

---

# 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<sup>(\*)</sup>**  
**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)

<sup>(\*)</sup> Les modifications apportées par rapport à la version 4.1 sont surlignées en jaune dans le document.

## Table des matières

|   |           |
|---|-----------|
| <b>1. CORRESPONDANTS À LA BANQUE DE FRANCE .....</b>  | <b>3</b>  |
| <b>2. CADRE RÉGLEMENTAIRE.....</b>  | <b>3</b>  |
| <b>3. PÉRIODE TRANSITOIRE SUITE À L'ENTRÉE EN VIGUEUR DE LA RÉFORME DU MARCHÉ<br/>LE 1<sup>ER</sup> JUIN 2016 .....</b> | <b>3</b>  |
| <b>4. PRÉSENTATION GÉNÉRALE DES ÉCHANGES .....</b>  | <b>4</b>  |
| 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         |
| <b>5. RÈGLES DE PRÉSENTATION DES FICHIERS ÉCHANGÉS .....</b>  | <b>6</b>  |
| 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         |
| <b>6. ÉCHANGES : DOMICILIATAIRE VERS BANQUE DE FRANCE .....</b>   | <b>9</b>  |
| 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        |
| <b>7. ÉCHANGES : BANQUE DE FRANCE VERS DOMICILIATAIRE .....</b>   | <b>16</b> |
| 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        |
| <b>8. ANNEXES.....</b>  | <b>26</b> |
| 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](mailto: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<sup>er</sup> 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<sup>er</sup> 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 Financière<sup>1</sup> 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).

---

<sup>1</sup> 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](mailto: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

|                                |   |
|--------------------------------|---|
| <b>&lt;REGROUPEMENT&gt;</b>    | Balise de début de regroupement   |
| <b>&lt;/ REGROUPEMENT &gt;</b> | Balise de fin de regroupement   |
| <b>&lt;ELEMENT&gt;</b>         | Balise de début d'élément simple  |
| <b>&lt;/ELEMENT&gt;</b>        | Balise de fin d'élément simple  |
| <b>ELEMENT</b>                 | Élément simple encadré d'une balise de début et de fin d'élément simple |
| <b>REGROUPEMENT</b>            | Regroupement  |
| <b>(répétition de 1 à n)</b>   | Indication de la répétition d'un élément ou d'un regroupement           |
| <b>?</b>                       | Élément ou regroupement non obligatoire                                 |
| <b>Ou</b>                      | Un et un seul des n éléments/regroupements                              |
| <b>(A : x, y)</b>              | 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   |
|--|--|
| <b>&lt;REGROUPEMENT1&gt;</b><br>ELEMENT1<br>ELEMENT2 <b>ou</b> ELEMENT3<br><b>REGROUPEMENT2</b><br><b>&lt;/REGROUPEMENT1&gt;</b> | <b>REGROUPEMENT1</b> contient :<br><br>ELEMENT1 <b>et</b> ( <b>ELEMENT2 ou</b> ELEMENT3) <b>et</b> <b>REGROUPEMENT2</b><br><b>toujours encadrés par des balises de début et de fin</b> |

## 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 :<br>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 :<br>AN (alphanumérique) – N (numérique) – D (format date))                     |
| Longueur                        | Longueur de la donnée  |
| Format                          | Format de la donnée :<br>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<br>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 | <b>DTM</b> |
| Demande de situation d'un émetteur          | <b>SPE</b> |

### 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_Devis
      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_Negociation
      Date_Valeur
      CIB_Placeur ou SIREN_Placeur
    </MOUVEMENT_TITRE >
    <ENCOURS>
      Type_TCN
      Code_Devis
      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<br>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 :<br>- C si création<br>- A si annulation |
| Type_TCN       | ELE      |                                 | Catégorie de rattachement du TCN  | AN   | 4    | V                    | O                 | Doit figurer dans la liste fournie en annexe<br>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<br>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<br>Doit être ≤ à la date de valeur du premier mouvement     |
| Date_Echeance  | ELE      |                                 | Date de maturité du titre   | D    | 8    | F                    | O                 | Format : JJMMSSAA<br>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 :<br>- C si création<br>- A si annulation  |
| Type_Operation      | ELE      |                                 |   | AN   | 1    | F                    | O                 | Doit figurer dans la liste suivante :<br>- E si émission<br>- R si rachat<br>- P si portage<br>- 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<br>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<br>Doit figurer si la date de valeur est différente  |
| Date_Valeur         | ELE      |                                 | Date comptable du mouvement   | D    | 8    | F                    | O                 | Format : JJMMSSAA<br>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<br>Cf. infra    |  |
| SIREN_Placeur       | ELE      |                                 | Identifiant INSEE   | N    | 9    | F                    | N<br>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<br>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_Devis       | 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\_Compartiment (**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<br>1. Fichier rejeté<br>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_Devises    | 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 9999999999999999                                |
| Montant_Calcule | ELE      |                                 | Montant en unités de l'encours calculé lors du traitement de la déclaration | N    | 15    | F                    | O                 | Format 9999999999999999                                |

### 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<br>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 :<br>- C si création<br>- A si annulation              |
| Type_Operation      | ELE      |                                 |  | AN   | 1    | F                    | O                 | Doit figurer dans la liste suivante :<br>- E si émission<br>- R si rachat<br>- 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<br>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_Negotiation    | 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<br>BT                                       | Certificat de dépôt<br>Billet de trésorerie   |
|                               | CPS                             | Subordinated Commercial Paper             | Titre négociable à court terme subordonné                  | CDNS<br>BTS                                     | Certificat de dépôt subordonné<br>Billet de trésorerie subordonné                     |
|                               | CPGS                            | State Guaranteed Commercial Paper         | Titre négociable à court terme avec garantie d'Etat        | CDNG<br>BTG                                     | Certificat de dépôt avec garantie d'Etat<br>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  |
|                               | <b>CPU</b>                      | <b>Unrated Commercial Paper</b>           | <b>Titre négociable à court terme non noté</b>             | <b>Pas d'équivalence dans les anciens codes</b> |   |
| 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<br>+ 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<br>Base 360 j pour durée ≤1 an<br>Base 365 j pour durée >1 an | Fixe                  |
| 003  | Taux fixe précompté   | Fixe                  |
| 005 (uniquement titre Long Terme)  | Taux fixe actuariel annuel<br>(base 365 j)  | Fixe                  |
| 007<br>(=008 depuis le 1 <sup>er</sup> /01/99)<br>(uniquement titre Court Terme) | Taux révisable : Euribor 3 mois<br>(base 360j)                                      | Variable ou révisable |
| 008 (uniquement titre Court Terme)   | Taux révisable : Euribor 3 mois<br>(base 360j)                                      | Variable ou révisable |
| 011  | Taux révisable : Euribor 6 mois connu le 3 <sup>ème</sup> j ouvré<br>(base 360j)    | Variable ou révisable |
| 013  | Taux révisable : Euribor 6 mois connu le 2 <sup>ème</sup> j ouvré<br>(base 360j)    | Variable ou révisable |
| 014  | Taux révisable : Euribor 1 mois connu le 2 <sup>ème</sup> j ouvré<br>(base 360j)    | Variable ou révisable |
| 015  | Émission zéro coupon<br>Base nombre d'années pleines                                | Fixe                  |
| 016  | Émission zéro coupon<br>Base nombre de jours exacts                                 | Fixe                  |
| 017  | Taux révisable : Euribor 1 an connu le 2 <sup>ème</sup> j ouvré<br>(base 360j)      | Variable ou révisable |
| 018 (uniquement titre Long Terme)  | Taux révisable : Euribor 3 mois<br>Pour émission à 1 an et 1 jour.                  | Variable ou révisable |
| 021  | Taux fixe post compté<br>assimilé au code 005 dès la première échéance passée       | Fixe                  |
| 035  | Produit structuré   | Structuré             |
| 037  | Rémunération indexée sur l'Eonia<br>(base 360 j)                                    | Variable ou révisable |
| 039  | Rémunération indexée sur l'Eonia capitalisé<br>(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<br>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<br>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<br>ou marge fournie                                 | X                                |     |
| EC019         | Code taux non rattache a une famille de taux du<br>programme d emission                                  | X                                |     |
| EC020         | Titre echu depuis moins de 3 ans code ISIN deja<br>declare ou invalide                                   | X                                |     |
| EC021         | Titre non echu code ISIN deja declare  | X                                |     |
| EC022         | Il existe des mouvements associes Vous devez les<br>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<br>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<br>echeance ou duree mini incompatible avec le type<br>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.<br>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<br>SREN_Emetteur | Balise non renseignée               | CibEmetteur Champ obligatoire non renseigné<br>SirenEmetteur Champ obligatoire non renseigné   |
| CIB_Emetteur<br>SREN_Emetteur | Valeur différente de celle attendue | CibEmetteur Longueur invalide : « x » caracteres au lieu de 5 attendus dans : y<br>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 renseigné                              |
| Type_TCN        | Valeur différente de celle attendue | TypeTCN xxx ne fait pas partie de la liste des types de TCN acceptés |
| Code_Devis      | Balise non renseignée               | CodeDevis Champ obligatoire non renseigné                            |
| Code_Devis      | Valeur différente de celle attendue | CodeDevis eur ne fait pas partie de la liste des devises acceptées   |
| Montant_Encours | Balise non renseignée               | MontantEncours Champ obligatoire non renseigné                       |
| Montant_Encours | Valeur différente de celle attendue | MontantEncours Champ numérique invalide                              |