

MODALITÉS TECHNIQUES D'ÉLABORATION ET DE TRANSMISSION DE OTC

I. MODALITÉS TECHNIQUES D'ÉLABORATION DU FICHER DECLARATIF

Un dossier comprenant 12 fichiers déclaratifs au format Excel est mis à votre disposition. Ci-dessous figure la description de chacun des fichiers :

- Table1.xls : Contrats sur Devises et Or

Le fichier « Table1.xls » recense les montants en encours notionnels, en valeur brute de marché positive et négative des contrats de devises et or pour les :

- Swaps de devises
- Terme sec et swaps cambistes
- Options de Gré à Gré

Attention : Les encours en montant notionnel ainsi que la valeur brute positive et négative de marché de chaque contrat seront déclarés pour deux fois leur montant (les deux jambes des opérations en devises étant distinctement recensées, soit 200% des contrats).

En revanche, le total des contrats devises et or déclarés dans le fichier correspond à la somme des contrats sur devises pour une seule jambe à laquelle on ajoute les encours relatifs à l'or.

- Table2.xls : Contrats sur Taux d'intérêt

Le fichier « Table 2.xls » recense les montants en encours notionnels, en valeur de marché positive et négative des contrats sur taux d'intérêt pour les :

- Accords de taux futurs
- Swaps de taux
- Options de Gré à Gré

- Table3.xls : Contrats sur actions et matières premières

Le fichier « Table3.xls » recense les montants en encours notionnels, en valeur de marché positive et négative des contrats sur actions et matières premières pour les :

- Terme et swaps
- Options de Gré à Gré

- Table4.xls : Contrats en encours notionnels ventilés par échéance résiduelle

Le fichier « Table4.xls » recense les montants en encours notionnels ventilés par durée restant à courir pour les contrats sur devises et or, les contrats sur taux d'intérêt et les contrats sur actions.

- Table5.xls : Contrats en valeur de marché

Le fichier « Table5.xls » recense les montants en valeur de marché positive et négative des contrats sur devises et or, des contrats sur taux d'intérêt et des contrats sur actions et matières premières.

Les fichiers CD1, CD2, CD3 et CD4 intègrent une contrepartie supplémentaire : les chambres de compensation. Un nouveau fichier CD5 recense les données relatives aux indices des CDS.

- CDS1.xls : « CDS - Credit Default Swaps » par indice de notation

Le fichier « CDS1.xls » détaille les montants en encours notionnels relatifs aux « CDS - Credit Default Swaps » ventilés par nature d'instrument (Single-Name, Multi-Name), par secteur de contrepartie et par indice de notation.

- CDS2.xls : « CDS - Credit Default Swaps » ventilés par durée restant à courir

Le fichier « CDS2.xls » détaille les montants en encours notionnels relatifs aux « CDS - Credit Default Swaps » ventilés par nature d'instrument (Single-Name, Multi-Name), par secteur de contrepartie et par durée restant à courir.

- CDS3.xls : « CDS - Credit Default Swaps » par secteur économique

Le fichier « CDS3.xls » détaille les montants en encours notionnels relatifs aux « CDS - Credit Default Swaps » ventilés par nature d'instrument (Single-Name, Multi-Name), par secteur de contrepartie et par secteur économique. La ventilation par secteur économique a été élargie.

- CDS4.xls : « CDS - Credit Default Swaps » en valeur brute de marché et en valeur nette de marché

Le fichier « CDS4.xls » détaille les montants en valeur de marché brute positive et négative et en valeur nette de marché positive et négative relatifs aux « CDS - Credit Default Swaps » ventilés par nature d'instrument (Single-Name, Multi-Name) et par contrepartie.

- CDS5.xls : Indice de « CDS - Credit Default Swaps »

Le fichier « CDS5.xls » détaille les montants en encours notionnels pour les indices « CDS - Credit Default Swaps » ventilés par nature d'instrument (Multi-Name) et par contrepartie.

- CDS6.xls : « CDS - Credit Default Swaps » par localisation géographique de la contrepartie

Le fichier « CDS6.xls » détaille les montants en encours notionnels relatifs aux « CDS - Credit Default Swaps » ventilés par secteur de contrepartie et par localisation géographique conformément à la liste figurant à l'annexe 2 du document « *Guidelines for semi-annual credit default swaps statistics* ».

- Annexe.xls : Les dérivés de crédits et les autres dérivés

Le fichier « Annexe.xls » recense les montants en encours notionnels et en valeurs brute de marché des contrats de dérivés de crédit et autres dérivés.

Tous les montants recensés doivent être arrondies au million de dollars US le plus proche (ne pas mettre de décimale).

Par ailleurs, des contrôles inter et intra documents demandés par la BRI devront être réalisés avant toute transmission à la Banque de France. Les contrôles sont les suivants :

Table1.xls	Le total des opérations déclarées pour les contrats en devises et or en encours notionnels ou en valeur brute positive et négative doit être supérieur ou égal (s'il n'y a pas d'or) à la somme de tous les contrats en devises détaillés divisée par deux (soit une jambe des contrats)
Table4.xls	La somme des contrats sur devises et or par échéance du fichier « Table4 .xls » doit être égale au total des contrats sur devises et or en encours notionnels déclaré dans le fichier « Table1.xls »
	La somme des contrats sur devises du fichier « Table4 .xls » doit être égale à la somme des opérations des contrats sur devises en encours notionnels dans le fichier « Table1.xls » divisée par deux (soit une jambe des contrats).
	La somme des contrats sur taux du fichier « Table4 .xls » doit être égale à la somme des opérations des contrats sur taux en encours notionnels dans le fichier « Table2.xls ».
	La somme des contrats sur actions du fichier « Table4 .xls » doit être égale à la somme des opérations des contrats sur actions en encours notionnels dans le fichier « Table3.xls ».
Table5.xls	La somme des valeurs de marché négative déclarées dans les fichiers « Table 1.xls » pour les contrats devises et or, « Table 2.xls » pour les contrats sur taux et « Table 3.xls » pour les contrats sur actions et matières premières doit être égale à la valeur de marché négative déclarée dans le fichier « Table5.xls ».
	La somme des valeurs de marché positive déclarées dans les fichiers « Table 1.xls » pour les contrats devises et or, « Table 2.xls » pour les contrats sur taux et « Table 3.xls » pour les contrats sur actions et matières premières doit être égale à la valeur de marché positive déclarée dans le fichier « Table5.xls ».
	La somme des valeurs de marché négative avec les établissements participants aux recensements déclarées dans les fichiers Table 1.xls pour les contrats devises et or, Table 2.xls pour les contrats sur taux et Table 3.xls pour les contrats sur actions et matières premières doit être égale à la valeur de marché négative avec les établissements participants aux recensements déclarée dans le fichier Table5.xls.
	La somme des valeurs de marché positive avec les établissements participants aux recensements déclarées dans les fichiers Table 1.xls pour les contrats devises et or, Table 2.xls pour les contrats sur taux et Table 3.xls pour les contrats sur actions et matières premières doit être égale à la valeur de marché positive avec les établissements participants aux recensements déclarée dans le fichier Table5.xls.
	Les encours déclarés en valeur brute positive de marché avec les participants aux recensements de la Table5.xls ne peuvent être supérieurs au total de la valeur brute positive de marché de la Table5.xls
	Les encours déclarés en valeur brute négative de marché avec les participants aux recensements de la Table5.xls ne peuvent être supérieurs au total de la valeur brute négative de marché de la Table5.xls
	Les encours déclarés en valeur nette positive de marché avec les participants aux recensements de la Table5.xls ne peuvent être supérieurs au total de la valeur nette positive de marché de la Table5.xls
	Les encours déclarés en valeur nette négative de marché avec les participants aux recensements de la Table5.xls ne peuvent être supérieurs au total de la valeur nette négative de marché de la Table5.xls.
CDS1.xls /CDS2.xls /CDS3.xls /CDS6.xls	La somme des contrats CDS vendus du fichier CDS1.xls doit être égale à celle du CDS2.xls, à celle du CDS3.xls et à celle du CDS6.xls.
	La somme des contrats CDS achetés du fichier CDS1.xls doit être égale à celle du CDS2.xls, à celle du CDS3.xls et à celle du CDS6.xls.
CDS5.xls	La somme des contrats d'indice Multi-Name achetés de la table CDS5 doit être inférieure ou égale au total des contrats Multi-Name achetés du fichier CDS1, du fichier CDS2, du fichier CDS3 et du fichier CDS6.
	La somme des contrats d'indice Multi-Name vendus de la table CDS5 doit être inférieure ou égale au total des contrats Multi-Name vendus du fichier CDS1, du fichier CDS2, du fichier CDS3 et du fichier CDS6.
Annexe.xls	La somme des contrats déclarés dans l' « Annexe.xls » doit être supérieure ou égale à la somme des contrats déclarés dans les fichiers CDS1.xls et CDS4.xls

II. MODALITÉS TECHNIQUES DE TRANSMISSION

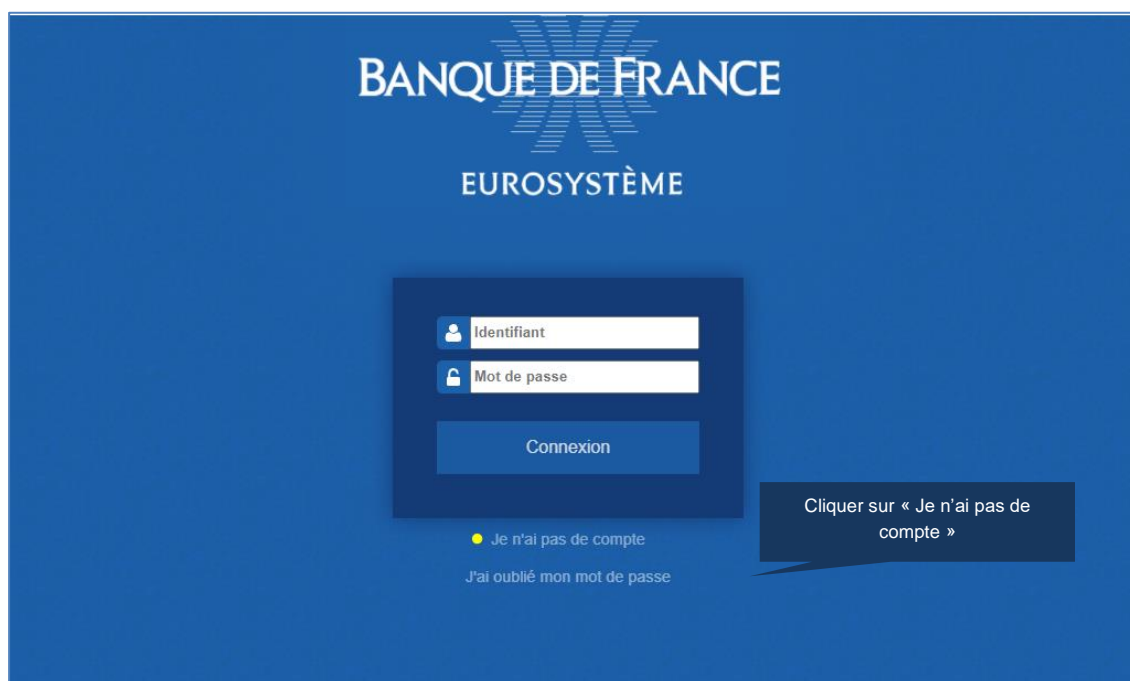
La transmission des 12 fichiers complétés se fait sur l'application OneGate selon les modalités présentées ci-dessous.

En complément, un guide utilisateur de l'application OneGate est disponible sur le site de la Banque de France : [onagate_guideutilisateur_remettant_v2.6.pdf \(banque-france.fr\)](#)

Première étape : Création d'un compte OneGate / Demande d'accès à la collecte SIF

- 1) Se rendre sur le portail OneGate : [OneGate - Banque de France \(banque-france.fr\)](#)

- 2) Créer un compte (p.6 du guide utilisateur) / se connecter :



- 2bis) Si le compte est déjà créé, demander l'accréditation à la collecte à partir du Profil utilisateur :

Collecte		Déclarants		Supprimer la demande
SIF	<input type="text" value="LEI"/> <input type="text" value="Code déclarant"/>	<input type="button" value="Ajouter"/>	<input type="button" value="Supprimer"/>	<input type="button" value="Valider"/>

3) Demande d'accès à la collecte SIF

Demande d'accès

Adresse e-mail

Civilité Prénom Nom de famille

Avez-vous reçu un code d'accréditation ? Oui Non

Collecte

Ajouter la Collecte SIF et indiquez au moins un déclarant

 captcha

Valider

Votre adresse email fera office d'identifiant pour toutes vos connexions à l'application.

Le code d'accréditation est indiqué dans le courrier postal que vous avez reçu. Si vous n'avez pas reçu de courrier postal, choisissez 'Non'.

Prouvez que vous n'êtes pas un robot en recopiant le texte présent sur l'image. Si le texte est trop difficile à lire, il est possible de régénérer une image.

Deuxième étape : Dépôt du fichier sur OneGate

1) Ouvrir l'onglet « Rapports » et choisir le domaine SIF (p.19 du guide utilisateur)

ONEGATE Suivi Rapports Panneau de contrôle Gestion documentaire Administration

Choix du rapport

Code du domaine	Code du rapport	Libellé du rapport
PFD	PFD	Données sur les produits financiers dérivés
EIS	ECEIS	Enquête complémentaire sur les échanges internationaux de Services
EFI	TEMPS_REP	Temps nécessaire pour répondre à l'enquête
SIF	CHBD	Rapport CHBD
SIF	OTC	Rapport OTC
SIF	TRIENNAL	Rapport Triennal

« < 1 2 > » Page 2 sur 2 Afficher résultats

2) Sélectionner et ouvrir le rapport « OTC »

Choix du rapport

Code du domaine	Code du rapport	Libellé du rapport
SIF	CHBD	Rapport CHBD
SIF	OTC	Rapport OTC
SIF	TRIENNAL	Rapport Triennal

Afficher résultats

3) Remise du fichier

Dans Onegate, vous avez la possibilité de charger les 12 fichiers en format .csv ou un fichier .zip contenant l'ensemble des fichiers attendus.

Les fichiers doivent être intitulés comme suit :

Pour un CIB XXXXX, le nom du fichier Table1.xls deviendra : XXXXX_Table1.csv

Rapport : OTC (Période : 2021-06)

Rapport OTC	OTC	Date avant	Dernière mise à jour	État	Cycle de vie	Néant	Référence
Rapport OTC	OTC	2021-06-30	2021-11-16	Ok	Fermé		

1 lignes | Lignes/Page 15

Rapport : OTC (Période : 2021-06) - OTC

Table des matières

- 1/ Commentaires sur la remise
- 2/ Chargement de fichiers (#Items : 12)

2^{ème} étape : Enregistrer, une fois que tous les fichiers sont saisis

Rapport : OTC (Période : 2021-06) - OTC - 2/ Chargement de fichiers

Les extensions autorisées sont le xls,xlsx, csv, zip

Section 2

libellé	pièce jointe
FICHER A CHARGER	Joindre un document

1 sur 1 lignes avec 5 colonnes | 1 lignes | Lignes/Page 10

2^{ème} étape : Enregistrer

Rapport : OTC (Période : 2021-06) - OTC - 2/ Chargement de fichiers

Les extensions autorisées sont le xls, xlsx, csv, .zip

Section Section 2

Sélectionner ++ pour ajouter des lignes de déclaration

libellé				pièce jointe
FICHIER A CHARGER	♦	♦♦	📎	XXXXX_Table1.csv (37Ko)
			📎	XXXXX_Table2.csv (37Ko)
			📎	Joindre un document
			📎	Joindre un document
			📎	Joindre un document
			📎	Joindre un document

6 sur 6 lignes avec 5 colonnes 6 lignes Lignes/Page 10

3^{ème} étape : Revenir sur l'onglet précédent

Rapport : OTC (Période : 2021-06) - OTC - 2/ Chargement de fichiers

Les extensions autorisées sont le xls, xlsx, csv, .zip

Section Section 2

Possibilité de charger un fichier ZIP

libellé				pièce jointe
FICHIER A CHARGER	♦	♦♦	📎	XXXXX_OTC.zip (15Ko)

1 sur 1 lignes avec 5 colonnes 1 lignes Lignes/Page 10

5^{ème} étape : cliquer sur le cadenas afin de fermer et d'envoyer le formulaire

Rapport : OTC (Période : 2021-06)

🔒 ⬆️ 📄 🗑️ 📧

<input type="checkbox"/>	Formulaire	Code	Nécessaire avant	Dernière mise à jour	État	Cycle de vie	Néant	Référence
<input type="checkbox"/>	Rapport_OTC	OTC	2021-06-30	2021-12-16	Ok	Ouvert		

1 sur 1 lignes Lignes/Page 15

4^{ème} étape : sélectionner le formulaire

Merci de nous informer de votre remise à l'adresse mail suivante : 1470-SFI-UT@banque-france.fr