d'accréditation au guichet GFIN.

Ces documents sont disponibles sur demande auprès du service en charge de la collecte statistique.

5. Règles de présentation des fichiers échangés

Les fichiers échangés entre la Banque de France et les domiciliataires sont de type XML.

Dans ce document, les informations échangées sont présentées sous une forme normalisée divisée en deux parties : l'arborescence (structure logique) et le dictionnaire (contenu). Les conventions d'écriture et de présentation sont décrites ci-dessous.

5.1. Partie Arborescence

<REGROUPEMENT>	Balise de début de regroupement
</REGROUPEMENT >	Balise de fin de regroupement
<ELEMENT>	Balise de début d'élément simple
</ELEMENT>	Balise de fin d'élément simple
ELEMENT	Élément simple encadré d'une balise de début et de fin d'élément simple
REGROUPEMENT	Regroupement
(répétition de 1 à n)	Indication de la répétition d'un élément ou d'un regroupement
?	Élément ou regroupement non obligatoire
Ou	Un et un seul des n éléments/regroupements
(A : x, y)	x et y sont attributs de l'élément considéré

Dans la présentation des modules, l'indentation permet de repérer la hiérarchie logique des différents regroupements.

Dans un regroupement, ses différentes parties sont présentées sur des lignes successives avec la même indentation. Ceci traduit visuellement le 'et' logique.

Exemple

Présentation	Traduction logique
<REGROUPEMENT1> ELEMENT1 ELEMENT2 ou ELEMENT3 REGROUPEMENT2 </REGROUPEMENT1>	REGROUPEMENT1 contient : ELEMENT1 et (ELEMENT2 ou ELEMENT3) et REGROUPEMENT2 toujours encadrés par des balises de début et de fin

Noms des balises XML

La syntaxe des balises est décrite dans la suite du document.

Il est absolument obligatoire de respecter la casse c'est-à-dire les majuscules et minuscules à l'identique du modèle.

5.2. Partie Dictionnaire

En tête de chaque regroupement est indiqué son titre.

Mot-clé XML	Terminologie conforme à la syntaxe XML
Type XML	2 valeurs possibles : ELE (élément) – REG (regroupement d'éléments)
Cardinalité pour une répétition	Répétition d'un élément ou d'un regroupement
Libellé	Libellé descriptif d'un élément ou d'un attribut
Type	Type de donnée : AN (alphanumérique) – N (numérique) – D (format date))
Longueur	Longueur de la donnée
Format	Format de la donnée : F (fixe) – V (variable)
Oblig Non oblig.	Caractère obligatoire (O) ou non obligatoire (N) de la donnée
Observations	Caractéristiques éventuelles du format d'affichage de la donnée Liste des valeurs possibles

A la suite de chaque tableau descriptif d'un regroupement peuvent figurer :

- une règle d'exclusion relative à n éléments de ce regroupement ;
- une règle de rattachement d'un ou plusieurs attributs à un élément ou à un regroupement ;
- un rappel de contraintes ou toute autre remarque particulière.

Un regroupement n'est jamais vide : il contient au moins un élément ou un regroupement.

Corollaire : un regroupement non obligatoire contient, dès lors qu'il est présent, au moins un élément ou un regroupement. S'il possède un attribut, cet attribut est obligatoire.

5.3. Conventions générales sur les fichiers échangés

- Tous les fichiers XML échangés entre les domiciliataires et la Banque de France (et vice versa) contiendront pour première ligne :
<?xml version="1.0" encoding="ISO-8859-1"?>
- La balise <!DOCTYPE> ne doit pas figurer dans les fichiers.
- Du fait d'une contrainte technique lors du transfert de fichier texte de longueur variable, un retour chariot devra être inséré après chaque balise fermante.
- Afin d'identifier la nature des fichiers lors de leur transfert via le moniteur de transfert PeSit hors SIT, un paramètre devra être indiqué dans la zone message utilisateur, conformément au tableau ci-dessous :

Sens Domiciliataire → Banque de France :

Type de fichier	Paramètre
Déclaration de titres mouvements et encours	DTM
Demande de situation d'un émetteur	SPE

5.4. Conventions générales sur les données requises

- Dans le cadre de données non obligatoires, les balises de début et de fin ne sont présentes que pour les données effectivement renseignées.
- S'agissant des données numériques, les conditions suivantes doivent être respectées :
 - Pour les flux domiciliataires vers la Banque de France (fichiers DTM), le séparateur décimal, s'il est attendu, est une virgule. Pour les flux Banque de France vers les domiciliataires (fichiers retour SPE), le séparateur décimal, s'il est attendu, est un point.
 - Les zéros non significatifs à gauche ne sont jamais obligatoires.
 - Les zéros non significatifs à droite après le séparateur décimal ne sont jamais obligatoires.
 - Le signe négatif, s'il est attendu, est en première position.
 - Le signe positif n'est jamais obligatoire.
- L'utilisation des caractères accentués n'est pas acceptée.

6. Échanges : Domiciliataire vers Banque de France

6.1. La déclaration des titres, mouvements et encours

Le paragraphe suivant décrit l'arborescence du fichier de déclaration, ce n'est pas un exemple. Chaque donnée élémentaire est impérativement encadrée d'une balise de début et de fin d'élément. Des exemples de fichiers de déclaration XML sont fournis sur le site internet de la Banque de France.

6.1.1 Arborescence Déclaration des titres, mouvements et encours

```
<TCN>
  ENTETE
  DECLARATION (répétition de 1 à n)
</TCN>
  <ENTETE>
    Numero_Remise
    CIB_Declarant
    Date_Declaration
    Type_Fichier
    Vos_References
  </ENTETE>
  <DECLARATION>
    CIB_Emetteur ou SIREN_Emetteur
    Code_Compartiment (uniquement pour les Sociétés de titrisation)
    CARACTERISTIQUES_TITRE (répétition de 0 à n)
    MOUVEMENT_TITRE (répétition de 1 à n)
    ENCOURS (répétition de 1 à n)
  </DECLARATION>
    <CARACTERISTIQUES_TITRE>
      Type_Mouvement
      Type_TCN
      Code_ISIN
      Libelle_Titre
      Code_Devisa
      Code_Taux
      Date_Emission
      Date_Echeance
    </CARACTERISTIQUES_TITRE>
    <MOUVEMENT_TITRE>
      Type_Mouvement
      Type_Operation
      Code_ISIN
      Reference_Mouvement
      Taux ou Marge
      Montant
      Code_Souscripteur
      Date_Negotiation
      Date_Valeur
      CIB_Placeur ou SIREN_Placeur
    </MOUVEMENT_TITRE >
    <ENCOURS>
      Type_TCN
      Code_Devisa
      Montant_Encours
    </ ENCOURS >
```

6.1.2 Dictionnaire Déclaration des titres, mouvements et encours

Remarques préalables :

- La périodicité d'échange est journalière.
- Un fichier contient de 1 à n déclarations des titres, mouvements et encours. Une déclaration comporte au moins la partie "mouvements_titres" et la partie "encours".
- Il ne peut exister dans un fichier qu'une et une seule déclaration pour un émetteur.
- Tous les titres déclarés sont identifiés par un code ISIN.
- Les caractéristiques sont à fournir avec le premier mouvement. Pour les mouvements suivants, les caractéristiques ne devront pas être transmises.
- Seuls les encours correspondant aux mouvements sur titres d'une déclaration doivent être fournis.
- Pour modifier les caractéristiques d'un titre ayant des mouvements associés, il faudra :
 - constituer un premier fichier où les mouvements seront annulés ;
 - créer un second fichier pour annuler le titre, le recréer avec ses mouvements associés.
- Si pour chaque regroupement défini ci-après, le contenu envoyé ne correspond pas au format attendu, le fichier est rejeté avec message d'anomalie "ET002, La structure du fichier est invalide".

6.1.2.1 Regroupement : TCN

Pas de zones spécifiques

6.1.2.2 Regroupement : Entête

Mot-clé XML	Type XML	Cardinalité pour une répétition	Libellé	Type	Long	Format Fixe Variable	Oblig. Non oblig.	Observations
Numero_Remise	ELE		Référence envoi	N	7	F	O	Doit s'incrémenter de 1 à chaque envoi Le premier n° d'envoi sera attribué par le STCN
CIB_Declarant	ELE		Code Ets de Crédit	N	5	F	O	Correspond au CIB du domiciliataire
Date_Declaration	ELE		Date	D	8	F	O	Format attendu : JJMMSSAA
Type_Fichier	ELE		Libellé du fichier	AN		V	O	Libellé imposé : "DECLARATION TCN"
Vos_References	ELE		Zone réservée	AN	50	V	N	Zone libre à la disposition du déclarant

REGLES DE GESTION :

1. Référence de l'envoi :

- Si le numéro de remise ne correspond pas à celui attendu, le STCN prendra contact avec le correspondant du domiciliataire.

2. Date de déclaration du fichier

- Si la date de déclaration est postérieure à la date du jour, rejet du fichier et écriture d'un message d'anomalie "ET003, Le fichier de déclaration est anticipé"

6.1.2.3 Regroupement : DECLARATION

Mot-clé XML	Type XML	Cardinalité pour une répétition	Libellé	Type	Long	Format Fixe Variable	Oblig. Non oblig.	Observations
CIB_Emetteur	ELE		Code Ets de Crédit	N	5	F	Cf. infra	
SIREN_Emetteur	ELE		Identifiant INSEE	N	9	F	Cf. infra	
Code_Compartment	ELE		Code du compartiment	N	1 à 2	V	Cf. infra	
CARACTERISTIQUES TITRE	REG	0 à n	Descriptif du titre				N	
MOUVEMENT TITRE	REG	1 à n	Descriptif des mouvements				O	
ENCOURS	REG	1 à n	Descriptif des encours				O	

Règle d'exclusion n°1: CIB_Emetteur (lorsque l'émetteur est un établissement de crédit ou la CDC) **ou** SIREN_Emetteur

Règle d'exclusion n°2 : le Code_Compartment ne doit être renseigné que dans le cas où l'émetteur est un organisme de titrisation.

6.1.2.4 Regroupement : CARACTERISTIQUES_TITRE

Mot-clé XML	Type XML	Cardinalité pour une répétition	Libellé	Type	Long	Format Fixe Variable	Oblig. Non oblig.	Observations
Type_Mouvement	ELE			AN	1	F	O	Doit figurer dans la liste suivante : - C si création - A si annulation
Type_TCN	ELE		Catégorie de rattachement du TCN	AN	4	V	O	Doit figurer dans la liste fournie en annexe Ex : CP, MTS...
Code_ISIN	ELE		Code du titre attribué par EUROCLEAR France	AN	12	F	O	Format obligatoire FR9999999999
Libelle_Titre	ELE		Libellé du titre	AN	60	V	O	Libellé libre
Code_Devises	ELE		Code ISO monnaie	AN	3	F	O	Ex : EUR, GBP, USD,...
Code_Taux	ELE		Code taux	N	3	F	O	Doit figurer dans la liste fournie en annexe Ex : 001, 037, ...
Date_Emission	ELE		Date de création du titre = Date de codification du titre auprès d'Euroclear France	D	8	F	O	Format : JJMMSSAA Doit être ≤ à la date de valeur du premier mouvement
Date_Echeance	ELE		Date de maturité du titre	D	8	F	O	Format : JJMMSSAA Doit être > à la date d'émission

6.1.2.5 Regroupement : MOUVEMENT_TITRE

Mot-clé XML	Type XML	Cardinalité pour une répétition	Libellé	Type	Long	Format Fixe Variable	Oblig. Non oblig.	Observations
Type_Mouvement	ELE			AN	1	F	O	Doit figurer dans la liste suivante : - C si création - A si annulation
Type_Operation	ELE			AN	1	F	O	Doit figurer dans la liste suivante : - E si émission - R si rachat - P si portage - V si vente-portage
Code_ISIN	ELE		Code du titre attribué par EUROCLEAR France	AN	12	F	O	Format obligatoire FR9999999999
Reference_Mouvement	ELE		Référence du mouvement dans le Système d'information du domiciliataire	AN	12	V	N	Si elle est renseignée, cette donnée sera renvoyée dans les fichiers compte-rendu
Taux	ELE		Valeur du taux	N	9	F	Cf. infra	Format : ±99,99999
Marge	ELE		Valeur de la marge	N	8	F	Cf. infra	Format : ±9,99999 Doit être comprise entre -9,00000 et +9,00000
Montant	ELE		Montant en unités, exprimé dans la devise déclarée dans les caractéristiques du titre	N	15	F	O	Format 9999999999999999
Code_Souscripteur	ELE		Code de rattachement à une catégorie de souscripteurs	AN	1	F	O	Doit figurer dans la liste des codes de souscripteurs fournie en annexe
Date_Negotiation	ELE		Date de décision de l'opération	D	8	F	N	Format : JJMMSSAA Doit figurer si la date de valeur est différente
Date_Valeur	ELE		Date comptable du mouvement	D	8	F	O	Format : JJMMSSAA Doit être comprise entre la date d'émission et la date d'échéance du titre (borne inférieure incluse)
CIB_Placeur	ELE		Code Ets de Crédit	N	5	F	N Cf. infra	
SIREN_Placeur	ELE		Identifiant INSEE	N	9	F	N Cf. infra	

Règle d'exclusion :

- Taux ou Marge
- CIB_Placeur ou SIREN_Placeur. Cette zone n'est pas obligatoire.

6.1.2.6 Regroupement : ENCOURS

Mot-clé XML	Type XML	Cardinalité pour une répétition	Libellé	Type	Long	Format Fixe Variable	Oblig. Non oblig.	Observations
Type_TCN	ELE		Catégorie de rattachement du TCN	AN	2 à 4	V	O	Doit figurer dans la liste des types de TCN cf. annexe
Code_Devises	ELE		Code monnaie ISO alphabétique	AN	3	F	O	Ex : EUR, USD, GBP
Montant_Encours	ELE		Montant en unités, exprimé dans la devise déclarée	N	15	F	O	Format 9999999999999999

L'encours déclaré correspond à la somme des encours de tous les titres vivants pour un couple (type de TCN / devise) présent dans la déclaration effectuée par un domiciliataire pour un émetteur donné. Il inclut les mouvements transmis dans ce fichier de déclaration. Seuls les encours correspondant aux mouvements transmis doivent être fournis.

6.2. La demande de situation d'encours d'un émetteur

Le paragraphe suivant décrit l'arborescence du fichier, ce n'est pas un exemple. Chaque donnée élémentaire est impérativement encadrée d'une balise de début et de fin d'élément. Des exemples de fichiers XML sont fournis sur le site Internet de la Banque de France.

6.2.1 Arborescence Demande de situation**<SITUATION>****ENTETE****DEMANDE_SITUATION****</ SITUATION >****<ENTETE>**

Numero_Remise

CIB_Declarant

Date_Demande

Type_Fichier

Vos_References

</ENTETE>**<DEMANDE_SITUATION>**CIB_Emetteur **ou** SIREN_EmetteurCode_Compartment (**uniquement pour les Sociétés de titrisation**)

Type_TCN

Code_Devises

</ DEMANDE_SITUATION>

6.2.2 Dictionnaire Demande de situation

Remarques préalables :

- La périodicité d'échange est ponctuelle, à la demande du domiciliataire.
- Un domiciliataire ne pourra effectuer une demande de situation que pour les émetteurs qui lui ont confié la gestion de leur TCN.
- La situation de l'émetteur sera celle à la date de la demande, c'est-à-dire la dernière situation.
- Si pour chaque regroupement défini ci-après, le contenu envoyé ne correspond pas au format attendu, le fichier est rejeté avec message d'anomalie "ET002, La structure du fichier est invalide".

6.2.2.1 Regroupement : SITUATION

Pas de zones spécifiques

6.2.2.2 Regroupement : ENTETE

Mot-clé XML	Type XML	Cardinalité pour une répétition	Libellé	Type	Long	Format Fixe Variable	Oblig. Non oblig.	Observations
Numero_Remise	ELE		Référence envoi	N	7	F	O	Doit s'incrémenter de 1 à chaque envoi Le premier n° d'envoi sera attribué par le STCN
CIB_Declarant	ELE		Code Ets de Crédit	N	5	F	O	Correspond au CIB du domiciliataire
Date_Demande	ELE		Date	D	8	F	O	Format attendu : JJMMSSAA
Type_Fichier	ELE		Libellé du fichier	AN		V	O	libelle imposé : "DEMANDE DE SITUATION"
Vos_References	ELE		Zone réservée	AN	50	V	N	Zone libre à la disposition du déclarant

6.2.2.3 Regroupement : DEMANDE_SITUATION

Mot-clé XML	Type XML	Cardinalité pour une répétition	Libellé	Type	Long	Format Fixe Variable	Oblig. Non oblig.	Observations
CIB_Emetteur	ELE		Code Ets de Crédit	N	5	F	Cf. infra	
SIREN_Emetteur	ELE		Identifiant INSEE	N	9	F	Cf. infra	
Code_Compartment	ELE		Code du compartiment	N	1 à 2	V	Cf. infra	
Type_TCN	ELE		Catégorie de rattachement du TCN	AN	2 à 4	V	O	Doit figurer dans la liste des types de TCN cf. annexe
Code_Devises	ELE		Code ISO alphabétique	AN	3	F	O	

Règle d'exclusion n°1: CIB_Emetteur (lorsque l'émetteur est un établissement de crédit ou la CDC) **ou** SIREN_Emetteur

Règle d'exclusion n°2 : le Code_Compartment ne doit être renseigné que dans le cas où l'émetteur est un organisme de titrisation.

7. Échanges : Banque de France vers domiciliataire

7.1. Le compte-rendu d'anomalie technique

Le compte rendu d'anomalie technique est envoyé suite à la réception d'un fichier de déclaration de format incorrect ou inexploitable.

Le paragraphe suivant décrit l'arborescence du fichier, ce n'est pas un exemple. Chaque donnée élémentaire est impérativement encadrée d'une balise de début et de fin d'élément. Des exemples de fichiers XML sont fournis sur le site internet de la Banque de France.

7.1.1 Arborescence compte rendu d'anomalie technique

<TRANSFERT>

Reference_Transfert

Code_Anomalie

Libelle_Anomalie

</TRANSFERT>

7.1.2 Dictionnaire compte rendu d'anomalie technique

7.1.2.1 Regroupement : TRANSFERT

Mot-clé XML	Type XML	Cardinalité pour une répétition	Libellé	Type	Long	Format Fixe Variable	Oblig. Non oblig.	Observations
Reference_Transfert	ELE		Référence Pacific ou GFIN	AN	6	F	O	
Code_Anomalie	ELE			AN	5	F	O	Détails des codes erreurs en annexe
Libelle_Anomalie	ELE			AN		V	O	Détails des codes erreurs en annexe

7.2. Le compte rendu de traitement déclaration titres, mouvement et encours

Le compte rendu de traitement est envoyé à l'issue du traitement du fichier de déclaration des titres mouvement et encours.

Le paragraphe suivant décrit l'arborescence du fichier, ce n'est pas un exemple. Chaque donnée élémentaire est impérativement encadrée d'une balise de début et de fin d'élément. Des exemples de fichiers XML sont fournis sur le site internet de la Banque de France.

7.2.1 Arborescence compte rendu de traitement déclaration TCN

<TCN>

ENTETE
STATUT_FICHER
DECLARATION (répétition de 0 à n)

</TCN>

<ENTETE>

Numero_Remise
CIB_Declarant
Date_Compte_Rendu
Type_Fichier
Vos_References

</ENTETE>

<STATUT_FICHER>

Code_Retour_Fichier
Libelle_Retour_Fichier
Nb_Declarations_Receptionnees
Nb_Declarations_Integrees

</STATUT_FICHER>

<DECLARATION>

CIB_Emetteur **ou** SIREN_Emetteur
Code_Compartment (**uniquement pour les Sociétés de titrisation**)
ERREUR_DTM (répétition de 0 à n)
ERREUR_ENCOURS (répétition de 0 à n)

</DECLARATION>

<ERREUR_DTM>

Code_Erreur
Libelle_Erreur
Code_ISIN
Libelle_Titre **ou** Reference_Mouvement

</ERREUR_DTM>

<ERREUR_ENCOURS>

Code_Erreur
Libelle_Erreur
Type_TCN
Code_Devises
Montant_Declare
Montant_Calcule

</ERREUR_ENCOURS>

7.2.2 Dictionnaire Compte rendu de traitement déclaration TCN

7.2.2.1 Regroupement : TCN

Pas de zones spécifiques

7.2.2.2 Regroupement : ENTETE

Mot-clé XML	Type XML	Cardinalité pour une répétition	Libellé	Type	Long	Format Fixe Variable	Oblig. Non oblig.	Observations
Numero_Remise	ELE		Référence envoi	N	7	F	O	reprend celui de la déclaration
CIB_Declarant	ELE		Code Ets de Crédit	N	5	F	O	reprend celui de la déclaration
Date_Compte_Rendu	ELE		Date de déclaration	D	8	F	O	Format : JJMMSSAA reprend celle de la déclaration
Type_Fichier	ELE		Libellé du fichier	AN		V	O	libelle imposé : "CR DECLARATION TCN"
Vos_References	ELE		Zone réservée	AN	50	V	N	reprend celle de la déclaration

7.2.2.3 Regroupement : STATUT_FICHER

Mot-clé XML	Type XML	Cardinalité pour une répétition	Libellé	Type	Long	Format Fixe Variable	Oblig. Non oblig.	Observations
Code_Retour_Fichier	ELE		Code retour fichier	N	1	F	O	Peut prendre les valeurs
Libelle_Retour_Fichier	ELE		Libelle retour fichier	AN		V	O	0. Fichier intégré dans sa totalité 1. Fichier rejeté 2. Fichier intégré partiellement
Nb_Declarations_Receptionnees	ELE		Nombre de déclarations reçues dans le fichier de déclaration	N	4	F	O	Format 9999
Nb_Declarations_Integrees	ELE		Nombre de déclarations intégrées dans le système d'information de la Banque de France	N	4	F	O	Format 9999

7.2.2.4 Regroupement : DECLARATION

Mot-clé XML	Type XML	Cardinalité pour une répétition	Libellé	Type	Long	Format Fixe Variable	Oblig . Non oblig.	Observations
CIB_Emetteur	ELE		Code Ets de Crédit	N	5	F	Cf. infra	
SIREN_Emetteur	ELE		Identifiant INSEE	N	9	F	Cf. infra	
Code_Compartment	ELE		Code du compartiment	N	1 à 2	V	Cf. infra	
ERREUR_DECLARATION	REG	1 à n	Erreurs détectées sur la déclaration					

Règle d'exclusion n°1: CIB_Emetteur (lorsque l'émetteur est un établissement de crédit ou la CDC) **ou** SIREN_Emetteur

Règle d'exclusion n°2 : le Code_Compartment ne doit être renseigné que dans le cas où l'émetteur est un organisme de titrisation.

7.2.2.5 Regroupement : ERREUR_DTM

Mot-clé XML	Type XML	Cardinalité pour une répétition	Libellé	Type	Long	Format Fixe Variable	Oblig . Non oblig.	Observations
Code_Erreur	ELE			AN	5	F	O	Détails des codes erreurs en annexe
Libelle_Erreur	ELE			AN		V	O	Détails des codes erreurs en annexe
Code_ISIN	ELE		Code du titre attribué par EUROCL EAR France	AN	12	F	N	Format obligatoire FR9999999999
Libelle_Titre	ELE			AN		V	Cf. infra	Sera servi si le rejet de la déclaration est dû à un regroupement CARACTERISTIQUES_TITRE
Reference_Mouvement	ELE			AN	12	F	Cf. infra	Sera servi si le rejet de la déclaration est dû à un regroupement MOUVEMENT_TITRE

Règle d'exclusion : Libelle_Titre **ou** Reference_Mouvement ou aucune de ces deux zones

7.2.2.6 Regroupement : ERREUR_ENCOURS

Mot-clé XML	Type XML	Cardinalité pour une répétition	Libellé	Type	Long	Format Fixe Variable	Oblig. Non oblig.	Observations
Code_Erreur	ELE			AN	5	F	O	Détails des codes erreurs en annexe
Libelle_Erreur	ELE			AN		V	O	Détails des codes erreurs en annexe
Type_TCN	ELE		Catégorie de rattachement du TCN	AN	2 à 4	V	O	Doit figurer dans la liste des types de TCN cf. annexe
Code_Devis	ELE		Code monnaie ISO alphabétique	AN	3	F	O	Ex : EUR, USD, GBP
Montant_Declare	ELE		Montant en unités de l'encours transmis lors de la déclaration	N	15	F	O	Format 999999999999999
Montant_Calcule	ELE		Montant en unités de l'encours calculé lors du traitement de la déclaration	N	15	F	O	Format 999999999999999

7.3. La situation d'un émetteur

Le paragraphe suivant décrit l'arborescence du fichier, ce n'est pas un exemple. Chaque donnée élémentaire est impérativement encadrée d'une balise de début et de fin d'élément. Des exemples de fichiers XML sont fournis sur le site internet de la Banque de France.

7.3.1 Arborescence Situation d'un émetteur

<SITUATION>

ENTETE

ERREUR_SITUATION (répétition de 0 à n)

SITUATION_EMETTEUR (répétition de 0 à 1)

</ SITUATION >

<ENTETE>

Numero_Remise

CIB_Declarant

Date_Demande

Type_Fichier

Vos_References

</ENTETE>

<ERREUR_SITUATION>

Code_Erreur

Libelle_Erreur

</ERREUR_SITUATION>

< SITUATION_EMETTEUR>

CIB_Emetteur **ou** SIREN_Emetteur

Code_Compartment (**uniquement pour les Sociétés de titrisation**)

Date_Encours

Type_TCN

Code_Devisa

Montant_Global

DETAIL_ENCOURS (répétition de 0 à n)

</ SITUATION_EMETTEUR >

< DETAIL_ENCOURS >

Code_ISIN

Montant_Encours

MOUVEMENT (répétition de 1 à n)

</ DETAIL_ENCOURS >

<MOUVEMENT>

Type_Mouvement

Type_Operation

Code_ISIN

Reference_Mouvement

Taux **ou** Marge

Montant

Code_Souscripteur

Date_Negotiation

Date_Valeur

CIB_Placeur **ou** SIREN_Placeur

</ MOUVEMENT >

7.3.2 Dictionnaire Situation d'un émetteur

Remarques préalables :

- La périodicité d'échange est ponctuelle, elle fait suite à la demande du domiciliataire.
- La situation de l'émetteur sera celle à la date demandée.

7.3.2.1 Regroupement : SITUATION

Pas de zones spécifiques

7.3.2.2 Regroupement : ENTETE

Mot-clé XML	Type XML	Cardinalité pour une répétition	Libellé	Type	Long	Format Fixe Variable	Oblig. Non oblig.	Observations
Numero_Remise	ELE		Référence envoi	N	7	F	O	reprend celui de la demande
CIB_Declarant	ELE		Code Ets de Crédit	N	5	F	O	reprend celui de la demande
Date_Demande	ELE		Date de la demande	D	8	F	O	reprend celle de la demande
Type_Fichier	ELE		Libellé du fichier	AN	20	F	O	Libellé imposé : "REPONSE SITUATION"
Vos_References	ELE		Zone réservée	AN	50	V	N	reprend celle de la demande

7.3.2.3 Regroupement : ERREUR_SITUATION

Ce regroupement ne sera présent qu'en cas d'erreur dans le flux de demande de situation.

Mot-clé XML	Type XML	Cardinalité pour une répétition	Libellé	Type	Long	Format Fixe Variable	Oblig. Non oblig.	Observations
Code_Anomalie	ELE			AN	5	F	N	Détails des codes erreurs en annexe
Libelle_Anomalie	ELE			AN		V	N	Détails en annexe

7.3.2.4 Regroupement : SITUATION_EMETTEUR

Mot-clé XML	Type XML	Cardinalité pour une répétition	Libellé	Type	Long	Format Fixe Variable	Oblig. Non oblig.	Observations
CIB_Emetteur	ELE		Code Ets de Crédit	N	5	F	Cf. infra	Reprend celui de la demande
SIREN_Emetteur	ELE		Identifiant INSEE	N	9	F	Cf. infra	Reprend celui de la demande
Code_Compartment	ELE		Code du compartiment	N	1 à 2	V	Cf. infra	Reprend celui de la demande
Date_Encours	ELE		Date de l'encours	D	8	F	O	format : JJMMSSAA Date du traitement de la réponse
Type_TCN	ELE		Code de rattachement du TCN	AN	2 à 4	V	O	Reprend celui de la demande
Code_Devises	ELE		Code ISO alphabétique	AN	3	F	O	Reprend celui de la demande
Montant_Global	ELE		Montant en unités	N	15	F	O	999999999999999
DETAIL_ENCOURS	REG	0 à n	Descriptif des encours				N	

Règle d'exclusion n°1: CIB_Emetteur (lorsque l'émetteur est un établissement de crédit ou la CDC) **ou** SIREN_Emetteur

Règle d'exclusion n°2 : le Code_Compartment ne doit être renseigné que dans le cas où l'émetteur est un organisme de titrisation.

7.3.2.5 Regroupement : DETAIL_ENCOURS

Mot-clé XML	Type XML	Cardinalité pour une répétition	Libellé	Type	Long	Format Fixe Variable	Oblig. Non oblig.	Observations
Code_ISIN	ELE		Code du titre attribué par Euroclear France	AN	12	F	O	FR9999999999
Montant_Encours	ELE		Montant en unités	N	15	F	O	999999999999999
MOUVEMENT	REG	1 à n	Liste des mouvements constituant l'encours				O	

7.3.2.6 Regroupement : MOUVEMENT

Mot-clé XML	Type XML	Cardinalité pour une répétition	Libellé	Type	Long	Format Fixe Variable	Oblig. Non oblig.	Observations
Type_Mouvement	ELE			AN	1	F	O	Doit figurer dans la liste suivante : - C si création - A si annulation
Type_Operation	ELE			AN	1	F	O	Doit figurer dans la liste suivante : - E si émission - R si rachat - T si tombée
Code_ISIN	ELE		Code du titre attribué par EUROCLEAR France	AN	12	F	O	Format obligatoire FR9999999999
Taux	ELE		Valeur du taux	N	9	F	Cf. infra	Format : ±99,99999
Marge	ELE		Valeur de la marge	N	8	F	Cf. infra	Format : ±9,99999 Doit être comprise entre -1,00000 et +1,00000
Reference_Mouvement	ELE		Référence du mouvement dans le Système d'information du domiciliataire	AN	12	F	N	Si elle est renseignée, cette donnée sera renvoyée
Montant	ELE		Montant en unités	N	15	F	O	Format 99999999999999999
Code_Souscripteur	ELE		Code de rattachement à une catégorie de souscripteurs	AN	1	F	O	Doit figurer dans la liste des codes de souscripteurs : cf annexe
Date_Negociation	ELE		Date de décision de l'opération	D	8	F	N	Format : JJMMSSAA
Date_Valeur	ELE		Date comptable du mouvement	D	8	F	O	Format : JJMMSSAA
CIB_Placeur	ELE		Code Ets de Crédit	N	5	F	N Cf. infra	
SIREN_Placeur	ELE		Identifiant INSEE	N	9	F	N Cf. infra	

Règle d'exclusion :

- CIB_Placeur ou SIREN_Placeur. Cette zone n'est pas obligatoire.
- Taux ou Marge

8. Annexes

8.1. Liste des codes et types de TCN

Rappel : pendant la période transitoire, les déclarations à la Banque de France pourront s'effectuer dans les 2 types de codes. A terme, date précisée ultérieurement, seuls les nouveaux codes seront acceptés.

Durée	Nouveaux codes et dénominations			Anciens codes et dénominations	
	Codes	Libellés anglais	Libellés français	Codes	Libellés
de 1 jour à 1 an	CP	Commercial paper	Titre négociable à court terme	CDN BT	Certificat de dépôt Billet de trésorerie
	CPS	Subordinated Commercial Paper	Titre négociable à court terme subordonné	CDNS BTS	Certificat de dépôt subordonné Billet de trésorerie subordonné
	CPGS	State Guaranteed Commercial Paper	Titre négociable à court terme avec garantie d'Etat	CDNG BTG	Certificat de dépôt avec garantie d'Etat Billet de trésorerie avec garantie d'Etat
	CPGA	Commercial Paper with Guarantee on Assets	Titre négociable à court terme garanti par sûretés réelles	CDGA	Certificat de dépôt garanti par sûretés réelles
	CPP	Privileged Commercial Paper	Titre négociable à court terme privilégié	CDNP	Certificat de dépôt privilégié
	CPU	Unrated Commercial Paper	Titre négociable à court terme non noté	Pas d'équivalence dans les anciens codes	
Strictement supérieure à 1 an	MT	Medium Term Note	Titre négociable à moyen terme	BMTN	Bon à moyen terme négociable
	MTS	Subordinated rated Medium Term Note	Titre négociable à moyen terme subordonné noté	BMTS	Bon à moyen terme négociable subordonné
	MTSU	Subordinated Unrated Medium Term Note	Titre négociable à moyen terme subordonné non noté	BSNN	Bon à moyen terme négociable subordonné non noté
	MTP	Privileged Medium Term Note	Titre négociable à moyen terme privilégié	BMCP	Bon à moyen terme négociable privilégié
	MTGS	State Guaranteed Medium Term Note	Titre négociable à moyen terme avec garantie d'Etat	BMTG	Bon à moyen terme négociable avec garantie d'Etat
	MTGA	Medium Term Note with Guarantee on Assets	Titre négociable à moyen terme garanti par sûretés réelles	BMGA	Bon à moyen terme négociable garanti par sûretés réelles
	MTU	Unrated Medium Term Note	Titre négociable à moyen terme non noté	BMNN	Bon à moyen terme négociable non noté

8.2. Liste des codes de souscripteurs

La distinction résidents/non-résidents repose sur le critère de résidence du souscripteur, distinct du critère de nationalité.

Sont donc distinguées :

- Les entités résidentes (codes A à M) qui comprennent les personnes physiques et morales, de nationalité française ou étrangère, établies en France ;
- Les entités non résidentes, Zone Euro (Z) ou hors Zone Euro (H), qui comprennent les personnes physiques et morales, de nationalité française ou étrangère, établies à l'étranger.

Par France, il faut entendre la France métropolitaine, ses 5 départements d'outre-mer - Guadeloupe, Martinique, Guyane, La Réunion et Mayotte – la collectivité de Saint-Pierre et Miquelon, ainsi que la Principauté de Monaco.

L'étranger comprend tous les autres pays que la France telle que définie ci-dessus. Y figurent entre autres les collectivités et territoires français d'outre-mer suivants :

- Nouvelle Calédonie, Polynésie française, îles Wallis et Futuna, à classer Hors Zone Euro (code H)
- Terres australes et antarctiques françaises incluant les îles éparses de l'Océan indien et l'île de Clipperton, Saint martin et Saint Barthélémy, à classer en Zone Euro (code Z).

Code	Libellé	Contenu (à titre indicatif)
A	Établissements de crédit et assimilés	Banques commerciales, banques mutualistes ou coopératives, Caisse des Dépôts et Consignations, caisses de crédits municipal, établissements de monnaie électronique, institutions financières spécialisées, sociétés de développements régionales, sociétés financières régies par des dispositions législatives ou réglementaires spécifiques aux banques, sociétés financières exerçant des activités de crédit-bail ou de distribution de crédit, sociétés de financement, sociétés d'affacturage.
B	OPC	Sicav et FCP monétaires ou non monétaires, SICAF, FCP Entreprises, OPC d'épargne salariale, Fonds communs d'intervention sur les marchés à terme (FCIMT), FCP à Risque y compris FCPI et FIP, Sociétés Civiles de Placements Immobiliers (SCPI), Organismes de Placements Collectifs en Immobilier (OPCI)
C	Entreprises d'assurances, caisses de retraites et mutuelles	Sociétés d'assurance agréées par l'ACPR (y compris les mutuelles et les Institutions de Prévoyance) et caisses de retraites.
D	Sociétés industrielles, commerciales et entreprises individuelles	Sociétés privées ou publiques dotées de la personnalité juridique qui sont des producteurs marchands et dont l'activité principale consiste à produire des biens et des services non financiers + les entreprises individuelles ou sociétés de personnes non dotées de la personnalité juridique et producteurs de services marchands (ex : professions libérales, artisans, commerçants, exploitants agricoles)
E	Administrations publiques	Etat, organismes divers d'administrations centrales, administrations locales et administrations de sécurité sociale à l'exclusion des caisses de retraite déclarées en C
M	Ménages et associations	Particuliers et institutions sans but lucratif au service des ménages (syndicats, partis politiques, clubs sociaux, culturels, sportifs...)
Z	Non-résidents installés dans la zone EURO	Non-résidents installés dans la zone euro Hors France
H	Non-résidents hors zone EURO	Non-résidents installés hors France et hors Zone euro
X	Autres cas	

8.3. Liste des codes taux

Code Taux	Libellé Taux	Nature taux
001	Taux fixe post compté Base 360 j pour durée ≤1 an Base 365 j pour durée >1 an	Fixe
003	Taux fixe précompté	Fixe
005 (uniquement titre Long Terme)	Taux fixe actuariel annuel (base 365 j)	Fixe
007 (=008 depuis le 1 ^{er} /01/99) (uniquement titre Court Terme)	Taux révisable : Euribor 3 mois (base 360j)	Variable ou révisable
008 (uniquement titre Court Terme)	Taux révisable : Euribor 3 mois (base 360j)	Variable ou révisable
011	Taux révisable : Euribor 6 mois connu le 3 ^{ème} j ouvré (base 360j)	Variable ou révisable
013	Taux révisable : Euribor 6 mois connu le 2 ^{ème} j ouvré (base 360j)	Variable ou révisable
014	Taux révisable : Euribor 1 mois connu le 2 ^{ème} j ouvré (base 360j)	Variable ou révisable
015	Émission zéro coupon Base nombre d'années pleines	Fixe
016	Émission zéro coupon Base nombre de jours exacts	Fixe
017	Taux révisable : Euribor 1 an connu le 2 ^{ème} j ouvré (base 360j)	Variable ou révisable
018 (uniquement titre Long Terme)	Taux révisable : Euribor 3 mois Pour émission à 1 an et 1 jour.	Variable ou révisable
021	Taux fixe post compté assimilé au code 005 dès la première échéance passée	Fixe
035	Produit structuré	Structuré
037	Rémunération indexée sur l'Eonia (base 360 j)	Variable ou révisable
039	Rémunération indexée sur l'Eonia capitalisé (base 360 j)	Variable ou révisable

A noter :

Le code « 000 » n'est pas repris dans cette nomenclature. Les titres émis en devises autre que l'euro devront utiliser un code taux mentionné dans le tableau ci-dessus.

Dans le cas où un titre est déclaré en code « 035 », les mouvements sur ce titre devront être déclarés avec soit un taux, éventuellement égal à zéro, soit une marge, éventuellement égale à zéro.

8.4. Liste des codes anomalies transmis dans les comptes-rendus

Les anomalies non bloquantes sont indiquées avec le signe *.

Code Anomalie	Libellé Anomalie	Compte-rendu concernant les flux	
		DTM	SPE
ET001	L'Identification du fichier impossible	X	X
ET002	La structure du fichier est invalide Pour les DTM cf. cas listés ci-dessous	X	X
ET003	Le fichier de déclaration est anticipé	X	
EC002	Fichier declaration rejete	X	
EC005	Emetteur est inconnu	X	X
EC006	DPF a regulariser	X	
EC007	Vous n etes pas habilite a declarer pour cet emetteur	X	
EC010	Pas de programme d emission pour ce type de TCN	X	X
EC011	Date d envoi et date d emission incompatibles impossible de declarer des titres par anticipation	X	
EC012	Date d emission et date d echeance incompatibles	X	
EC013	Retrait d agrement ou cessation dactivite	X	
EC015	Devise inconnue ou n ayant plus cours	X	X
EC016	Devise non declaree dans le programme d emission	X	
EC017	Code taux inconnu	X	
EC018	Incompatibilite entre le code taux et la donnee taux ou marge fournie	X	
EC019	Code taux non rattache a une famille de taux du programme d emission	X	
EC020	Titre echu depuis moins de 3 ans code ISIN deja declare ou invalide	X	
EC021	Titre non echu code ISIN deja declare	X	
EC022	Il existe des mouvements associes Vous devez les annuler avant d annuler le titre	X	
EC023	Code ISIN inconnu	X	
EC024	Titre inexistant mouvement impossible	X	
EC025	Titre annule mouvement impossible	X	
EC026	Emission impossible sur un titre ayant fait l objet d un rachat anticipe total de tous ses mouvements	X	
EC028	Date de valeur anterieure a la date d emission	X	
EC029	Date de valeur incompatible avec la date d echeance ou duree mini incompatible avec le type de TCN	X	

EC031	Code souscripteur inexistant	X	
EC032	Montant inferieur au montant minimum legal	X	
EC033 *	Encours superieur au plafond du programme	X	
EC034	Rachat impossible : Durée de vie du titre inférieure à un jour	X	
EC035	Rachat impossible le montant du titre rachete est inferieur au montant minimum requis	X	
EC036	Mouvement impossible le montant residuel serait inferieur au montant minimum requis	X	
EC037	Mouvement introuvable annulation de l emission impossible	X	
EC038	Mouvement deja annule	X	
EC039	Mouvement inexistant annulation du rachat impossible	X	
EC050	Le déclarant n'est pas habilité à demander la situation de cet émetteur.		X
EC040	Rachat impossible montant superieur a l encours	X	
EC041 *	Encours different a ajuster	X	
EC042	Declaration d encours incomplete	X	
EC052	Titre n'appartenant pas a l emetteur	X	
EC053	L' encours porte depasse le pourcentage autorise	X	
EC054	Mouvement introuvable, revente du portage impossible	X	
EC055	Portage impossible montant superieur a l'encours du titre	X	
EC056	Revente impossible montant incompatible avec le portage	X	
EC057	Mouvement inexistant annulation du mouvement impossible	X	
EC058 *	Encours porte différent à ajuster	X	
EC061	Le compartiment de la Societe de Titrisation n'est pas renseigne.	X	X
EC062	Le compartiment est inconnu pour cette Societe de Titrisation	X	X
EC063	Il n'existe pas de compartiment pour cet émetteur	X	X
EC100	Attention, les codes Types de TCN ont change. Merci de mettre a jour votre systeme	X	

Codes Anomalie ET002 pour les DTM

Balise	Erreur	Message erreur
CIB_Declarant	Valeur différente de celle attendue	CibDeclarant Longueur invalide : « x » caracteres au lieu de 5 attendus dans : y (où « x » valeur du nombre de caractères saisis dans le fichier et « y » la valeur saisie du Cib-Declarant)
Date_Declaration	Balise non renseignée	DateDeclaration Champ obligatoire non renseigné

Date_Declaration	Valeur différente de celle attendue	DateDeclaration Longueur invalide: « x » caracteres au lieu de 8 attendus dans : y
Type_Fichier	Valeur différente de celle attendue	TypeDeclaration Type fichier différent de DECLARATION TCN
Vos_References	Trop de caractères	VosReferences Nbr caractères invalide : plus de 50 dans le champ : xxxxxxxx (où xxxxxxxx correspond à la saisie faite sur cette balise)
CIB_Emetteur SREN_Emetteur	Balise non renseignée	CibEmetteur Champ obligatoire non renseigné SirenEmetteur Champ obligatoire non renseigné
CIB_Emetteur SREN_Emetteur	Valeur différente de celle attendue	CibEmetteur Longueur invalide : « x » caracteres au lieu de 5 attendus dans : y SirenEmetteur Longueur invalide : « x » caracteres au lieu de 9 attendus dans : y
Code Compartiment	Valeur différente de celle attendue	CodeCompartiment Nbr caracteres invalide: plus de 2 dans le champ : (y)
Type_Mouvement	Balise non renseignée	TypeMouvement Champ obligatoire non renseigné
Type_Mouvement	Valeur différente de celle attendue	TypeMouvement « x » ne fait pas partie de la liste
Type_TCN	Balise non renseignée	TypeTCN Champ obligatoire non renseigné
Type_TCN	Valeur différente de celle attendue	TypeTCN xxxx ne fait pas partie de la liste des types de TCN acceptés
Code_ISIN	Balise non renseignée	CodeISIN Champ obligatoire non renseigné
Code_ISIN	Valeur différente de celle attendue	CodeISIN Longueur invalide : x caracteres au lieu de 12 attendus dans : FRxxxxxxxxxx
Libelle_Titre	Balise non renseignée	LibelleTitre Champ obligatoire non renseigné
Code_Devises	Balise non renseignée	CodeDevises Champ obligatoire non renseigné
Code_Devises	Valeur différente de celle attendue	CodeDevises Longueur invalide : « x » caracteres au lieu de 3 attendus dans : c
Code_Taux	Balise non renseignée	CodeTaux Champ obligatoire non renseigné
Code_Taux	Valeur différente de celle attendue	CodeTaux Nbr caracteres invalide : plus de 3 dans le champ : « z »
Date_Emission	Balise non renseignée	DateEmission Champ obligatoire non renseigné
Date_Emission	Valeur différente de celle attendue	DateEmission Longueur invalide : « x » caracteres au lieu de 8 attendus dans : « z »
Date_Echéance	Balise non renseignée	DateEcheance Champ obligatoire non renseigné
Date_Echéance	Valeur différente de celle attendue	DateEcheance Longueur invalide : « x » caracteres au lieu de 8 attendus dans : « z »
Type_Mouvement	Balise non renseignée	TypeMouvement Champ obligatoire non renseigné
Type_Mouvement	Valeur différente de celle attendue	TypeMouvement W ne fait pas partie de la liste
Type_Operation	Balise non renseignée	TypeOperation Champ obligatoire non renseigné
Type_Operation	Valeur différente de celle attendue	TypeOperation X ne fait pas partie de la liste
Referenc_Mouvement	Valeur différente de celle attendue	
Code_ISIN	Balise non renseignée	CodeISIN Champ obligatoire non renseigné
Code_ISIN	Valeur différente de celle attendue	Codelsin Longueur invalide : « n » caracteres au lieu de 12 attendus dans : FRxxxxxxxxxx
« Taux » et « Marge »	Balise non renseignée	TauxMarge Champ obligatoire non renseigné
« Taux » et « Marge »	Valeur différente de celle attendue	La rémunération dépasse les bornes autorisées
Montant	Balise non renseignée	MontantMouvement Champ obligatoire non renseigné
Montant	Valeur différente de celle attendue	MontantMouvement Champ numérique invalide : AAAA
Code_Souscripteur	Balise non renseignée	CodeSouscripteur Champ obligatoire non renseigné
Code_Souscripteur	Valeur différente de celle attendue	CodeSouscripteur 1 ne fait pas partie de la liste [A, B, C, D, E, F, H, M, X, Z]
Date_Negociation	Valeur différente de celle attendue	DateNegociation Longueur invalide : x caracteres au lieu de 8 attendus dans : yyyyyy
Date_Valeur	Balise non renseignée	DateValeur Champ obligatoire non renseigné
CIB_Placeur	Valeur différente de celle attendue	Placeur Longueur invalide : x caracteres au lieu de 5 attendus dans : yyyyy

Type_TCN	Balise non renseignée	TypeTCN Champ obligatoire non renseigne
Type_TCN	Valeur différente de celle attendue	TypeTCN xxx ne fait pas partie de la liste des types de TCN acceptes
Code_Devis	Balise non renseignée	CodeDevis Champ obligatoire non renseigne
Code_Devis	Valeur différente de celle attendue	CodeDevis eur ne fait pas partie de la liste des devises acceptees
Montant_Encours	Balise non renseignée	MontantEncours Champ obligatoire non renseigne
Montant_Encours	Valeur différente de celle attendue	MontantEncours Champ numerique invalide