

GESTION GLOBALE DES GARANTIES

Cahier des charges Contreparties Partie 2

Format des échanges avec la Banque de France- Adaptations T2S

Avril 2016

1.	APPORT DE COLLATÉRAL DANS LE POOL.....	4
2.	CONFIRMATION DE DÉNOUEMENT D’UN APPORT DE COLLATÉRAL.....	14
3.	RESTITUTION DE COLLATÉRAL DU POOL	19
4.	CONFIRMATION DE DÉNOUEMENT D’UNE RESTITUTION DE COLLATÉRAL	29
5.	CAS D’UNE NEUTRALISATION	33
	<i>Neutralisation : Détail du format de message MT 544 envoyés vers les contreparties pour confirmer la livraison des titres dans le Pool 3G.....</i>	<i>34</i>
6.	MODIFICATION DU MONTANT DE CRÉDIT RÉSERVÉ.....	38
7.	MESSAGE DE REJET D’UNE INSTRUCTION D’APPORT OU DE RESTITUTION.....	41
1.	FORMAT DU MESSAGE	41
2.	TABLEAU DES MOTIFS DE REJET	43
8.	RELEVÉ DE PORTEFEUILLE.....	44
9.	SPÉCIFICITÉS DU RÈGLEMENT-LIVRAISON CCBM	49
1.	CAS GÉNÉRAL : AVEC OU SANS LIEN.	50
2.	CAS DES EURO-BONDS.....	50
3.	IMPACT DE LA MIGRATION DES CSD SUR LE FORMAT DES MESSAGES	51
4.	INSTRUCTIONS D’APPORT	52
5.	INSTRUCTIONS DE RESTITUTION	56

Ce document a pour objectif de préciser comment, avec le passage à T2S, devront être formatés :

- les messages Swift de Règlement Livraison entre les clients 3G et la Banque de France (MT540/544 et MT542/546), pour les apports et restitutions en Euroclear France de collatéral dans les pools 3G BDF, BDF en tant que HCB.
- les messages Swift de règlement livraison entre les clients 3G et la BDF pour les apports et restitutions de titres dans le cadre du CCBM et CROSS CSD, BDF en tant que HCB.
- les autres messages, concernant les relevés de portefeuille et crédit réservé pour lesquels il n'y a aucune modification dans le cadre T2S

Il pointe sur les modifications apportées à ces messages par rapport aux messages actuellement utilisés, **à la réserve près, des modifications ultérieures qu'Euroclear France** pourraient demander à la communauté bancaire française.

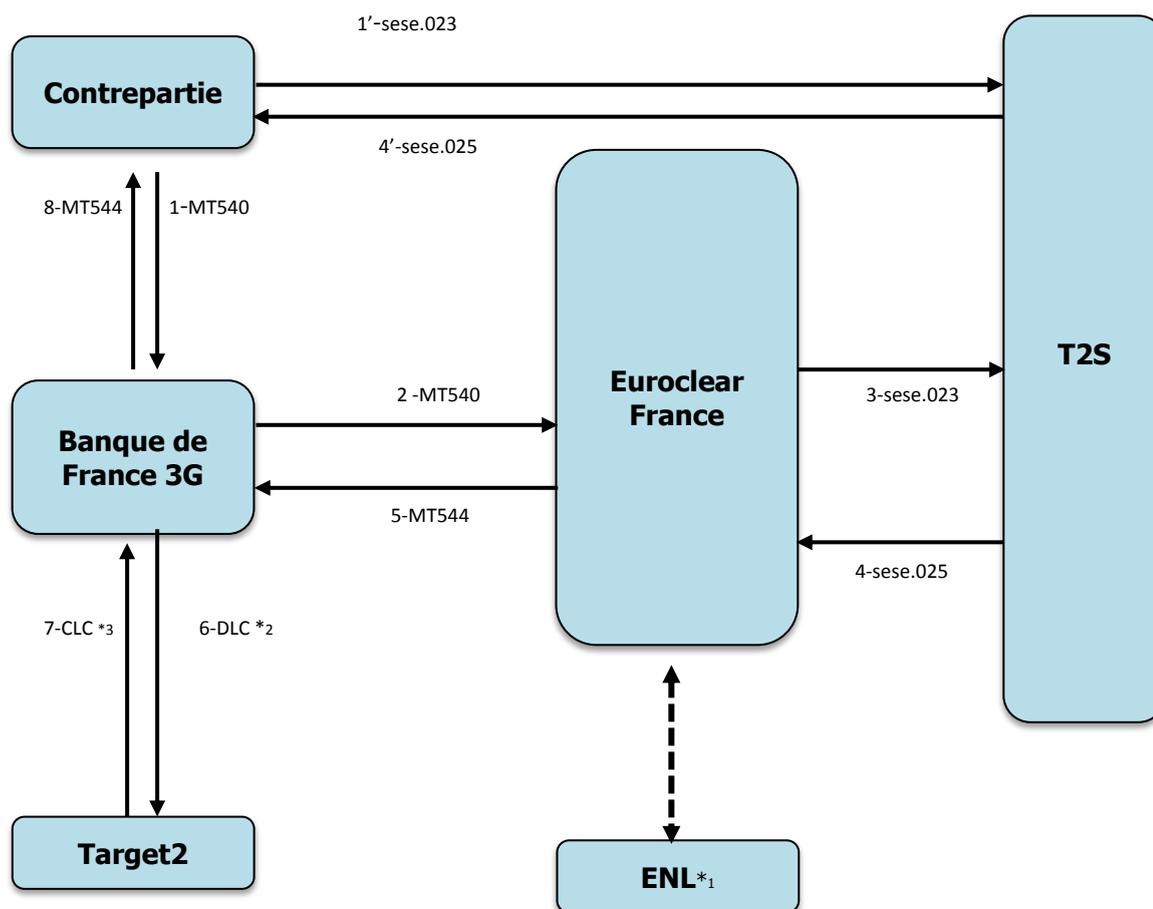
Remarque : les messages décrits ci-dessous s'appliquent pour **tous les titres négociables** (titres réglés-livrés en Euroclear France et titres éligibles étrangers) ainsi que pour les **créances privées étrangères transférées via le CCBM**. La procédure de cession des créances privées domestiques reste inchangée (utilisation du système TRICP).

En sus des messages décrits ci-dessous, la Banque de France émet également des messages MT564 et MT566 pour l'annonce et la confirmation des OST. Ces messages ne présentant pas de particularités liées au pool de collatéral ne sont pas détaillés dans ce document.

1. Apport de collatéral dans le pool

Apport Euroclear France

Participant direct (DCP)

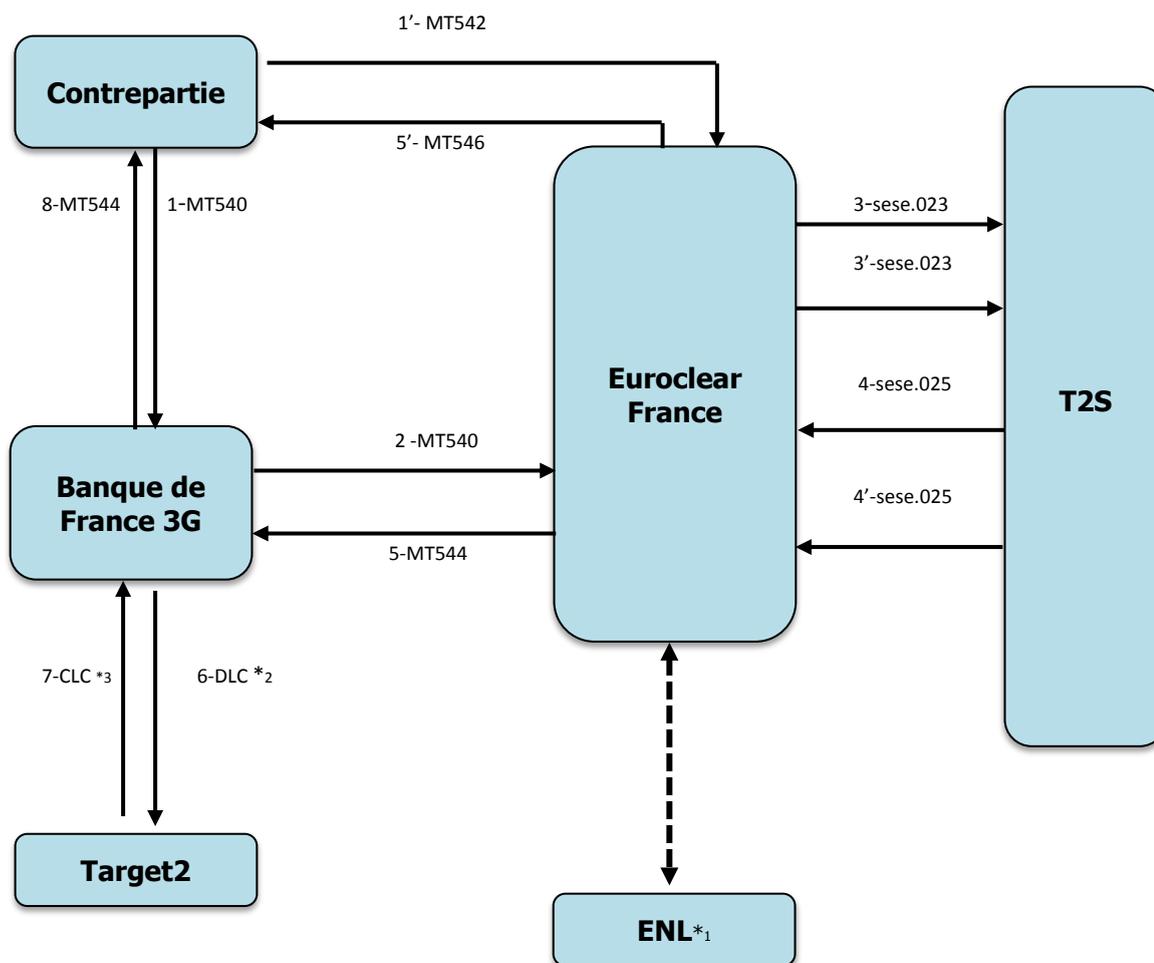


*₁Extension du membership si le titre est déposé en ENL.

*₂ DLC : Demande de la ligne de crédit

*₃ CLC : Confirmation de la ligne de crédit

Participant indirect (ICP)



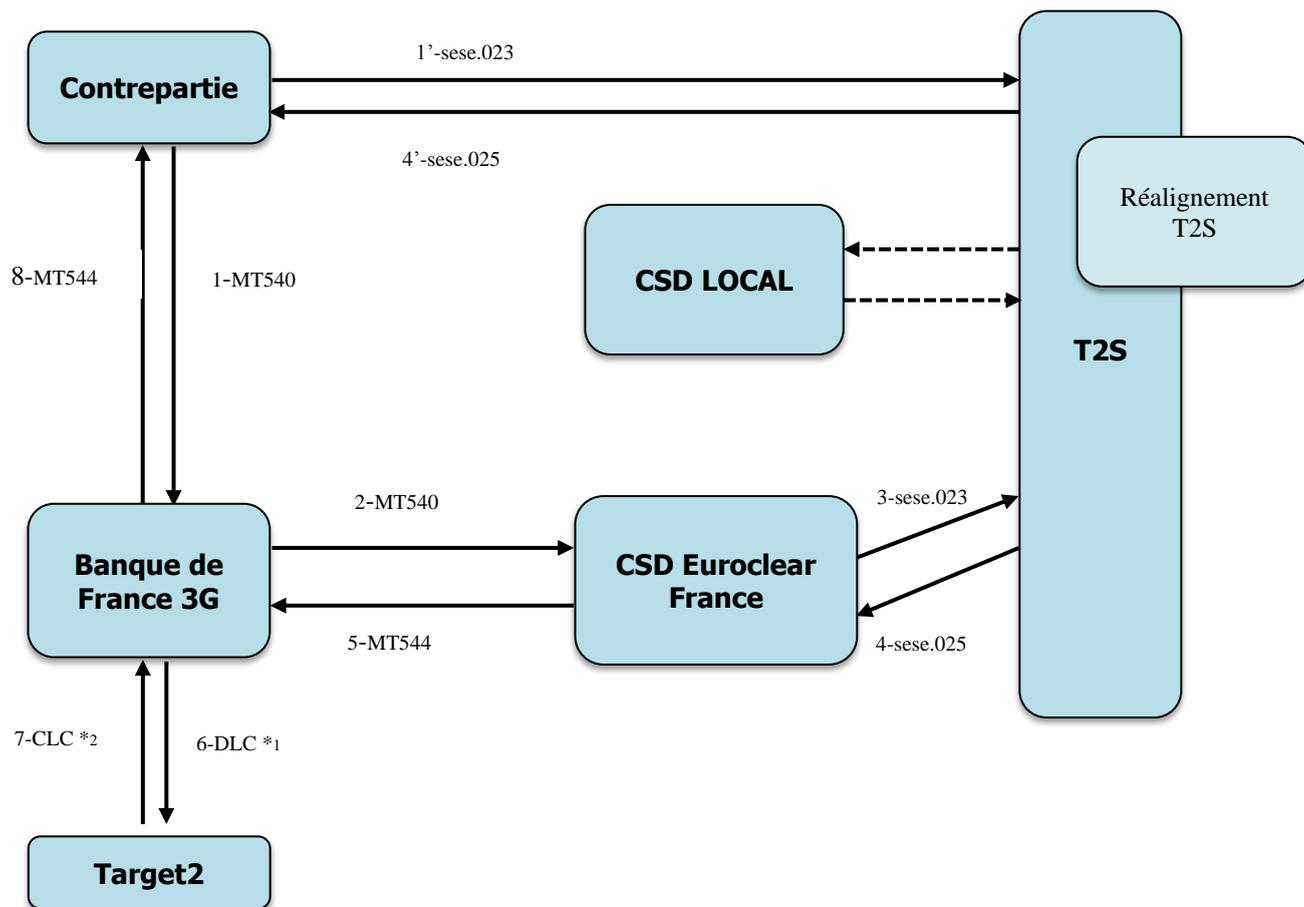
*₁Extension du membership si le titre est déposé en ENL.

*₂ DLC : Demande de la ligne de crédit

*₃ CLC : Confirmation de la ligne de crédit

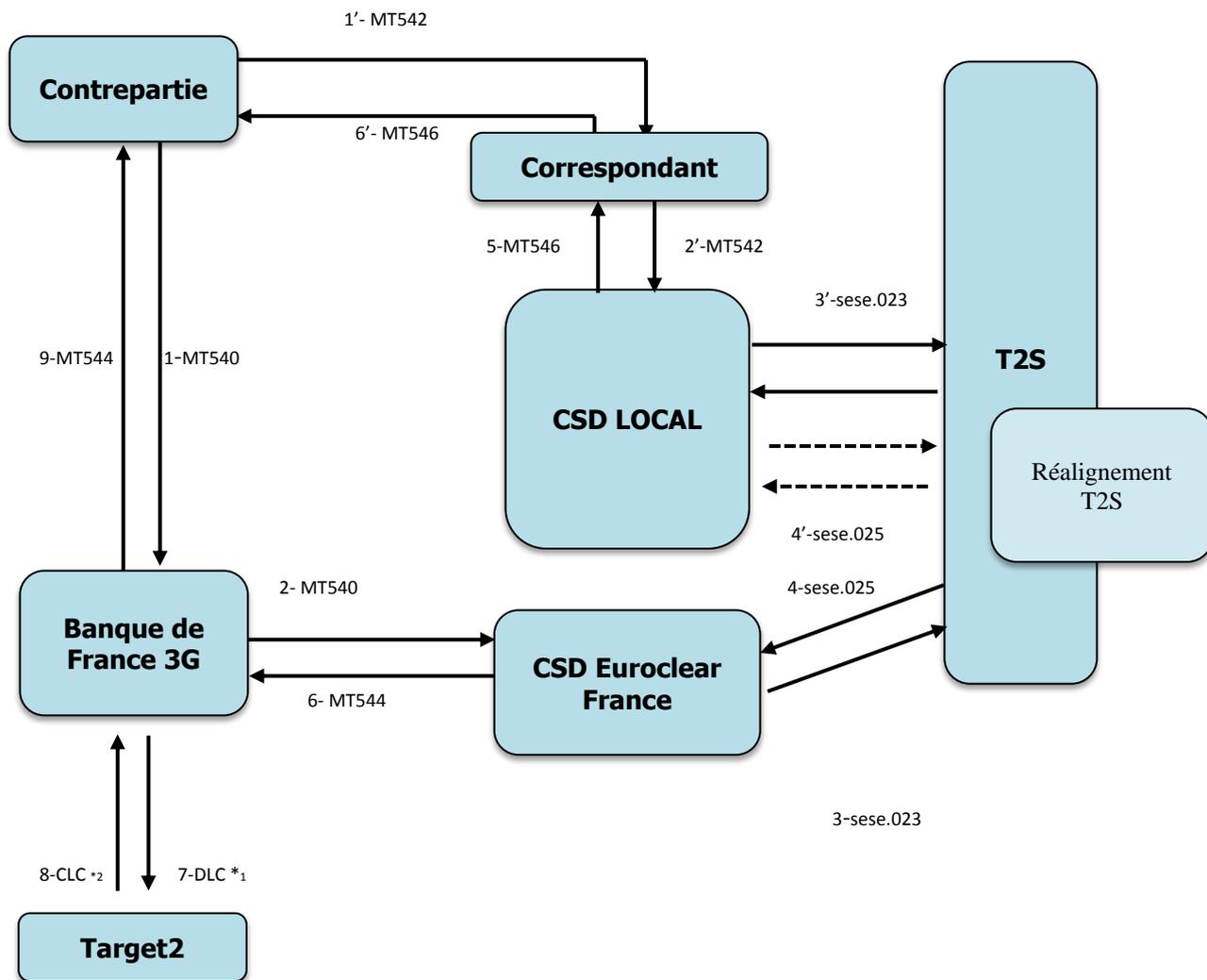
Apport Cross CSD en HCB

Participant direct (DCP)



*1 DLC : Demande de la ligne de crédit
*2 CLC : Confirmation de la ligne de crédit

Pour un participant indirect (ICP)

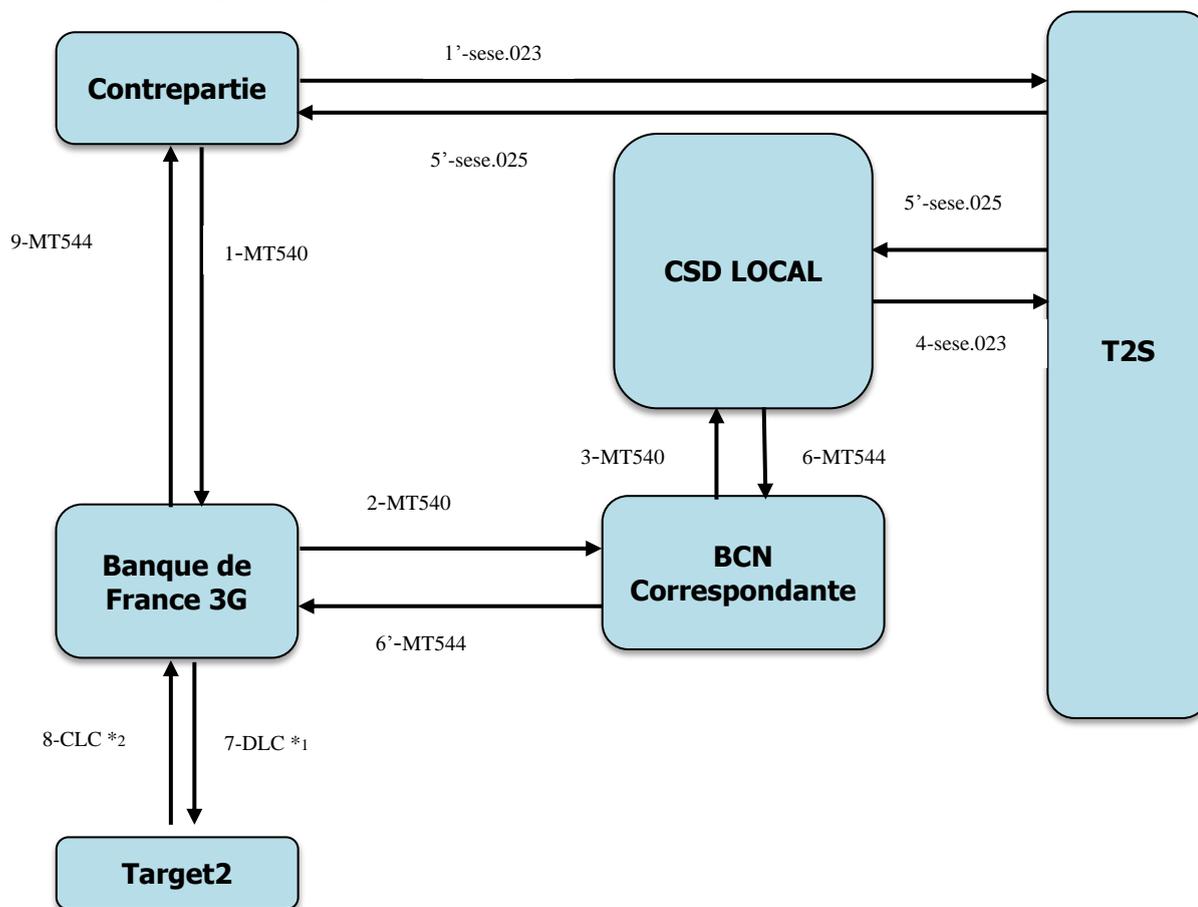


*₁ DCL : Demande de la ligne de crédit

*₂ CLC : Confirmation de la ligne de crédit

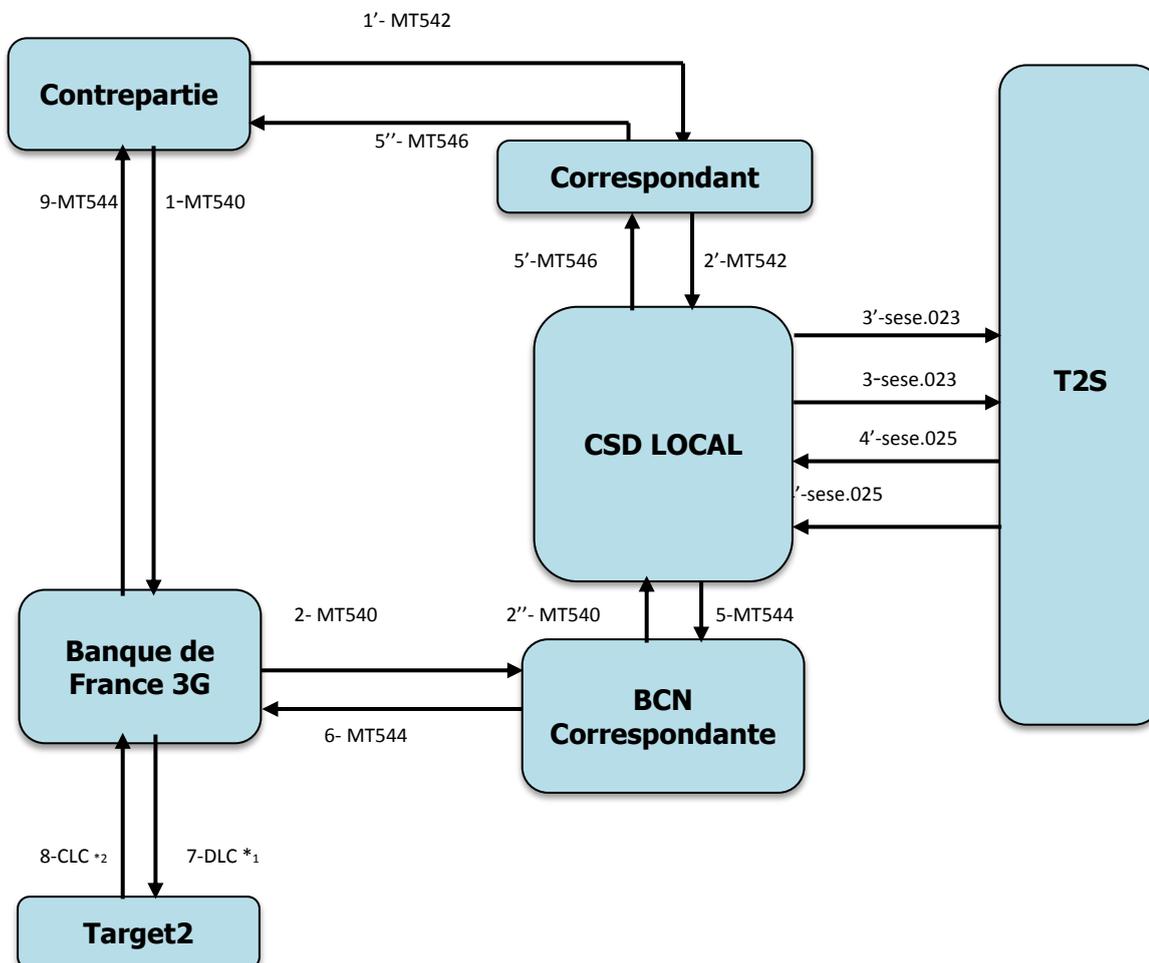
Apport des actifs en CCBM

Pour un participant direct (DCP)



*1 DCL : Demande de la ligne de crédit
 *2 CLC : Confirmation de la ligne de crédit

Pour un participant indirect (ICP)



*₁ DCL : Demande de la ligne de crédit

*₂ CLC : Confirmation de la ligne de crédit

- MESSAGE SWIFT MT540 POOL-

Remarque : le statut des champs est indiqué à "M" (mandatory) quand il est obligatoire et "O" (optionnel).

Status	Field	Qualifier	Generic field name	Detailed field name	Content/Options	Comments
Mandatory Sequence A - General information						
M	16R			Start of block	GENL	
M	20C	SEME	Reference	Sender's reference	:4 !c//16x SEME//	A l'initiative de l'émetteur du message
M	23G			Function of the message	4!c/4 !c] « NEWM » « CANC »	« NEWM » pour un nouveau message « CANC » pour annuler un message envoyé précédemment
M	98a	PREP	Date/Time	Preparation date/time	4 !c/8 !n Option A « PREP »//yyyymmdd	Date de préparation du message

Optional Repetitive Subsequence A1 - Linkages

O	16R			Start of block	LINK	
O	20C	4 !c	Reference	Common reference	:4 !c//16x « COMM »//16x	COMM//16x Common Trade Reference : Critère de matching optionnel
O	16S			End of block	LINK	

Optional Repetitive Subsequence A1 - Linkages

O	16R			Start of block	LINK	
O	20C	4 !c	Reference	Related reference	:4 !c//16x « PREV »//TRN	« PREV » + TRN du message annulé pour les messages d'annulation
O	16S			End of block	LINK	

End of Sequence A - General information

M	16S			End of block	GENL	
---	-----	--	--	--------------	------	--

Mandatory Sequence B - Trade details

M	16R			Start of block	TRADDET	
M	98a	4 !c	Date/time	Option A	:4 !c/8 !n « SETT »//yyyymmdd	Date de livraison = date de valeur de l'opération
M	98a	4 !c	Date/time	Option A	4 !c/8 !n « TRAD »//yyyymmdd	Date de négociation = date d'initialisation de l'opération. Cette date doit être identique à celle qui a été transmise à votre correspondant livreur des titres Pour un dénouement en Euroclear France, toujours instruire avec Date de négociation = Date de livraison
M	35B			Identification of the financial instrument	[[ISIN !e12 !c] [4*35x]	Code ISIN du titre + (optionnel) libellé de la valeur Ou LOAN suivi du numéro identifiant de la créance privée fournie au préalable par la banque centrale correspondante + DEBT suivi du n° identifiant du débiteur pour les créances privées étrangères
O	22F	4 !c	Indicator	Trade Transaction Condition Indicator	4 !c/4 !c « TTCO »//4 !c	TTCO//CCPN ou XCPN : critère de matching additionnel

Mandatory Subsequence B1 - Financial Instrument attributes

M	16R			Start of block	FIA	
M	11A	DENO	Currency	Currency of denomination	:4 !c/3 !a « DENO »//ISO	Code ISO de la devise
M	16S			End of block	FIA	

End of sequence B - Trade details

M	16S			End of block	TRADDET	
---	-----	--	--	--------------	---------	--

Mandatory sequence C - Financial instrument account

M	16R			Start of block	FIAC	
M	36B	SETT	Quantity of financial instrument	Quantity of financial instrument to be settled	4 !c/4 !c/15d « SETT »// type/quantity	Le type est UNIT si la quantité est exprimée en nombre de titres ou FAMT si elle est exprimée en capital (FAMT pour les créances privées étrangères)
M	97a	4 !c	Account	Option A	:4 !c/35 x « SAFE »	A servir avec le n° du compte d'instruments financiers gagé
M	16S			End of block	FIAC	

Mandatory sequence E – Settlement details

M	16R			Start of block	SETDET	
M	22F	4 !c	Indicator	Option A	4 !c/4 !c ; « SETR »// COLI »	Remise de collatéral
M	22F	4 !c	Indicator	Option A	4 !c/4 !c ; « STCO »// «NPAR»	Dénouement partiel non autorisé pour la politique monétaire. Indiquer la mention NPAR
O	22F	4 !c	Indicator		4 !c/4 !c ; « STCO »// «NOMC»	STCO//NOMC : critère de matching additionnel Mandatory pour les instructions marché envoyées vers NBB SSS

Repetitive mandatory subsequence E1 – Settlement parties

M	16R			Start of block	SETPRTY	
M	95a	4 !c	Party	Option P	Option P 4 !c/4 !a2 !a2 !a[3 !c] SELL//BIC code of initiating counterparty	“SELL” + Code BIC de la contrepartie française initiatrice de l’opération
M	16S			End of block	SETPRTY	

M	16R			Start of block	SETPRTY	
---	-----	--	--	----------------	---------	--

M	95a	4 !c	Party	Option P ou R	Option P 4 !c/4 !a2 !a2 !a[3 !c] DEAG//BIC of the delivery agent Option R 4 !c/8c/34x DEAG//issuer code/proprietary code	L'utilisation de l'une ou l'autre option est fonction du pays correspondant pour les titres étrangers OPTION P : code BIC du correspondant OPTION R : donnée propre à chaque système de règlement/livraison Pour Euroclear France : -95R:: DEAG/EGSP/code participant EOF sur 12 caractères (ex : 000000000999 pour le code participant EOF 999). N.B : l'ancien « Qualifier » SICV n'est plus autorisé et sera remplacé par EGSP.
O	97A	SAFE	Account	Safekeeping Account	4!c//35x SAFE//NDC/sscpte/ICP G	"SAFE" + Nature de compte + Sous-compte +ICPG ex:SAFE//000/L10/0 ex : SAFE//000/LM0123456789/0
M	16S			End of block	SETPRTY	
O	16R			Start of block	SETPRTY	
O	95a	4 !c	Party	Option R	Option R 4 !c/8c/34x DECU//issuer code/proprietary code	A servir uniquement dans le cas de la Grèce quand Euroclear Bank ou Clearstream sont concernés
M	16S			End of block	SETPRTY	
M	16R			Start of block	SETPRTY	
M	95a	4 !c	Party	Option P	Option P 4 !c/4 !a2 !a2 !a[3 !c] PSET//BIC code of place of settlement	"PSET" + code BIC du CSD où les titres seront livrés - titres Euroclear France : SICVFRPPXXX - titres NL/BE/IT admis en Euroclear France : SICVFRPPXXX en cross CSD ou BIC du CSD local en circuit CCBM - BIC de la banque centrale correspondante pour les créances privées étrangères N.B : Euroclear France attend un BIC 11 uniquement (rejet des instructions avec BIC sur 8 caractères)
M	16S			End of block	SETPRTY	
M	16S			End of block	SETDET	

2. Confirmation de dénouement d'un apport de collatéral

- MESSAGE MT544 POOL -

Remarque : le statut des champ est indiqué à "M"(mandatory) quand il est obligatoire et "O" (optionnel).

Status	Field	Qualifier	Generic field name	Detailed field name	Content/Options	Comments
--------	-------	-----------	--------------------	---------------------	-----------------	----------

Mandatory Sequence A - General information

M	16R			Start of block	GENL	
M	20C	SEME	Reference	Sender's reference	:4 !c//16x SEME// structured TRN	Structure du TRN : AAAAABBBBBBCCC avec AAAAA = 30001 = CIB BDF BBBBBB = date sur 6 num (AAMMJJ) CCC = compteur réinitialisé tous les jours
M	23G			Function of the message	4!c[4 !c] « NEWM»	Sera toujours servi à "NEWM"

Mandatory Subsequence A1 - Linkages

M	16R			Start of block	LINK	
M	20C	4 !c	Reference	Related reference	4 !c//16x « RELA»//	« RELA » + TRN du message d'origine (MT540 de livraison)
M	16S			End of block	LINK	

Mandatory Subsequence A1 - Linkages

M	16R			Start of block	LINK	
---	-----	--	--	----------------	------	--

M	20C	4 !c	Reference	Market Infrastructure Reference	4 !c//16x « MITI »//	« MITI » + référence T2S
M	16S			End of block	LINK	

Optional Repetitive Subsequence A1 – Linkages

O	16R			Start of block	LINK	
O	20C	4 !c	Reference	Common reference	:4 !c//16x « COMM »//16x	COMM//16x Common Trade Reference : Critère de matching optionnel
O	16S			End of block	LINK	

End of Sequence A - General information

M	16S			End of block	GENL	
---	-----	--	--	--------------	------	--

Mandatory Sequence B - Trade details

M	16R			Start of block	TRADDET	
M	98a	4 !c	Date/time	Option A	:4 !c//8 !n « ESET »//yyyymmdd	Date de livraison effective
M	98a	4 !c	Date/time	Option A	4 !c//8 !n « TRAD »//yyyymmdd	Date de négociation
M	90a	4 !c	Deal price	Option A	:4!c//4!c//15d « DEAL »// « PRCT »// haircut	Décote applicable au titre (ou à la créance privée)
M	35B			Identification of the financial instrument	[ISIN !e12 !c] [4*35x]	« ISIN » + code ISIN du titre Ou « LOAN » suivi du numéro identifiant de la créance
O	22F	4 !c	Indicator	Trade Transaction Condition Indicator	4 !c//4 !c « TTCO »//4 !c	TTCO//CCPN ou XCPN : critère de matching additionnel

Mandatory Subsequence B1 – Financial Instruments attributes

M	16R			Start of block	FIA	
M	11A	DENO	Currency	Currency of denomination	:4 !c//3 !a « DENO »// ISO	Code ISO de la devise

M	98A	4 !c	Date		4 !c/8 !n « COUP »//yyyyymmdd « MATU »//yyyyymmdd	Date du prochain coupon (sauf dans le cas d'une créance privée étrangère) Date d'échéance du titre (ou de remboursement final de la créance)
O	92A	CUFC	Rate	Current pool factor	:4 !c/[N]15d ; « CUFC » current pool factor	Pool factor en vigueur pour les asset back securities (ABS) ou FCC
O	90a	4 !c	Flag	Option A Option B	4 !c/4 !c/15d « MRKT»// »PRCT»/ 4 !c/4 !c/3a15d « MRKT»// »ACTU»/	Dans le cas où le prix est exprimé en pourcentage (pour les créances privées, toujours égal à 100) Dans le cas où le prix est exprimé en nombre de titres (précisant le code ISO de la devise)
M	16R			End of block	FIA	

End of sequence B - Trade details

M	16S			End of block	TRADDET	
---	-----	--	--	--------------	---------	--

Mandatory sequence C - Financial instrument account

M	16R			Start of block	FIAC	
M	36B	4 !c	Quantity of financial instrument	Quantity of financial instrument to be settled	4 !c/4 !c/15d « ESTT »// type/quantity	Le type est UNIT si la quantité est exprimée en nombre de titres ou FAMT si elle est exprimée en capital (FAMT pour les créances privées)
M	97a	4 !c	Account	Option A	:4 !c/35 x « SAFE »//	N° du compte d'instruments financiers gagé
M	16S			End of block	FIAC	

Mandatory sequence E – Settlement details

M	16R			Start of block	SETDET	
M	22F	4 !c	Indicator	Option A	4 !c/4 !c ; « SETR »// COLI	Collatéral In
M	22F	4 !c	Indicator	Option A	4 !c/4 !c ; « STCO »// «NPAR»	Dénouement partiel non autorisé pour la politique monétaire.Mention NPAR
O	22F	4 !c	Indicator		4 !c/4 !c ; « STCO »// «NOMC»	STCO/NOMC : critère de matching additionnel

Repetitive mandatory subsequence E1 – Settlement parties

M	16R			Start of block	SETPRTY	
---	-----	--	--	----------------	---------	--

M	95a	4 !c	Party	Option P	Option P 4 !c/4 !a2 !a2 !a[3 !c] SELL//BIC code of initiating counterparty	« SELL » + Code BIC de la contrepartie française initiatrice de l'opération
M	16S			End of block	SETPRTY	
M	16R			Start of block	SETPRTY	
M	95a	4 !c	Party	Option P ou R	Option P 4 !c/4 !a2 !a2 !a[3 !c] DEAG//BIC of the delivery agent Option R 4 !c/8c/34x DEAG/issuer code/proprietary code	L'utilisation de l'une ou l'autre option est fonction du pays correspondant pour les titres étrangers OPTION P : code BIC du correspondant OPTION R : donnée propre à chaque système de règlement/livraison Pour Euroclear France : :95R::DEAG/EGSP/n°compte sur 12 caractères (ex : 00000000999 pour le code participant EOF 999)
O	97A	SAFE	Account	Safekeeping Account	4!c//35x SAFE//NDC/sscpte/ICPG	"SAFE" + Nature de compte + Sous-compte +ICPG ex:SAFE//000/L10/0 ex : SAFE//000/LM0123456789/0
M	16S			End of block	SETPRTY	
M	16R			Start of block	SETPRTY	
M	95a	4 !c	Party	Option P	Option P 4 !c/4 !a2 !a2 !a[3 !c] PSET//BIC code of place of settlement	"PSET" + code BIC du CSD où les titres ont été livrés - titres Euroclear France : SICVFRPPXXX - titres NL/BE/IT admis en Euroclear France : SICVFRPPXXX en cross CSD ou BIC du CSD local en circuit CCBM - BIC de la banque centrale correspondante pour les créances privées étrangères
M	16S			End of block	SETPRTY	
O	16R			Start of block	SETPRTY	
O	95a	4 !c	Party	Option R	Option R 4 !c/8c/34x DECU//issuer code/proprietary code	A servir uniquement dans le cas de la Grèce quand Euroclear Bank ou Clearstream sont concernés
O	16S			End of block	SETPRTY	

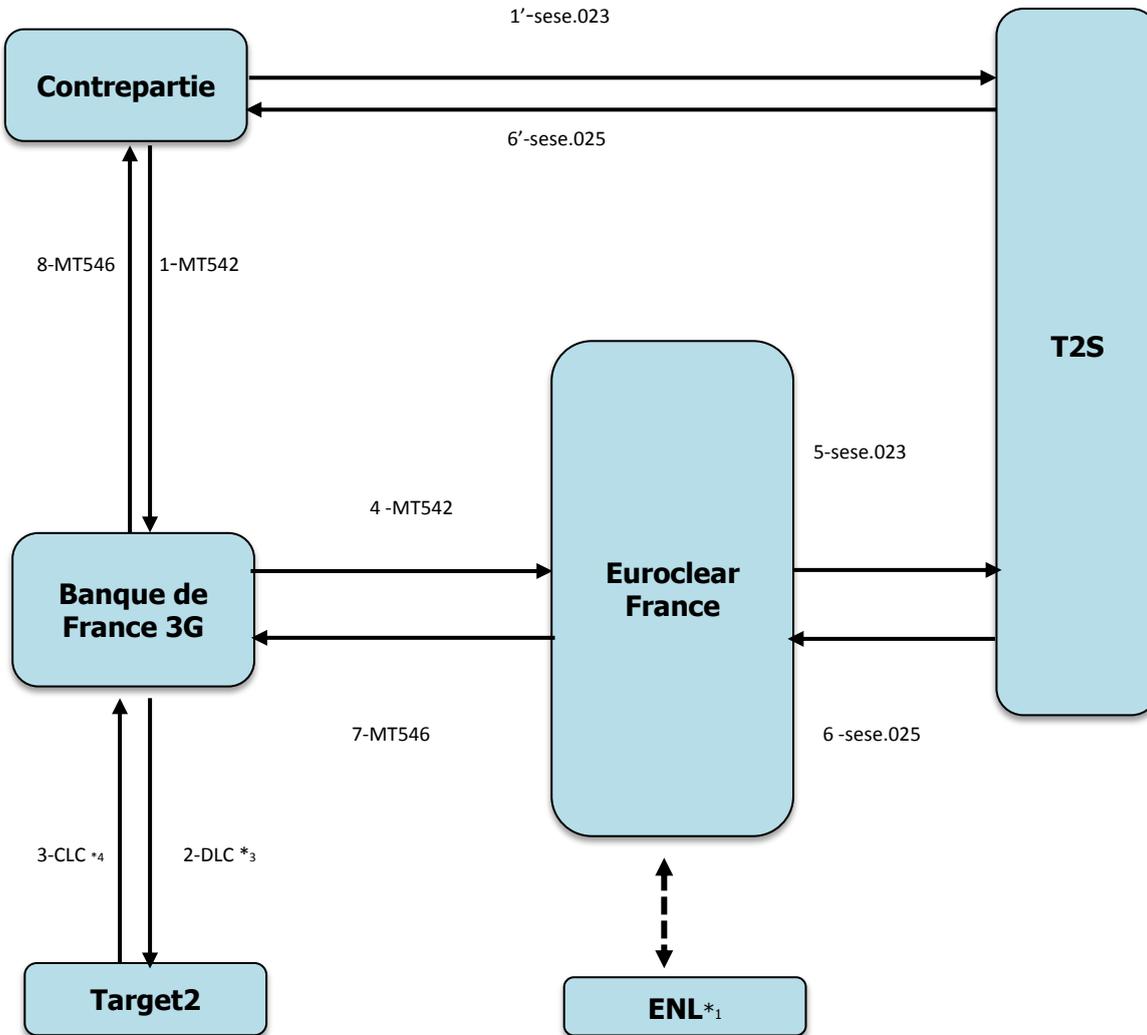
Mandatory subsequence E3 – amounts

M	16R			Start of block	AMT	
M	19A	4 !c	Amount		4 !c/3 !a15d « ACRU »//currency code plus accrued interest amount	Montant total des intérêts dans la devise du titre (renseigné à 0 pour les créances privées)
O	19A	4 !c	Amount		4 !c/3 !a15d « RESU »//currency code plus amount result from exchange of currency	Montant total des intérêts en euros si la devise du titre n'est pas l'euro, après application du taux de change
O	92B	EXCH	Rate		4 !c/3 !a/3 !a/15d « EXCH »//ISO code of the first currency/ISO code of the second currency/exchange rate	Devise du titre, devise euro et taux de change utilisé. Ces 2 champs optionnels (19A et 92B) doivent obligatoirement être servis ensemble
M	16S			End of block	AMT	
M	16S			End of block	SETDET	

3. Restitution de collatéral du pool

Restitution Euroclear France

Participant direct (DCP)



*₁Extension du membership si le titre est déposé en ENL.

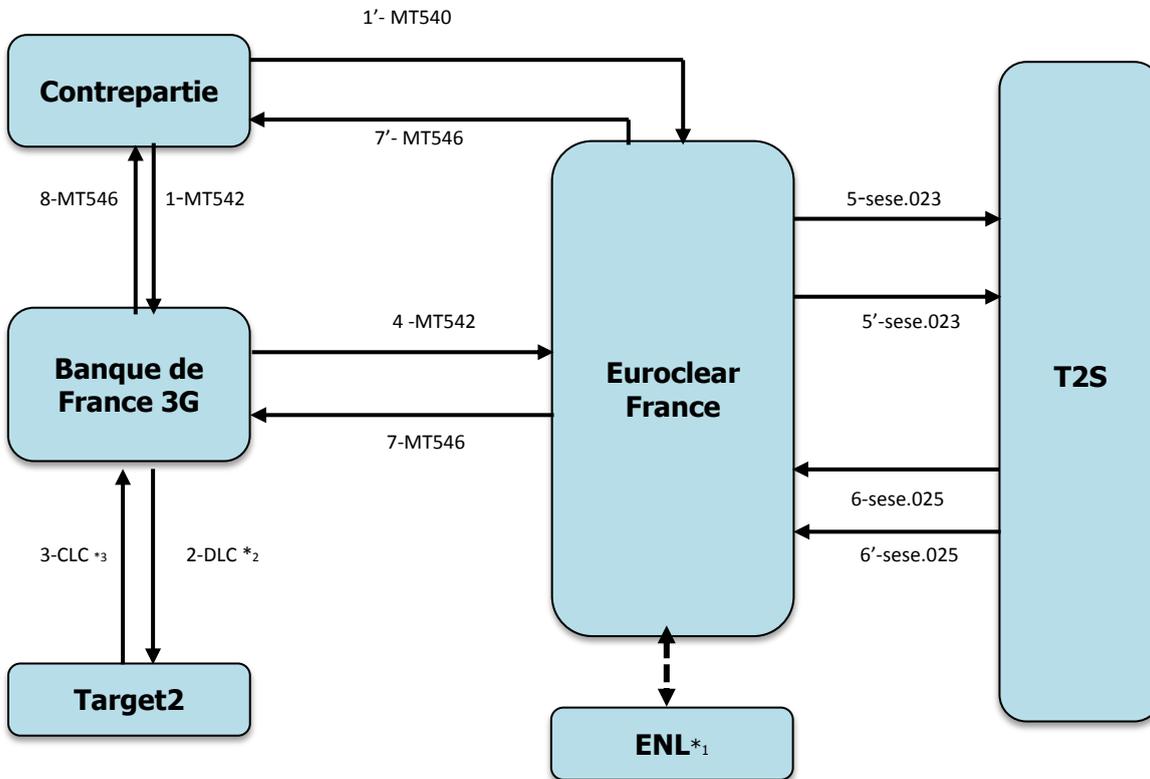
*₂ CD : Confirmation de dénouement

*₃ DCL : Demande de la ligne de crédit

*₄ CLC : Confirmation de la ligne de crédit

Restitution Euroclear France

Participant indirect (ICP)

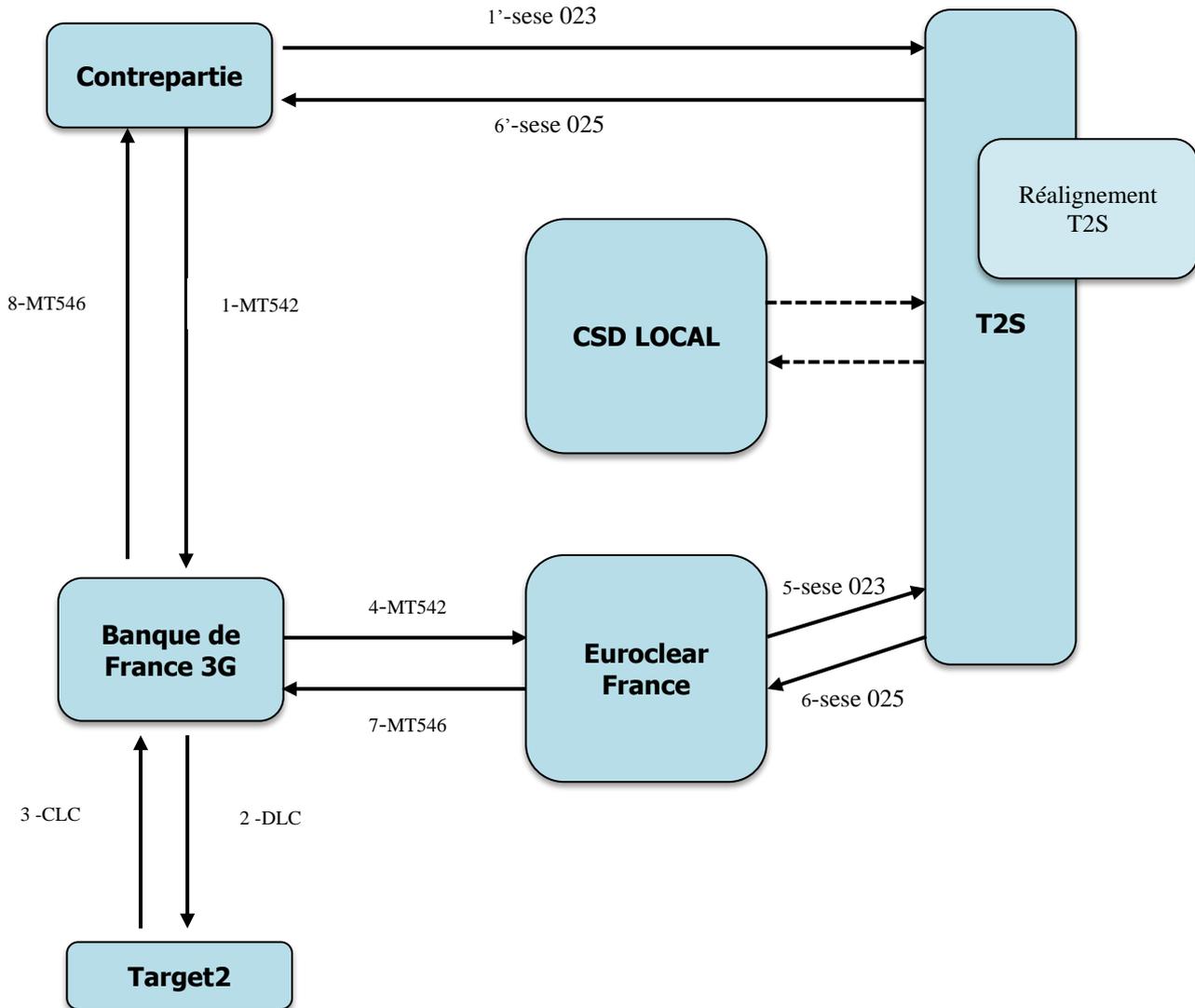


*₁Extension du membership si le titre est déposé en ENL.

*₂ DCL : Demande de la ligne de crédit

*₃CLC : Confirmation de la ligne de crédit

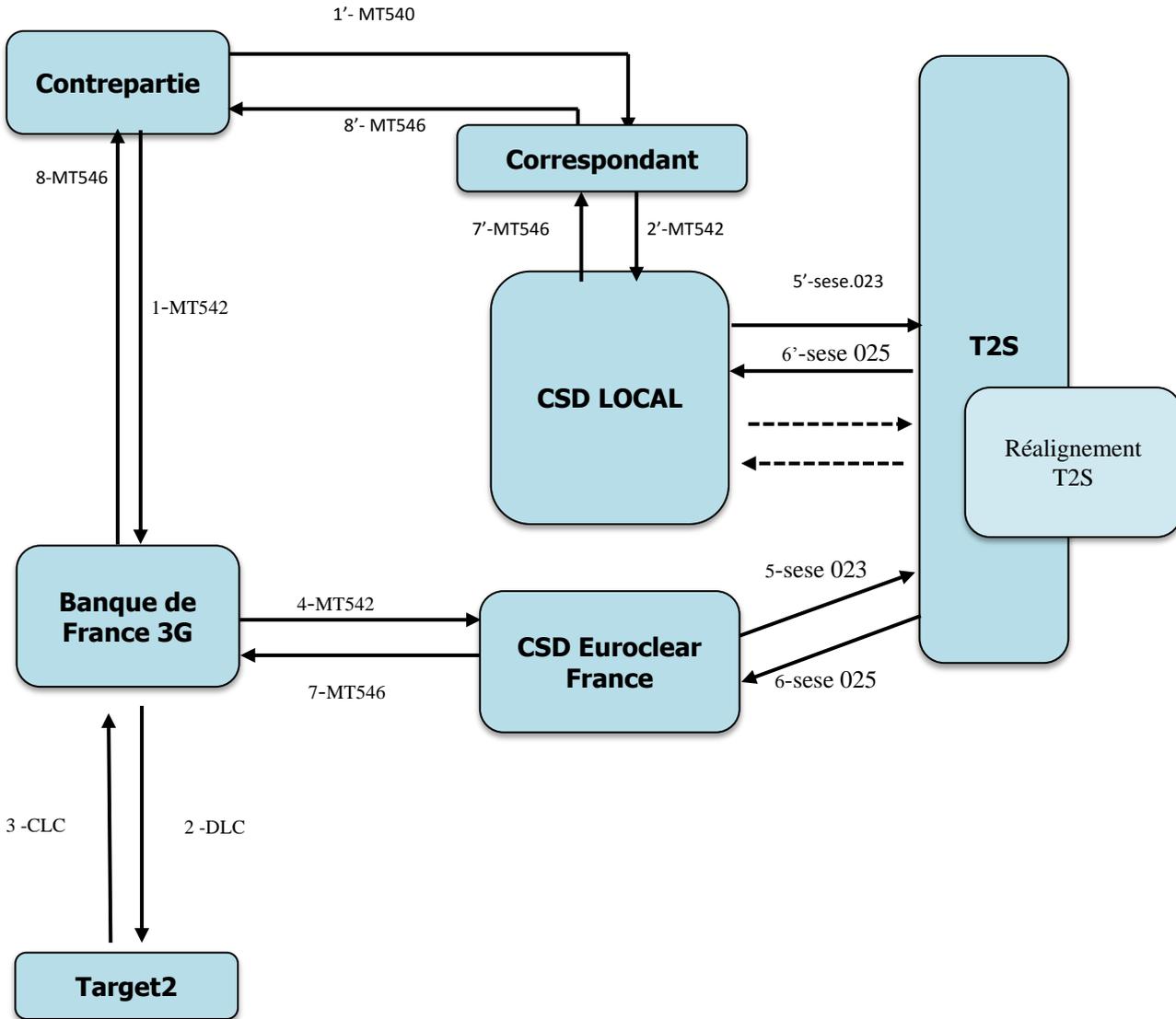
*Restitution Cross CSD en HCB
Participant direct (DCP)*



*₁ DCL : Demande de la ligne de crédit

*₂ CLC : Confirmation de la ligne de crédit

Pour un participant indirect (ICP)

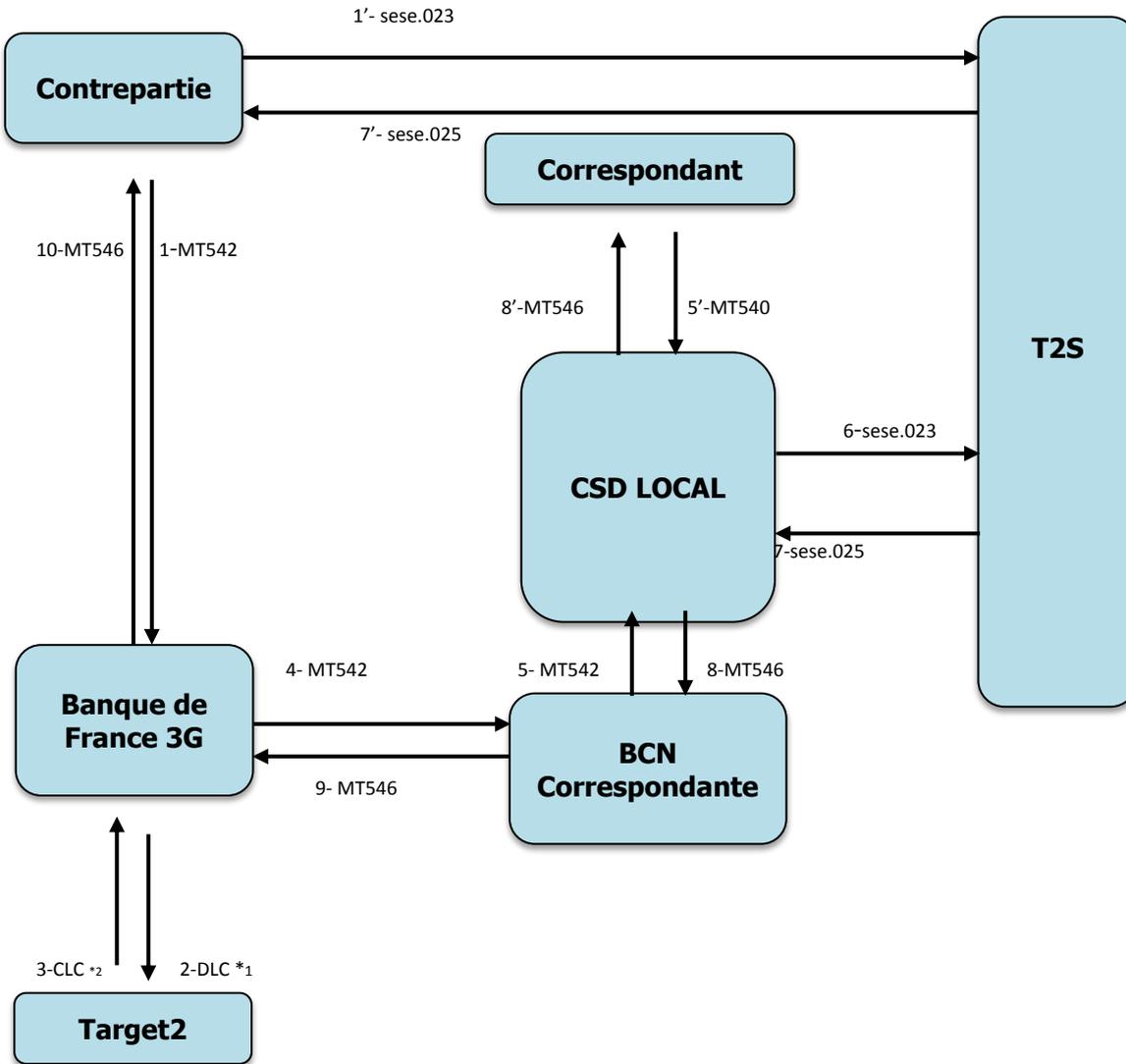


*₁ DLC : Demande de la ligne de crédit

*₂ CLC : Confirmation de la ligne de crédit

Restitution d'actifs en CCBM

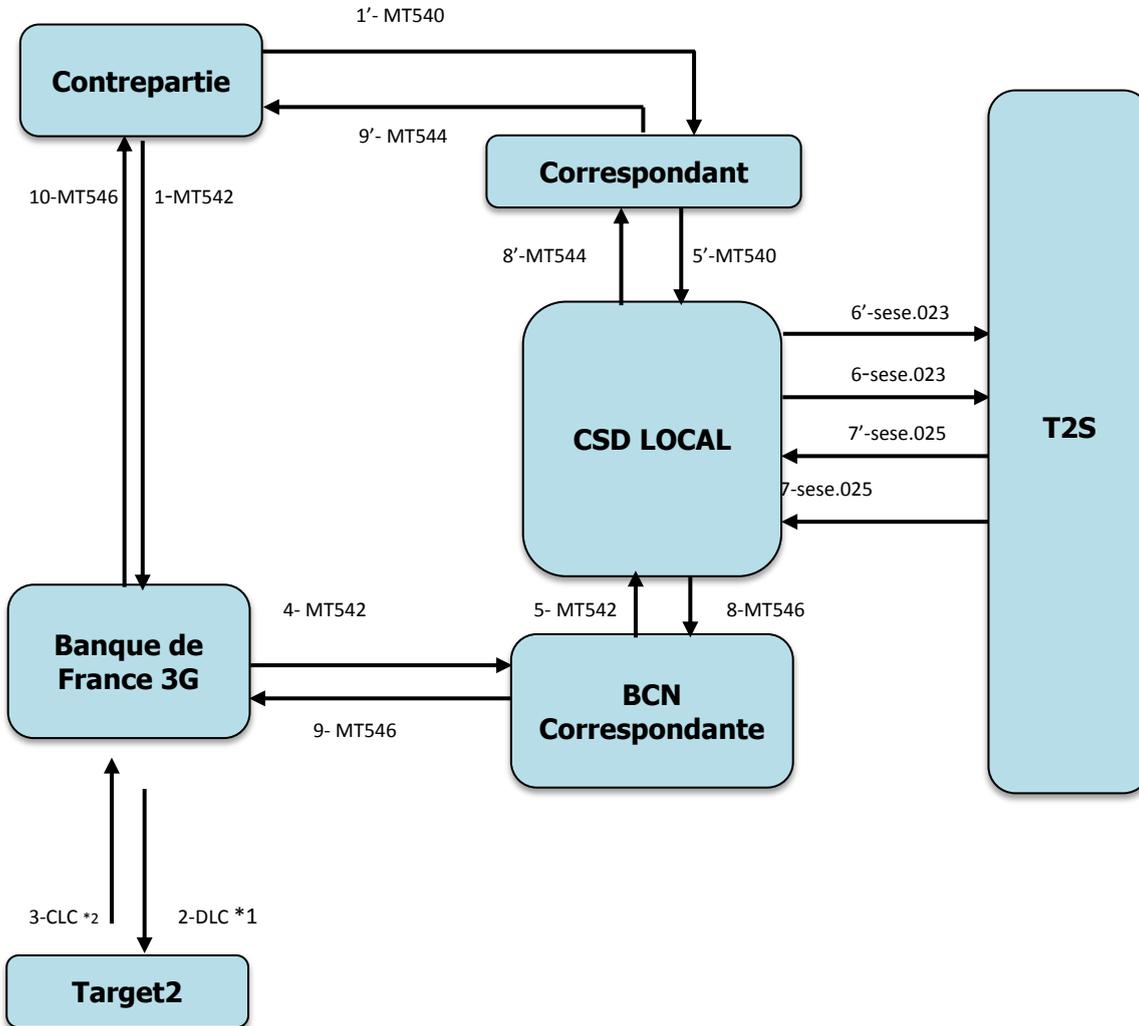
Participant direct (DCP)



*₁ DCL : Demande de la ligne de crédit

*₂ CLC : Confirmation de la ligne de crédit

Participant indirect (ICP)



*₁ DLC : Demande de la ligne de crédit

*₂ CLC : Confirmation de la ligne de crédit

- MESSAGE SWIFT MT542 POOL-

Remarque : le statut des champs est indiqué à "M" (mandatory) quand il est obligatoire et "O" (optionnel).

Status	Field	Qualifier	Generic field name	Detailed field name	Content/Options	Comments
--------	-------	-----------	--------------------	---------------------	-----------------	----------

Mandatory Sequence A - General information

M	16R			Start of block	GENL	
M	20C	SEME	Reference	Sender's reference	:4 !c//16x SEME//	A l'initiative de l'émetteur du message
M	23G			Function of the message	4!c/4 !c] « NEWM » « CANC »	« NEWM » pour un nouveau message « CANC » pour annuler un message envoyé précédemment
M	98a	PREP	Date/Time	Preparation date/time	4 !c//8 !n Option A « PREP»//yyyymmdd	Date de préparation du message

Optional Repetitive Subsequence A1 - Linkages

O	16R			Start of block	LINK	
O	20C	4 !c	Reference	Common reference	:4 !c//16x « COMM »//16x	COMM//16x Common Trade Reference : Critère de matching optionnel
O	16S			End of block	LINK	

Optional Repetitive Subsequence A1 – Linkages

O	16R			Start of block	LINK	
O	20C	4 !c	Reference	Related reference	:4 !c//16x « PREV»//TRN	« PREV » + TRN du message annulé pour les messages d'annulation
O	16S			End of block	LINK	

End of Sequence A - General information

M	16S			End of block	GENL	
---	-----	--	--	--------------	------	--

Mandatory Sequence B - Trade details

M	16R			Start of block	TRADDET	
M	98a	4 !c	Date/time	Option A	:4 !c//8 !n « SETT »//yyyyymmdd	Date de livraison = date de valeur de l'opération
M	98a	4 !c	Date/time	Option A	4 !c//8 !n « TRAD »//yyyyymmdd	Date de négociation = date d'initialisation de l'opération. Cette date doit être identique à celle qui a été transmise à votre correspondant réceptionneur des titres Pour un dénouement en Euroclear France, toujours instruire avec Date de négociation = Date de livraison
M	35B			Identification of the financial instrument	[[ISIN !e12 !c] [4*35x]	Code ISIN du titre + (optionnel) libellé de la valeur Ou LOAN suivi du numéro identifiant de la créance privée fournie au préalable par la banque centrale correspondante + DEBT suivi du n° identifiant du débiteur pour les créances privées étrangères
O	22F	4 !c	Indicator	Trade Transaction Condition Indicator	4 !c/4 !c « TTCO »//4 !c	TTCO/CCPN ou XCPN : critère de matching additionnel

Mandatory Subsequence B1 - Financial Instrument attributes

M	16R			Start of block	FIA	
M	11A	DENO	Currency	Currency of denomination	:4 !c//3 !a « DENO »//ISO	Code ISO de la devise
M	16S			End of block	FIA	

End of sequence B - Trade details

M	16S			End of block	TRADDET	
---	-----	--	--	--------------	---------	--

Mandatory sequence C - Financial instrument account

M	16R			Start of block	FIAC	
M	36B	SETT	Quantity of financial instrument	Quantity of financial instrument to be settled	4 !c//4 !c/15d « SETT »// type/quantity	Le type est UNIT si la quantité est exprimée en nombre de titres ou FAMT si elle est exprimée en capital (FAMT pour les créances privées étrangères)
M	97a	4 !c	Account	Option A	:4 !c//35 x « SAFE »	A servir avec le n° du compte d'instruments financiers gagé
M	16S			End of block	FIAC	

Mandatory sequence E – Settlement details

M	16R			Start of block	SETDET	
M	22F	4 !c	Indicator	Option A	4 !c//4 !c ; « SETR//COLO »	Restitution de collatéral
	22F	4 !c	Indicator	Option A	4 !c//4 !c ; « STCO »// «NPAR»	Dénouement partiel non autorisé pour la politique monétaire. Indiquer la mention NPAR
O	22F	4 !c	Indicator		4 !c//4 !c ; « STCO »// «NOMC»	STCO/NOMC : critère de matching additionnel Mandatory pour les instructions marché envoyées vers NBB SSS

Repetitive mandatory subsequence E1 – Settlement parties

M	16R			Start of block	SETPRTY	
M	95a	4 !c	Party	Option P	Option P 4 !c//4 !a2 !a2 !a[3 !c] BUYR//BIC code of initiating counterparty	“BUYR” + Code BIC de la contrepartie française initiatrice de l’opération
M	16S			End of block	SETPRTY	

M	16R			Start of block	SETPRTY	
M	95a	4 !c	Party	Option P ou R	Option P 4 !c//4 !a2 !a2 !a[3 !c] REAG//BIC of the delivery agent Option R 4 !c/8c/34x REAG//issuer code/proprietary code	L’utilisation de l’une ou l’autre option est fonction du pays correspondant pour les titres étrangers OPTION P : code BIC du correspondant OPTION R : donnée propre à chaque système de règlement/livraison Pour Euroclear France : :95R::REAG/EGSP/Code participant EOF sur 12 caractères (ex : 00000000999 pour code 0999). L’Ancien « qualifier » SICV n’est plus autorisé
O	97A	SAFE	Account	Safekeeping Account	4!c/35x SAFE//NDC/sscpte/ICPG	"SAFE" + Nature de compte + Sous-compte +ICPG ex:SAFE//000/L10/0 ex : SAFE//000/LM0123456789/0
M	16S			End of block	SETPRTY	
M ¹	16R			Start of block	SETPRTY	

M	95a	4 !c	Party	Option P	Option P 4 !c/4 !a2 !a2 !a[3 !c] PSET//BIC code of place of settlement	"PSET" + code BIC du CSD où les titres seront livrés - titres Euroclear France : SICVFRPPXXX - titres NL/BE/IT admis en Euroclear France : SICVFRPPXXX en cross CSD ou BIC du CSD local en circuit CCBM - BIC de la banque centrale correspondante pour les créances privées étrangères
M	16S			End of block	SETPRTY	

O	16R			Start of block	SETPRTY	
O	95a	4 !c	Party	Option R	Option R 4 !c/8c/34x RECU//issuer code/proprietary code	A servir uniquement dans le cas de la Grèce quand Euroclear Bank ou Clearstream sont concernés
O	16S			End of block	SETPRTY	

End of Sequence E – Settlement Details

M	16S			End of block	SETDET	
---	-----	--	--	--------------	--------	--

4. Confirmation de dénouement d'une restitution de collatéral

- MESSAGE MT546 POOL -

Remarque : le statut des champs est indiqué à "M"(mandatory) quand il est obligatoire et "O" (optionnel).

Status	Field	Qualifier	Generic field name	Detailed field name	Content/Options	Comments
--------	-------	-----------	--------------------	---------------------	-----------------	----------

Mandatory Sequence A - General information

M	16R			Start of block	GENL	
M	20C	SEME	Reference	Sender's reference	:4 !c//16x SEME//structured TRN	Structure du TRN : AAAAABBBBBBCCC avec AAAAA = 30001 = CIB BDF BBBBBB = date sur 6 num (AAMMJJ) CCC = compteur réinitialisé tous les jours
M	23G			Function of the message	4!c/4 !c] « NEWM »	Sera toujours servi à "NEWM"

Mandatory Subsequence A1 - Linkages

M	16R			Start of block	LINK	
M	20C	4 !c	Reference	Related reference	:4 !c//16x « RELA»//	« RELA » + TRN du message d'origine (MT542 suite à demande)
M	16S			End of block	LINK	

Mandatory Subsequence A1 - Linkages

M	16R			Start of block	LINK	
M	20C	4 !c	Reference	Market Infrastructure Reference reference	4 !c//16x « MITI»//	« MITI » + référence T2S
M	16S			End of block	LINK	

Optional Repetitive Subsequence A1 – Linkages

0	16R			Start of block	LINK	
0	20C	4 !c	Reference	Related reference	:4 !c//16x « COMM »//16x	COMM//16x Common Trade Reference : Critère de matching optionnel
0	16S			End of block	LINK	

End of Sequence A - General information

M	16S			End of block	GENL	
---	-----	--	--	--------------	------	--

Mandatory Sequence B - Trade details

M	16R			Start of block	TRADDET	
M	98a	4 !c	Date/time	Option A	:4 !c//8 !n « ESET »//yyyymmdd	Date de livraison effective
M	98a	4 !c	Date/time	Option A	4 !c//8 !n « TRAD »//yyyymmdd	Date de négociation = date indiquée par la contrepartie pour une confirmation de restitution de titres.
M	35B			Identification of the financial instrument	[ISIN !e12 !c] [[4*35x]	Code ISIN du titre ou LOAN suivi du numéro d'identification de la créance privée

O	22F	4 !c	Indicator	Trade Transaction Condition Indicator	4 !c/4 !c « TCO »//4 !c	TCO//CCPN ou XCPN : critère de matching additionnel
---	-----	------	-----------	---------------------------------------	----------------------------	---

End of sequence B - Trade details

M	16S			End of block	TRADDET	
---	-----	--	--	--------------	---------	--

Mandatory sequence C - Financial instrument account

M	16R			Start of block	FIAC	
M	36B	4 !c	Quantity of financial instrument	Quantity of financial instrument to be settled	4 !c//4 !c/15d « ESTT »// type/quantity	Le type est UNIT si la quantité est exprimée en nombre de titres ou FAMT si elle est exprimée en capital (FAMT pour les créances)
M	97a	4 !c	Account	Option A	:4 !c//35 x « SAFE »//	N° du compte d'instruments financiers gagé
M	16S			End of block	FIAC	

Mandatory sequence E – Settlement details

M	16R			Start of block	SETDET	
M	22F	4 !c	Indicator	Option A	4 !c//4 !c ; « SETR »//COLO	Collatéral Out
M	22F	4 !c	Indicator	Option A	4 !c//4 !c ; « STCO »// «NPAR»	Dénouement partiel non autorisé pour la politique monétaire.Mention NPAR
O	22F	4 !c	Indicator		4 !c//4 !c ; « STCO »// «NOMC»	STCO/NOMC : critère de matching additionnel

Repetitive mandatory subsequence E1 – Settlement parties

M	16R			Start of block	SETPRTY	
M	95a	4 !c	Party	Option P	Option P 4 !c//4 !a2 !a2 !a[3 !c] BUYR//BIC code of initiating counterparty	“BUYR” + Code BIC de la contrepartie française initiatrice de l’opération
M	16S			End of block	SETPRTY	

M	16R			Start of block	SETPRTY	
M	95a	4 !c	Party	Option P ou R	Option P 4 !c//4 !a2 !a2 !a[3 !c] REAG//BIC of the delivery agent Option R 4 !c/8c/34x REAG//issuer code/proprietary code	L’utilisation de l’une ou l’autre option est fonction du pays correspondant pour les titres étrangers OPTION P : code BIC du correspondant OPTION R : donnée propre à chaque système de règlement/livraison Pour les titres en EOCF, cette option est à utiliser : :95R::REAG/ EGSP/n°compte sur 12 caractères (ex : 00000000999 pour le code participant EOF 999)
O	97A	SAFE	Account	Safekeeping Account	4!c/35x SAFE//NDC/sscpte/ICPG	"SAFE" + Nature de compte + Sous-compte +ICPG ex:SAFE/000/L10/0 ex : SAFE//000/LM0123456789/0
M	16S			End of block	SETPRTY	

M	16R			Start of block	SETPRTY	
M	95a	4 !c	Party	Option P	Option P 4 !c//4 !a2 !a2 !a[3 !c] PSET//BIC code of place of settlement	“PSET” + code BIC du CSD où les titres seront livrés - titres Euroclear France : SICVFRPPXXX - titres NL/BE/IT admis en Euroclear France : SICVFRPPXXX en cross CSD ou BIC du CSD local en circuit CCBM - BIC de la banque centrale correspondante pour les créances privées étrangères
M	16S			End of block	SETPRTY	

O	16R			Start of block	SETPRTY	
O	95a	4 !c	Party	Option R	Option R 4 !c/8c/34x RECU//issuer code/proprietary code	A servir uniquement dans le cas de la Grèce quand Euroclear Bank ou Clearstream sont concernés
O	16S			End of block	SETPRTY	

End of Sequence E – Settlement Details

M	16S			End of block	SETDET	
---	-----	--	--	--------------	--------	--

5. Cas d'une neutralisation

En cas de neutralisation en fin de journée T2S, les titres apportés en collatéral seront placés dans un compte 3G dédié à la BDF, de type 052xxxxx, différent du compte 047xxxxxxx (cf. les services BDF/BOPM pour connaître le numéro de compte dédié).

Conséquences :

- 1) Lors de l'apport des titres neutralisés, dans le MT544 envoyé au client 3G concerné par la neutralisation pour confirmer la prise des titres collatéralisés, sera renseigné le compte 052xxxxxxx et non le compte 047xxxxxxx :

```
:16R:FIAC  
:36B::ESTT//FAMT/100000,  
:97A::SAFE//052xxxxxxx  
:16S:FIAC
```

- 2) Lors de la demande de restitution des titres neutralisés, le MT542 envoyé par le client 3G, doit renseigner le compte 052xxxxxxx et non le compte 047xxxxxxx :

```
.....  
:16R:FIAC  
:36B::SETT//FAMT/100000,  
:97A::SAFE//052xxxxxxx  
:16S:FIAC  
.....
```

Neutralisation : Détail du format de message MT 544 envoyés vers les contreparties pour confirmer la livraison des titres dans le Pool 3G

MT 544 Receive Free Confirmation						
Status	Tag	Qualifier	Generic Field Name	Detailed Field Name	Content/Options	Comments
Mandatory Sequence A General Information						
M	16R			Start of Block	GENL	
M	20C	SEME	Reference	Sender's Message Reference	:4!c//16x	Structure de la référence : AAAAABBBBBBCCCCC AAAAA=30001= CIB BdF BBBBBB = date sur 6 digits (AAMMJJ) CCCCC = 00000 sur 5 digits
M	23G			Function of the Message	4!c[4!c] « NEWM »	Sera toujours servi à « NEWM »
----> Mandatory Repetitive Subsequence A1 Linkages						
M	16R			Start of Block	LINK	
M	20C	4!c	Reference	(see qualifier description)	:4!c//16x	:RELA//Référence d'origine du 545 adressé par EF à la BdF
M	16S			End of Block	LINK	
M	16R			Start of Block	LINK	
M	20C	4!c	Reference	Market infrastructure reference	:4!c//16x "MITI"	"MITI" +reference T2S
M	16S			End of Block	LINK	
----- End of Subsequence A1 Linkages						

MT 544 Receive Free Confirmation

Status	Tag	Qualifier	Generic Field Name	Detailed Field Name	Content/Options	Comments
M	16S			End of Block	GENL	

End of Sequence A General Information

Mandatory Sequence B Trade Details

M	16R			Start of Block	TRADEDET	
M	98a	4!c	Date/Time	TRAD	A	98A ::TRAD//date sur format AAAAMMJJ
M	98a	4!c	Date/Time	ESET	A	98A ::ESET//date sur format AAAAMMJJ
M	35B			Identification of the Financial Instrument	[ISIN!e12!c] [4*35x]	

Optional Subsequence B1 Financial Instrument Attributes

M	16R			Start of Block	FIA	
O	11A	DENO	Currency	Currency of Denomination	:4!c/3!a	11A ::DENO//EUR
M	16S			End of Block	FIA	

End of Subsequence B1 Financial Instrument Attributes

O	70E	4!c	Narrative	SPRO	:4!c/10*35x	70R ::SPRO//NEUTRALISATION
M	16S			End of Block	TRADEDET	

End of Sequence B Trade Details

Mandatory Sequence C Financial Instrument/Account

MT 544 Receive Free Confirmation

Status	Tag	Qualifier	Generic Field Name	Detailed Field Name	Content/Options	Comments
M	16R			Start of Block	FIAC	
M	36B	4!c	Quantity of Financial Instrument	ESTT	:4!c/4!c/15d	36B ::ESST//FAMT/xxxxx ou 36B ::ESST//UNIT/
M	97a	4!c	Account	SAFE	A	97A ::SAFE/Votre N° de cpte préfixé en 052
M	16S			End of Block	FIAC	

End of Sequence C Financial Instrument/Account

Mandatory Sequence E Settlement Details

M	16R			Start of Block	SETDET	
M	22F	4!c	Indicator	SETR	:4!c/[8c]/4!c	22F ::SETR//TRAD

-----> Mandatory Repetitive Subsequence E1 Settlement Parties

M	16R			Start of Block	SETPRTY	
M	95a	4!c	Party	DEAG	R	95R ::DEAG/EGSP/Votre N°de compte sur 12 caractères
M	16S			End of Block	SETPRTY	
M	16R			Start of Block	SETPRTY	
M	95a	4!c	Party	PSET	R	95R ::PSET/SICVFRPPXXX
M	16S			End of Block	SETPRTY	

-----| End of Subsequence E1 Settlement Parties

MT 544 Receive Free Confirmation

Status	Tag	Qualifier	Generic Field Name	Detailed Field Name	Content/Options	Comments
M	16S			End of Block	SETDET	

End of Sequence E Settlement Details

6. Modification du montant de crédit réservé

Les contreparties ont la possibilité de geler une partie du collatéral enregistré dans le pool en l'affectant au « Crédit réservé ». La modification de celui-ci se fait par l'émission vers la Banque de France d'un MT598.

-- MESSAGE MT598 --

Statut	Champ	Nom du champ	Format	Description
M	20	Transaction Reference Number	16x	Référence unique du message Swift (par émetteur / type de message)
M	12	Sub-Message Type	3 !n	Type du message (doit être renseigné à 598)
M	77E	Propriety message	73x[n*78x]	
M	16R	Start of Block	GENL	
M	20C	Sender Message Reference	:SEME//16x	Même référence que celle présente dans le tag 20
M	23G	Function of the message	4 !c[/4 !c]	NEWM
M	16R	Start of block	FRZG	
M	95P	Account owner	:4!c//4!a2!a2! c[3!c]	:ACOW// suivi du code BIC de l'établissement de crédit
M	97A	Safe Account	:4!c//35x	:SAFE//suivi du numéro de compte titres de l'établissement de crédit
M	22F	Freezing type	:4!c//[8c]/4!c	:FRZG//GENL
M	19B	Amount	:4!c//3!a15d	://COVA suivi du code devise (EUR) et du montant de crédit réservé a mettre en place (en cas de clôture du crédit réservé mettre ce montant à 0)
M	16S	End of block	FRZG	
M	16S	Start of Block	GENL	

La prise en compte ou le rejet de la modification par la Banque de France se fait via l'envoi vers la contrepartie d'un MT599.

- MESSAGE MT599 CONFIRMATION -

Statut	Champ	Nom du champ	Format	Description
M	20	Transaction Reference Number	16x	Référence unique du message Swift (par émetteur / type de message)
M	79	Narrative	35*50x	NOUS VOUS INFORMONS QUE VOTRE DEMANDE DE MISE A JOUR DU CREDIT RESERVE EN DATE DU {BUSINESS DATE} AYANT POUR REFERENCE {ETC REQUEST REFERENCE} A ÉTÉ ACCEPTEE ; SERVICE BACK OFFICE POLITIQUE MONETAIRE BANQUE DE FRANCE TEL: + 33 1 42 92 27 16

- MESSAGE MT599 REJET -

Statut	Champ	Nom du champ	Format	Description
M	20	Transaction Reference Number	16x	Référence unique du message Swift (par émetteur / type de message)
M	79	Narrative	35*50x	NOUS VOUS INFORMONS QUE VOTRE DEMANDE DE MISE A JOUR DU CREDIT RESERVE EN DATE DU {BUSINESS DATE} AYANT POUR REFERENCE {ETC REQUEST REFERENCE} A ÉTÉ REJETEE ; SERVICE BACK OFFICE POLITIQUE MONETAIRE BANQUE DE FRANCE TEL: + 33 1 42 92 27 16

7. Message de rejet d'une instruction d'apport ou de restitution

1. Format du message

- MESSAGE SWIFT MT548 POOL-

Status	Field	Qualifier	Generic field name	Detailed field name	Content/Options	Comments
--------	-------	-----------	--------------------	---------------------	-----------------	----------

Mandatory Sequence A - General information

M	16R			Start of block	GENL	
M	20C	SEME	Reference	Sender's reference	:4 !c//16x SEME//	Référence du message
M	23G			Function of the message	4!c[4 !c]	INST ou CAST (voir tableau anomalies)

M	16R			Start of block	LINK	
M	20C	4 !c	Reference	Related reference	:4 !c//16x « RELA »//TRN	« RELA » + TRN du message incriminé
M	16S			End of block	LINK	

M	16R			Start of block	STAT	
M	25D	4 !c			:4 !c//4 !c	Voir tableau anomalies

M	16R			Start of block	REAS	
M	24B	4 !c			:4 !c//4 !c	Voir tableau anomalies

M	70D	4 !c			:4 !c//n REAS//	« REAS » + message libre reprenant la cause de
M	16S			End of block	REAS	

M	16S			End of block	STAT	
---	-----	--	--	--------------	------	--

End of Sequence A - General information

M	16S			End of block	GENL	
---	-----	--	--	--------------	------	--

2. *Tableau des motifs de rejet*

Tableau des codes anomalies utilisés dans le MT548*

Champ 23G	Champ 25D	Champ 24B	Libellé champ 70D
INST	IPRC//REJT	REJT//DDAT	Date livraison incorrecte (champ 98a)
INST	IPRC//REJT	REJT//DQUA	Quantité incorrecte (champ 36B)
INST	IPRC//REJT	REJT//DTRD	Date négociation incorrecte (champ 98a)
INST	IPRC//REJT	REJT//DSEC	Titre non éligible (champ 35B)
INST	IPRC//REJT	REJT//DSEC	Mode de cotation incorrect (champ 36B)
INST	IPRC//REJT	REJT//NCRR	Code devise incorrect (champ 11A)
INST	IPRC//REJT	REJT//RTGS	Code BIC système règlement/livraison incorrect (champ 95P)
INST	IPRC//REJT	REJT//SAFE	Code établissement incorrect
INST	IPRC//REJT	REJT//SETR	Type d'opération unique = COLL (champ 22F)
INST	IPRC//REJT	REJT//NARR	Format message incorrect (champ xxx absent)
INST	IPRC//REJT	REJT//NARR	Valeur champ 23G non admise
INST	IPRC//REJT	REJT//NARR	Référence origine (champ 20C sous-séquence A1) incompatible avec la fonction du message
INST	IPRC//REJT	REJT//NARR	TRN ordre à annuler (champ 20C sous-séquence A1) incompatible avec type du message
INST	IPRC//REJT	REJT//NARR	Code établissement/code BIC incompatibles
INST	MTCH//NMAT	NMAT//CMIS	TRN ordre à annuler inconnu (champ 20C sous séquence A1)
INST	MTCH//NMAT	NMAT//CMIS	Contrepartie manquante
INST	MTCH//NMAT	NMAT//CPCA	Annulation impossible, ordre déjà annulé
INST	MTCH//NMAT	NMAT//DDAT	Date livraison différente date contrepartie (champ 98a)
INST	MTCH//NMAT	NMAT//DTRD	Date négociation différente date contrepartie (champ 98a)
INST	MTCH//NMAT	NMAT//ICAG	Code BIC contrepartie incorrect (champ 95P)
INST	MTCH//NMAT	NMAT//ICUS	Code BIC correspondant incorrect (champ 95P ou 95R)
INST	MTCH//NMAT	NMAT//IEXE	Données correspondant erronées (champ 95P ou 95R)
INST	MTCH//NMAT	NMAT//LATE	Opération trop tardive pour appariement
INST	MTCH//NMAT	NMAT//PODU	Instruction reçue en double
INST	MTCH//NMAT	NMAT//RTGS	Code BIC système règlement/livraison incorrect (champ 95P)
INST	SETT//PEND	PEND//LACK	Quantité de titres insuffisante à la BDF
CAST	CPRC//CAND	CAND//CANI	Confirmation message d'annulation traité

* La liste de Rejet disponible en date du 15/02/2016 peut être enrichie selon les rajouts d'EOCF, motifs paramétrables dans l'application de la BDF.

8. Relevé de portefeuille

– Message MT535 POOL –

Ce type de message sera utilisé par la Banque de France pour communiquer aux établissements de crédit les informations relatives aux titres conservés pour leur compte par la Banque (titres nantis).

Status	Field	Qualifier	Generic field name	Detailed field name	Content/Options	Comments
--------	-------	-----------	--------------------	---------------------	-----------------	----------

Mandatory Sequence A – General Information

M	16R	4 !c		Start of block	GENL	
M	28E			Page number/continuation indicator	5n/4 !c 5n = page number a!c = « LAST », « MORE » or « ONLY »	ONLY = une seule page MORE = plusieurs pages et pas la dernière LAST = plusieurs pages et dernière page
M	20C	SEME	Reference	Sender's reference	:4 !c/16x SEME// structured TRN	Structure du TRN AAAAABBBBBBCCDDD avec AAAAA = 30001 = CIB BDF BBBBBB = date sur 6 num (AAMMJJ) CC = RP DDD = compteur réinitialisé tous les jours
M	23G			Function of the message	4!c/4 !c] « NEWM »	Sera toujours servi à "NEWM"
M	98a	4 !c	Date/Time	Option A	:4 !c/8 !n « PREP »//yyyymmdd	Date de constitution du portefeuille
M	98a	4 !c	Date/Time	Option A	:4 !c/8 !n « STAT »//yyyymmdd	Date d'arrêté du portefeuille
M	22F		Indicator		:4 !c/4 !c « STTY »// »CUST »	

M	22F				:4 !c//4 !c « SFRE »// « AAAA »	AAAA en fonction de la périodicité du relevé DAIL = quotidien WEEK = hebdomadaire MNTH = mensuel ADHO = périodicités différentes
M	22F				:4 !c//4 !c « STBA »// « SETT »	
M	22F				:4 !c//4 !c « CODE »// « COMP »	
M	97a	4 !c	Account	Option A	:4 !c//35x « SAFE »//account	Numéro de compte de nantissement + lettre clé de la contrepartie à la Banque de France
M	17B		Flag	Activity flag	:4 !c//1a « ACTI »// « Y » ou « ACTI »// « N »	Servi à « Y » indique que des titres sont conservés, servi à « N » que le relevé est vide. Dans ce cas, pas de séquence « subsafekeeping account ».
M	17B		Flag	Activity flag	:4 !c//1a « CONS »// « N »	Les comptes ne sont pas consolidés
M	16S			End of block	GENL	

Repetitive Optional Sequence B – Sub-safekeeping Account

M	16R			Start of block	SUBSAFE	
---	-----	--	--	----------------	---------	--

Repetitive Optional Subsequence B1 – Financial Instrument

M	16R			Start of block	FIN	
M	35B			Identification of the financial instrument	[ISIN1 !e12 !c] [4*35x] ISINcode + libellé	« ISIN » + code du titre+ libellé Ou « LOAN » + numéro d'identification de la créance privée étrangère

Optional subsequence B1a- Financial Instrument Attribute

M	16R			Start of block	FIA	
O	11A	DENO	Currency	Currency of denomination	:4 !c//3 !a « DENO »//ISO	Code ISO de la devise
M	92A	CUFC	Rate	Current factor	:4 !c/[N]15d; “CUFC” current pool factor	Pool factor pour les asset back securities (ABS) et FCC

M	90a	4 !c	Price	Option A or B	Option A 4 !c/4 !c/15d « MRKT »// « PRCT » price in percentage Option B 4 !c/4 !c/3 !a15d « MRKT »// « ACTU » price expressed as an amount per unit	Dans le cas où le prix est exprimé en pourcentage (renseigné à 100 pour les créances privées) Dans le cas où le prix est exprimé en montant unitaire (précisant le code ISO de la devise)
M	16S			End of block	FIA	

M	93B	AGGR	Balance	Aggregate balance	4 !c[8c]/4 !c[N]15d « AGGR »// « UNIT »/ +quantité ou « AGGR »// « FAMT »/ +quantité	Quantité totale détenue sur le compte de nantissement Dans le cas où la quantité est exprimée en nombre de titres Dans le cas où la quantité est exprimée en capital (FAMT pour les créances privées)
---	-----	------	---------	-------------------	--	--

Repetitive Optional Subsequence B1a – Sub-Balance

M	16R			Start of block	SUBBAL	
M	93a	4 !c	Option B	Aggregate balance	Option B 4 !c[8c]/4 !c[N]15d « AGGR »// « UNIT »/ +quantité ou « AGGR »// « FAMT »/ +quantité	Quantité totale détenue sur le compte de nantissement Dans le cas où la quantité est exprimée en nombre de titres Dans le cas où la quantité est exprimée en capital
M	93a	4 !c	Option B	Aggregate balance	Option B 4 !c[8c]/4 !c[N]15d « AVAI »// « UNIT »/ + quantité ou « AVAI »// « FAMT »/ + quantité	Quantité totale disponible sur le compte de nantissement Dans le cas où la quantité est exprimée en nombre de titres Dans le cas où la quantité est exprimée en capital
M	94a	4 !c	Place	Place of safekeeping	Option F 4 !c/4!c/4 !a2 !a2 !c[3!c]	« SAFE »// « CUST »//BIC de la BCN locale pour les titres CCBM et les créances privées CCBM ou « SAFE »// « NCS D »//SICVFRPPXXX pour les titres Euroclear France

M	70C	SUBB	Narrative	Sub-balance details narrative	:4 !c//10*35x « SUBB »//TITRES INSCRITS EN COMPTE DE NANTISSEMENT	
	16S			End of block	SUBBAL	

M	19A	4 !c	Amount	Option A	4 !c//[N]3 !a15d « ACRU »//currency And accrued interest amount	Devise de cotation + montant global des coupons pour le code ISIN concerné (renseigné à 0 pour les créances privées)
M	19A	4 !c	Amount	Option A	4 !c//[N]3 !a15d « HOLD »//currency and holding value	Devise de cotation + montant global de la valorisation pour le code ISIN concerné (ou
O	92B	4 !c	Rate	Option A	:4!c//[N]15d « EXCH//EUR »/ currency and exchange rate	EXCH//EUR/Devise/Taux de change utilisé pour la valorisation
M	70E	HOLD	Narrative	Holdings narrative	:4 !c//10*35x « HOLD »// Haircut in percentage	Taux de décote applicable au titre ou à la créance

End of Subsequence B1- Financial instrument

M	16S	End of block		FIN		
---	-----	--------------	--	-----	--	--

End of Sequence B – Sub-safekeeping Account

M	16S			End of block	SUBSAFE	
---	-----	--	--	--------------	---------	--

Repetitive Optional Sequence C – Additional Information

M	16R			Start of block	ADDINFO	
---	-----	--	--	----------------	---------	--

M	19A		Amount		4 !c//[N]3 !a/15d « HOLS »// currency and holding value of the	Devise + Montant valorisé total de la page
O	19A		Amount		4 !c//[N]3 !a/15d « HOLS »// currency and total holding value	Devise + Montant valorisé total pour l'ensemble des pages
M	16S			End of block	ADDINFO	

9. Spécificités du règlement-livraison CCBM

(la BDF est HCB : une contrepartie française désire mobiliser des titres étrangers)

Le Correspondent Central Banking Model (CCBM) permet à une contrepartie française de mobiliser comme collatéral des titres détenus dans certains autres pays de l'Eurosystème.

La procédure de mobilisation des titres se fait en deux étapes :

Instruction Marché:

Il convient donc que la contrepartie souhaitant mobiliser ces titres émette, **d'une part**, une instruction marché à destination :

- soit du CSD de détention, à condition qu'un lien éligible existe entre ce CSD de détention et le CSD d'émission des titres.
- soit du CSD d'émission, si l'option précédente n'est pas praticable lorsqu'il n'existe aucun lien spécifique validé par l'Eurosystème entre le CSD de détention et le CSD d'émission.

Cette instruction marché vise à donner l'ordre de livrer les titres auprès de la BCN correspondante chez qui les titres apportés seront conservés pour le compte de la Banque de France.

Le présent document n'adresse pas les éventuelles modifications à apporter dans le format des instructions marché du fait du déploiement de T2S.

Des éléments de réponse figurent néanmoins sur le site internet de la BCE à l'adresse :

<https://www.ecb.europa.eu/paym/coll/coll/ncbpractices/html/index.en.html>

Instruction BdF :

Il convient **d'autre part** que la contrepartie adresse une instruction à destination de la Banque de France, instruction que celle-ci fera suivre à la BCN correspondante.

Une fois l'opération dénouée et confirmée par la BCN correspondante, la Banque de France pourra alors octroyer la ligne de crédit adéquate.

Les éléments d'information ci-dessous concernent uniquement ce flux de messages entre la contrepartie et la BdF.

1. Cas général : avec ou sans lien.

Dans le référentiel de la BCE, le pays d'émission est indiqué par l'attribut « Country Location ». Cet attribut est formaté sur 4 caractères :

- Le code « CL » (comme « Country Location »)
- Le code ISO sur 2 positions du pays d'émission du titre.

1) Mobilisation sans lien :

Les titres mobilisés via le CCBM sont toujours conservés par la Banque Centrale du pays d'émission du titre. Ils ne peuvent lui être livrés qu'à partir du CSD d'émission du titre.

Cela implique donc que la contrepartie rapatrie les titres auprès du dépositaire central national de ce pays d'émission.

Exemple : un titre dont l'attribut Country Location vaut CLDE sera déposé en Clearstream Banking Frankfurt et conservé par la BundesBank pour le compte de la Banque de France.

Dans ses instructions de règlement-livraison l'établissement contrepartie devra spécifier dans le :95P ::PSET//DAKVDEFFDOM

2) Mobilisation avec lien :

Les titres mobilisés via le CCBM seront conservés par la Banque Centrale du pays du CSD de détention du titre.

Cela implique l'existence d'un lien validé par l'Eurosysteme.

(liste publique sur le site de la BCE à l'adresse :

<https://www.ecb.europa.eu/paym/coll/coll/ssslinks/html/index.en.html>)

2. Cas des Euro-Bonds

Les Euro-Bonds (généralement les codes ISIN commençant par « XS ») sont émis simultanément en Euroclear Bank et en Clearstream Banking Luxembourg. Dans le référentiel BCE leur Country Location est un code particulier : «CLBL », où « BL » vaut pour un pays « fictif », «Belgique / Luxembourg».

Dans ce cas :

- Si la place de dénouement demandée par l'établissement contrepartie est Euroclear Bank, la BCN correspondante de la Banque de France est la Banque Nationale de Belgique.
- Si la place de dénouement demandée par l'établissement contrepartie est Clearstream Luxembourg, la BCN correspondante de la Banque de France est la Banque Centrale du Luxembourg.

3. *Impact de la migration des CSD sur le format des messages*

Pour les CSD ayant déjà migré dans T2S, et dans le cadre du CCBM, le format des messages à adresser à BdF change peu.

Globalement, les systèmes des BCN correspondantes ont été adaptés pour compléter automatiquement les champs supplémentaires obligatoires si ceux-ci sont absents.

CETTE DISPOSITION CONCERNE UNIQUEMENT LES INSTRUCTIONS QUI TRANSITERONT PAR LA BdF ET SERONT TRANSMISES A LA BCN CORRESPONDANTE. L'INSTRUCTION MARCHE (en regard de cette instruction BCN) DOIT, ELLE, ETRE AU FORMAT T2S, FAUTE DE QUOI T2S NE POURRA PAS LA TRAITER.

Pour mémoire, le tableau ci-dessous reprend les dates de migration des CSD dans T2S.

Wave 1 22 Jun 2015 - 31 Aug 2015	Wave 2 29 Mar 2016	Wave 3 12 Sep 2016	Wave 4 6 Feb 2017	Final wave 18 Sep 2017
Bank of Greece Securities Settlement System (BOGS)	Interbolsa (Portugal)	Euroclear Belgium	Centrálny depozitár cenných papierov SR (CDCP) (Slovakia)	Baltic CSDs (Estonia, Latvia, Lithuania)
Depozitarul Central (Romania)	National Bank of Belgium Securities Settlement Systems (NBB-SSS)	Euroclear France	Clearstream Banking (Germany)	Euroclear Finland
Malta Stock Exchange		Euroclear Nederland	KDD - Centralna klirinško depotna družba (Slovenia)	Iberclear (Spain)
Monte Titoli (Italy)		VP Lux (Luxembourg)	KELER (Hungary)	
SIX SIS (Switzerland)		VP Securities (Denmark)	LuxCSD (Luxembourg)	
			Oesterreichische Kontrollbank (Austria)	

Source BCE : <https://www.ecb.europa.eu/paym/t2s/progplan/html/index.en.html>

4. Instructions d'apport

A titre indicatif, et sans but d'exhaustivité, le tableau ci-dessous a pour objet d'indiquer aux établissements de crédit comment remplir les séquences E1 relatives aux informations sur le règlement / livraison des titres : champs 95a (option P ou R) des messages SWIFT MT540 adressés à la Banque de France, en fonction du type de titres mobilisés

Country	TYPE DE TITRE	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Allemagne	All Marketable Assets	Clearstream Banking Frankfurt (CBF) - CASCADE (via local correspondent)	:95R::DEAG/DAKV/ n° compte de la contrepartie en CBF	:95P::PSET//DAKVDEFFDOM
	All Marketable Assets	Clearstream Banking Frankfurt (CBF) - CASCADE (via EUROCLEAR)	:97A::SAFE//n° compte de la contrepartie en Euroclear :95R::DEAG/DAKV/4312	:95P::PSET//DAKVDEFFDOM
	All Marketable Assets	Clearstream Banking Frankfurt (CBF) - CASCADE (via CLEARSTEAM Luxembourg)	:97A::SAFE//n° compte de la contrepartie en Clearstream :95R::DEAG/DAKV/7201	:95P::PSET//DAKVDEFFDOM
Country	TYPE DE TITRE	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Autriche	All Marketable Assets	OeKB CSD GmbH	:95P::DEAG//BIC code du correspondant	:95P::PSET//OCSDATWWXXX
	All Marketable Assets	OeKB via Clearstream	:95P::DEAG//CEDELULLXXX :97A::SAFE//243900 :95R::SELL/CEDE/Votre N° cpte en CEDEL	:95P::PSET//OCSDATWWXXX
	All Marketable Assets	OeKB via Euroclear Bank	:95P::DEAG//MGTCBEBEECL :97A::SAFE// 247200 :95R:: SELL/ECLR/Votre N° de compte en Euroclear	:95P::PSET//OCSDATWWXXX
Country	Asset Type	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Belgique	All Marketable Assets	Banque Nationale de Belgique (2) (BE Isins only) NBB-SSS	:95P::DEAG/CEDELULLXXX or :95P::DEAG/MGTCBEBEECL	:95P::PSET//NBBEBEBB216 or :95P::PSET//NBBEBEBB216
	All Marketable Assets	Clearstream Luxembourg (XS Isins)	:95R::DEAG/CEDE/n° de compte de la contrepartie en Clearstream	:95P::PSET//CEDELULLXXX
	All Marketable Assets	Euroclear Bank (XS Isins)	:95R::DEAG/ECLR/n° de compte de la contrepartie en Euroclear	:95P::PSET//MGTCBEBEECL
Country	Asset Type	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Danemark	Currently no eligible assets	VP Securities (Denmark)	:95P::DEAG//BIC code du correspondant	:95P::PSET//VPDKDKKXXX

Country	Asset Type	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Espagne		via CLEARSTREAM	:95P::DEAG//BBVAESMMXXX	:95P::PSET//IBRCESMMXXX
	Equities and other assets traded in Bolsa de Madrid (PLEDGE ONLY)	IBERCLEAR (SCLV) (3)	:95P::DEAG//code bic du correspondant (ex: BSUIFRPPXXX)	:95P::PSET//IBRCESMMXXX
	Public and private debt securities	IBERCLEAR (CADE)	:95P::DEAG//code bic du correspondant	:95P::PSET//IBRCESMMXXX
	Bonds	Euroclear via Banco Santander	:95P::DEAG//BSSSESM2XXX	:95P::PSET//IBRCESMMXXX
	Bonds (PLEDGE ONLY)	SCL BILBAO	:95P::DEAG//BBVAESMMXXX	:95P::PSET//XBILES21XXX
	Bonds (PLEDGE ONLY)	SCL VALENCIA		:95P::PSET//XVALESV1XXX
	Bonds	SCL Barcelona --titres catalans-- (4)	:95P::DEAG//code bic du correspondant	:95P::PSET//XBARES1XXX
Country	Asset Type	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Finlande	All Marketable Assets	Euroclear Finland APK	:95P::DEAG//code bic du correspondant	:95P::PSET//APKEFIHHATP
	All Marketable Assets	APK via Euroclear Bank	:95P::DEAG//MGTCBEBEECL	:95P::PSET//APKEFIHHATP
	All Marketable Assets	APK via Clearstream Luxembourg	:95P::DEAG//CEDELULLXXX :97A::SAFE//votre N°cpte chez Clearstream	:95P::PSET//APKEFIHHATP
Country	Asset Type	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Royaume Uni	Euro-market and international issues in Euroclear Bank where the issuer is the Government of the United Kingdom (or a company incorporated in the United Kingdom)	Euroclear Bank	:95R::DEAG/ECLR/n° de compte de la contrepartie en Euroclear	:95P::PSET//MGTCBEBEXXX
	Euro-market and international issues in Clearstream where the issuer is the Government of the United Kingdom (or a company incorporated in the United Kingdom)	Clearstream Luxembourg	:95R::DEAG/CEDE/n° de compte de la contrepartie en Clearstream	:95P::PSET//CEDELULLXXX

Country	Asset Type	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Grèce	Government securities	BOGS via Euroclear	:95P::DEAG//CITIGRAAXXX :95R::DECU/ECLR/votre N°cpte (1)	:95P::PSET//BNGRGRAASSS
	Government securities	BOGS via Clearstream	:95P::DEAG//CITIGRAAXXX :95R::DECU/CEDE/votre N°cpte (1)	:95P::PSET//BNGRGRAASSS
	Government securities	BOGS	:95P::DEAG//code bic du correspondant	:95P::PSET//BNGRGRAASSS
Country	Asset Type	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Irlande	Irish Treasury note and bills	NTMA	:95P::DEAG//code bic du correspondant	:95P::PSET//NTMAIE2DXXX
	Irish Government bonds	Euroclear Bank	:95R::DEAG/ECLR/votre N°cpte ajouter champ 94F::SAFE//ICSD//IRCEIE2DXXX dans le bloc FIAC	:95P::PSET//MGTCBEBEXXX
		Clearstream Luxembourg	:95R::DEAG/CEDE/votre N°cpte ajouter champ 94F::SAFE//ICSD//IRCEIE2DXXX dans le bloc FIAC	:95P::PSET//CEDELULLXXX
Country	Asset Type	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Italie	All Marketable Assets	MONTE TITOLI	:95P::DEAG//code bic du correspondant	:95P::PSET//MOTIITMMXXX
	All Marketable Assets	MONTE TITOLI via Euroclear	:95P::DEAG//MGTCBEBEECL	:95P::PSET//MOTIITMMXXX
	All Marketable Assets	MONTE TITOLI via Clearstream	:95P::DEAG//CEDELULLXXX	:95P::PSET//MOTIITMMXXX
Country	Asset Type	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Luxembourg	Domestic bonds, Eurobonds	Euroclear Bank	:95R::DEAG/ECLR/votre N°cpte	:95P::PSET//MGTCBEBEXXX
	Domestic bonds, Eurobonds	Clearstream Luxembourg	:95R::DEAG/CEDE/votre N°cpte	:95P::PSET//CEDELULLXXX
Country	Asset Type	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Pays Bas	All Marketable Assets	Euroclear Group Single Platform (EGSP)	:95R::DEAG/EGSP/votre N°cpte (<u>sur 12 caractères</u>)	:95P::PSET//NECINL2AXXX
	All Marketable Assets	EGSP via Euroclear Bank	:95R::DEAG/EGSP/000000000611 :95P::SELL//BIC 11 caractères :97A::SAFE//Votre N° de compte en Euroclear Bank	:95P::PSET//NECINL2AXXX
	All Marketable Assets	EGSP via Clearstream Luxembourg	:95R::DEAG/EGSP/000000000641 :95P::SELL//BIC 11 caractères :97A::SAFE//Votre N° de compte en Clearstream	:95P::PSET//NECINL2AXXX

Country	Asset Type	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Portugal	Marketable assets	INTERBOLSA	:95P::DEAG//BIC code du correspondant	:95P::PSET//IBLSPTPPXXX
	Marketable assets	via Clearstream Luxembourg	:95P::DEAG//PARBFRPPXXX 97A::SAFE// n° de compte en Clearstream	:95P::PSET//IBLSPTPPXXX
	Marketable assets	via Euroclear Bank	:95P::DEAG//BCOMPTPLXXX	:95P::PSET//IBLSPTPPXXX
Country	Asset Type	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Chypre	Government Securities	CDCR	:95P::DEAG//code bic du client	:95P::PSET//XCYSCY2NXXX
			:95R::DECU/CDCR/N° de compte du dépositaire	
Country	Asset Type	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Slovenie	All Marketable Assets	Central Clearing and Depository Corporation Inc., Ljubljana (KDD)	:95R::DEAG/KDDS/member code en KDD+X+votre N° cpte	:95P::PSET//KDDSSI22XXX
Country	Asset Type	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Suède	Currently no eligible assets	VPC	:95P::DEAG//code bic du correspondant	:95P::PSET//VPCSESSXXX

5. Instructions de restitution

Ce tableau a pour objet d'indiquer aux établissements de crédit comment remplir les séquences E1 relatives aux informations sur le règlement / livraison des titres : champs 95a des messages SWIFT MT542 adressés à la Banque de France, en fonction du type de titres mobilisés.

Country	TYPE DE TITRE	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Allemagne		Clearstream Banking Frankfurt (CBF) - CASCADE (via local correspondent)	:95R::REAG/DAKV/votre N° cpte de la contrepartie chez CBF	:95P::PSET//DAKVDEFFDOM
		Clearstream Banking Frankfurt (CBF) - CASCADE (via EUROCLEAR)	:97A::SAFE//n° compte de la contrepartie en Euroclear :95R::REAG/DAKV/4312	:95P::PSET//DAKVDEFFDOM
		Clearstream Banking Frankfurt (CBF) - CASCADE (via CLEARSTREAM Luxembourg)	:97A::SAFE//n° compte de la contrepartie en Clearstream :95R::REAG/DAKV/7201	:95P::PSET//DAKVDEFFDOM
Country	TYPE DE TITRE	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Autriche		OEKB	:95P::REAG//code bic du correspondant local :97A::SAFE//N° cpte en OCSD	:95P::PSET//OCSDATWW
		OEKB via Clearstream	:95P::REAG//CEDELULLXXX :97A::SAFE//243900 :95R::SELL/CEDE/votreN° compte en Clearstream	:95P::PSET//OCSDATWW
		OEKB via Euroclear	:95P::REAG//MGTCBEBEECL :97A::SAFE//247200 :95R::SELL/ECLR/votre n° de compte en Euroclear	:95P::PSET//OCSDATWW
Country	TYPE DE TITRE	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Belgique		Banque Nationale de Belgique (2) (BE Isins only)	:95P::DEAG/CEDELULLXXX or :95P::DEAG/MGTCBEBEECL	:95P::PSET//NBBEBEBB216 or :95P::PSET//NBBEBEBB216
		Clearstream Luxembourg (XS Isins)	:95R::REAG/CEDE/n° de compte de la contrepartie en Clearstream	:95P::PSET//CEDELULLXXX
		Euroclear Bank (XS Isins)	:95R::REAG/ECLR/n° de compte de la contrepartie en Euroclear	:95P::PSET//MGTCBEBEECL
Country	TYPE DE TITRE	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Danemark		VP Securities (Denmark)	:95P::REAG//code bic du correspondant	:95P::PSET//VPDKDKKXXX

Country	TYPE DE TITRE	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Espagne		via CLEARSTREAM	:95P::REAG//BBVAESMMXXX	:95P::PSET//IBRCESMMXXX
		IBERCLEAR (SCLV) (3)	:95P::REAG//code bic du correspondant	:95P::PSET//IBRCESMMXXX
		IBERCLEAR (CADE)	:95P::REAG//code bic du correspondant	:95P::PSET//IBRCESMMXXX
		Euroclear via Banco Santander	:95P::REAG//BSSSESM2XXX	:95P::PSET//IBRCESMMXXX
		SCL BILBAO	:95P::REAG//BBVAESMMXXX	:95P::PSET//XBILES21XXX
		SCL VALENCIA		:95P::PSET//XVALESV1XXX
		SCL Barcelona –titres catalans– (4)	:95P::REAG//code bic du correspondant	:95P::PSET//XBARES1XXX
Country	Asset Type	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Finlande		APK	:95P::REAG//code bic du correspondant	:95P::PSET//APKEFIHHATP
		APK via Euroclear Bank	:95P::REAG//MGTCBEBEECL	:95P::PSET//APKEFIHHATP
		APK via Clearstream Luxembourg	:95P::REAG//CEDELULLXXX :97A::SAFE//votre N°cpte chez Clearstream	:95P::PSET//APKEFIHHATP
Country	Asset Type	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Royaume Uni		Euroclear Bank	:95R::REAG/ECLR/n° de compte de la contrepartie en Euroclear	:95P::PSET//MGTCBEBEXXX
		Clearstream Luxembourg	:95R::DEAG/CEDE/n° de compte de la contrepartie en Clearstream	:95P::PSET//CEDELULLXXX

Country	Asset Type	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Grèce		BOGS via Euroclear	:95P::REAG//CITIGRAAXXX :95R::RECU/ECLR/votre N°cpte (1)	:95P::PSET//BNGRGRAASSS
		BOGS via Clearstream	:95P::REAG//CITIGRAAXXX :95R::RECU/CEDE/votre N°cpte (1)	:95P::PSET//BNGRGRAASSS
		BOGS	:95P::REAG//code bic du correspondant	:95P::PSET//BNGRGRAASSS
Country	Asset Type	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Irlande		NTMA	:95P::REAG//code bic du correspondant	:95P::PSET//NTMAIE2DXXX
		Euroclear Bank	:95R::REAG/ECLR/N° compte de la contrepartie en Euroclear ajouter champ 94F::SAFE//ICSD//RCEIE2DXXX dans le bloc FIAC	:95P::PSET//MGTCBEBEXX
		Clearstream Luxembourg	:95R::REAG/CEDE/N° compte de la contrepartie en Clearstream ajouter champ 94F::SAFE//ICSD//RCEIE2DXXX dans le bloc FIAC	:95P::PSET//CEDELULLXXX
Country	Asset Type	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Italie		MONTE TITOLI	:95P::REAG//code bic du correspondant	:95P::PSET//MOTIITMMXXX
		MONTE TITOLI via Euroclear	:95P::REAG//MGTCBEBEECL	:95P::PSET//MOTIITMMXXX
		MONTE TITOLI via Clearstream	:95P::REAG//CEDELULLXXX	:95P::PSET//MOTIITMMXXX
Country	Asset Type	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Luxembourg		Euroclear Bank	:95R::REAG/ECLR/votre N°cpte	:95P::PSET//MGTCBEBEXX
		Clearstream Luxembourg	:95R::REAG/CEDE/votre N°cpte	:95P::PSET//CEDELULLXXX

Country	Asset Type	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Pays Bas		Euroclear Group Single Platform (EGSP)	:95R::REAG/EGSP/votre N°cpte (sur 12 caractères)	:95P::PSET//NECINL2AXXX
		EGSP via Euroclear Bank	:95R::REAG/EGSP/000000000611 Après le 95P::BUYR, il faut mentionner votre compte par 97A::SAFE//numéro de compte en Euroclear Bank	:95P::PSET//NECINL2AXXX
		EGSP via Clearstream Luxembourg	:95R::REAG/EGSP/000000000641 Après le 95P::BUYR, il faut mentionner votre compte par 97A::SAFE//numéro de compte en Clearstream	:95P::PSET//NECINL2AXXX
Country	Asset Type	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Portugal		INTERBOLSA	:95P::REAG//BIC code du correspondant	:95P::PSET//IBLSPTPPXXX
		via Clearstream Luxembourg	:95P::REAG//PARBFRPPXXX 97A :: SAFE// n° de compte en Clearstream	:95P::PSET//IBLSPTPPXXX
		via Euroclear Bank	:95P::REAG//BCOMPTPLXXX	:95P::PSET//IBLSPTPPXXX
Country	Asset Type	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Chypre		CDCR	:95P::REAG//code bic du client :95R::RECU/CDCR/N° de compte du dépositaire	:95P::PSET//XCYSCY2NXXX
Country	Asset Type	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Slovenie		Central Clearing and Depository Corporation Inc., Ljubljana (KDD)	:95R::REAG/KDDS/member code en KDD+X+vosre N°cpte	:95P::PSET//KDDSSI22XXX
Country	Asset Type	Settlement System	MT540 SETPRTY	MT540 SETPRTY
Suède		VPC	:95P::REAG//code bic du correspondant	:95P::PSET//VPCSSSESSXXX