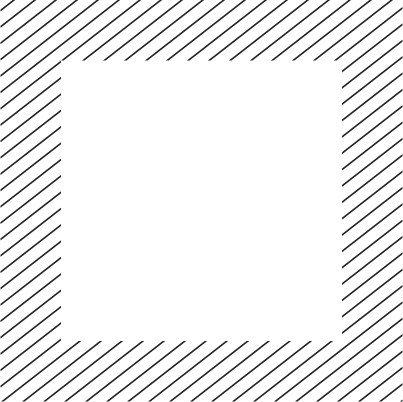
****

2020

Guide RDT 2

-

Guide À l’attention des dÉclarants

**Versions du document**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Version | Date | Auteur | Commentaire |
| 1.0 | 2017 | AMF | 1ère version |
| 1.3 | Septembre 2017 | AMF | 1ère version publique |
| 1.4 | Juin 2020 | AMF | Modifications et précisions notables   * Reformulation et suppression des parties liées au projet de mise en oeuvre de l’applicatif en 2018 * Ajout de la cinématique des Feedbacks – schéma donnant le contenu des feedbacks en fonction de leur version (détail et/ou statistiques globales) * Dans le fonctionnement du versionning des fichiers déclarés, précisions :   + Lorsqu’une séquence doit être abandonnée pour passer à la suivante   + Lorsque la séquence doit être conservée et la version mise à jour * Modification des algorithmes de compression autorisés * Ajout de précisions quant à l’obligation réglementaire de re-soumettre dans les meilleurs délais une déclaration qui aurait été rejetée * Mise en annexe de la partie liée aux tests 2017 (précédent chapitre 3) * Précision du mode de fonctionnement des séquences lors du changement d’année * Ajout du guide Adhoc Request en annexe * Ajout du mode opératoire pour les tests liés à des évolutions du système RDT2 * Suppression des parties liées au projet de mise en œuvre (tests avant l’ouverture de service 2018) * Ajout d’une FAQ * Ajout du guide Monthly Reports |
| 1.4.1 | Septembre 2020 | AMF | Précisions sur la construction des codes CONCAT |

**Documents de référence**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Ref | Titre |  |
| 1 | Directive MIF2 |  |
| 2 | Règlement délégué 2017-590 |  |
| 3 | Orientations ESMA |  |
| 4 | Instructions techniques |  |
| 5 | Guide Monthly Report |  |
| 6 | Listing des codes erreur produits par RDT |  |





**SOMMAIRE**

[1 Objectif du document 5](#_Toc42267457)

[2 CONTEXTE – RAPPEL REGLEMENTAIRE 6](#_Toc42267458)

[3 Modalités de transmission des déclarations de transactions 8](#_Toc42267459)

[3.1 Enregistrement en tant qu’assujetti 8](#_Toc42267460)

[3.2 Enregistrement en tant que déclarant 8](#_Toc42267461)

[3.3 Règles entourant les mots de passe 8](#_Toc42267462)

[3.4 Différences entre Homologation et Production 9](#_Toc42267463)

[3.5 Normes de nommage des fichiers et règles de gestion associées 10](#_Toc42267464)

[3.6 Gestion des feedbacks 13](#_Toc42267465)

[4 Gestion de la qualité RDT 17](#_Toc42267466)

[4.1 FAQ 17](#_Toc42267467)

[4.2 Monthly Reports 24](#_Toc42267468)

# Objectif du document

L’Autorité des marchés financiers (AMF) met à disposition des entreprises d’investissement, des ARM[[1]](#footnote-2) et des plateformes de négociation un système informatisé de Reporting Direct des Transactions (RDT2) via sa plateforme ICY, leur permettant d’effectuer des déclarations de transactions conformément à l’article 26 de MiFIR[[2]](#footnote-3) - cet article impose aux entreprises d’investissement qui réalisent des transactions sur des instruments financiers éligibles à faire une déclaration détaillée, complète et exacte de ces transactions à l’autorité compétente, et ce au plus tard au terme du jour ouvrable suivant.

**Harmonisation européenne maximale**

Les modalités de reporting ont été harmonisées au niveau européen par le biais d’un règlement délégué[[3]](#footnote-4) et d’Orientations ESMA[[4]](#footnote-5), complétés par des « reporting instructions » publiées par l’ESMA. Ces documents de portée européenne définissent les informations à fournir et leur format, les règles de garnissage de chacun des champs, le format des fichiers (XML), leur structure (schéma XSD)[[5]](#footnote-6) et les règles de validation associées. Pour partie, la cinématique des traitements est également imposée par le fonctionnement du système d’échange entre régulateurs (TREM).

Seules quelques spécificités techniques demeurent au plan national (modalités de connexion et gestion des mots de passe, fréquence des traitements, règles de nommage et de séquençage des fichiers, modalités de récupération des feedbacks, etc.).

**Une nouvelle plateforme AMF**

Le système RDT2 est un module de la plateforme de surveillance des marchés, ICY (prononcer « I see why »), qui a remplacé l’application SESAM en 2018. L’ambition de la plateforme ICY est notamment d’offrir :

* des performances nettement supérieures, en vue d’assurer une meilleure régularité des traitements et des délais rapides de mise à disposition des feedbacks, y compris en période de forte volatilité / volumes élevés sur les marchés ;
* un véritable environnement dédié aux tests (plateforme dite « d’homologation ») ;
* une capacité d’analyse des données accrue en vue de maintenir un niveau de qualité du reporting élevé malgré la masse d’informations supplémentaires apportée par la nouvelle règlementation.

**Plan du document**

Le document est composé de trois parties distinctes :

* Rappels règlementaires
* Précisions sur les modalités techniques et la cinématique des échanges de fichiers
* FAQ contenant les sujets d’interrogation les plus fréquents pour les entités déclarantes auprès de l’AMF.

# CONTEXTE – RAPPEL REGLEMENTAIRE

Le reporting des transactions MiFIR (entrant en application le 3 janvier 2018) concerne l’ensemble des entreprises d’investissement françaises, qui doivent déclarer à l’AMF toutes les transactions sur instruments financiers tel que mentionné à l’article 26 de MiFIR.

Les entités concernées par le reporting des transactions MiFIR sont :

* Les entreprises d’investissement qui exécutent une transaction sur :
  + un instrument financier admis à la négociation ou négocié sur une plateforme de négociation ;
  + un instrument financier dont le sous-jacent est un instrument financier négocié sur une plateforme de négociation ;
  + un instrument financier dont le sous-jacent est un indice ou un panier composé d’instruments financiers négociés sur une plateforme de négociation.
* Les entreprises d’investissement qui transmettent des ordres sur de tels instruments pour exécution, si et seulement si :
  + l’une des informations déclarables, en particulier l’identité du client final, n’est pas transmise au maillon suivant de la chaîne d’exécution (Réception-transmission d’ordres (RTO) + Gestion sous mandat).
* Les plateformes de négociation pour :
  + le compte de leurs membres qui ne sont pas des entreprises d’investissement au sens de MiFID.

Pour rappel, seuls **trois types d’entités** peuvent se connecter au système de reporting ICY de l’AMF. Par conséquent, à partir du 3 janvier 2018 l’AMF fournit uniquement une connexion à :

* l’entreprise d’investissement assujettie à l’obligation déclarative qui souhaite déclarer ses transactions directement au régulateur ;
* l’ARM qui déclare au régulateur (sous condition d’être agréé par son régulateur européen d’origine) les transactions réalisées par une entreprise d’investissement ;
* l’opérateur d’une plateforme de négociation qui doit déclarer au régulateur européen d’origine les transactions réalisées sur sa plateforme par ses membres « *non MiFID firm* ».

Des informations plus complètes, et les liens vers les documents clés (règlement délégué 2017/590 du 28 juillet 2016, Guidelines et Q&A ESMA), sont disponibles sur le site Internet AMF, dans la rubrique « Le reporting des transactions MIF2 » de la page intitulée « Mes relations avec l’AMF - Effectuer mes reporting et déclarations » (cf. lien ci-dessous) :

<https://www.amf-france.org/fr/espace-professionnels/prestataires-de-services-dinvestissement-psi/mes-relations-avec-lamf/effectuer-mes-reporting-et-declarations#Le_reporting_des_transactions_MIF2>

Il convient enfin de rappeler qu’en application de l’article 26.7 de MiFIR, les entreprises d’investissement sont responsables de l’exhaustivité, de l’exactitude et des délais de présentation des déclarations faites à l’autorité compétente.

Il appartient aux entreprises d’investissement de prendre des mesures raisonnables pour vérifier l’exhaustivité, l’exactitude et les délais de présentation des déclarations de transaction faites en leur nom.

L’AMF s’attend à ce que les établissements, sous leur seule responsabilité et à leur initiative, réalisent des tests avant mise en production en cas de changements significatifs dans leurs activités (nouvelle classe d’actifs, connexion à une nouvelle plateforme de négociation) ou leurs systèmes d’informations (migration technique, changement de progiciel, etc.).

Enfin, la réglementation impose également une obligation d’alerter « promptement » le régulateur en cas d’anomalie concernant les obligations déclaratives (cf. article 15. 2 du RD 2017/590) : « *Lorsque […] l’entreprise d’investissement a connaissance d’une erreur ou omission quelconque dans une déclaration de transaction soumise à une autorité compétente, d’un manquement quelconque à son obligation de soumettre une déclaration de transaction, y compris à l’obligation de soumettre à nouveau une déclaration rejetée concernant une transaction à déclarer, ou du fait qu’une transaction non concernée par l’obligation de déclaration a été déclarée, elle en avise promptement l’autorité compétente concernée* ». En cohérence avec cette disposition règlementaire, l’AMF attend des établissements qu’ils l’alertent systématiquement en cas de problème identifié sur leur reporting des transactions.

# Modalités de transmission des déclarations de transactions

## Enregistrement en tant qu’assujetti

Il est demandé à chaque entreprise d’investissement de renvoyer le questionnaire fonctionnel permettant de connaitre la nature des obligations déclaratives de l’entité ainsi que d’identifier les contacts de conformité et fonctionnels responsables. Ce questionnaire est à retourner à l’AMF que l’entité soit assujettie ou non au reporting des transactions.

## Enregistrement en tant que déclarant

Pour s’enregistrer en tant que déclarant, les établissements (reporting direct) ou les ARM doivent adresser une demande à la boîte de réception [rdt@amf-france.org](mailto:rdt@amf-france.org). Un questionnaire technique leur est envoyé permettant notamment d’identifier des contacts techniques au sein de l’entité déclarante et de récupérer les adresses IP permettant la création d’un login de connexion. **Lors de l’ajout ou de la suppression d’une adresse IP déjà enregistrée, il sera systématiquement demandé de revalider l’ensemble des adresses utilisées et cela à des fins de sécurité**. Une fois le questionnaire validé par les services de l’AMF, le déclarant reçoit de manière sécurisée par email les détails de connexion aux plateformes de déclarations AMF.

Chaque entité autorisée[[6]](#footnote-7) se voit attribuer deux logins distincts, un login de production et un login d’homologation :

* Login de production

Ce login a pour objectif de permettre à l’entité déclarante de transmettre les déclarations de transactions au système de reporting ICY.

Il s’agit du canal de production, par conséquent toutes les transactions déclarées via ce login sont considérées comme étant des transactions réellement réalisées par l’assujetti à l’obligation déclarative.

A chaque login de production est alloué un mot de passe unique.

* Login d’homologation

Ce login a pour objectif de permettre à l’entité déclarante de transmettre ses déclarations de transactions (de tests) au système de reporting ICY. Il est à utiliser pour réaliser par exemple des tests de connectivité ou la déclaration d’une nouvelle activité de marché afin de tester la qualité de la donnée envoyée.

Il s’agit du canal d’homologation, par conséquent toutes les transactions déclarées via ce login sont considérées comme étant des transactions de tests et ne relevant pas d’une activité réelle de l’assujetti à l’obligation déclarative.

A chaque login d’homologation est alloué un mot de passe unique.

## Règles entourant les mots de passe

Plusieurs cas peuvent amener les services de l’AMF à générer un mot de passe à une entité déclarante :

1. Création de la connexion avec une entité déclarante :

Afin d’assurer la connectivité d’une entité déclarante au système de reporting ICY, les services de l’AMF génèrent deux mots de passe donnant accès d’une part à la plateforme de production et d’autre part à la plateforme d’homologation.

1. Perte ou corruption du mot de passe par l’entité déclarante :

Une fois créés et transmis à l’entité déclarante, les mots de passe deviennent la propriété de l’entité déclarante.

Par conséquent, les services de l’AMF ne conservent pas les mots de passe, ces derniers ne peuvent pas être retransmis. Ainsi, en cas de perte ou de corruption du ou des mot(s) de passe, les services de l’AMF généreront systématiquement un nouveau mot de passe.

1. Expiration du mot de passe :

Une communication annoncera la campagne de renouvellement des mots de passe et précisera le jour exact à partir duquel les nouveaux mots de passe devront être utilisés (les anciens deviendront inopérants).

## Différences entre Homologation et Production

Le système de reporting ICY est composé de deux plateformes distinctes permettant aux déclarants directs de transmettre les déclarations de transactions.

Ces deux plateformes sont constituées comme suit :

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | **Canal de production** | **Canal d’homologation** |
| **Utilisation des référentiels connexes FIRDS** | Utilisation des référentiels ESMA. | |
| **Historique des données déclarées** | Déclarées à partir du 03/01/2018.  Les transactions déclarées ne devront pas être antérieures au 03/01/2018. | |
| **Type de données déclarées** | Données réelles. | Transactions théoriques et/ou réelles de marché. |
| **Seuils / Volumes** | Pas de limite sur le nombre de fichiers transmis quotidiennement par les entités déclarantes. **Maximum de 500.000 déclarations par fichier (règle européenne).** | Maximum de 4 fichiers par jour par les entités déclarantes. Maximum de 10.000 déclarations par fichier. |
| **Règle de nommage des fichiers** | Fichiers de déclarations :  Login\_DATTRA\_FR\_SequenceNumber-Version-PreviousFileSequenceNumber\_Year  Fichiers de feedbacks :  FR\_FDBTRA\_Login\_SequenceNumber-Version\_Year | Fichiers de déclarations :  Login\_DATTRATEST\_FR\_SequenceNumber-Version-PreviousFileSequenceNumber\_Year  Fichiers de feedbacks :  FR\_FDBTRATEST\_Login\_SequenceNumber-Version\_Year |
| **Plage de disponibilité plateforme d’échange** | 7/7 24/24. | |
| **Support fonctionnel** | **Support fonctionnel :**  Courriel : [rdt@amf-france.org](mailto:rdt@amf-france.org) | |
| **Plage de support technique de la plateforme** | **8h30 / 18h30 les jours ouvrés.**  **Support technique :**  Courriel : [ExploitationAMF@amf-france.org](mailto:ExploitationAMF@amf-france.org)  Téléphone : 01 53 45 60 50 | |
| **Cas d'usage** | Production - répond à la règlementation MIF2. | Permettre aux entités déclarantes de tester les évolutions de leurs systèmes d’informations.  Permettre aux entités déclarantes de valider la qualité des données déclarées par rapport aux référentiels utilisés par l'AMF. |
| **Login** | Login / mdp de production | Login / mdp d’homologation |

## Normes de nommage des fichiers et règles de gestion associées

L’AMF a fait le choix, dans une optique d’harmonisation européenne, d’appliquer au niveau national pour le RDT MIF 2 des règles de nommage et de séquençage / versionning des fichiers utilisés par l’ESMA pour le système d’échange des transactions entre régulateurs (TREM).

Les fichiers de déclarations de transactions déposés via le canal de production par les entités déclarantes doivent respecter **la norme de nommage** suivante :

* ***Login\_*DATTRA\_FR*\_SequenceNumber-Version-PreviousFileSequenceNumber\_Year***

Avec les définitions suivantes:

* + *Login (sur 5 caractères en majuscule)* : le login RDT2 de l’entité déclarante
  + *Sequence number* *(sur 6 caractères)*: le numéro de séquence identifiant le fichier (doit être incrémental (c’est-à-dire croissant) mais pas nécessairement consécutif, avec remise à zéro le 1er janvier de chaque année)
  + *Version* *(sur 1 caractère)* : le numéro de version du fichier qui permet à un établissement qui transmettrait un fichier erroné de lui substituer un fichier correct. Commence à 0. A incrémenter de 1 par version.
  + *Previous File Sequence number* *(sur 6 caractères)* : le numéro de séquence identifiant le fichier qui doit avoir été précédemment intégré. Son objectif est d’assurer que tous les fichiers de déclarations sont bien transmis et de détecter un éventuel gap dans une série de fichiers (voir exemple de séquençage ci-dessous)
  + *Year (sur 2 caractères)*: l’année de génération du fichier sur 2 caractères (ex : 17 pour 2017, 18 pour 2018…)

Pour le canal d’homologation, la norme de nommage reste la même hormis pour le type de fichier qui devra être renseigné à « DATTRATEST » au lieu de « DATTRA ».

Le fichier transmis doit être zippé **.zip** (algorithme de compression : ZIP et GZIP) et **ne doit comprendre qu’un unique fichier portant le même nom à l’exception de l’extension « .xml »** :

Le fichier zippé **transmis** :

*Login\_*DATTRA\_FR*\_SequenceNumber-Version-PreviousFileSequenceNumber\_Year****.zip***

**Contient** uniquement le fichier :

*Login\_*DATTRA\_FR*\_SequenceNumber-Version-PreviousFileSequenceNumber\_Year****.xml***

Pour chaque fichier reçu un ou plusieurs *feedbacks* sont émis par l’AMF à destination des entités déclarantes (cf. 4.5).

Les fichiers de *feedbacks* envoyés aux entités déclarantes respectent la norme suivante :

* **FR*\_*FDBTRA\_*Login\_SequenceNumber-Version[[7]](#footnote-8)\_Year***

Plus exactement, le fichier zippé mis à disposition du déclarant :

**FR*\_*FDBTRA\_*Login\_SequenceNumber-Version\_Year.zip***

contient uniquement le fichier:

**FR*\_*FDBTRA\_*Login\_SequenceNumber-Version\_Year.xml***

Les définitions des éléments composant ce nom sont identiques à celles régissant la norme pour les DATTRA.

Remarque : il n’y a pas de lien entre le numéro de séquence du fichier de déclaration DATTRA et le numéro de séquence du feedback FDBTRA correspondant.

Le lien entre le feedback et le fichier de déclaration d’origine se fait via la balise XML, présente dans le feedback : « <FinInstrmRptgStsAdvc><StsAdvc><MsgRptIdr> où le nom du fichier DATTRA d’origine est renseigné (voir le xsd dans le paragraphe 5.2.1 *Status Advice*).

***Exemples de séquençage et de versionning :***

1. ***Séquençages :***

Tous les fichiers de déclarations ont un numéro de séquence unique (contenu dans le nom du fichier – cf. chapitre 4.4). Cette séquence doit être unique sur l’année pour un déclarant donné et croissante.

* En J : un 1er fichier nommé LOGIN\_DATTRA\_FR\_**000001**-0-**000000**\_20.zip est envoyé au système de reporting ICY. Celui-ci est intégré au système de reporting ICY sans rejet global du fichier.
  + *Sequence Number* = 1, il s’agit du premier fichier envoyé
  + *Version* = 0 car il n’y a pas eu de version précédente
  + *Previous Sequence Number* = 0 car il n’y pas eu de fichier envoyé précédemment.
* En J+1 : un 2ème fichier nommé LOGIN\_DATTRA\_FR\_**000003**-0-**000001**\_20.zip est envoyé à l’AMF.

Ce 2nd fichier peut faire l’objet d’un traitement par le système de reporting ICY car il fait bien référence au 1er fichier intégré par le système de reporting ICY.

* + *Sequence Number* = 3, le *Sequence Number* est correct car supérieur au précédent (3>1)
  + *Version* = 0 car il n’y a pas eu de version précédente
  + *Previous Sequence Number* = 1 est correct, il fait bien référence au dernier *Sequence Number* reçu et intégré à savoir « 1 » en J.
* En J+2 : un 3ème fichier nommé LOGIN\_DATTRA\_FR\_000005-0-000004\_20.zip est envoyé au système de reporting ICY.

Il manque alors au moins un fichier car la séquence d’intégration n’est pas respectée. Le fichier n’est pas intégré et l’intégration des fichiers est stoppée, pour l’entité autorisée concernée, tant que ce manque est identifié. L’entité autorisée en est immédiatement informée dans le fichier de feedback (code FIL-109). En outre, le processus d’émission d’un rappel (« reminder ») (FIL-109) est enclenché et sera transmis au déclarant à 18h00 si le ou les fichiers manquants ne sont toujours pas transmis.

* + *Sequence Number = 5, le Sequence Number est correct car supérieur au précédent (5>3)*
  + *Version* = 0 car il n’y a pas eu de version précédente
  + *Previous Sequence Number* = 4 est **incorrect** car il ne fait pas référence au dernier *Sequence Number* reçu à savoir «3 » en J+1.
* En J+3 : un 4ème fichier  LOGIN\_DATTRA\_FR\_**000004**-0-**000003**\_20.zip est envoyé au système de reporting ICY. Il permet de débloquer la chaine d’intégration et les **deux fichiers**[[8]](#footnote-9) peuvent être traités.
  + *Sequence Number* = 4, le *Sequence Number* est correct car supérieur au précédent (4>3)
  + *Version* = 0 car il n’y a pas eu de version précédente
  + *Previous Sequence Number* = 3 est correct car il fait bien référence au dernier *Sequence Number* reçu à savoir «3 » en J+1.
* En J+4 : un 5ème fichier  LOGIN\_DATTRA\_FR\_**000006**-0-**000003**\_20.zip est envoyé au système de reporting ICY.

La séquence du fichier (6) est bien supérieure à la dernière séquence reçue (5) mais la *previous séquence number* indiquée (3) est inférieure à la séquence précédemment reçue (5). Donc impossible qu’un fichier intermédiaire puisse venir compléter ce chainage. Le fichier doit alors être rejeté. Le code erreur utilisé sera le même que celui utilisé pour une erreur de nommage (non-respect de la norme : *INCF*).

* + *Sequence Number* = 6, le *Sequence Number* est correct car supérieur au précédent (6>5)
  + *Version* = 0 car il n’y a pas eu de version précédente
  + *Previous Sequence Number* = 3 est incorrect car il ne fait pas référence au dernier *Sequence Number* reçu à savoir «5» en J+3, le fichier est rejeté par le système de reporting ICY.

1. ***Versionning :***

* Un 1er fichier  LOGIN\_DATTRA\_FR\_**000001**-**0**-**000000**\_20.zip est envoyé au système de reporting ICY
  + Cas 1 : Ce fichier est rejeté

Un feedback est généré par l’AMF avec un code erreur de type fichier (« FIL »). => L’entité doit corriger l’erreur et renvoyer le fichier corrigé intitulé   
LOGIN\_DATTRA\_FR\_**000001**-**1**-**000000**\_20.zip .  
Il s’agit exactement du même intitulé de fichier envoyé, seul le numéro de version est différent. Le fichier envoyé est une 2ème version et vient remplacer le fichier envoyé précédemment.

* + Cas 2 : Ce fichier est accepté,

Un feedback « OK » est généré par l’AMF.  
Si par la suite l’AMF reçoit un nouveau fichier intitulé   
LOGIN\_DATTRA\_FR\_**000001**-**1**-**000000**\_20zip, ce deuxième fichier sera rejeté.  
Le déclarant devra envoyer les modifications dans un nouveau fichier (donc avec changement de numéro de séquence).

* Un 2ème fichier  LOGIN\_DATTRA\_FR\_**000002**-**1**-**000001**\_20.zip est envoyé au système de reporting ICY.

Ce fichier est rejeté car le numéro de version ne correspond pas à l’attendu (pas de version 0 reçue précédemment pour ce numéro de séquence).  
L’entité doit corriger l’erreur et renvoie le fichier corrigé intitulé   
LOGIN\_DATTRA\_FR\_**000002**-**0**-**000001**\_20.zip  
Attention : Si ce nouveau fichier est rejeté, l’AMF génère un feedback avec un code erreur de type fichier (« FIL »). L’entité doit corriger l’erreur et renvoie le fichier corrigé intitulé :  
LOGIN\_DATTRA\_FR\_**000002**-**1**-**000001**\_20.zip.

**Remarques générales :**

* Dans le cas d’une erreur de convention de nommage ayant entrainé le rejet du fichier, le nouveau fichier envoyé en correction change de nom (même si le numéro de séquence est identique).  
  Le fichier changeant de nom, le numéro de version du fichier envoyé doit être 0.

**Exemple :**

Un fichier envoyé LOGIN\_DATTRA\_FR\_000003-0-000002\_2020.zip est rejeté (car année sur 4 digits).  
L’entité doit corriger l’erreur et renvoie le fichier corrigé intitulé :

LOGIN\_DATTRA\_FR\_**000003**-**0**-**000002**\_20.zip .

* Dans le cas où l’entité déclarante a envoyé 9 versions du même fichier et que les fichiers ont tous été rejetés, le nouveau fichier envoyé en correction change de nom.

**Exemple :**

Le neuvième fichier envoyé LOGIN\_DATTRA\_FR\_000001\_9\_000000\_20.zip est rejeté.

L’entité doit corriger l’erreur et renvoie le fichier corrigé intitulé :

LOGIN\_DATTRA\_FR\_**000002**\_**0**\_**000000**\_20.zip .

* Dans le cas d’un fichier où toutes les déclarations de transactions sont rejetées, le fichier est considéré comme rejeté. La correction attendue est le changement de version.

**Exemple :**

Le fichier envoyé LOGIN\_DATTRA\_FR\_000001\_0\_000000\_20.zip est rejeté car toutes les déclarations de transactions contenues dans ce fichier ont été rejetées.

L’entité doit corriger le fichier initial comme suit :

LOGIN\_DATTRA\_FR\_**000001**\_**1**\_**000000**\_20.zip .

* Si, et seulement si, un fichier est rejeté pour l’une des trois causes suivantes, alors il doit être réémis avec la même séquence **mais également la même version** (car la séquence de ce fichier n’aura pas été consommée dans le système d’information de l’AMF) :

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Code erreur** | **Contrôles** | **Message de l'erreur** |
| FIL-101 | Decompress the file. | The file cannot be decompressed. |
| FIL-102 | Check that the decompressed container zip file contains exactly one XML file. | The file contains more than 1 XML file. |
| FIL-103 | Check that the sender code, the file type code, Key1 code, Key2 code, the recipient code and the Year of the XML file and of the ZIP file are equal. | The name of the XML file is not consistent with the name of its container ZIP file. |

## Gestion des feedbacks

**Périodicité des traitements AMF**

Les fichiers de déclarations RDT 2 sont traités au fil de l’eau par des traitements batchs déclenchés périodiquement (plusieurs traitements par heure), avec mise à disposition des fichiers de feedbacks correspondants à l’issue de chaque traitement. Le délai théorique de mise à disposition d’un fichier feedback est inférieur à 2 heures à partir du moment où le fichier de déclaration est déposé avec succès sur la plateforme d’échange de l’AMF.

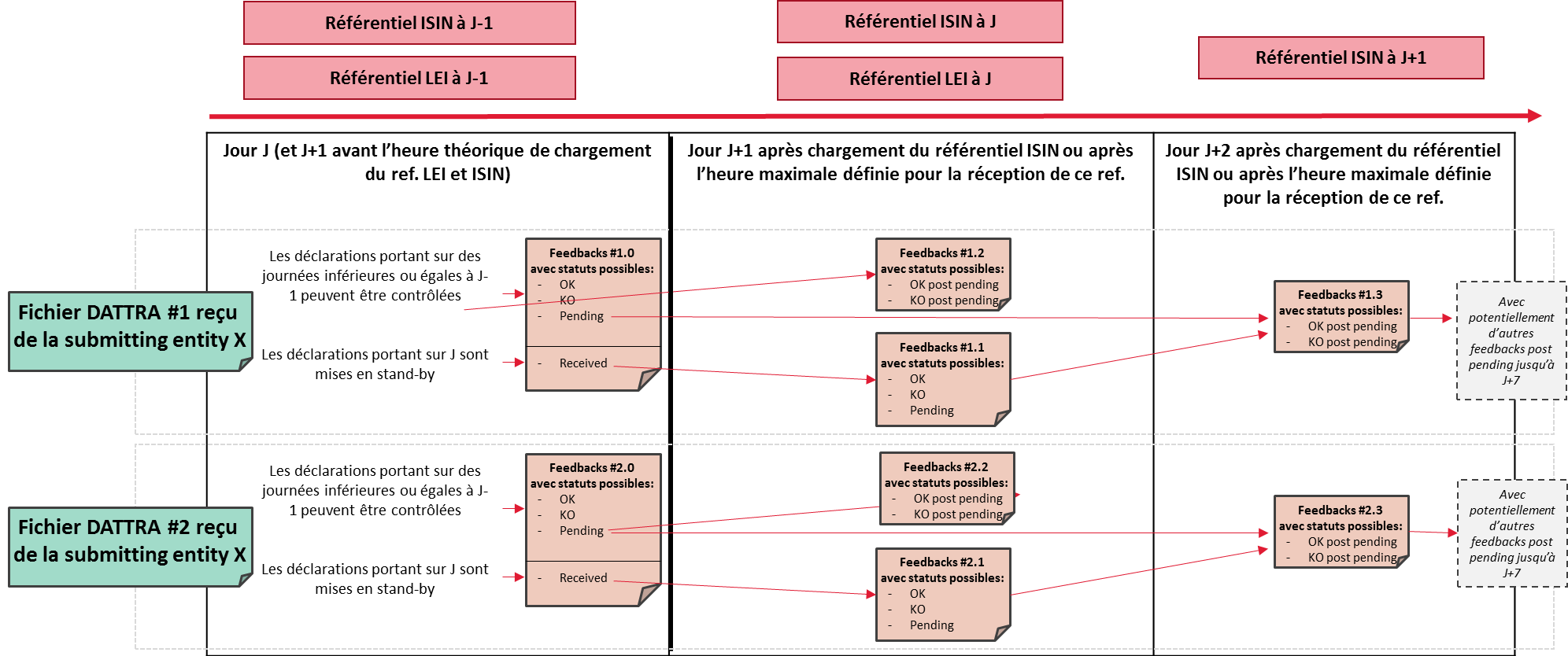
**Cinématique des traitements**

L’introduction des nouveaux statuts « *Pending* » et « *Received* » dans le processus de reporting lié à MiFIR a pour effet d’annuler et supprimer la relation unique qui existait dans le reporting des transactions MIFID entre un fichier de déclarations de transactions et son fichier de *feedback*.

En effet, plusieurs fichiers de *feedbacks* peuvent être associés à un fichier de déclarations et produits jusqu’à 7 jours calendaires après sa transmission.

Dans l’hypothèse où un établissement fait le choix de transmettre à l’AMF les fichiers de déclarations après J+1 à 8h (horaire auquel les référentiels ESMA actualisés auront normalement été chargés), et que les référentiels ESMA ont été mis à jour correctement avec les nouveaux instruments financiers admis à la négociation, un seul fichier de feedback sera émis par fichier de déclarations (sans « *received* », ni « *pending* »).

Le processus général des *feedbacks* est le suivant (analogue à la description du module « Intégration des déclarations ») :



* En J :
* Emission par une entité déclarante / réception par l’AMF d’un fichier de déclarations de transactions (de type DATTRA).
* Génération du premier *feedback* (1.0 et 2.0 dans le schéma) contenant potentiellement les statuts suivants :

=> OK : la déclaration de transaction a passé l’ensemble des règles de validation et elle est intégrée au système ICY.

=> KO : la déclaration de transaction n’a pas passé l’une des règles de validation et elle est rejetée par le système ICY, envoi dans le feedback du ou des codes erreurs (CONXXX)

=> « *Pending* » : la déclaration de transaction a été contrôlée en s’appuyant sur l’ensemble des référentiels valeurs à jour. Cependant, la déclaration de transaction affiche le statut « *pending* » tant que le code (ISIN) identifiant l’instrument financier n’est pas référencé dans la liste des instruments financiers de l’ESMA (FIRDS). Ce statut peut perdurer pendant au maximum 7 jours calendaires. Au-delà des 7 jours calendaires la déclaration est rejetée si le code ISIN n’est toujours pas listé dans le référentiel ESMA des instruments financiers (FIRDS). Le fichier de feedback donne le détail de déclarations au statut « *pending* ». Si un établissement constate qu’une déclaration est « *pending* » en raison d’une erreur de sa part sur l’identifiant de l’instrument financier, il a la possibilité de transmettre une déclaration modificatrice. Dans ce cas, il s’agit du même schéma que pour annuler et/ou modifier une déclaration de transaction. L’établissement doit annuler puis resoumettre la déclaration de transaction.

=> « *Received* » : la déclaration de transaction affiche un statut « *received* » car la date de négociation de la transaction est supérieure à la date des référentiels du régulateur (hypothèse où une transaction effectuée à J sur un instrument nouvellement admis aux négociations est transmise avant J+1 à 8h). Le fichier de feedback indique simplement le nombre de déclarations au statut « *received* ».

* En J+1 :
  1. **Dès la réception du référentiel ISIN de la journée J par l’AMF, s’il est intégré avant 8:00 AM,** la plateforme émet un nouveau *feedback* contenant les changements de statuts des déclarations affichant un statut « *received* », ou de « *pending* » devenus « OK ».
  2. **Si l’heure maximale de réception du référentiel ISIN pour la journée J est dépassée (10:00 AM) et que ce référentiel n’a pas été intégré**, la plateforme utilise le référentiel disponible, quelle que soit la date de validité de ce référentiel, et la production d’un nouveau feedback se fait sur la base de ces données.
  3. **A la réception du référentiel ISIN**, quelle que soit l’heure d’intégration de ce référentiel, la plateforme produit un nouveau *feedback* contenant les éventuels changements de statuts des déclarations affichant un statut « *Pending* ».
* En J+N (N allant de 2 à 7) :

A la réception du référentiel des instruments (ISIN) donnant l’image de la journée J+N-1 ou à l’heure maximale définie pour la réception de ce référentiel, le système ICY produira un nouveau feedback contenant les éventuels changements de statuts des déclarations stockées en statut « *Pending*».

Exemple de cinématique pour la gestion des feedbacks :

- 1er fichier reçu :

*LOGIN\_DATTRA\_FR\_000121-0-000119\_20.zip*

Fichier rejeté (ex : XML non conforme). Génération du feedback (numéro de séquence indépendant de celui du fichier de déclaration) :

*FR\_FDBTRA\_LOGIN\_000428-0\_20.zip*

- 2ème version du fichier reçu – le premier étant rejeté (même numéro de séquence que le fichier rejeté mais incrémentation du numéro de version) :

*LOGIN\_DATTRA\_FR\_000121-1-000119\_20.zip*

Fichier encore rejeté. Génération du nouveau feedback avec un nouveau numéro de séquence indépendant :

*FR\_FDBTRA\_LOGIN\_000442-0\_20.zip*

- 3ème version du fichier reçu – le deuxième étant rejeté (même numéro de séquence mais nouvelle incrémentation du numéro de version) :

*LOGIN\_DATTRA\_FR\_000121-2-000119\_20zip*

Fichier accepté. Génération du feedback sur un nouveau numéro de séquence :

*FR\_FDBTRA\_LOGIN\_000463-0\_20.zip*

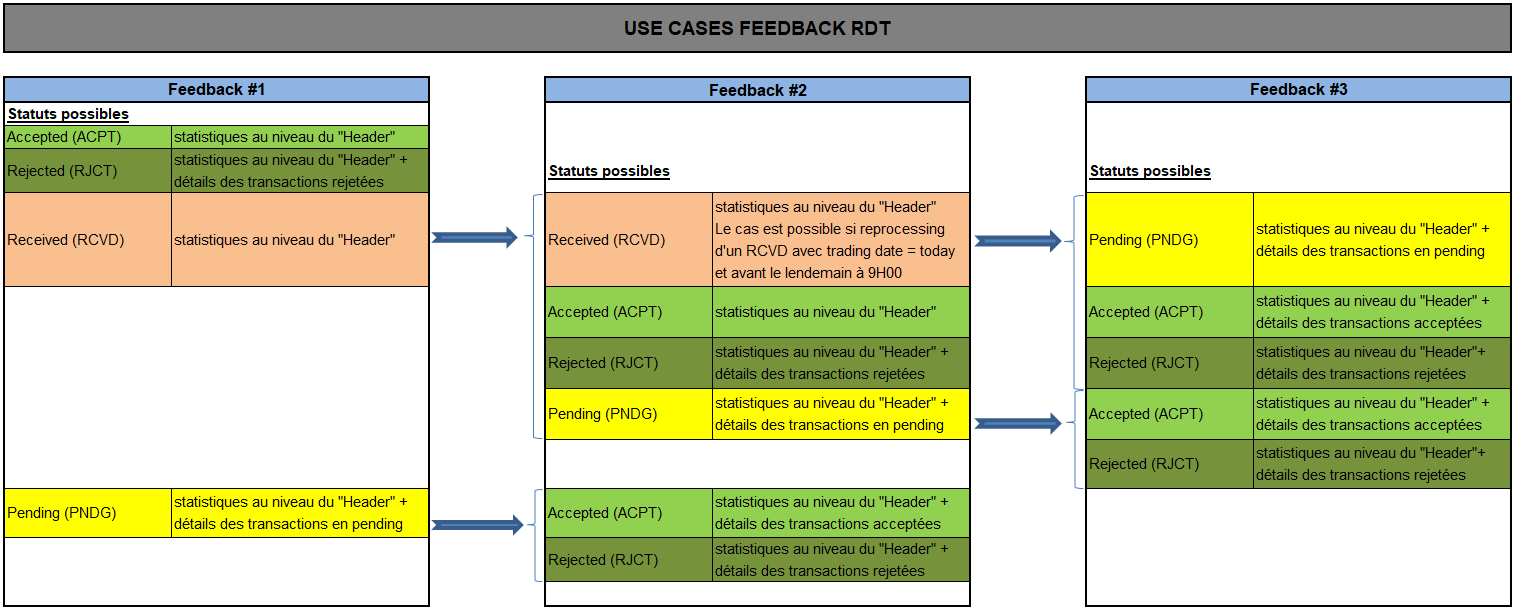
Si le 3ème fichier contient des déclarations en statut *Received* / *Pending*, des feedbacks seront générés quotidiennement dans le cadre de la gestion des stocks de *Received* / *Pending*. Ces fichiers feedbacks conserveront le même numéro de séquence mais verront leur numéro de version s’incrémenter :

*FR\_FDBTRA\_LOGIN\_000463-1\_20.zip*

*FR\_FDBTRA\_LOGIN\_000463-2\_20.zip*

*FR\_FDBTRA\_LOGIN\_000463-3\_20.zip ….*

Le contenu des fichiers feedbacks fournis par l’AMF est le suivant :



# Gestion de la qualité RDT

## FAQ

L’objectif de ce paragraphe est de référencer les questions les plus fréquentes ainsi que les erreurs déclaratives susceptibles d’être les plus courantes dans le reporting RDT 2.

* **Quelles sont les priorités de l’AMF en termes de qualité des données du RDT ?** 
  1. **La complétude du reporting**

Que les entreprises d’investissement assujetties au Reporting Des Transactions soient des déclarants directs ou indirects (utilisation d’un ARM), celles-ci doivent disposer de méthodes et de dispositifs leur permettant de s’assurer de la cohérence entre les données déclarées à l’AMF (directement ou par leur ARM) avec leurs transactions effectivement réalisées. Pour rappel, l’article 15 du Règlement Européen 2017/590 (anciennement dénommé RTS 22) demande à ce que des méthodes et des dispositifs soient mis en place par les entités déclarantes pour garantir un niveau de qualité satisfaisant, avec entre autres :

* + des mécanismes d'identification des erreurs et des omissions au sein des déclarations de transactions ;
  + des mécanismes permettant d'identifier les transactions non déclarées qui sont soumises à une obligation de déclaration en vertu de l'article 26 du règlement (UE) no 600/2014, y compris les cas où les déclarations de transactions rejetées par l'autorité compétente concernée n'ont pas été renvoyées avec succès.

Il est également et notamment fait mention des points suivants :

* + *Lorsque la plateforme de négociation ou l'entreprise d'investissement a connaissance d'une erreur ou omission quelconque dans une déclaration de transaction soumise à une autorité compétente, d'un manquement quelconque à son obligation de soumettre une déclaration de transaction, y compris à l'obligation de soumettre à nouveau une déclaration rejetée concernant une transaction à déclarer, ou du fait qu'une transaction non concernée par l'obligation de déclaration a été déclarée, elle en avise promptement l'autorité compétente concernée*.
  + *Les entreprises d'investissement se dotent de dispositifs appropriés pour garantir l'exhaustivité et l'exactitude de leurs déclarations de transactions. Ces dispositifs consistent notamment à tester leur processus de déclaration et à procéder au rapprochement régulier des enregistrements de leurs activités de négociation de front office avec des échantillons de données que les autorités compétentes leur fournissent à cet effet.*
  + *Lorsque les autorités compétentes ne fournissent pas d'échantillons de données, les entreprises d'investissement rapprochent les enregistrements de leurs activités de négociation de front office avec les informations contenues dans les déclarations de transactions qu'elles ont soumises aux autorités compétentes, ou dans les déclarations de transactions faites pour leur compte par des mécanismes de déclaration agréés ou des plateformes de négociation* (…).
  + *Les entreprises d'investissement mettent en place des dispositifs garantissant que leurs déclarations de transactions, envisagées collectivement, reflètent l'ensemble des changements survenus au niveau de leur position et de la position de leurs clients sur les instruments financiers concernés au moment de l'exécution des transactions sur les instruments financiers.*

Les entreprises d’investissement sont donc tenues d'assurer un suivi irréprochable de leurs rapports de transactions et elles doivent pouvoir répondre aux demandes de l’AMF dans des délais raisonnables.

* 1. **Les niveaux de rejets**

L’AMF réalise un contrôle régulier des taux de rejets de chaque entité et peut être amené à contacter certaines entités lorsque ces taux atteignent des niveaux trop importants.

Il est demandé aux entités de procéder à un suivi régulier de ces rejets par le biais des feedbacks générés par l’AMF et de procéder aux corrections nécessaires le cas échéant.

Dans le cas de rejets liés à du sur-reporting (déclarations de transactions sur des instruments non éligibles au reporting), il est demandé aux entités d’en informer les services de l’AMF au plus vite afin d’écarter ces rejets des analyses ultérieures.

Pour rappel, l’article 15 du règlement 2017/590 mentionne le point suivant :

* + *Lorsque la plateforme de négociation ou l'entreprise d'investissement a connaissance d'une erreur ou omission quelconque dans une déclaration de transaction soumise à une autorité compétente, d'un manquement quelconque à son obligation de soumettre une déclaration de transaction, y compris à l'obligation de soumettre à nouveau une déclaration rejetée concernant une transaction à déclarer, ou du fait qu'une transaction non concernée par l'obligation de déclaration a été déclarée, elle en avise promptement l'autorité compétente concernée.*
  1. **La cohérence du RDT avec les questionnaires envoyés aux entreprises d’investissement**

L’AMF procède, entre autres, à des contrôles de cohérence entre les données du système RDT et les déclarations faites dans les questionnaires annuels et les questionnaires techniques et fonctionnels relatifs au reporting RDT.

En particulier, sont contrôlés :

* + le fait que l’entité déclare bien des transactions dans le système RDT lorsqu’elle nous déclare être soumise aux dispositions prévues à l’article 26 de MiFIR ;
  + la cohérence entre les services d’investissements déclarés et ceux constatés dans le reporting ;
  + le mode de transmission des données (utilisation d’un ARM et/ou déclarations directes).
  1. **Les contrôles de qualités sur les champs les plus critiques**

L’AMF identifie les champs déclaratifs suivants dont la mise en qualité est prioritaire :

* #2 : Le numéro de référence de la transaction qui doit être unique dans le temps pour chaque transaction (il est également systématiquement utilisé lors d’une annulation et d’une re-soumission).
* #3 : Le code d’identification de transaction de la plateforme de négociation (ou TVTIC) avec l’utilisation d’un format conforme aux spécifications données par la plateforme de négociation concernée lorsque la transaction est exécutée sur **une plateforme de négociation.**
* #7 et #16 : Codes d’identification des acheteurs et vendeurs. En particulier, il est demandé depuis le 3 juillet 2018 que les entreprises d’investissement empêchent que des transactions puissent être exécutées pour toute entité juridique ne possédant pas de **code LEI**.
* #8, #17, #37, #58 et #60 : champs relatifs aux succursales. Le code pays des succursales est à renseigner lorsqu’une ou plusieurs succursales prennent part à la réalisation de la transaction.
* #25 : Indicateur de transmission des ordres. Il est demandé aux assujettis de renseigner systématiquement ce champ à « true » lors de la transmission d’un ordre (cf. article 4 du règlement délégué).
* #26 et #27 : Code d'identification de l'entreprise transmettrice pour l'acheteur et le vendeur. Il est demandé **aux entités réceptrices** d’un ordre d’indiquer dans ces champs le code d’identification de l’entité transmettrice de l’ordre.
* #28 : Date et heure de négociation. Il est demandé notamment de déclarer l’horaire d’exécution **en UTC**. Par ailleurs, il est attendu que les déclarations reflétant une transaction réalisée sur une plateforme soient renseignées **à la milliseconde**.
* #29 : Type de négociation.
* #30 et #33 : Quantité et Prix. Il est demandé d’utiliser les balises de quantité et prix en cohérence avec les instruments financiers négociés
* #36 : Code MIC de la plateforme – uniquement dans les cas d’exécution – et à renseigner avec **un *segment* MIC et non un *operating* MIC** (cf. plus loin, section sur les rejets).
* #41 : Code d’identification de l’instrument.
* **Comment remplir les champs de transmission d’ordres, de plateforme et de type de négociation dans les cas les plus fréquents ?**

Les volumes les plus importants de déclarations à effectuer concernent des transactions consécutives à de la réception et transmission d’ordres (RTO), à de l’exécution pour compte de tiers ou de la négociation pour compte propre.

Les déclarants peuvent se référer à l’article 4 du Règlement délégué 2017/590 pour avoir le détail des éléments à renseigner pour le Reporting des Transactions dans un contexte de réception transmission d’ordres (RTO) et à l’article 5 du même règlement pour le Reporting des Transactions dans un contexte d’exécution d’ordres qu’il soit effectué pour compte de tiers ou pour le compte propre du déclarant. Les déclarants peuvent également se référer aux exemples dédiés figurant dans les Orientations de l’ESMA, y compris pour des modalités déclaratives concernant des situations moins fréquentes.

Le tableau ci-après détaille certaines modalités de transaction fréquemment rencontrées selon les cas. Il détaille en particulier la bonne utilisation du champ #25 sur la transmission d’ordre et identifie certains schémas de reporting anormaux.

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Indicateur de transmission d’ordre**  Champ #25 | **Plateforme**  Champ #36 | **Type de négociation**  Champ #29 | **Commentaires** |
| False | XOFF (ou XXXX pour les instruments non listés sur une plateforme UE) | AOTC | Cas d’une exécution pour compte de tiers effectuée de gré à gré |
| False | XOFF (ou XXXX pour les instruments non listés sur une plateforme UE) | DEAL | Cas d’une exécution pour compte propre effectuée de gré à gré ou d’utilisation d’un accès direct au marché (DMA) pour l’exécution d’ordres pour compte propre |
| False | Code MIC de la Venue ou XOFF | MTCH | Cas d’une exécution en Matched Trading Principal (négociation par appariement avec interposition de compte propre) |
| False | Code MIC de la Venue | DEAL ou AOTC | Cas d’une exécution pour compte de tiers ou pour compte propre sur une plateforme |
| True | XOFF | AOTC | RTO ou utilisation d’un DMA pour l’exécution d’ordres pour compte de tiers |
| True | Code MIC de la Venue | DEAL, AOTC ou MTCH | Ce schéma est erroné. Seuls les membres de marché peuvent déclarer un code MIC dans le champ 36. Même si le déclarant qui a transmis l’ordre sait sur quelle plateforme son ordre a été exécuté, le champ 36 doit être rempli à XOFF quand le champ 25 est à *True* (dans le cas contraire cela fausse les rapprochements que peuvent faire les autorités avec les autres déclarations reçues de la part des plateformes ou d’autres déclarants prenant part à l’exécution de la transaction concernée). |
| True | Code MIC de la Venue ou XOFF | DEAL ou MTCH | Ce schéma est erroné. Il n’est pas possible de remplir le champ 25 à *True* et le champ 29 à DEAL ou MTCH. |

* **Comment déclarer des transactions utilisant un accès direct au marché (DMA) ou un accès électronique au marché (DEA) ? Quelles sont les erreurs les plus courantes ?**

Les Orientations de l’ESMA explicitent les différents cas possibles au chapitre 5.28 et donnent les schémas déclaratifs attendus dans le cas où le client du DMA/DEA négocie pour compte propre (chapitre 5.28.1) et où il négocie pour le compte d’un tiers (chapitre 5.28.2).

Il est important de noter que le fournisseur de DMA/DEA doit apparaitre en contrepartie dans la déclaration faite par le client du DMA/DEA.

* **Comment renseigner les champs liés aux succursales ? Quelles sont les erreurs les plus courantes ?**

L’article 14 du Règlement délégué 2017/590 décrit le déclaratif à réaliser lors de l’implication totale ou partielle d’une succursale dans la réalisation d’une transaction éligible au RDT.

Les champs relatifs à l’utilisation d’une succursale sont les suivants :

|  |  |
| --- | --- |
| **Numéro de champ dans le règlement 2017/590** | **Champ / descriptif** |
| #8 | Pays de la succursale pour l'acheteur |
| #17 | Pays de la succursale pour le vendeur |
| #37 | Pays de participation au marché de la succursale |
| #58 | Pays de la succursale chargée de surveiller la personne responsable de la décision d'investissement |
| #60 | Pays de la succursale chargée de surveiller la personne responsable de l'exécution |

**Une erreur relativement commune est de renseigner la nationalité des clients dans les champs 8 et 17 en lieu et place du code pays de la succursale**.

Ci-après un tableau récapitulatif des schémas les plus probables pour le renseignement des champs succursales :



* **Comment définir la notion d’éligibilité au RDT ? Comment considérer qu’un instrument non listé est économiquement équivalent à un titre listé ?**

Conformément à l’article 26 du règlement MiFIR, l’obligation (de déclaration) s’applique :

1. *aux instruments financiers qui sont admis à la négociation ou négociés sur une plateforme de négociation ou pour lesquels une demande d’admission à la négociation a été présentée ;*
2. *aux instruments financiers dont le sous-jacent est un instrument financier négocié sur une plateforme de négociation ;*
3. *aux instruments financiers dont le sous-jacent est un indice ou un panier composé d’instruments financiers négociés sur une plateforme de négociation.*

*Cette obligation s’applique aux transactions sur les instruments financiers visés aux points a) à c), que ces transactions soient ou non exécutées sur une plateforme de négociation.*

A noter également que les dérivés OTC partageant les mêmes caractéristiques que les dérivés listés sur une plateforme de négociation européenne doivent être considérés comme TOTV, et par conséquent, être soumis à l’obligation de déclaration. Les caractéristiques de l’instrument à considérer pour réaliser cette comparaison sont celles définies pour le référentiel FIRDS – à l’exception des champs 5 à 12 (venue et informations sur l’émetteur) ainsi que l’ISIN (cf. Opinion ESMA : esma70-156-117\_mifir\_opinion\_on\_totv – points 11 et 12).

* **Comment gérer les cas de rejets de type « CON-412 »[[9]](#footnote-10) (et CON-472)[[10]](#footnote-11) relatif à l’absence de l’instrument déclaré dans le référentiel FIRDS pour la date de négociation donnée ?**

Différentes raisons peuvent amener à des rejets de type CON-412 (ou CON-472). De ce fait, il n’est pas possible de donner une règle générale pour le traitement et le recyclage de ces rejets et une analyse au cas par cas est nécessaire. Néanmoins, nous préconisons qu’une analyse soit réalisée par les services de l’entité concernée avant de prendre contact avec l’AMF pour envisager une solution au problème.

Les principales raisons des rejets de type CON-412 (ou CON-472) sont les suivantes :

* **Sur-reporting** : c’est-à-dire la déclaration de transaction sur des instruments non ToTV (ou non uToTV) ou sur des dates de négociations ne nécessitant pas de reporting (cf. paragraphe 4.1.b de ce document).
* **Utilisation *d’Operating* MIC au lieu de *Segment* MIC pour identifier les plateformes** : les déclarations de transactions effectuées sur une plateforme de négociation sont testées sur le couple « ISIN de l’instrument / code MIC de la plateforme » qui doit être présent dans le référentiel FIRDS[[11]](#footnote-12) (pour les déclarations de transactions sur un internalisateur systématique, seule la présence de l’ISIN dans FIRDS est testée). Dans de nombreux cas, c’est l’*operating* MIC de la plateforme qui était renseigné dans les déclarations, or le référentiel FIRDS référence des *segment* MIC (exemple : XMIL au lieu de MTAA ou XETR au lieu de XETA ou XETB).
* **Problèmes de qualité FIRDS**: les instruments référencés dans FIRDS proviennent de déclarations d’instruments listés – initialement effectuées par l’ensemble des plateformes de négociations européennes et des Internalisateurs Systématiques (IS). Ces déclarations peuvent souffrir de défauts de qualité tels que :
  + Leur absence dans le référentiel – à noter qu’il peut également s’agir d’un retard de déclaration de la part de la plateforme ou de l’IS. Dans ce cas de figure, la mise en « pending » des déclarations RDT (code CON-411) vise justement à pallier ce retard pour permettre une intégration de l’instrument concerné dans les 7 jours suivants la déclaration RDT. Cela étant, il existe des cas où ce référencement se fera au-delà des 7 jours prévus.
  + Une erreur sur les dates de validité de l’ISIN renseignés.
* **Quel est le schéma déclaratif pour les transactions en lien avec un contrat de liquidité ?**

Un bref rappel du cadre juridique du contrat de liquidité :

Conformément au règlement européen sur les abus de marché, l'Autorité des marchés financiers a notifié en février **2018** un projet de pratique de marché admise encadrant l'usage des contrats de liquidité sur actions. Conclus entre un prestataire de services d'investissement et un émetteur, ces contrats améliorent la liquidité sur les actions concernées. Lorsqu'ils sont instaurés en tant que pratique de marché admise, ces contrats confèrent aux émetteurs et aux prestataires de services d'investissement qui les mettent en œuvre et en respectent les termes un confort juridique au regard de la règlementation en matière de manipulation de marché. Largement répandue en France (plus de 400 sociétés françaises ont conclu un contrat de liquidité sur leurs titres), cette pratique est considérée comme essentielle pour le bon fonctionnement du marché français des actions des émetteurs de taille moyenne.

Modalités de reporting des transactions :

Comme communiqué aux différents établissements concernés, il est attendu que les différents champs du reporting figurant dans le tableau soient reportés comme indiqué dans le cas d’une transaction dans le sens acheteur (pour une transaction dans le sens vendeur, il y a inversion des champs *acheteur* et *vendeur* et remplissage du champ *#21 au lieu du champ #12*) :

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Champ #3**  **Code d'identification de transaction de la plate-forme de négociation** | **Champ #7**  **Code d'identification de l'acheteur** | **Champ #16**  **Code d'identification du vendeur** | **Champ #25 Indicateur de transmission d’ordre** | **Champ #12**  **Code du responsable de la décision pour l'acheteur** | **Champ #57**  **Code du responsable de la décision d’investissement** | **Champ # 59**  **Exécution au sein de l’entreprise** |
| Code MIC de la plate-forme concernée | Code LEI de l’émetteur | Code LEI de la chambre de compensation de la plateforme | False | LEI de l’entreprise d’investissement en charge du contrat de liquidité | Code CONCAT de la personne ou identifiant de l’algorithme responsable de la décision d’investissement | Code CONCAT de la personne ou identifiant de l’algorithme responsable de l’exécution |

* **Comment renseigner le code d’identification de l’entreprise transmettrice pour l’acheteur ou le vendeur ?**

Lorsqu’une transaction concerne un ordre transmis remplissant les conditions de transmission définies à l'article 4 du règlement Européen 2017/590, les informations des champs 7 à 24 sont fournies par l'entreprise réceptrice dans sa déclaration, en même temps que les informations reçues de l'entreprise transmettrice. Les champs 26 ou 27, identifiant respectivement l’entreprise transmettrice pour l’acheteur ou le vendeur, doivent être renseignés avec le code LEI de l’entreprise transmettrice de l’ordre.

A noter :

* qu’un seul de ces deux champs doit être renseigné, et ce suivant le sens de la transaction,
* que les entités qui transmettent des ordres et effectuent elles-mêmes le reporting des transaction (champ 25 « True » n’ont pas à renseigner ce champ. Il s’agit ici notamment des déclarations de transactions pour lesquelles l’identifiant client n’a pas été transmis à l’entité réceptrice.
* **Rappel des règles de construction des codes CONCAT**

Le code CONCAT a été retenu par l’AMF pour identifier les personnes physiques de nationalité française déclarées dans le reporting RDT (pour les autres nationalités, cf. Annexe II du règlement délégué 2017/590).

Pour rappel, les règles de génération d’un code CONCAT sont décrites dans les Orientations ESMA (chapitre 5.5.1). Le respect de ces règles est primordial pour permettre aux régulateurs de mener des travaux de réconciliation des données.

Une des erreurs les plus fréquemment constatée porte sur la transcodification des prénoms composés dans le CONCAT. Il est constaté dans de nombreux cas que seule la première partie du prénom est retenue, et complétée par le sigle #. Or, la seconde partie des prénoms est bien à prendre en compte dans cette construction. Par exemple, pour le prénom « Amy-Ally », nous devrions retrouver dans le code CONCAT la chaine de caractère suivante : « AMYAL » (et non « AMY## »).

* **Comment corriger/modifier une déclaration déjà acceptée ?**

La déclaration originellement soumise doit être annulée avant d’être re-soumise. La nouvelle déclaration doit alors contenir le même numéro de référence de la transaction (champ #2 du Règlement Européen 2017/590) que celui indiqué dans la déclaration originelle – comme précisé dans les Technical Reporting Instructions (chapitre 4.1 - point 74).

## Monthly Reports

Ce reporting produit par l’AMF a pour objectif de permettre aux déclarants directs et aux ARM de réaliser des contrôles de cohérence mensuels. Se référer au document de référence « Guide Monthly Report » pour plus de détails.



FIN DU DOCUMENT

1. *Approved Reporting Mechanism* [↑](#footnote-ref-2)
2. Règlement (UE) N° 600/2014 du Parlement Européen et du Conseil du 15 mai 2014 concernant les marchés d’instruments financiers et modifiant le règlement (UE) n° 648/2012 [↑](#footnote-ref-3)
3. Règlement délégué (UE) 2017/590 de la Commission du 28 juillet 2016 [↑](#footnote-ref-4)
4. Déclarations des transactions, conservation des données sur les ordres et synchronisation des horloges en vertu de la directive MIF II 02/10/2017 | ESMA/2016/1452 [↑](#footnote-ref-5)
5. Aussi bien pour les fichiers de déclarations que pour les fichiers de feedback. [↑](#footnote-ref-6)
6. Entreprise d’investissement assujettie, ARM, plateforme de négociation [↑](#footnote-ref-7)
7. Attention, la notion de « version » pour les feedbacks correspond aux versions successives de fichiers de feedbacks générés pour un même fichier de déclaration dans l’hypothèse où ce fichier ne peut pas être traité intégralement dès le 1er traitement (succession de « received » et/ou de « pending »). [↑](#footnote-ref-8)
8. A savoir le fichier LOGIN\_DATTRA\_FR\_**000004**-0-**000003**\_17.zip reçu en J+3 et le fichier LOGIN\_DATTRA\_FR\_**000005**-0-**000004**\_17.zip reçue en J+2. [↑](#footnote-ref-9)
9. *“If at least 7 days has passed after the transaction submission (i.e. it is the 8th day after the submission) the transaction shall be rejected with the following error message : Instrument is not valid in reference data on transaction date”* [↑](#footnote-ref-10)
10. *“If at least 7 days has passed after the transaction submission (i.e. it is the 8th day after the submission) the transaction shall be rejected with the following error message : Underlying instrument XXX is not valid in reference data on transaction date”* [↑](#footnote-ref-11)
11. FIRDS : Financial Instrument Reference Data System, référentiel des instruments financiers de l’ESMA qui contient l’ensemble des instruments négociés sur des plateformes européennes [↑](#footnote-ref-12)