

Note technique DSMF n° 2024-01 relative à la collecte française et aux contrôles des informations statistiques des marchés monétaires (MMFR) remises par les institutions monétaires et financières résidant en France.

Vu le règlement (UE) n°1333/2014 de la Banque Centrale Européenne du 26 novembre 2014 concernant les statistiques des marchés monétaires (BCE/2014/48), et notamment :

- L'article 3 alinéa 2 qui prévoit que les banques centrales nationales (BCN) définissent et mettent en œuvre les dispositifs de déclaration applicables par les agents déclarants pour les instruments du marché monétaire ;
- L'article 4, alinéa 3 qui prévoit que les BCN décident du délai dans lequel elles ont besoin de recevoir les données des déclarants afin de respecter leurs délais de déclaration précisés au paragraphe 2 et en informent les agents déclarants en conséquence ;
- L'article 8, qui prévoit que la Banque centrale européenne (BCE) et les BCN ont le droit de vérifier et, si nécessaire, de collecter de manière obligatoire les informations que les agents déclarants fournissent conformément aux obligations de déclaration statistique ;
- Son annexe IV.

Vu la décision n° 2024-01 du Gouverneur du 8 février 2024 modifiant la décision 2021-01 du 21 avril 2021 relative à la collecte et au contrôle d'informations statistiques requises des établissements de crédit et des autres intermédiaires financiers.

La présente note technique a pour objet de préciser les obligations qui incombent aux agents déclarants résidant en France concernés par la collecte des informations statistiques des marchés monétaires (MMFR). Elle est publiée sur le site internet de la Banque de France.

Elle reprend pour partie et complète les modalités de remise des déclarations décrites dans le document *Reporting instructions for the electronic transmission of money market statistical reporting (MMSR)* publié par la Banque Centrale Européenne et disponible sur son site internet^{1,2}.

La présente note technique entre en vigueur le 1^{er} juillet 2024.

Article 1 : Définitions

On entend par :

1. « jours de règlement TARGET », jours d'ouverture du système Target selon le calendrier arrêté par la Banque centrale européenne. Ce calendrier contient l'ensemble des jours ouvrés, exception faite des jours suivants, s'ils tombent un jour ouvré :
 - 1^{er} janvier
 - Vendredi saint – vendredi précédent immédiatement le lundi de Pâques
 - Lundi de Pâques
 - 1^{er} mai

¹ https://www.ecb.europa.eu/stats/financial_markets_and_interest_rates/money_market/html/index.en.html

² Version 3.6.1 applicable le 1^{er} juillet 2024.

- 25 décembre – Noël,
 - 26 décembre.
2. « jours de fermeture TARGET » les jours ne rentrant pas dans la définition du 1.
 3. « révision », toute modification, correction ou annulation.

Article 2 : Population déclarante effective

1. Sont concernés par la présente note technique et dénommés ci-après « agents déclarants », les institutions financières monétaires résidant en France métropolitaine et soumises à l'obligation de déclaration quotidienne définie par le règlement (UE) n° 1333/2014.
2. La liste des agents déclarants soumis à cette obligation est arrêtée par décision du Conseil des Gouverneurs de la Banque Centrale Européenne conformément à l'article 2 du règlement (UE) n°1333/2014. Cette liste est reprise en annexe I.

Article 3 : Obligations de déclaration statistique

1. Aux fins de la production régulière de statistiques relatives aux marchés monétaires, les agents déclarants concernés déclarent à la Banque de France, sous forme consolidée, y compris pour toutes leurs succursales situées dans l'Union Européenne et dans un pays de l'AELE ainsi que pour leurs succursales situées au Royaume-Uni, des informations statistiques quotidiennes sur les transactions conclues par elles sur les marchés monétaires, afférentes aux segments d'activité définis par les annexes I à III du règlement (UE) n°1333/2014 et selon les normes minimales de qualité définies à l'annexe IV de ce même règlement.
2. Ils se conforment également :
 - a. Aux instructions « Reporting Instructions » relatives à la collecte des informations statistiques des marchés monétaires (MMSR) publiées par la Banque centrale européenne sur son site internet ;
 - b. Au document de « Questions and Answers » publié par la BCE sur son site internet¹ ;
 - c. A la documentation technique mise à disposition des agents déclarants MMFR par la Banque de France, notamment l'annexe relative au système d'information mis en place pour cette collecte et aux règles pour l'accès à ce système d'information qui s'imposent aux remettants.
3. Les agents déclarants se conforment à leurs obligations en se référant aux notes, instructions et notices pertinentes les plus récemment publiées par la Banque de France et la Banque centrale européenne.

Article 4 : Périmètre de déclaration

1. Sont concernées par l'obligation déclarative les transactions conclues sur les marchés monétaires relevant de l'un des quatre segments suivants :
 - a. Les opérations garanties (segment SECURED) décrites à l'annexe I du règlement (UE) n° 1333/2014 ;

- b. Les opérations non garanties (segment UNSECURED) décrites à l'annexe II du règlement (UE) n° 1333/2014 ;
 - c. Les opérations de swaps de change (segment FX SWAP) décrites à l'annexe III, première partie, point a), du règlement (UE) n° 1333/2014 ;
 - d. Les opérations de swaps « overnight index swap » (segment OIS) décrites à l'annexe III, première partie, point b) du règlement (UE) n° 1333/2014.
2. Le fait générateur de l'obligation de déclaration d'une transaction est l'enregistrement de celle-ci par l'agent déclarant ou l'une de ses succursales située dans l'Union Européenne, dans un pays de l'AELE ou au Royaume-Uni, indépendamment de l'endroit où la transaction a été initiée ou exécutée.
3. Les transactions intra-groupe au sens de l'article 1, alinéa 19 règlement (UE) n° 1333/2014 sont exclues du périmètre de déclaration. La notion de groupe s'entendant comme l'ensemble le plus grand d'entreprises dont l'agent déclarant fait partie et remettant des comptes consolidés conformément à la directive 2013/34/UE.
4. Les transactions dont le nominal est inférieur à cinq cent mille euros (EUR 500,000) ne sont plus collectées par la Banque de France à compter du 1^{er} juillet 2024. Ce seuil s'applique à l'ensemble des transactions, quel que soit le segment de marché duquel elles relèvent ou le secteur de la contrepartie.

Article 5 : Modalités de remise et de contrôle de la qualité des déclarations

1. La déclaration statistique s'effectue sur la plateforme transactionnelle MMFR, qui dispose également d'une interface utilisateur accessible via l'adresse mmfr.banque-france.fr. Le système d'information de l'agent déclarant doit permettre le fonctionnement d'un service de transmission automatique (*webservice*) au portail de collecte. Ce *webservice* est fourni par la Banque de France.
2. Les modalités de connexion au *webservice* sont décrites dans le document « IT Appendix » remis aux correspondants habilités définis à l'article 3 de la Décision du Gouverneur 2021-01 du 21 avril 2021 modifiée, identifiés comme référents techniques. Les modalités de connexion à l'interface utilisateur sont décrites dans le manuel utilisateur MMFR remis aux nouveaux correspondants habilités durant le processus d'accréditation. Pour accéder à l'interface utilisateur, les correspondants habilités doivent disposer de certificats d'authentification. Il se conforme pour l'obtention de ces certificats aux instructions données par la direction générale du Système d'information de la Banque de France.
3. Chaque segment déclaratif tel que défini à l'article 2 de la présente note technique doit faire l'objet d'une transmission distincte des autres segments. Plusieurs fichiers peuvent toutefois être remis pour un même segment.
4. En application de l'article 4.3 du règlement (UE) n° 1333/2014, l'heure limite de déclaration journalière par les agents déclarants pour transmettre les informations statistiques quotidiennes telles que précisées aux annexes I, II et III du même règlement est fixée à 6h00 heure d'Europe centrale (CET), le premier jour de règlement TARGET suivant le jour de transaction.

5. Pour s'assurer de la cohérence et de l'exactitude des informations transmises par les agents déclarants dans le cadre de leurs obligations déclaratives, la Banque de France et la BCE réalisent des contrôles systématiques sur les données du segment UNSECURED ('L3 checks'). Dans ce cadre, les agents déclarants peuvent être sollicités par message électronique à compter de 7h05 CET par la BCE ou la Banque de France chaque jour ouvrable TARGET. En application du paragraphe 2 v) de l'annexe IV du règlement (UE) n° 1333/2014, les agents déclarants sont tenus d'accuser réception de ces communications dans les 15 minutes qui suivent leurs réceptions et de transmettre les informations demandées avant 7h45 CET le même jour, en respectant le format de réponse défini par la BCE. Pour toute demande reçue après 8h00 CET, l'agent déclarant concerné doit répondre le même jour avant 15h00 CET.
6. Les agents déclarants sont tenus de répondre à toute communication de la BCE ou de la Banque de France après 8h00 CET et ayant pour objet de confirmer la précision des données transmises dans le cadre de l'obligation déclarative MMSR à échéance 15h00 CET le jour-même.
7. L'absence de réponse à une question posée par la Banque de France ou par la BCE dans les délais fixés aux paragraphes 5 et 6 du présent article, constitue un cas de non-conformité présumée aux normes minimales de transmission telles que définies à l'article IV du règlement (UE) n° 1333/2014.

Article 6 : Correspondants habilités

1. Il appartient à l'agent déclarant d'informer la Banque de France de toute évolution du correspondant habilité ou de la liste des correspondants habilités défini à l'article 3 de la Décision du Gouverneur 2021-01 du 21 avril 2021 modifiée.
2. Lorsqu'une liste de correspondants habilités est définie, les responsabilités respectives des membres de cette liste doivent être précisées.
3. Les responsabilités du ou des référents habilités désignés par l'agent remettant couvrent notamment, le cas échéant :
 - a. la réponse aux demandes de confirmation de transactions sur le segment UNSECURED ;
 - b. la réponse aux sollicitations de la Banque de France pour toute problématique de transmission de l'information ;
 - c. la réponse aux questions relatives à la qualité des données autres que les demandes de confirmation ;
 - d. le suivi des actions correctrices définies par l'agent remettant en réponse à des incidents de déclaration et du respect de leur calendrier de mise en œuvre.

Article 7 : Dispositif de contrôle de la bonne transmission des déclarations et continuité d'activité

1. Il appartient à l'agent déclarant de mettre en place des processus et un dispositif de contrôle permettant de s'assurer de la bonne transmission des déclarations statistiques dans le respect des règles minimales en matière de transmission prévues à l'annexe IV.1 du règlement (UE) n° 2014/1333. Ces processus et dispositif incluent notamment :
 - a. La supervision du bon fonctionnement des systèmes informatiques susceptibles d'affecter directement ou indirectement le processus de transmission ;
 - b. La prise en compte du risque d'échec de la transmission dans la planification de celle-ci, compte-tenu notamment du délai visé à l'article 5, paragraphe 4, et de l'item c. ci-dessous. La transmission anticipée des transactions survenant la veille d'un jour de fermeture TARGET, sans attendre le matin du jour suivant d'ouverture TARGET ;
 - c. La mise en œuvre d'une procédure de relance de la transmission (*'retry'*) comprenant minimum deux tentatives de relance de la transmission avec une durée de latence minimale mesurée entre la réception de la première notification de l'échec de la transmission et la dernière tentative automatique d'au moins 30 minutes ;
 - d. Une disponibilité suffisante des équipes en charge de la transmission et du support informatique sur les plages de transmission et de réponse aux questions posées par la Banque de France ;
 - e. Une maîtrise et une capacité de mise en œuvre de la procédure de chargement manuel des données sur la plateforme de transmission (*'manual upload'*).
2. Pour assurer la continuité de l'activité de collecte et le maintien de la qualité du service, la Banque de France se réserve le droit de demander ponctuellement à l'agent déclarant de déclarer ses données via webservice ou « manual upload » sur l'environnement de pré-production, en complément de la déclaration sur l'environnement de production. La Banque de France informera l'agent déclarant au moins 48 heures avant la date prévue d'utilisation de l'environnement de pré-production.

Article 8 : Révision d'une déclaration passée

1. Lorsque l'agent déclarant constate que des données qu'il a transmises ne sont pas cohérentes avec les données les plus à jour dont il dispose, celui-ci doit transmettre à la Banque de France une révision des données déclarées.
2. Toute révision d'une déclaration statistique passée doit intervenir dans les 10 jours d'ouverture TARGET après la déclaration initiale des données concernées.
3. La renégociation d'une transaction déjà déclarée emportant des effets rétroactifs doit être déclarée comme une modification de la transaction initiale, y compris lorsque cette renégociation intervient une fois le délai prévu au second paragraphe écoulé.
4. Lorsque la modification d'une transaction déclarée concerne le seul identifiant UTI de cette transaction, il n'est pas tenu compte du délai prévu au second paragraphe.
5. Lorsque la révision d'une déclaration ne peut intervenir dans les délais fixés au second paragraphe, l'agent déclarant en informe la Banque de France dans les plus brefs délais. L'agent déclarant précise dans sa déclaration le périmètre identifié des révisions attendues, les difficultés rencontrées n'ayant pas permis le respect des délais impartis, ainsi qu'une date prévisionnelle pour la transmission des révisions.
6. Le délai indiqué au second paragraphe du présent article ne s'applique aux agents déclarants nouvellement soumis à la transmission d'informations statistiques MMSR à compter du 1er juillet 2024, selon la liste rappelée en annexe I, qu'à compter du 1er janvier 2027. Jusqu'à cette date, les agents déclarants peuvent transmettre une révision de leurs données quelles que soit leur antériorité et nonobstant le paragraphe 3 du présent article.

Annexe 1 : Liste des agents déclarants soumis à la collecte statistique des marchés monétaires et résidant en France

Liste des agents soumis à la collecte statistique des marchés monétaires conformément à l'article 2, alinéa (2) du règlement (UE) n°1333/2014.

Nom de l'agent déclarant	CIB	LEI
Banque fédérative du crédit mutuel	11808	VBHFXSYT7OG62HNT8T76
BNP Paribas	30004	R0MUWSFPU8MPRO8K5P83
BPCE	16188	9695005MSX1OYEMGDF46
Caisse des dépôts et consignations – section générale	40031	969500Q2PFTTP0Y5QL44
Caisse Fédérale de Crédit Mutuel	10278	969500LFTDNMONT2EP08
Crédit Agricole Corporate and Investment Bank	31489	1VUV7VQFKUOQSJ21A208
Crédit Agricole S.A.	30006	969500TJ5KRTCJQWXH05
Crédit Lyonnais	30002	9695009F5UPB9IIT298
Dexia Crédit Local	17290	F4G136OIPBYND1F41110
HSBC France	30056	F0HUI1NY1AZMJMD8LP67
La Banque Postale	20041	96950066U5XAAIRCPA78
Natixis	30007	KX1WK48MPD4Y2NCUIZ63
Société Générale	30003	O2RNE8IBXP4R0TD8PU41

Liste additionnelle des agents soumis à la collecte statistique des marchés monétaires conformément à l'article 2, alinéa (3) du règlement (UE) n°1333/2014, à compter du 1^{er} juillet 2024

Nom de l'agent déclarant	CIB	LEI
BRED – Banque Populaire	10107	NICH5Q04ADUV9SN3Q390
CACEIS Bank	18129	96950023SCR9X9F3L662
Crédit Industriel et Commercial (CIC)	30066	N4JDFKKH2FTD8RKFXO39

Liste des agents pour lesquels l'obligation déclarative est retirée.

Nom de l'agent déclarant	CIB	LEI	Date d'effet
Dexia Crédit Local	17290	F4G136OIPBYND1F41110	1er janvier 2024
Caisse Fédérale de Crédit Mutuel	10278	969500LFTDNMONT2EP08	1er juillet 2024