

Ce texte constitue seulement un outil de documentation et n'a aucun effet juridique. Les institutions de l'Union déclinent toute responsabilité quant à son contenu. Les versions faisant foi des actes concernés, y compris leurs préambules, sont celles qui ont été publiées au Journal officiel de l'Union européenne et sont disponibles sur EUR-Lex. Ces textes officiels peuvent être consultés directement en cliquant sur les liens qui figurent dans ce document

► **B** **RÈGLEMENT D'EXÉCUTION (UE) 2022/1860 DE LA COMMISSION**
du 10 juin 2022

définissant des normes techniques d'exécution pour l'application du règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil en ce qui concerne les normes, les formats, la fréquence et les méthodes et modalités de déclaration

(Texte présentant de l'intérêt pour l'EEE)

(JO L 262 du 7.10.2022, p. 68)

Rectifié par:

- **C1** Rectificatif, JO L 304 du 24.11.2022, p. 102 (2022/1860)
- **C2** Rectificatif, JO L 304 du 24.11.2022, p. 106 (2022/1860)
- **C3** Rectificatif, JO L 125 du 11.5.2023, p. 59 (2022/1860)



RÈGLEMENT D'EXÉCUTION (UE) 2022/1860 DE LA COMMISSION

du 10 juin 2022

définissant des normes techniques d'exécution pour l'application du règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil en ce qui concerne les normes, les formats, la fréquence et les méthodes et modalités de déclaration

(Texte présentant de l'intérêt pour l'EEE)

Article premier

Normes et formats de données des déclarations de contrats dérivés

Les éléments d'un contrat dérivé à déclarer au titre de l'article 9 du règlement (UE) n° 648/2012 sont fournis dans le respect des normes et des formats présentés dans les tableaux 1, 2 et 3 de l'annexe du présent règlement et sous une forme commune électronique et lisible à la machine et dans un modèle XML commun conformément à la méthode ISO 20022.

Article 2

Fréquence des déclarations

1. Toutes les déclarations des éléments d'un contrat dérivé spécifiés à l'article 1^{er} du règlement délégué (UE) 2022/1855 de la Commission ⁽¹⁾ sont effectuées dans l'ordre chronologique dans lequel les événements se rapportant aux informations à déclarer se sont produits.

2. Une contrepartie centrale, une contrepartie financière ou une contrepartie non financière au sens de l'article 10 du règlement (UE) n° 648/2012, qui constitue une contrepartie à un contrat dérivé, ou l'entité responsable de la déclaration, signale tout changement des éléments concernant les données sur les sûretés dans les champs 1 à 29 du tableau 3 de l'annexe du règlement délégué (UE) 2022/1855 avec le type d'action «Actualisation de la marge», tels que ces éléments se présentent à la fin de chaque journée, pour ledit contrat dérivé lorsque:

- a) le contrat dérivé n'est pas arrivé à échéance et n'a pas fait l'objet d'une déclaration avec le type d'action «Résiliation», «Erreur» ou «Composante de la position» tel que visé dans le champ 151 du tableau 2 de l'annexe; ou
- b) le contrat dérivé a fait l'objet d'une déclaration avec le type d'action «Réactivation», qui n'a pas été suivie d'une autre déclaration avec le type d'action «Résiliation» ou «Erreur», tel que visé dans le champ 151 du tableau 2 de l'annexe.

⁽¹⁾ Règlement délégué (UE) 2022/1855 de la Commission du 10 juin 2022 complétant le règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil par des normes techniques de réglementation précisant les informations minimales à déclarer aux référentiels centraux et le type de déclarations à utiliser (voir page 1 du présent Journal officiel).

▼B

3. Une contrepartie à un contrat dérivé visé au paragraphe 2, points a) et b), qui constitue une contrepartie centrale, une contrepartie financière ou une contrepartie non financière au sens de l'article 10 du règlement (UE) n° 648/2012 ou l'entité responsable de la déclaration déclare la valorisation du contrat à la fin de la journée, au prix du marché ou par référence à un modèle, dans les champs 21 à 25 du tableau 2 de l'annexe du règlement délégué (UE) 2022/1855 avec le type d'action «Actualisation de la valorisation», telle qu'elle est à la fin de chaque journée.

*Article 3***Identification des contreparties et des autres entités**

1. La déclaration utilise un code d'identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 pour identifier:

- a) une entité de courtage;
- b) une contrepartie centrale;
- c) un membre compensateur;
- d) une contrepartie qui est une entité juridique;
- e) une entité soumettant une déclaration;
- f) une entité responsable de la déclaration;
- g) un fournisseur de services de réduction des risques post-négociation.

2. Une contrepartie 1 à un contrat dérivé telle que visée dans le champ 4 du tableau 1 de l'annexe du règlement délégué (UE) 2022/1855 et l'entité responsable de la déclaration veillent à ce que les données de référence portant sur son code LEI ISO 17442 soient renouvelées conformément aux conditions de toute unité opérationnelle locale accréditée du système LEI international lorsqu'elles déclarent la conclusion ou la modification d'un contrat dérivé au titre de l'article 9 du règlement (UE) n° 648/2012.

*Article 4***Sens du contrat dérivé**

1. Le côté de la contrepartie au contrat dérivé visé dans les champs 17 à 19 du tableau 1 de l'annexe est déterminé lors de la conclusion du contrat dérivé, ►**C1** conformément aux paragraphes 2 à 13 ◄.

2. Dans le cas des options et des options sur contrat d'échange (swaptions), la contrepartie qui détient le droit d'exercer l'option est identifiée comme l'acheteur, et la contrepartie qui vend l'option et reçoit une prime, comme le vendeur.

3. Dans le cas des contrats à terme de gré à gré ayant pour objet des devises, la contrepartie 1 est identifiée comme soit le payeur soit le receveur pour la jambe 1, et inversement pour la jambe 2. La contrepartie 2 remplit les champs 18 et 19 du tableau 1 avec les valeurs opposées à celles de la contrepartie 1.

▼B

4. Dans le cas des contrats d'échange ayant pour objet des devises et dans le cadre desquels de multiples échanges de devises ont lieu, chaque contrepartie pour les deux jambes de la transaction est identifiée soit comme payeur soit comme receveur de la jambe en fonction de l'échange de devises qui a lieu le plus près de la date d'expiration.
5. Dans le cas des contrats à terme de gré à gré autres que ceux portant sur des devises et dans le cas des contrats à terme normalisés, la contrepartie qui achète l'instrument est identifiée comme l'acheteur, et la contrepartie qui vend l'instrument, comme le vendeur.
6. Dans le cas des contrats financiers avec paiement d'un différentiel et des contrats permettant de miser sur un écart (spreadbets), la contrepartie en position courte sur le contrat est identifiée comme le vendeur, et la contrepartie en position longue sur le contrat, comme l'acheteur.
7. Dans le cas des contrats d'échange portant sur des dividendes, la contrepartie qui reçoit l'équivalent des montants de dividende distribués est identifiée comme l'acheteur, et la contrepartie qui paie le montant de dividende équivalent, comme le vendeur.
8. Dans le cas des contrats d'échange portant sur des titres autres que ceux liés aux dividendes, la contrepartie 1 est identifiée comme soit le payeur soit le receveur de la jambe 1, et inversement pour la jambe 2. La contrepartie 2 remplit les champs 18 et 19 du tableau 1 avec les valeurs opposées à celles de la contrepartie 1.
9. Dans le cas des contrats d'échange portant sur des taux d'intérêts ou des indicateurs d'inflation, y compris les crédits croisés, la contrepartie 1 est identifiée comme soit le payeur soit le receveur pour la jambe 1, et inversement pour la jambe 2. La contrepartie 2 remplit les champs 18 et 19 du tableau 1 avec les valeurs opposées à celles de la contrepartie 1.
10. Dans le cas des instruments dérivés servant au transfert du risque de crédit, à l'exception des options et des swaptions, la contrepartie qui achète la protection est identifiée comme l'acheteur, et la contrepartie qui vend la protection, comme le vendeur.
11. Dans le cas des contrats d'échange portant sur des matières premières, la contrepartie 1 est identifiée comme soit le payeur soit le receveur de la jambe 1, et inversement pour la jambe 2. La contrepartie 2 remplit les champs 18 et 19 du tableau 1 avec les valeurs opposées à celles de la contrepartie 1.
12. Dans le cas des accords de taux futurs, la contrepartie 1 est identifiée comme soit le payeur soit le receveur de la jambe 1, et inversement pour la jambe 2. La contrepartie 2 remplit les champs 18 et 19 du tableau 1 avec les valeurs opposées à celles de la contrepartie 1.
13. Dans le cas des contrats dérivés portant sur la variance, la volatilité et la corrélation, la contrepartie qui profite d'une hausse du prix du sous-jacent est identifiée comme l'acheteur, et la contrepartie qui profite d'une baisse du prix du sous-jacent, comme le vendeur.

*Article 5***Collatéralisation**

La contrepartie déclarante identifie le type de collatéralisation du contrat dérivé ou d'un portefeuille de produits dérivés visé dans le champ 11 du tableau 3 de l'annexe comme suit:

- a) comme «non collatéralisé» lorsqu'il n'existe aucun accord de sûreté entre les contreparties ou lorsque l'accord de sûreté entre les contreparties prévoit que les contreparties ne fournissent pas de marge initiale ni de marge de variation pour le contrat dérivé ou un portefeuille de produits dérivés;
- b) comme «partiellement collatéralisé: contrepartie 1 uniquement» lorsque l'accord de sûreté entre les contreparties prévoit que la contrepartie déclarante ne fournit régulièrement que des marges de variation et que l'autre contrepartie ne fournit aucune marge pour le contrat dérivé ou un portefeuille de produits dérivés;
- c) comme «partiellement collatéralisé: contrepartie 2 uniquement» lorsque l'accord de sûreté entre les contreparties prévoit que l'autre contrepartie ne fournit régulièrement que des marges de variation et que la contrepartie déclarante ne fournit aucune marge pour le contrat dérivé ou un portefeuille de produits dérivés;
- d) comme «partiellement collatéralisé» lorsque l'accord de sûreté entre les contreparties prévoit que les deux contreparties ne fournissent régulièrement que les marges de variation pour le contrat dérivé ou un portefeuille de produits dérivés;
- e) comme «collatéralisé à sens unique: contrepartie 1 uniquement» lorsque l'accord de sûreté entre les contreparties prévoit que la contrepartie déclarante fournit la marge initiale et fournit régulièrement des marges de variation et que l'autre contrepartie ne fournit aucune marge pour le contrat dérivé ou un portefeuille de produits dérivés;
- f) comme «collatéralisé à sens unique: contrepartie 2 uniquement» lorsque l'accord de sûreté entre les contreparties prévoit que l'autre contrepartie fournit la marge initiale et fournit régulièrement des marges de variation et que la contrepartie déclarante ne fournit aucune marge pour le contrat dérivé ou un portefeuille de produits dérivés;
- g) comme «collatéralisé à sens unique/partiellement: contrepartie 1» lorsque l'accord de sûreté entre les contreparties prévoit que la contrepartie déclarante fournit la marge initiale et fournit régulièrement des marges de variation et que l'autre contrepartie ne fournit régulièrement que des marges de variation pour le contrat dérivé ou un portefeuille de produits dérivés;
- h) comme «collatéralisé à sens unique/partiellement: contrepartie 2» lorsque l'accord de sûreté entre les contreparties prévoit que l'autre contrepartie fournit la marge initiale et fournit régulièrement des marges de variation et que la contrepartie déclarante ne fournit régulièrement que des marges de variation pour le contrat dérivé ou un portefeuille de produits dérivés;

▼B

- i) comme «pleinement collatéralisé:» lorsque l'accord de sûreté entre les contreparties prévoit que les deux contreparties fournissent une marge initiale et fournissent régulièrement des marges de variation pour le contrat dérivé ou un portefeuille de produits dérivés.

*Article 6***Spécification, identification et classification des produits dérivés**

1. La déclaration spécifie les produits dérivés sur la base du type de contrat et de la catégorie d'actifs, conformément aux champs 10 et 11 du tableau 2 de l'annexe.

La déclaration spécifie la catégorie d'actifs dont le produit dérivé se rapproche le plus lorsque le produit dérivé n'entre dans aucune des catégories de produits dérivés visées dans le champ 11 du tableau 2 de l'annexe. Les deux contreparties indiquent la même catégorie d'actifs.

2. Un produit dérivé est identifié dans le champ 7 du tableau 2 de l'annexe au moyen du numéro international d'identification des titres (code ISIN) ISO 6166 dans l'un des cas suivants:

- a) il est admis à la négociation ou négocié sur une plate-forme de négociation;
- b) il est négocié par l'intermédiaire d'un internalisateur systématique et son sous-jacent est admis à la négociation ou négocié sur une plate-forme de négociation ou constitue un indice ou un panier composé d'instruments négociés sur une plate-forme de négociation.

3. Un produit dérivé autre que celui mentionné au paragraphe 2 est identifié dans le champ 8 du tableau 2 de l'annexe au moyen d'un identifiant unique de produit (UPI) ISO 4914.

4. La contrepartie déclarante classe le produit dérivé dans le champ 9 du tableau 2 de l'annexe en utilisant un code de classification des instruments financiers («code CFI») ISO 10962.

*Article 7***Identifiant de transaction unique**

1. Les contreparties déclarent les produits dérivés à l'aide de l'UTI généré conformément aux paragraphes 2, 3 et 5.

2. Un produit dérivé, déclaré soit au niveau de la transaction, soit au niveau de la position, est identifié au moyen d'un identifiant de transaction unique (UTI) ISO 23897 dans le champ 1 du tableau 2 de l'annexe. L'UTI se compose du LEI de l'entité qui a généré cet UTI, suivi d'un code de 32 caractères au maximum, unique au niveau de l'entité génératrice.

3. Les contreparties déterminent l'entité à laquelle il incombe de générer l'UTI conformément aux principes suivants:

▼B

- a) pour les contrats dérivés faisant l'objet d'une compensation autres que ceux conclus entre deux contreparties centrales, l'UTI est généré au point de compensation par la contrepartie centrale pour le membre compensateur. Un autre UTI est généré par le membre compensateur pour sa contrepartie, pour une transaction dans laquelle la contrepartie centrale n'est pas une contrepartie;
- b) pour les contrats dérivés faisant l'objet d'une exécution centralisée, mais non d'une compensation centralisée, l'UTI est généré par la plate-forme où a lieu l'exécution pour son membre;
- c) pour les contrats dérivés autres que ceux mentionnés aux points a) et b), lorsque l'une des contreparties est soumise aux exigences de déclaration dans un pays tiers, l'UTI est généré dans le respect des règles du pays ou territoire de la contrepartie qui doit se conformer d'abord auxdites exigences.

Lorsque la contrepartie assujettie à l'obligation de déclaration au titre de l'article 9 du règlement (UE) n° 648/2012 doit d'abord s'acquitter des exigences de déclaration, l'entité responsable de la génération de l'UTI est la suivante:

- i) pour les contrats dérivés qui sont confirmés de manière centralisée par voie électronique, la plate-forme de confirmation des transactions au point de confirmation;
- ii) pour tous les autres contrats dérivés, les contreparties conviennent de l'entité responsable de la génération de l'UTI. Si les contreparties ne parviennent pas à s'entendre, le responsable de la génération est la contrepartie dont le LEI est le premier après classement des identifiants des contreparties dans l'ordre inverse des caractères.

Lorsque le droit applicable du pays tiers concerné prévoit le même délai de déclaration que le droit applicable à la contrepartie soumise à l'exigence de déclaration en application de l'article 9 du règlement (UE) n° 648/2012, conformément à l'article 9, paragraphe 1, premier alinéa, dudit règlement, les contreparties conviennent de l'entité responsable de la génération de l'UTI.

Si les contreparties échouent à s'accorder, et que le contrat dérivé a été confirmé de manière centralisée par voie électronique, l'UTI est généré par la plate-forme de confirmation des transactions au point de confirmation.

Si l'UTI ne peut pas être généré par la plate-forme de confirmation des transactions au point de confirmation, et que les éléments du contrat dérivé doivent être déclarés à un référentiel central unique, ledit référentiel est responsable de la génération de l'UTI.

Si l'UTI ne peut pas être généré par le référentiel central auquel les éléments du contrat dérivé ont été déclarés, le responsable de la génération est la contrepartie dont le LEI est le premier après classement des identifiants des contreparties dans l'ordre inverse des caractères;

▼B

- d) pour les contrats dérivés autres que ceux visés aux points a), b) et c), qui ont été confirmés de manière centralisée par voie électronique, l'UTI est généré par la plate-forme de confirmation des transactions au point de confirmation;
- e) pour tous les contrats dérivés autres que ceux visés aux points a) à d), les dispositions suivantes s'appliquent:
- i) lorsque des contreparties financières concluent un contrat dérivé avec des contreparties non financières, l'UTI est généré par les contreparties financières;
 - ii) lorsque des contreparties non financières qui dépassent le seuil de compensation concluent un contrat dérivé avec des contreparties non financières qui ne dépassent pas ce seuil, l'UTI est généré par les contreparties non financières qui dépassent le seuil de compensation;
 - iii) pour tous les contrats dérivés autres que ceux visés aux points i) et ii), les contreparties s'entendent sur l'entité responsable de la génération de l'UTI. Si les contreparties ne parviennent pas à s'entendre, le responsable de la génération est la contrepartie dont le LEI est le premier après classement des identifiants des contreparties dans l'ordre inverse des caractères.
4. La contrepartie générant l'UTI communique ce dernier à l'autre contrepartie en temps voulu et au plus tard à 10 h 00 TUC (temps universel coordonné) le jour ouvrable suivant la date de la conclusion du contrat dérivé.
5. Nonobstant le paragraphe 3, la génération de l'UTI peut être déléguée à une entité autre que celle désignée en vertu dudit paragraphe. L'entité qui génère l'UTI se conforme aux exigences énoncées dans les paragraphes 2 et 4.

*Article 8***Déclaration des changements de LEI et actualisation du code d'identification en LEI**

1. Lorsque la contrepartie identifiée aux termes de l'article 3 dans une déclaration de contrat dérivé subit une restructuration d'entreprise débouchant sur un changement de son LEI, cette contrepartie ou la contrepartie à laquelle se rapporte le nouveau LEI, ou l'entité responsable de la déclaration au nom de l'une ou l'autre de ces contreparties au titre de l'article 9, paragraphes 1 *bis* à 1 *quinqüies*, du règlement (UE) n° 648/2012, ou l'entité à laquelle l'une des contreparties a délégué la déclaration en application de l'article 9, paragraphe 1 *septies*, du même règlement, notifie le changement au référentiel central auquel la contrepartie ayant subi la restructuration d'entreprise a déclaré ses contrats dérivés et demande à actualiser le LEI dans les contrats dérivés en question visés à l'article 2, paragraphe 2, points a) et b), à la date de la restructuration d'entreprise ayant conduit au changement de LEI ou des contrats déclarés après cette date.

▼B

2. Si possible, la demande d'actualisation de l'identifiant dans les contrats dérivés mentionnés à l'article 2, paragraphe 2, points a) et b), est soumise au minimum 30 jours calendaires avant la restructuration d'entreprise débouchant sur le changement de LEI. Si l'entité visée au paragraphe 1 n'est pas en mesure de communiquer ces informations au référentiel central dans les 30 jours calendaires précédant la restructuration d'entreprise entraînant le changement de LEI, elle en informe le référentiel central le plus tôt possible.

3. La demande visée au paragraphe 1 comprend au moins les éléments suivants:

a) le LEI de chaque contrepartie participant à la restructuration d'entreprise;

b) le LEI de la nouvelle contrepartie;

c) la date à laquelle le changement de LEI aura lieu ou a eu lieu;

d) les UTI des produits dérivés concernés dans le cas où la restructuration d'entreprise ne touche qu'une sous-catégorie de produits dérivés visés à l'article 2, paragraphe 2, points a) et b);

e) les éléments de preuve attestant que la restructuration d'entreprise a eu lieu ou aura lieu, sous réserve des dispositions relatives à la publication d'informations privilégiées énoncées à l'article 17 du règlement (UE) n° 596/2014.

4. Lorsqu'une contrepartie signale par erreur un changement de son LEI à un référentiel central, elle suit la procédure de demande d'actualisation de son LEI conformément aux paragraphes 1, 2 et 3.

5. Lorsqu'une contrepartie précédemment identifiée au moyen d'un identifiant autre que le LEI obtient un LEI, les procédures prévues aux paragraphes 1, 2 et 3 s'appliquent.

6. Lorsqu'un changement de LEI se rapporte à une contrepartie établie dans un pays tiers, sa contrepartie déclarante établie dans l'Union ou l'entité responsable de la déclaration au titre de l'article 9, paragraphes 1 *bis* à 1 *quinquies*, du règlement (UE) n° 648/2012, ou l'entité à laquelle la contrepartie déclarante établie dans l'Union a délégué la déclaration engage la procédure en vertu des paragraphes 1, 2 et 3.

7. Lorsqu'une contrepartie établie dans un pays tiers précédemment identifiée à l'aide d'un identifiant autre que le LEI obtient un LEI, chaque contrepartie déclarante établie dans l'Union concernée par ce changement, ou l'entité responsable de la déclaration en application de l'article 9, paragraphes 1 *bis* à 1 *quinquies*, du règlement (UE) n° 648/2012, ou l'entité à laquelle la contrepartie déclarante établie dans l'Union a délégué la déclaration demande l'actualisation de l'identifiant de la contrepartie établie dans un pays tiers auprès de son référentiel central respectif.

▼B

8. Lorsque le changement de LEI concerne une entité visée à l'article 3, paragraphe 1, point a), b), c), e) ou g), qui n'est pas une contrepartie au contrat dérivé, la contrepartie 1 ou l'entité responsable de la déclaration valide auprès du référentiel central les UTI des produits dérivés concernés mentionnés à l'article 2, paragraphe 2, points a) et b). Si la contrepartie 1 et l'entité responsable de la déclaration ne valident pas auprès du référentiel central les UTI des produits dérivés visés à l'article 2, paragraphe 2, points a) et b), concernés par le changement de LEI, la contrepartie 1 ou l'entité responsable de la déclaration actualise le LEI de l'entité en question dans toutes les déclarations portant sur les produits dérivés concernés mentionnés à l'article 2, paragraphe 2, points a) et b), en envoyant une déclaration avec le type d'action «Modification».

*Article 9***Méthodes et modalités de déclaration**

1. L'entité responsable de la déclaration envoie une notification à son autorité compétente et, s'il s'agit de deux organes différents, à l'autorité compétente pour la contrepartie déclarante, en cas:

- a) de déclaration erronée causée par des défaillances des systèmes de déclaration susceptibles de concerner un nombre non négligeable de déclarations;
- b) d'obstacle à la déclaration empêchant l'entité soumettant la déclaration d'envoyer cette dernière à un référentiel central dans le délai fixé à l'article 9, paragraphe 1, du règlement (UE) n° 648/2012;
- c) de problème important conduisant à des erreurs de déclaration qui ne provoqueraient pas de refus par un référentiel central conformément au règlement délégué (UE) 2022/1858 de la Commission ⁽²⁾.

L'entité responsable de la déclaration signale rapidement les cas qui précèdent, dès qu'elle en a connaissance.

La notification indique, au moins, le type d'erreur ou d'omission, la date à laquelle l'erreur ou l'omission est survenue, l'étendue des déclarations concernées, les raisons de l'erreur ou de l'omission, les mesures prises pour résoudre le problème et le calendrier de cette résolution ainsi que des mesures correctives.

2. Lorsqu'une contrepartie financière est seule responsable, y compris légalement, de la déclaration des éléments des contrats dérivés de gré à gré au nom d'une contrepartie non financière au titre de l'article 9, paragraphe 1 *bis*, du règlement (UE) n° 648/2012, elle met en place les modalités suivantes:

⁽²⁾ Règlement délégué (UE) 2022/1858 de la Commission du 10 juin 2022 complétant le règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil par des normes techniques de réglementation précisant les procédures de rapprochement des données entre référentiels centraux et les procédures à appliquer par le référentiel central pour vérifier le respect des obligations de déclaration par la contrepartie déclarante ou par l'entité qui soumet la déclaration et pour vérifier l'exhaustivité et l'exactitude des données déclarées (voir page 46 du présent Journal officiel).

▼B

- a) les modalités qui doivent lui permettre de fournir en temps opportun les éléments suivants des contrats dérivés de gré à gré, lorsque l'on ne peut pas raisonnablement attendre de la contrepartie financière qu'elle détienne ces éléments et que ces derniers ne sont effectivement pas connus d'elle:
- i) l'identifiant du courtier, tel que visé dans le champ 15 du tableau 1 de l'annexe;
 - ii) le membre compensateur, tel que visé dans le champ 16 du tableau 1 de l'annexe;
 - iii) le lien direct avec l'activité commerciale ou le financement de trésorerie, tel que visé dans le champ 20 du tableau 1 de l'annexe;
- b) les modalités pour le signalement en temps voulu, par la contrepartie non financière à la contrepartie financière, de toute modification de ses obligations légales en vertu de l'article 10, paragraphe 1, du règlement (UE) n° 648/2012;
- c) les modalités pour le renouvellement en bonne et due forme par la contrepartie non financière de son LEI, dans le respect des conditions de l'une des unités opérationnelles locales accréditées du système LEI international;
- d) les modalités pour la notification en temps opportun, par la contrepartie non financière à la contrepartie financière, de sa décision de commencer ou de cesser la déclaration des éléments des contrats dérivés de gré à gré conclus avec la contrepartie financière. Ces modalités garantissent, au minimum, que la notification est effectuée, par écrit ou par un autre moyen électronique équivalent, au moins dix jours ouvrables avant la date à laquelle la contrepartie non financière souhaite commencer ou cesser la déclaration.

3. Les contreparties, les entités responsables de la déclaration et les entités qui soumettent les déclarations, selon le cas, mettent en place des modalités permettant d'assurer la prise en compte du retour d'information sur les échecs de rapprochement prévu en application de l'article 3 du règlement délégué (UE) 2022/1858.

▼C3*Article 10***Date à laquelle les contrats dérivés doivent être déclarés**

Une contrepartie à un contrat dérivé qui satisfait aux conditions énoncées à l'article 2, paragraphe 2, point a) ou b), à la date du 29 avril 2024 ou l'entité responsable de la déclaration déclare l'ensemble des éléments dudit contrat dérivé requis conformément à l'annexe, en soumettant une déclaration avec le type d'événement «Actualisation» dans les 180 jours calendaires suivant le 29 avril 2024, sauf si elle a soumis une déclaration avec le type d'action «Modification» ou «Correction» pour ce contrat dérivé dans ce délai.

▼B

Article 11

Abrogation

Le règlement d'exécution (UE) n° 1247/2012 est abrogé.

Les références faites au règlement abrogé s'entendent comme faites au présent règlement.

Article 12

Entrée en vigueur et application

Le présent règlement entre en vigueur le vingtième jour suivant celui de sa publication au *Journal officiel de l'Union européenne*.

Il est applicable à partir du 29 avril 2024.

Le présent règlement est obligatoire dans tous ses éléments et directement applicable dans tout État membre.



ANNEXE

Tableau 1

	Section	Champ	Format
1	Parties au contrat dérivé	Horodatage de la déclaration	Date au format ISO 8601 et heure TUC (temps universel coordonné), comme suit: AAAA-MM-DDTh:mm:ssZ
2	Parties au contrat dérivé	Identifiant de l'entité qui transmet la déclaration	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques inclus dans les données LEI telles qu'elles sont publiées par la Global LEI Foundation.
3	Parties au contrat dérivé	Entité chargée de la déclaration	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques inclus dans les données LEI telles qu'elles sont publiées par la Global LEI Foundation. Le LEI doit être dûment renouvelé conformément aux modalités de l'une des unités opérationnelles locales accréditées du système mondial d'identifiant d'entité juridique.
4	Parties au contrat dérivé	Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques inclus dans les données LEI telles qu'elles sont publiées par la Global LEI Foundation. Le LEI doit être dûment renouvelé conformément aux modalités de l'une des unités opérationnelles locales accréditées du système mondial d'identifiant d'entité juridique.
5	Parties au contrat dérivé	Nature de la contrepartie 1	F = contrepartie financière N = contrepartie non financière C = contrepartie centrale O = autre (<i>other</i>)
6	Parties au contrat dérivé	Secteur d'activité de la contrepartie 1	Taxinomie des contreparties financières: «INVF» — une entreprise d'investissement agréée conformément à la directive 2014/65/UE du Parlement européen et du Conseil ⁽¹⁾ ; «CDTI» — un établissement de crédit agréé conformément à la directive 2013/36/UE du Parlement européen et du Conseil ⁽²⁾ ; «INUN» — une entreprise d'assurance ou de réassurance agréée conformément à la directive 2009/138/CE du Parlement européen et du Conseil ⁽³⁾ ; «UCIT» — un OPCVM et, le cas échéant, sa société de gestion agréés conformément à la directive 2009/65/CE du Parlement européen et du Conseil ⁽⁴⁾ , à moins que cet OPCVM ne soit établi exclusivement aux fins de servir un ou plusieurs plans d'actionnariat salarié; «ORPI» — une institution de retraite professionnelle (IRP) au sens de l'article 6, point 1), de la directive (UE) 2016/2341 du Parlement européen et du Conseil ⁽⁵⁾ ;

▼ B

	Section	Champ	Format
			<p>«AIFD» — un fonds d'investissement alternatif (FIA) au sens de l'article 4, paragraphe 1, point a), de la directive 2011/61/UE du Parlement européen et du Conseil ⁽⁶⁾, qui est soit établi dans l'Union, soit géré par un gestionnaire de fonds d'investissement alternatif (ci-après dénommé «gestionnaire de FIA»), agréé ou enregistré conformément à ladite directive, à moins que ce FIA ne soit établi exclusivement aux fins de servir un ou plusieurs plans d'actionnariat salarié, ou que le FIA ne soit une structure de titrisation ad hoc visée à l'article 2, paragraphe 3, point g), de la directive 2011/61/UE et, le cas échéant, son gestionnaire de FIA établi dans l'Union;</p> <p>«CSDS» — un dépositaire central de titres agréé conformément au règlement (UE) n° 909/2014 du Parlement européen et du Conseil ⁽⁷⁾;</p> <p>Taxinomie des contreparties non financières.</p> <p>Les catégories ci-dessous correspondent aux principales sections de la nomenclature NACE, telle que définie dans le règlement (CE) n° 1893/2006 du Parlement européen et du Conseil ⁽⁸⁾:</p> <p>«A» — Agriculture, sylviculture et pêche;</p> <p>«B» — Industries extractives;</p> <p>«C» — Industrie manufacturière;</p> <p>«D» — Production et distribution d'électricité, de gaz, de vapeur et d'air conditionné;</p> <p>«E» — Production et distribution d'eau; assainissement, gestion des déchets et dépollution;</p> <p>«F» — Construction;</p> <p>«G» — Commerce; réparation d'automobiles et de motocycles;</p> <p>«H» — Transports et entreposage;</p> <p>«I» — Hébergement et restauration;</p> <p>«J» — Information et communication;</p> <p>«K» — Activités financières et d'assurance;</p> <p>«L» — Activités immobilières;</p> <p>«M» — Activités spécialisées, scientifiques et techniques;</p> <p>«N» — Activités de services administratifs et de soutien;</p> <p>«O» — Administration publique et défense; sécurité sociale obligatoire;</p> <p>«P» — Enseignement;</p> <p>«Q» — Santé humaine et action sociale;</p> <p>«R» — Arts, spectacles et activités récréatives;</p> <p>«S» — Autres activités de services;</p>

▼ B

	Section	Champ	Format
			<p>«T» — Activités des ménages en tant qu'employeurs; activités indifférenciées des ménages en tant que producteurs de biens et services pour usage propre;</p> <p>«U» — Activités des organisations et organismes extraterritoriaux.</p> <p>Lorsque plusieurs activités sont déclarées, lister les codes par ordre d'importance relative des activités correspondantes.</p> <p>Laisser la case vierge pour les contreparties centrales et les autres types de contreparties visés à l'article 1^{er}, paragraphe 5, du règlement (UE) n° 648/2012 ⁽⁹⁾.</p>
7	Parties au contrat dérivé	Seuil de compensation de la contrepartie 1	<p>Valeur booléenne:</p> <p>TRUE (vraie) = au-dessus du seuil</p> <p>FALSE (fausse) = en dessous du seuil</p>
8	Parties au contrat dérivé	Type d'identifiant de la contrepartie 2	<p>Valeur booléenne:</p> <p>— TRUE (vraie)</p> <p>— FALSE (fausse), pour les personnes physiques agissant en tant que particuliers qui ne sont pas éligibles à l'obtention d'un LEI conformément à la déclaration du Comité de surveillance réglementaire du 20 septembre 2015 relative aux individus agissant en qualité d'entreprise (Statement on Individuals Acting in a Business Capacity, ci-après la «déclaration du Comité de surveillance réglementaire»).</p>
9	Parties au contrat dérivé	Contrepartie 2	<p>— Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques inclus dans les données LEI telles qu'elles sont publiées par la Global LEI Foundation ou code de 72 caractères alphanumériques au maximum pour les personnes physiques agissant en tant que particuliers qui ne sont pas éligibles à l'obtention d'un LEI conformément à la déclaration du Comité de surveillance réglementaire.</p> <p>Le code d'identification d'une personne physique se compose du LEI de la contrepartie 1 suivi d'un identifiant unique attribué et conservé systématiquement par la contrepartie 1 pour cette personne physique aux fins des déclarations réglementaires.</p>
10	Parties au contrat dérivé	Pays de la contrepartie 2	Code pays ISO 3166 — code pays à 2 caractères
11	Parties au contrat dérivé	Nature de la contrepartie 2	<p>F = contrepartie financière</p> <p>N = contrepartie non financière</p> <p>C = contrepartie centrale</p> <p>O = autre (<i>other</i>)</p>

▼ B

	Section	Champ	Format
12	Parties au contrat dérivé	Secteur d'activité de la contrepartie 2	<p>Taxinomie des contreparties financières:</p> <p>«INVF» — une entreprise d'investissement agréée conformément à la directive 2014/65/UE;</p> <p>«CDTI» — un établissement de crédit agréé conformément à la directive 2013/36/UE;</p> <p>«INUN» — une entreprise d'assurance ou de réassurance agréée conformément à la directive 2009/138/CE;</p> <p>«UCIT» — un OPCVM et, le cas échéant, sa société de gestion agréés conformément à la directive 2009/65/CE, à moins que cet OPCVM ne soit établi exclusivement aux fins de servir un ou plusieurs plans d'actionnariat salarié;</p> <p>«ORPI» — une institution de retraite professionnelle (IRP) au sens de l'article 6, point 1), de la directive (UE) 2016/2341;</p> <p>«AIFD» — un fonds d'investissement alternatif (FIA) au sens de l'article 4, paragraphe 1, point a), de la directive 2011/61/UE, qui est soit établi dans l'Union, soit géré par un gestionnaire de fonds d'investissement alternatif (ci-après dénommé «gestionnaire de FIA»), agréé ou enregistré conformément à ladite directive, à moins que ce FIA ne soit établi exclusivement aux fins de servir un ou plusieurs plans d'actionnariat salarié, ou que le FIA ne soit une structure de titrisation ad hoc visée à l'article 2, paragraphe 3, point g), de la directive 2011/61/UE et, le cas échéant, son gestionnaire de FIA établi dans l'Union;</p> <p>«CSDS» — un dépositaire central de titres agréé conformément au règlement (UE) n° 909/2014;</p> <p>Taxinomie des contreparties non financières.</p> <p>Les catégories ci-dessous correspondent aux principales sections de la nomenclature NACE, telle que définie dans le règlement (CE) n° 1893/2006:</p> <p>«A» — Agriculture, sylviculture et pêche;</p> <p>«B» — Industries extractives;</p> <p>«C» — Industrie manufacturière;</p> <p>«D» — Production et distribution d'électricité, de gaz, de vapeur et d'air conditionné;</p> <p>«E» — Production et distribution d'eau; assainissement, gestion des déchets et dépollution;</p> <p>«F» — Construction;</p> <p>«G» — Commerce; réparation d'automobiles et de motocycles;</p> <p>«H» — Transports et entreposage;</p> <p>«I» — Hébergement et restauration;</p> <p>«J» — Information et communication;</p> <p>«K» — Activités financières et d'assurance;</p>

▼ B

	Section	Champ	Format
			<p>«L» — Activités immobilières;</p> <p>«M» — Activités spécialisées, scientifiques et techniques;</p> <p>«N» — Activités de services administratifs et de soutien;</p> <p>«O» — Administration publique et défense; sécurité sociale obligatoire;</p> <p>«P» — Enseignement;</p> <p>«Q» — Santé humaine et action sociale;</p> <p>«R» — Arts, spectacles et activités récréatives;</p> <p>«S» — Autres activités de services;</p> <p>«T» — Activités des ménages en tant qu'employeurs; activités indifférenciées des ménages en tant que producteurs de biens et services pour usage propre;</p> <p>«U» — Activités des organisations et organismes extraterritoriaux.</p> <p>Lorsque plusieurs activités sont déclarées, lister les codes par ordre d'importance relative des activités correspondantes.</p> <p>Laisser la case vierge pour les contreparties centrales et les autres types de contreparties visés à l'article 1^{er}, paragraphe 5, du règlement (UE) n° 648/2012.</p>
13	Parties au contrat dérivé	Seuil de compensation de la contrepartie 2	<p>Valeur booléenne:</p> <p>TRUE (vraie) = au-dessus du seuil</p> <p>FALSE (fausse) = en dessous du seuil</p>
14	Parties au contrat dérivé	Obligation de déclaration de la contrepartie 2	<p>Valeur booléenne:</p> <p>— TRUE (vraie), si la contrepartie 2 est soumise à l'obligation de déclaration</p> <p>— FALSE (fausse), si la contrepartie 2 n'est pas soumise à l'obligation de déclaration</p>
15	Parties au contrat dérivé	Identifiant du courtier	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques inclus dans les données LEI telles qu'elles sont publiées par la Global LEI Foundation.
16	Parties au contrat dérivé	Membre compensateur	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques inclus dans les données LEI telles qu'elles sont publiées par la Global LEI Foundation.
17	Parties au contrat dérivé	Sens	<p>4 caractères alphabétiques:</p> <p>BYER = acheteur (<i>buyer</i>)</p> <p>SLLR = vendeur (<i>seller</i>)</p> <p>À compléter conformément à l'article 4 du présent règlement</p>

▼B

	Section	Champ	Format
18	Parties au contrat dérivé	Sens de la jambe 1	4 caractères alphabétiques: MAKE = payeur TAKE = receveur À compléter conformément à l'article 4 du présent règlement
19	Parties au contrat dérivé	Sens de la jambe 2	4 caractères alphabétiques: MAKE = payeur TAKE = receveur À compléter conformément à l'article 4 du présent règlement
20	Parties au contrat dérivé	Lien direct avec l'activité commerciale ou le financement de trésorerie	Valeur booléenne: TRUE (vraie) = Oui FALSE (fausse) = Non

(1) Directive 2014/65/UE du Parlement européen et du Conseil du 15 mai 2014 concernant les marchés d'instruments financiers et modifiant la directive 2002/92/CE et la directive 2011/61/UE (JO L 173 du 12.6.2014, p. 349).

(2) Directive 2013/36/UE du Parlement européen et du Conseil du 26 juin 2013 concernant l'accès à l'activité des établissements de crédit et la surveillance prudentielle des établissements de crédit et des entreprises d'investissement, modifiant la directive 2002/87/CE et abrogeant les directives 2006/48/CE et 2006/49/CE (JO L 176 du 27.6.2013, p. 338).

(3) Directive 2009/138/CE du Parlement européen et du Conseil du 25 novembre 2009 sur l'accès aux activités de l'assurance et de la réassurance et leur exercice (solvabilité II) (JO L 335 du 17.12.2009, p. 1).

(4) Directive 2009/65/CE du Parlement européen et du Conseil du 13 juillet 2009 portant coordination des dispositions législatives, réglementaires et administratives concernant certains organismes de placement collectif en valeurs mobilières (OPCVM) (JO L 302 du 17.11.2009, p. 32).

(5) Directive (UE) 2016/2341 du Parlement européen et du Conseil du 14 décembre 2016 concernant les activités et la surveillance des institutions de retraite professionnelle (IRP) (JO L 354 du 23.12.2016, p. 37).

(6) Directive 2011/61/UE du Parlement européen et du Conseil du 8 juin 2011 sur les gestionnaires de fonds d'investissement alternatifs et modifiant les directives 2003/41/CE et 2009/65/CE ainsi que les règlements (CE) n° 1060/2009 et (UE) n° 1095/2010 (JO L 174 du 1.7.2011, p. 1).

(7) Règlement (UE) n° 909/2014 du Parlement européen et du Conseil du 23 juillet 2014 concernant l'amélioration du règlement de titres dans l'Union européenne et les dépositaires centraux de titres, et modifiant les directives 98/26/CE et 2014/65/UE ainsi que le règlement (UE) n° 236/2012 (JO L 257 du 28.8.2014, p. 1).

(8) Règlement (CE) n° 1893/2006 du Parlement européen et du Conseil du 20 décembre 2006 établissant la nomenclature statistique des activités économiques NACE Rév. 2 et modifiant le règlement (CEE) n° 3037/90 du Conseil ainsi que certains règlements (CE) relatifs à des domaines statistiques spécifiques (JO L 393 du 30.12.2006, p. 1).

(9) Règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil du 4 juillet 2012 sur les produits dérivés de gré à gré, les contreparties centrales et les référentiels centraux (JO L 201 du 27.7.2012, p. 1).

Tableau 2

	Section	Champ	Format
1	Section 2a — Identifiants et liens	UTI	UTI ISO 23897. 52 caractères alphanumériques au maximum, seuls les caractères alphabétiques majuscules de A à Z et les chiffres de 0 à 9 sont autorisés
2	Section 2a — Identifiants et liens	Numéro de suivi de la déclaration	Champ alphanumérique de 52 caractères au maximum
3	Section 2a — Identifiants et liens	UTI antérieur (pour les relations un-à-un et un-à-plusieurs entre les transactions)	52 caractères alphanumériques au maximum, seuls les caractères alphabétiques majuscules de A à Z et les chiffres de 0 à 9 sont autorisés

▼ **B**

	Section	Champ	Format
4	Section 2a — Identifiants et liens	UTI de la position ultérieure	52 caractères alphanumériques au maximum, seuls les caractères alphabétiques majuscules de A à Z et les chiffres de 0 à 9 sont autorisés
5	Section 2a — Identifiants et liens	Identifiant de la réduction des risques post-négociation (PTRR — <i>Post Trade Risk Reduction</i>)	52 caractères alphanumériques au maximum, seuls les caractères alphabétiques majuscules de A à Z et les chiffres de 0 à 9 sont autorisés. Les 20 premiers caractères représentent le LEI du fournisseur de compression
6	Section 2a — Identifiants et liens	Identifiant du groupe	Jusqu'à 35 caractères alphanumériques.
7	Section 2b — Informations contractuelles	Numéro international d'identification des titres (code ISIN)	Code ISIN ISO 6166 à 12 caractères alphanumériques
8	Section 2b — Informations contractuelles	Identifiant unique de produit (UPI)	Code UPI ISO 4914 à 12 caractères alphanumériques
9	Section 2b — Informations contractuelles	Classification du produit	Code CFI ISO 10962 à 6 caractères alphabétiques
10	Section 2b — Informations contractuelles	Type de contrat	CFDS = contrat financier avec paiement d'un différentiel (<i>financial contracts for difference</i>) FRAS = accord de taux futurs (<i>forward rate agreements</i>) FUTR = contrat à terme standardisé (<i>futures</i>) FORW = contrat à terme de gré à gré (<i>forwards</i>) OPTN = option SPDB = spéculation sur écart (<i>spreadbet</i>) SWAP = contrat d'échange SWPT = option sur contrat d'échange (<i>swaption</i>) OTHR = autre (<i>other</i>)
11	Section 2b — Informations contractuelles	Catégorie d'actifs	► C2 COMM = matières premières et quotas d'émission (<i>commodity and emission allowances</i>) CRDT = crédit CURR = monnaie (<i>currency</i>) EQUI = actions (<i>equity</i>) INTR = taux d'intérêt (<i>interest rate</i>) ◀
12	Section 2b — Informations contractuelles	Produits dérivés fondés sur des crypto-actifs	Valeur booléenne: — TRUE (vraie) — pour les produits dérivés fondés sur des crypto-actifs — FALSE (fausse) — pour les autres produits dérivés
13	Section 2b — Informations contractuelles	Type d'identification du sous-jacent	1 caractère alphabétique: I = code ISIN B = panier (<i>basket</i>) X = indice (<i>index</i>)

▼ B

	Section	Champ	Format
14	Section 2b — Informations contractuelles	Identification du sous-jacent	Pour un identifiant du sous-jacent de type I: Code ISIN ISO 6166 à 12 caractères alphanumériques Pour un identifiant du sous-jacent de type X: Code ISIN ISO 6166 si disponible, à 12 caractères alphanumériques
15	Section 2b — Informations contractuelles	Indicateur de l'indice sous-jacent	Indication de l'indice du taux variable. 4 caractères alphabétiques: ESTR = €STR SONA = SONIA SOFR = SOFR EONA = EONIA EONS = EONIA SWAP EURI = EURIBOR EUUS = EURODOLLAR EUCH = EuroSwiss GCFR = GCF REPO ISDA = ISDAFIX LIBI = LIBID LIBO = LIBOR MAAA = Muni AAA PFAN = Pfandbriefe TIBO = TIBOR STBO = STIBOR BBSW = BBSW JIBA = JIBAR BUBO = BUBOR CDOR = CDOR CIBO = CIBOR MOSP = MOSPRIM NIBO = NIBOR PRBO = PRIBOR TLBO = TELBOR WIBO = WIBOR TREA = Trésor SWAP = Contrats d'échange FUSW = Contrats d'échange à terme standardisés (<i>future SWAP</i>) EFFR = Taux effectif des fonds fédéraux (<i>effective federal funds rate</i>) OBFR = taux de financement bancaire au jour le jour (<i>overnight bank funding rate</i>) CZNA = CZEONIA
16	Section 2b — Informations contractuelles	Nom de l'indice sous-jacent	Jusqu'à 50 caractères alphanumériques. Les caractères spéciaux sont autorisés s'ils font partie du nom complet de l'indice.

▼ B

	Section	Champ	Format
17	Section 2b — Informations contractuelles	Code de panier personnalisé	Jusqu'à 72 caractères alphanumériques composés du LEI du structuré de panier suivi de 52 caractères alphanumériques au maximum.
18	Section 2b — Informations contractuelles	Identifiant des composantes du panier	Pour un identifiant du sous-jacent de type B: Toutes les composantes individuelles sont identifiées au moyen du code ISIN ISO 6166
19	Section 2b — Informations contractuelles	Monnaie de règlement 1	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques
20	Section 2b — Informations contractuelles	Monnaie de règlement 2	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques
21	Section 2c — Valorisation	Montant de la valorisation	Valeur positive ou négative, jusqu'à 25 caractères numériques, dont 5 décimales au maximum. Si la valeur comporte plus de cinq chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point. Si le signe moins est employé, il n'est pas compté comme un caractère numérique.
22	Section 2c — Valorisation	Monnaie de valorisation	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques
23	Section 2c — Valorisation	Horodatage de la valorisation	Date au format ISO 8601 et heure TUC, comme suit: AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ
24	Section 2c — Valorisation	Méthode de valorisation	4 caractères alphabétiques: MTMA = valorisation au prix du marché (<i>mark-to-market</i>) MTMO = valorisation par référence à un modèle (<i>mark-to-model</i>) CCPV = valorisation par la contrepartie centrale (<i>CCP's valuation</i>).
25	Section 2c — Valorisation	Delta	Jusqu'à 25 caractères numériques, dont 5 décimales au maximum. Si la valeur comporte plus de cinq chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point. Toute valeur comprise entre - 1 et 1 (toutes deux incluses) est autorisée.
26	Section 2d — Sûretés	Indicateur de collatéralisation du portefeuille	Valeur booléenne: TRUE (vraie) = collatéralisé sur la base d'un portefeuille FALSE (fausse) = ne fait pas partie d'un portefeuille
27	Section 2d — Sûretés	Code du portefeuille de sûretés	Jusqu'à 52 caractères alphanumériques Les caractères spéciaux ne sont pas autorisés
28	Section 2e — Réduction des risques/déclaration	Horodatage de la confirmation	Date au format ISO 8601 et heure TUC, comme suit: AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ

▼ B

	Section	Champ	Format
29	Section 2e — Réduction des risques/déclaration	Confirmé	4 caractères alphabétiques: — NCNF = non confirmé — ECNF = électronique — YCNF = non électronique
30	Section 2f — Compensation	Obligation de compensation	TRUE (vrai) = le contrat appartient à une catégorie de produits dérivés de gré à gré qui a été déclarée soumise à l'obligation de compensation et les deux contreparties au contrat sont soumises à l'obligation de compensation FLSE (faux) = le contrat appartient à une catégorie de produits dérivés de gré à gré qui a été déclarée soumise à l'obligation de compensation, mais une contrepartie au contrat au moins n'est pas soumise à l'obligation de compensation ou valeur «UKWN» (inconnu) — le contrat n'appartient pas à une catégorie de produits dérivés de gré à gré qui a été déclarée soumise à l'obligation de compensation
31	Section 2f — Compensation	Compensé	1 caractère alphabétique: Y= oui, compensé centralement, pour les transactions bêta et gamma. N= non, non compensé centralement.
32	Section 2f — Compensation	Horodatage de la compensation	Date au format ISO 8601 et heure TUC, comme suit: AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ
33	Section 2f — Compensation	Contrepartie centrale	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques inclus dans les données LEI telles qu'elles sont publiées par la Global LEI Foundation.
34	Section 2g — Détails de la transaction	Type d'accord-cadre	4 caractères alphabétiques: «ISDA» — ISDA (<i>International Swaps and Derivatives Association master agreement</i>) «CDEA» — FIA-ISDA <i>Cleared Derivatives Execution Agreement</i> «EUMA» — accord-cadre européen (<i>European Master Agreement</i>) «FPCA» — accord client professionnel FOA (<i>FOA Professional Client Agreement</i>) «FMAT» — accord-cadre FBF (<i>FBF Master Agreement</i>) relatif aux transactions sur instruments financiers à terme de gré à gré «DERV» — <i>Deutscher Rahmenvertrag für Finanztermingeschäfte (DRV)</i> «CMOP» — <i>Contrato Marco de Operaciones Financieras</i> «CHMA» — accord-cadre suisse (<i>Swiss Master Agreement</i>) «IDMA» — accord-cadre islamique sur les produits dérivés (<i>Islamic Derivative Master Agreement</i>) «EFMA» — accord-cadre EFET (<i>EFET Master Agreement</i>)

▼ B

	Section	Champ	Format
			<p>«GMRA» — accord-cadre d'achat global (GMRA, <i>Global Master Repurchase Agreement</i>)</p> <p>«GMSL» — accord-cadre mondial de prêt de titres (GMSLA, <i>Global Master Securities Lending Agreement</i>)</p> <p>«BIAG» — accord bilatéral (<i>bilateral agreement</i>)</p> <p>Ou «OTHR» (Autre) si le type d'accord-cadre ne figure pas dans la liste ci-dessus</p>
35	Section 2g — Détails de la transaction	Autre type d'accord-cadre	Jusqu'à 50 caractères alphanumériques.
36	Section 2g — Détails de la transaction	Version de l'accord-cadre	Date au format ISO 8601 (AAAA)
37	Section 2g — Détails de la transaction	Intragroupe	<p>Valeur booléenne:</p> <p>TRUE (vraie) = contrat conclu en tant que transaction intragroupe</p> <p>FALSE (fausse) = contrat non conclu en tant que transaction intragroupe</p>
38	Section 2g — Détails de la transaction	PTRR (réduction des risques post-négociation)	<p>Valeur booléenne:</p> <p>TRUE (vraie) = le contrat résulte d'une action de PTRR</p> <p>FALSE (fausse) = le contrat ne résulte pas d'une action de PTRR</p>
39	Section 2g — Détails de la transaction	Type de technique PTRR	<p>4 caractères alphabétiques:</p> <p>«PWOS» — compression de portefeuille sans fournisseur de services tiers (<i>Portfolio Compression without a third-party service provider</i>)</p> <p>«PWAS» — compression de portefeuille avec fournisseur de services tiers ou contrepartie centrale (<i>Portfolio Compression with a third-party service provider or CCP</i>)</p> <p>«PRBM» — Rééquilibrage de portefeuille/gestion des marges (<i>Portfolio Rebalancing/Margin management</i>)</p> <p>«OTHR» — Autre</p>
40	Section 2g — Détails de la transaction	Fournisseur de services PTRR	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques inclus dans les données LEI telles qu'elles sont publiées par la Global LEI Foundation.
41	Section 2g — Détails de la transaction	Lieu d'exécution	Code d'identification de marché (MIC) ISO 10383 à 4 caractères alphanumériques
42	Section 2c — Détails de la transaction	Horodatage de l'exécution	Date au format ISO 8601 et heure TUC, comme suit: AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ
43	Section 2c — Détails de la transaction	Date de prise d'effet	Date au format ISO 8601 et TUC, comme suit: AAAA-MM-JJ.
44	Section 2c — Détails de la transaction	Date d'expiration	Date au format ISO 8601 et TUC, comme suit: AAAA-MM-JJ.

▼ B

	Section	Champ	Format
45	Section 2c — Détails de la transaction	Date de résiliation anticipée	Date au format ISO 8601 et TUC, comme suit: AAAA-MM-JJ.
46	Section 2c — Détails de la transaction	Date de règlement contractuel final	Date au format ISO 8601 et TUC, comme suit: AAAA-MM-JJ.
47	Section 2c — Détails de la transaction	Type de livraison	4 caractères alphabétiques: «CASH» = espèces PHYS = physique OPTL = optionnel pour la contrepartie ou décidé par un tiers
48	Section 2g — Détails de la transaction	Prix	<p>— Si le prix est exprimé en valeur monétaire — toute valeur jusqu'à 18 caractères numériques, dont 13 décimales au maximum. Si la valeur comporte plus de 13 chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure.</p> <p>— Si le prix est exprimé en pourcentage — toute valeur jusqu'à 11 caractères numériques, dont 10 décimales au maximum, exprimée en pourcentage (par exemple 2,57 au lieu de 2,57 %). Si la valeur comporte plus de 10 chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure.</p> <p>Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.</p> <p>Si le signe moins est employé, il n'est pas compté comme un caractère numérique.</p>
49	Section 2g — Détails de la transaction	Monnaie du prix	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques
	Les champs 50 à 52 sont répétables et remplis dans le cas des contrats dérivés impliquant des échéanciers de prix		
50	Section 2g — Détails de la transaction	Date de prise d'effet du prix non ajustée	Date au format ISO 8601 et TUC, comme suit: AAAA-MM-JJ.
51	Section 2g — Détails de la transaction	Date de fin du prix non ajustée	Date au format ISO 8601 et TUC, comme suit: AAAA-MM-JJ.
52	Section 2g — Détails de la transaction	Prix en vigueur entre la date de prise d'effet et la date de fin non ajustées	— Si le prix est exprimé en valeur monétaire — toute valeur jusqu'à 18 caractères numériques, dont 13 décimales au maximum. Si la valeur comporte plus de 13 chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure.

▼B

	Section	Champ	Format
			<p>— Si le prix est exprimé en pourcentage — toute valeur jusqu'à 11 caractères numériques, dont 10 décimales au maximum, exprimée en pourcentage (par exemple 2,57 au lieu de 2,57 %). Si la valeur comporte plus de 10 chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure.</p> <p>Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.</p> <p>Si le signe moins est employé, il n'est pas compté comme un caractère numérique.</p>
53	Section 2g — Détails de la transaction	Prix pour les transactions groupées	<p>— Si le prix de la transaction groupée est exprimé en valeur monétaire — toute valeur jusqu'à 18 caractères numériques, dont 13 décimales au maximum. Si la valeur comporte plus de 13 chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure.</p> <p>— Si le prix de la transaction groupée est exprimé en pourcentage — toute valeur jusqu'à 11 caractères numériques, dont 10 décimales au maximum, exprimée en pourcentage (par exemple 2,57 au lieu de 2,57 %). Si la valeur comporte plus de 10 chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure.</p> <p>Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.</p> <p>Si le signe moins est employé, il n'est pas compté comme un caractère numérique.</p>
54	Section 2g — Détails de la transaction	Monnaie du prix de la transaction groupée	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques
55	Section 2g — Détails de la transaction	Montant notionnel de la jambe 1	<p>Toute valeur supérieure ou égale à zéro, jusqu'à 25 caractères numériques, dont 5 décimales au maximum. Si la valeur comporte plus de cinq chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure.</p> <p>Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.</p>
56	Section 2g — Détails de la transaction	Monnaie du notionnel 1	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques
	Les champs 57 à 59 sont répétables et remplis dans le cas des contrats dérivés impliquant des échéanciers de montant notionnel		

▼B

	Section	Champ	Format
57	Section 2g — Détails de la transaction	Date de prise d'effet du montant notionnel de la jambe 1	Date au format ISO 8601 et TUC, comme suit: AAAA-MM-JJ
58	Section 2g — Détails de la transaction	Date de fin du montant notionnel de la jambe 1	Date au format ISO 8601 et TUC, comme suit: AAAA-MM-JJ
59	Section 2g — Détails de la transaction	Montant notionnel en vigueur à la date de prise d'effet associée de la jambe 1	Toute valeur supérieure ou égale à zéro, jusqu'à 25 caractères numériques, dont 5 décimales au maximum. Si la valeur comporte plus de cinq chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
60	Section 2g — Détails de la transaction	Quantité notionnelle totale de la jambe 1	Toute valeur supérieure ou égale à zéro, jusqu'à 25 caractères numériques, dont 5 décimales au maximum. Si la valeur comporte plus de cinq chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
	Les champs 61 à 63 sont répétables et remplis dans le cas des contrats dérivés impliquant des échéanciers de quantité notionnelle		
61	Section 2g — Détails de la transaction	Date de prise d'effet de la quantité notionnelle de la jambe 1	Date au format ISO 8601 et TUC, comme suit: AAAA-MM-JJ
62	Section 2g — Détails de la transaction	Date de fin de la quantité notionnelle de la jambe 1	Date au format ISO 8601 et TUC, comme suit: AAAA-MM-JJ
63	Section 2g — Détails de la transaction	Quantité notionnelle en vigueur à la date de prise d'effet associée de la jambe 1	Toute valeur supérieure ou égale à zéro, jusqu'à 25 caractères numériques, dont 5 décimales au maximum. Si la valeur comporte plus de cinq chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.

▼B

	Section	Champ	Format
64	Section 2g — Détails de la transaction	Montant notionnel de la jambe 2	Toute valeur supérieure ou égale à zéro, jusqu'à 25 caractères numériques, dont 5 décimales au maximum. Si la valeur comporte plus de cinq chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
65	Section 2g — Détails de la transaction	Monnaie du notionnel 2	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques
	Les champs 66 à 68 sont répétables et remplis dans le cas des contrats dérivés impliquant des échéanciers de montant notionnel		
66	Section 2g — Détails de la transaction	Date de prise d'effet du montant notionnel de la jambe 2	Date au format ISO 8601 et TUC, comme suit: AAAA-MM-JJ
67	Section 2g — Détails de la transaction	Date de fin du montant notionnel de la jambe 2	Date au format ISO 8601 et TUC, comme suit: AAAA-MM-JJ
68	Section 2g — Détails de la transaction	Montant notionnel en vigueur à la date de prise d'effet associée de la jambe 2	Toute valeur supérieure ou égale à zéro, jusqu'à 25 caractères numériques, dont 5 décimales au maximum. Si la valeur comporte plus de cinq chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
69	Section 2g — Détails de la transaction	Quantité notionnelle totale de la jambe 2	Toute valeur supérieure ou égale à zéro, jusqu'à 25 caractères numériques, dont 5 décimales au maximum. Si la valeur comporte plus de cinq chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
	Les champs 70 à 72 sont répétables et remplis dans le cas des contrats dérivés impliquant des échéanciers de quantité notionnelle		

▼ B

	Section	Champ	Format
70	Section 2g — Détails de la transaction	Date de prise d'effet de la quantité notionnelle de la jambe 2	Date au format ISO 8601 et TUC, comme suit: AAAA-MM-JJ
71	Section 2g — Détails de la transaction	Date de fin de la quantité notionnelle de la jambe 2	Date au format ISO 8601 et TUC, comme suit: AAAA-MM-JJ
72	Section 2g — Détails de la transaction	Quantité notionnelle en vigueur à la date de prise d'effet associée de la jambe 2	Toute valeur supérieure ou égale à zéro, jusqu'à 25 caractères numériques, dont 5 décimales au maximum. Si la valeur comporte plus de cinq chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
	La section des champs 73 à 78 est répétable		
73	Section 2g — Détails de la transaction	Paiements d'un autre type	4 caractères alphabétiques: UFRO = paiement anticipé (<i>Upfront Payment</i>), c'est-à-dire le paiement initial effectué par l'une des contreparties soit pour amener une transaction à une juste valeur soit pour toute autre raison susceptible d'être à l'origine d'une transaction hors marché UWIN = révocation ou résiliation totale (<i>Uwind or Full termination</i>), c'est-à-dire le règlement final effectué lorsqu'une transaction est dénouée avant sa date de fin; Paiements pouvant résulter de la résiliation totale de la (des) transaction(s) sur produits dérivés PEXH = échange principal (<i>Principal Exchange</i>), c'est-à-dire échange de valeurs notionnelles pour les swaps de devises
74	Section 2g — Détails de la transaction	Montant de l'autre paiement	Jusqu'à 25 caractères numériques, dont 5 décimales au maximum. Si la valeur comporte plus de cinq chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point. Toute valeur supérieure ou égale à zéro est autorisée.
75	Section 2g — Détails de la transaction	Monnaie de l'autre paiement	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques
76	Section 2g — Détails de la transaction	Date de l'autre paiement	Date au format ISO 8601 et TUC, comme suit: AAAA-MM-JJ.

▼ B

	Section	Champ	Format
77	Section 2g — Détails de la transaction	Payeur de l'autre paiement	<p>— Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques inclus dans les données LEI telles qu'elles sont publiées par la Global LEI Foundation ou code de 72 caractères alphanumériques au maximum pour les personnes physiques agissant en tant que particuliers qui ne sont pas éligibles à l'obtention d'un LEI conformément à la déclaration du Comité de surveillance réglementaire.</p> <p>Le code d'identification d'une personne physique se compose du LEI de la contrepartie 1 suivi d'un identifiant unique attribué et conservé systématiquement par la contrepartie 1 pour cette personne physique aux fins des déclarations réglementaires.</p>
78	Section 2g — Détails de la transaction	Receveur de l'autre paiement	<p>— Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques inclus dans les données LEI telles qu'elles sont publiées par la Global LEI Foundation ou code de 72 caractères alphanumériques au maximum pour les personnes physiques agissant en tant que particuliers qui ne sont pas éligibles à l'obtention d'un LEI conformément à la déclaration du Comité de surveillance réglementaire.</p> <p>Le code d'identification d'une personne physique se compose du LEI de la contrepartie 1 suivi d'un identifiant unique attribué et conservé systématiquement par la contrepartie 1 pour cette personne physique aux fins des déclarations réglementaires.</p>
79	Section 2h — Taux d'intérêt	Taux fixe de la jambe 1 ou coupon	<p>Valeurs positives ou négatives jusqu'à 11 caractères numériques, dont 10 décimales au maximum, exprimées en pourcentage (par exemple 2,57 au lieu de 2,57 %).</p> <p>Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.</p> <p>Si le signe moins est employé, il n'est pas compté comme un caractère numérique.</p>
80	Section 2h — Taux d'intérêt	Convention de calcul des jours du taux fixe de la jambe 1 ou du coupon	<p>4 caractères alphanumériques:</p> <p>A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule</p> <p>A002 = IC30365</p> <p>A003 = IC30Actual</p> <p>A004 = Actual360</p> <p>A005 = Actual365Fixed</p> <p>A006 = ActualActualICMA</p> <p>A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1</p> <p>A008 = ActualActualISDA</p> <p>A009 = Actual365LorActuActubasisRule</p> <p>A010 = ActualActualAFB</p> <p>A011 = IC30360ICMAor30360basicrule</p>

▼ B

	Section	Champ	Format
			A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364 A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = narratif
81	Section 2h — Taux d'intérêt	Fréquence de paiement du taux fixe de la jambe 1 ou du coupon	4 caractères alphabétiques: DAIL = quotidienne (<i>daily</i>) WEEK = hebdomadaire (<i>weekly</i>) MNTH = mensuelle (<i>monthly</i>) YEAR = annuelle (<i>yearly</i>) ADHO = ad hoc, applicable lorsque les paiements sont irréguliers EXPI = paiement à terme
82	Section 2h — Taux d'intérêt	Multiplicateur de la fréquence de paiement du taux fixe de la jambe 1 ou du coupon	Toute valeur entière supérieure ou égale à zéro, jusqu'à 3 caractères numériques.
83	Section 2h — Taux d'intérêt	Identifiant du taux variable de la jambe 1	Si le taux variable a un code ISIN, le code ISIN de ce taux.
84	Section 2h — Taux d'intérêt	Indicateur du taux variable de la jambe 1	Indication de l'indice du taux variable. 4 caractères alphabétiques: ESTR = €STR SONA = SONIA SOFR = SOFR EONA = EONIA EONS = EONIA SWAP EURI = EURIBOR EUUS = EURODOLLAR EUCH = EuroSwiss GCFR = GCF REPO ISDA = ISDAFIX LIBI = LIBID LIBO = LIBOR MAAA = Muni AAA PFAN = Pfandbriefe

▼ B

	Section	Champ	Format
			<p>TIBO = TIBOR</p> <p>STBO = STIBOR</p> <p>BBSW = BBSW</p> <p>JIBA = JIBAR</p> <p>BUBO = BUBOR</p> <p>CDOR = CDOR</p> <p>CIBO = CIBOR</p> <p>MOSP = MOSPRIM</p> <p>NIBO = NIBOR</p> <p>PRBO = PRIBOR</p> <p>TLBO = TELBOR</p> <p>WIBO = WIBOR</p> <p>TREA = Trésor</p> <p>SWAP = Contrats d'échange</p> <p>FUSW = Contrats d'échange à terme standardisés (<i>future SWAP</i>)</p> <p>EFFR = Taux effectif des fonds fédéraux (<i>effective federal funds rate</i>)</p> <p>OBFR = taux de financement bancaire au jour le jour (<i>overnight bank funding rate</i>)</p> <p>CZNA = CZEONIA</p>
85	Section 2h — Taux d'intérêt	Nom du taux variable de la jambe 1	Jusqu'à 50 caractères alphanumériques. Les caractères spéciaux sont autorisés s'ils font partie du nom complet de l'indice.
86	Section 2h — Taux d'intérêt	Convention de calcul des jours du taux variable de la jambe 1	<p>4 caractères alphanumériques:</p> <p>A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule</p> <p>A002 = IC30365</p> <p>A003 = IC30Actual</p> <p>A004 = Actual360</p> <p>A005 = Actual365Fixed</p> <p>A006 = ActualActualICMA</p> <p>A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1</p> <p>A008 = ActualActualISDA</p> <p>A009 = Actual365LorActuActubasisRule</p> <p>A010 = ActualActualAFB</p> <p>A011 = IC30360ICMAor30360basicrule</p> <p>A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2</p> <p>A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3</p> <p>A014 = Actual365NL</p> <p>A015 = ActualActualUltimo</p> <p>A016 = IC30EPlus360</p> <p>A017 = Actual364</p>

▼ B

	Section	Champ	Format
			A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = narratif
87	Section 2h — Taux d'intérêt	Fréquence de paiement du taux variable, jambe 1	4 caractères alphabétiques: DAIL = quotidienne (<i>daily</i>) WEEK = hebdomadaire (<i>weekly</i>) MNTH = mensuelle (<i>monthly</i>) YEAR = annuelle (<i>yearly</i>) ADHO = ad hoc, applicable lorsque les paiements sont irréguliers EXPI = paiement à terme
88	Section 2h — Taux d'intérêt	Multiplicateur de la fréquence de paiement du taux variable, jambe 1	Toute valeur entière supérieure ou égale à zéro, jusqu'à 3 caractères numériques.
89	Section 2h — Taux d'intérêt	Période de référence du taux variable de la jambe 1 — unité de temps	4 caractères alphabétiques: DAIL = quotidienne (<i>daily</i>) WEEK = hebdomadaire (<i>weekly</i>) MNTH = mensuelle (<i>monthly</i>) YEAR = annuelle (<i>yearly</i>) ADHO = ad hoc, applicable lorsque les paiements sont irréguliers EXPI = paiement à terme
90	Section 2h — Taux d'intérêt	Période de référence du taux variable de la jambe 1 — multiplicateur	Toute valeur entière supérieure ou égale à zéro, jusqu'à 3 caractères numériques.
91	Section 2h — Taux d'intérêt	Fréquence de réinitialisation du taux variable, jambe 1	4 caractères alphabétiques: DAIL = quotidienne (<i>daily</i>) WEEK = hebdomadaire (<i>weekly</i>) MNTH = mensuelle (<i>monthly</i>) YEAR = annuelle (<i>yearly</i>) ADHO = ad hoc, applicable lorsque les paiements sont irréguliers EXPI = paiement à terme
92	Section 2h — Taux d'intérêt	Multiplicateur de la fréquence de réinitialisation du taux variable de la jambe 1	Toute valeur entière supérieure ou égale à zéro, jusqu'à 3 caractères numériques.

▼ B

	Section	Champ	Format
93	Section 2h — Taux d'intérêt	Écart de la jambe 1	<p>— Si l'écart est exprimé en montant monétaire — toute valeur jusqu'à 18 caractères numériques, dont 13 décimales au maximum.</p> <p>— Si l'écart est exprimé en pourcentage — toute valeur jusqu'à 11 caractères numériques, dont 10 décimales au maximum, exprimée en pourcentage (par exemple 2,57 au lieu de 2,57 %).</p> <p>— Si l'écart est exprimé en points de base — toute valeur entière jusqu'à 5 caractères numériques exprimée en points de base (par exemple 257 au lieu de 2,57 %).</p>
94	Section 2h — Taux d'intérêt	Monnaie de l'écart de la jambe 1	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques
95	Section 2h — Taux d'intérêt	Taux fixe de la jambe 2	<p>Valeurs positives ou négatives jusqu'à 11 caractères numériques, dont 10 décimales au maximum, exprimées en pourcentage (par exemple 2,57 au lieu de 2,57 %).</p> <p>Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.</p> <p>Si le signe moins est employé, il n'est pas compté comme un caractère numérique.</p>
96	Section 2h — Taux d'intérêt	Convention de calcul des jours du taux fixe, jambe 2	<p>4 caractères alphanumériques:</p> <p>A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule</p> <p>A002 = IC30365</p> <p>A003 = IC30Actual</p> <p>A004 = Actual360</p> <p>A005 = Actual365Fixed</p> <p>A006 = ActualActualICMA</p> <p>A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1</p> <p>A008 = ActualActualISDA</p> <p>A009 = Actual365LorActuActubasisRule</p> <p>A010 = ActualActualAFB</p> <p>A011 = IC30360ICMAor30360basicrule</p> <p>A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2</p> <p>A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3</p> <p>A014 = Actual365NL</p> <p>A015 = ActualActualUltimo</p> <p>A016 = IC30EPlus360</p> <p>A017 = Actual364</p> <p>A018 = Business252</p> <p>A019 = Actual360NL</p> <p>A020 = 1/1</p> <p>NARR = narratif</p>

▼ B

	Section	Champ	Format
97	Section 2h — Taux d'intérêt	Fréquence de paiement du taux fixe, jambe 2	4 caractères alphabétiques: DAIL = quotidienne (<i>daily</i>) WEEK = hebdomadaire (<i>weekly</i>) MNTH = mensuelle (<i>monthly</i>) YEAR = annuelle (<i>yearly</i>) ADHO = ad hoc, applicable lorsque les paiements sont irréguliers EXPI = paiement à terme
98	Section 2h — Taux d'intérêt	Multiplicateur de la fréquence de paiement du taux fixe, jambe 2	Toute valeur entière supérieure ou égale à zéro, jusqu'à 3 caractères numériques.
99	Section 2h — Taux d'intérêt	Identifiant du taux variable de la jambe 2	Si le taux variable a un code ISIN, le code ISIN de ce taux.
100	Section 2h — Taux d'intérêt	Indicateur du taux variable de la jambe 2	Indication de l'indice du taux variable. 4 caractères alphabétiques: ESTR = €STR SONA = SONIA SOFR = SOFR EONA = EONIA EONS = EONIA SWAP EURI = EURIBOR EUUS = EURODOLLAR EUCH = EuroSwiss GCFR = GCF REPO ISDA = ISDAFIX LIBI = LIBID LIBO = LIBOR MAAA = Muni AAA PFAN = Pfandbriefe TIBO = TIBOR STBO = STIBOR BBSW = BBSW JIBA = JIBAR BUBO = BUBOR CDOR = CDOR CIBO = CIBOR MOSP = MOSPRIM NIBO = NIBOR PRBO = PRIBOR TLBO = TELBOR

▼ B

	Section	Champ	Format
			<p>WIBO = WIBOR</p> <p>TREA = Trésor</p> <p>SWAP = Contrats d'échange</p> <p>FUSW = Contrats d'échange à terme standardisés (<i>future SWAP</i>)</p> <p>EFFR = Taux effectif des fonds fédéraux (<i>effective federal funds rate</i>)</p> <p>OBFR = taux de financement bancaire au jour le jour (<i>overnight bank funding rate</i>)</p> <p>CZNA = CZEONIA</p>
101	Section 2h — Taux d'intérêt	Nom du taux variable de la jambe 2	Jusqu'à 50 caractères alphanumériques. Les caractères spéciaux sont autorisés s'ils font partie du nom complet de l'indice.
102	Section 2h — Taux d'intérêt	Convention de calcul des jours du taux variable de la jambe 2	<p>4 caractères alphanumériques:</p> <p>A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule</p> <p>A002 = IC30365</p> <p>A003 = IC30Actual</p> <p>A004 = Actual360</p> <p>A005 = Actual365Fixed</p> <p>A006 = ActualActualICMA</p> <p>A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1</p> <p>A008 = ActualActualISDA</p> <p>A009 = Actual365LorActuActubasisRule</p> <p>A010 = ActualActualAFB</p> <p>A011 = IC30360ICMAor30360basicrule</p> <p>A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2</p> <p>A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3</p> <p>A014 = Actual365NL</p> <p>A015 = ActualActualUltimo</p> <p>A016 = IC30EPlus360</p> <p>A017 = Actual364</p> <p>A018 = Business252</p> <p>A019 = Actual360NL</p> <p>A020 = 1/1</p> <p>NARR = narratif</p>
103	Section 2h — Taux d'intérêt	Fréquence de paiement du taux variable, jambe 2	<p>4 caractères alphabétiques:</p> <p>DAIL = quotidienne (<i>daily</i>)</p> <p>WEEK = hebdomadaire (<i>weekly</i>)</p> <p>MNTH = mensuelle (<i>monthly</i>)</p> <p>YEAR = annuelle (<i>yearly</i>)</p> <p>ADHO = ad hoc, applicable lorsque les paiements sont irréguliers</p> <p>EXPI = paiement à terme</p>

▼ B

	Section	Champ	Format
104	Section 2h — Taux d'intérêt	Multiplicateur de la fréquence de paiement du taux variable, jambe 2	Toute valeur entière supérieure ou égale à zéro, jusqu'à 3 caractères numériques.
105	Section 2h — Taux d'intérêt	Période de référence du taux variable de la jambe 2 — unité de temps	4 caractères alphabétiques: DAIL = quotidienne (<i>daily</i>) WEEK = hebdomadaire (<i>weekly</i>) MNTH = mensuelle (<i>monthly</i>) YEAR = annuelle (<i>yearly</i>) ADHO = ad hoc, applicable lorsque les paiements sont irréguliers EXPI = paiement à terme
106	Section 2h — Taux d'intérêt	Période de référence du taux variable de la jambe 2 — multiplicateur	Toute valeur entière supérieure ou égale à zéro, jusqu'à 3 caractères numériques.
107	Section 2h — Taux d'intérêt	Fréquence de réinitialisation du taux variable, jambe 2	4 caractères alphabétiques: DAIL = quotidienne (<i>daily</i>) WEEK = hebdomadaire (<i>weekly</i>) MNTH = mensuelle (<i>monthly</i>) YEAR = annuelle (<i>yearly</i>) ADHO = ad hoc, applicable lorsque les paiements sont irréguliers EXPI = paiement à terme
108	Section 2h — Taux d'intérêt	Multiplicateur de la fréquence de réinitialisation du taux variable de la jambe 2	Toute valeur entière supérieure ou égale à zéro, jusqu'à 3 caractères numériques.
109	Section 2h — Taux d'intérêt	Écart de la jambe 2	— Si l'écart est exprimé en montant monétaire — toute valeur jusqu'à 18 caractères numériques, dont 13 décimales au maximum. — Si l'écart est exprimé en pourcentage — toute valeur jusqu'à 11 caractères numériques, dont 10 décimales au maximum, exprimée en pourcentage (par exemple 2,57 au lieu de 2,57 %). — Si l'écart est exprimé en points de base — toute valeur entière jusqu'à 5 caractères numériques exprimée en points de base (par exemple 257 au lieu de 2,57 %).
110	Section 2h — Taux d'intérêt	Monnaie de l'écart de la jambe 2	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques

▼ B

	Section	Champ	Format
111	Section 2h — Taux d'intérêt	Écart pour les transactions groupées	<p>— Si l'écart de la transaction groupée est exprimé en montant monétaire — valeur positive ou négative jusqu'à 18 caractères numériques, dont 13 décimales au maximum. Si la valeur comporte plus de 13 chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure.</p> <p>— Si l'écart de la transaction groupée est exprimé en pourcentage — valeur positive ou négative jusqu'à 11 caractères numériques, dont 10 décimales au maximum, exprimée en pourcentage (par exemple 2,57 au lieu de 2,57 %). Si la valeur comporte plus de 10 chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure.</p> <p>— Si l'écart de la transaction groupée est exprimé en points de base — toute valeur entière jusqu'à 5 caractères numériques exprimée en points de base (par exemple 257 au lieu de 2,57 %).</p> <p>Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.</p> <p>Si le signe moins est employé, il n'est pas compté comme un caractère numérique.</p>
112	Section 2h — Taux d'intérêt	Monnaie de l'écart pour les transactions groupées	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques
113	Section 2i — Changes	Taux de change 1	<p>Toute valeur supérieure à zéro, jusqu'à 18 caractères numériques, dont 13 décimales au maximum.</p> <p>Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.</p>
114	Section 2i — Changes	Taux de change à terme	<p>Toute valeur supérieure à zéro, jusqu'à 18 caractères numériques, dont 13 décimales au maximum.</p> <p>Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.</p>
115	Section 2i — Changes	Base du taux de change	<p>7 caractères représentant deux codes monnaie ISO 4217 séparés d'un «/» sans restriction concernant l'ordre des paires de monnaies.</p> <p>Le premier code monnaie désigne l'unité monétaire, et le second la monnaie de cotation.</p>
116	Section 2j — Matières premières et quotas d'émission (général)	Catégorie de produit	N'indiquer que des valeurs figurant dans la colonne «Catégories de produits» du tableau de classification des produits dérivés sur matières premières.
117	Section 2j — Matières premières et quotas d'émission (général)	Sous-catégorie de produit	<p>N'indiquer que des valeurs figurant dans la colonne «Sous-catégories de produits» du tableau de classification des produits</p> <p>dérivés sur matières premières.</p>

▼ B

	Section	Champ	Format
118	Section 2j — Matières premières et quotas d'émission (général)	Produit	N'indiquer que des valeurs figurant dans la colonne «Produit» du tableau de classification des produits dérivés sur matières premières.
119	Section 2k — Matières premières et quotas d'émission (énergie)	Point ou zone de livraison	EIC (<i>energy identification code</i>) à 16 caractères alphanumériques Champ répétable.
120	Section 2k — Matières premières et quotas d'émission (énergie)	Point d'interconnexion	EIC (<i>energy identification code</i>) à 16 caractères alphanumériques
121	Section 2k — Matières premières et quotas d'émission (énergie)	Type de charge	BSLD = charge de base (<i>base load</i>) PKLD = charge maximale (<i>peak load</i>) OFFP = hors période de pointe (<i>off-peak</i>) HABH = heures/bloc d'heures SHPD = <i>shaped</i> GASD = journée gazière (<i>gas day</i>) OTHR = autre (<i>other</i>)
	La section des champs 122 à 131 est répétable		
122	Section 2k — Matières premières et quotas d'émission (énergie)	Heure de début de l'intervalle de livraison	hh:mm:ssZ
123	Section 2k — Matières premières et quotas d'émission (énergie)	Heure de fin de l'intervalle de livraison	hh:mm:ssZ
124	Section 2k — Matières premières et quotas d'émission (énergie)	Date de début de la livraison	Date au format ISO 8601, comme suit: AAAA-MM-JJ
125	Section 2k — Matières premières et quotas d'émission (énergie)	Date de fin de la livraison	Date au format ISO 8601, comme suit: AAAA-MM-JJ
126	Section 2k — Matières premières et quotas d'émission (énergie)	Durée	MNUT = minutes HOUR = heure DASD = jour (<i>day</i>) WEEK = semaine MNTH = mois (<i>month</i>) QURT = trimestre (<i>quarter</i>) SEAS = saison (<i>season</i>) YEAR = année OTHR = autre

▼ B

	Section	Champ	Format
127	Section 2k — Matières premières et quotas d'émission (énergie)	Jours de la semaine	<p>WDAY = jours de la semaine (<i>Weekdays</i>)</p> <p>WEND = week-end</p> <p>MOND = lundi (<i>Monday</i>)</p> <p>TUED = mardi (<i>Tuesday</i>)</p> <p>WEDD = mercredi (<i>Wednesday</i>)</p> <p>THUD = jeudi (<i>Thursday</i>)</p> <p>FRID = vendredi (<i>Friday</i>)</p> <p>SATD = samedi (<i>Saturday</i>)</p> <p>SUND = dimanche (<i>Sunday</i>)</p> <p>XBHL = hors jours fériés (<i>Excluding bank holidays</i>)</p> <p>IBHL = jours fériés compris (<i>Including bank holidays</i>)</p> <p>Plusieurs valeurs possibles</p>
128	Section 2k — Matières premières et quotas d'émission (énergie)	Capacité de livraison	<p>Jusqu'à 20 caractères numériques, décimales comprises</p> <p>Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.</p> <p>Si le signe moins est employé, il n'est pas compté comme un caractère numérique.</p>
129	Section 2k — Matières premières et quotas d'émission (énergie)	Unité de mesure	<p>KWAT = KW</p> <p>KWHH = KWh/h</p> <p>KWHD = KWh/jour</p> <p>MWAT = MW</p> <p>MWHH = MWh/h</p> <p>MWHD = MWh/jour</p> <p>GWAT = GW</p> <p>GWHH = GWh/h</p> <p>GWHD = GWh/jour</p> <p>THMD = Therm/jour</p> <p>KTMD = Ktherm/jour</p> <p>MTMD = Mtherm/jour</p> <p>CMPD = M³/jour</p> <p>MCMD = Mio m³/jour</p> <p>BTUD = Btu/jour</p> <p>MBTD = MMBtu/jour</p> <p>MJDD = MJ/jour</p> <p>HMJD = 100MJ/jour</p> <p>MMJD = MMJ/jour</p> <p>GJDD = GJ/jour</p>
130	Section 2k — Matières premières et quotas d'émission (énergie)	Prix par quantité par intervalle de temps de livraison	<p>Jusqu'à 20 caractères numériques, décimales comprises.</p> <p>Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.</p> <p>Si le signe moins est employé, il n'est pas compté comme un caractère numérique.</p>

▼ B

	Section	Champ	Format
131	Section 2k — Matières premières et quotas d'émission (énergie)	Monnaie du prix par quantité par intervalle de temps de livraison	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques
132	Section 2l — Options	Type d'option	4 caractère alphabétique: PUTO = Put (<i>option de vente</i>) CALL = Call (<i>option d'achat</i>) OTHR = si la nature de l'option (achat ou vente) ne peut être déterminée
133	Section 2l — Options	Style d'option	4 caractères alphabétiques: AMER = américaine BERM = bermudienne EURO = européenne
134	Section 2l — Options	Prix d'exercice	— Si le prix d'exercice est exprimé en montant monétaire: toute valeur jusqu'à 18 caractères numériques, dont 13 décimales au maximum (par exemple 6,39 USD, exprimé par «6,39»), pour les options sur titres de propriété, les options sur matières premières, les options sur devises et produits similaires. Si la valeur comporte plus de 13 chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure. — Si le prix d'exercice est exprimé en pourcentage: toute valeur jusqu'à 11 caractères numériques, dont 10 décimales au maximum, exprimée en pourcentage (par exemple 2,1 au lieu de 2,1 %), pour les options sur taux d'intérêt, les swaptions sur taux d'intérêt et les swaptions de crédit exprimées en tant qu'écart de cotation, et produits similaires. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point. Si le signe moins est employé, il n'est pas compté comme un caractère numérique.
	Les champs 135 à 137 sont répétables et remplis dans le cas des contrats dérivés impliquant des échéanciers de prix d'exercice		
135	Section 2l — Options	Date de prise d'effet du prix d'exercice	Date au format ISO 8601 et TUC, comme suit: AAAA-MM-JJ.
136	Section 2l — Options	Date de fin du prix d'exercice	Date au format ISO 8601 et TUC, comme suit: AAAA-MM-JJ.

▼ **B**

	Section	Champ	Format
137	Section 2l — Options	Prix d'exercice en vigueur à la date de prise d'effet associée	<p>— Si le prix d'exercice est exprimé en montant monétaire: toute valeur jusqu'à 18 caractères numériques, dont 13 décimales au maximum (par exemple 6,39 USD, exprimé par «6,39»), pour les options sur titres de propriété, les options sur matières premières, les options sur devises et produits similaires. Si la valeur comporte plus de 13 chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure.</p> <p>— Si le prix d'exercice est exprimé en pourcentage: toute valeur jusqu'à 11 caractères numériques, dont 10 décimales au maximum, exprimée en pourcentage (par exemple 2,1 au lieu de 2,1 %), pour les options sur taux d'intérêt, les swaptions sur taux d'intérêt et les swaptions de crédit exprimées en tant qu'écart de cotation, et produits similaires.</p> <p>Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.</p> <p>Si le signe moins est employé, il n'est pas compté comme un caractère numérique.</p>
138	Section 2l — Options	Monnaie/paire de monnaies du prix d'exercice	<p>Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques; ou pour les options sur devises: 7 caractères représentant deux codes monnaie ISO 4217 séparés d'un «/» sans restriction concernant l'ordre des paires de monnaies.</p> <p>Le premier code monnaie désigne la monnaie de base, et le second la monnaie de cotation.</p>
139	Section 2l — Options	Montant de la prime d'option	<p>Toute valeur supérieure ou égale à zéro, jusqu'à 25 caractères numériques, dont 5 décimales au maximum. Si la valeur comporte plus de cinq chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure.</p> <p>Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.</p>
140	Section 2l — Options	Monnaie de la prime d'option	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques
141	Section 2l — Options	Date de paiement de la prime d'option	Date au format ISO 8601 et TUC, comme suit: AAAA-MM-JJ.
142	Section 2i — Options	Date d'échéance du sous-jacent	Date au format ISO 8601 et TUC, comme suit: AAAA-MM-JJ.

▼ B

	Section	Champ	Format
143	Section 2m — Dérivés de crédit	Rang	4 caractères alphabétiques: SNDB = dette senior, telle que dette de premier rang non garantie (entreprises/établissements financiers) ou dette souveraine en devises (administration publique) SBOD = dette subordonnée, telle que dette subordonnée ou de catégorie 2 inférieure (banques), ou telle que dette subordonnée de second rang ou de catégorie 2 supérieure (banques) OTHR = autre, tel qu'actions privilégiées, fonds propres de catégorie 1 (banques) ou autres dérivés de crédit
144	Section 2m — Dérivés de crédit	Entité de référence	Code pays ISO 3166 à 2 caractères ou code pays ISO 3166-2 à 2 caractères suivi d'un tiret «-» et du code de subdivision du pays comptant jusqu'à 3 caractères alphanumériques ou identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
145	Section 2m — Dérivés de crédit	Séries	Nombre entier de 5 caractères au maximum
146	Section 2m — Dérivés de crédit	Version	Nombre entier de 5 caractères au maximum
147	Section 2m — Dérivés de crédit	Facteur d'indice	Toute valeur jusqu'à 11 caractères numériques, dont 10 décimales au maximum, exprimée en fraction décimale (par exemple 0,05 au lieu de 5 %), entre 0 et 1 (tous deux inclus). Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
148	Section 2m — Dérivés de crédit	Tranche	Valeur booléenne: TRUE (vrai) = subdivision en tranches FALSE (faux) = pas de subdivision en tranches
149	Section 2m — Dérivés de crédit	Point d'attachement de l'indice de CDS (<i>credit derivative swaps</i>)	Toute valeur jusqu'à 11 caractères numériques, dont 10 décimales au maximum, exprimée en fraction décimale (par exemple 0,05 au lieu de 5 %), entre 0 et 1 (tous deux inclus). Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
150	Section 2m — Dérivés de crédit	Point de détachement de l'indice de CDS (<i>credit derivative swaps</i>)	Toute valeur jusqu'à 11 caractères numériques, dont 10 décimales au maximum, exprimée en fraction décimale (par exemple 0,05 au lieu de 5 %), entre 0 et 1 (tous deux inclus). Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.

▼ B

	Section	Champ	Format
151	Section 2n — Modifications du contrat dérivé	Type d'action	4 caractères alphabétiques: «NEWT» = nouveau MODI = modification CORR = correction TERM = résiliation (<i>Terminate</i>) EROR = erreur REVI = réactivation(<i>Revive</i>) VALU = valorisation (<i>Valuation</i>) POSC = composante de la position (<i>Position component</i>)
152	Section 2n — Modifications du contrat dérivé	Type d'événement	4 caractères alphabétiques: TRAD = transaction (<i>Trade</i>) NOVA = novation COMP = PTRR (réduction des risques post-négociation) ETRM = résiliation anticipée (<i>Early termination</i>) CLRG = compensation (<i>Clearing</i>) EXER = exercice ALOC = allocation CREV = événement de crédit (<i>Credit event</i>) CORP = événement d'entreprise (<i>Corporate event</i>) INCP = inclusion dans la position UPDT = actualisation (<i>Update</i>)
153	Section 2n — Modifications du contrat dérivé	Date de l'événement	Date au format ISO 8601 et TUC, comme suit: AAAA-MM-JJ.
154	Section 2n — Modifications du contrat dérivé	Niveau	4 caractères alphabétiques: TCTN = transaction (<i>Trade</i>) PSTN = position

Tableau 3

	Section	Champ	Format
1	Parties au contrat dérivé	Horodatage de la déclaration	Date au format ISO 8601 et heure TUC (temps universel coordonné), comme suit: AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ
2	Parties au contrat dérivé	Identifiant de l'entité qui transmet la déclaration	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques inclus dans les données LEI telles qu'elles sont publiées par la Global LEI Foundation.
3	Parties au contrat dérivé	Entité chargée de la déclaration	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques inclus dans les données LEI telles qu'elles sont publiées par la Global LEI Foundation. Le LEI doit être dûment renouvelé conformément aux modalités de l'une des unités opérationnelles locales accréditées du système mondial d'identifiant d'entité juridique.

▼ B

	Section	Champ	Format
4	Parties au contrat dérivé	Contrepartie 1 (contrepartie déclarante)	Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques inclus dans les données LEI telles qu'elles sont publiées par la Global LEI Foundation. Le LEI doit être dûment renouvelé conformément aux modalités de l'une des unités opérationnelles locales accréditées du système mondial d'identifiant d'entité juridique.
5	Parties au contrat dérivé	Type d'identifiant de la contrepartie 2	Valeur booléenne: — TRUE (vraie) — FALSE (fausse), pour les personnes physiques agissant en tant que particuliers qui ne sont pas éligibles à l'obtention d'un LEI conformément à la déclaration du Comité de surveillance réglementaire.
6	Parties au contrat dérivé	Contrepartie 2	— Identifiant d'entité juridique (LEI) ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques inclus dans les données LEI telles qu'elles sont publiées par la Global LEI Foundation ou code de 72 caractères alphanumériques au maximum pour les personnes physiques agissant en tant que particuliers qui ne sont pas éligibles à l'obtention d'un LEI conformément à la déclaration du Comité de surveillance réglementaire. Le code d'identification d'une personne physique se compose du LEI de la contrepartie 1 suivi d'un identifiant unique attribué et conservé systématiquement par la contrepartie 1 pour cette personne physique aux fins des déclarations réglementaires.
7	Sûretés	Horodatage des sûretés	Date au format ISO 8601 et heure TUC, comme suit: AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ
8	Sûretés	Indicateur de collatéralisation du portefeuille	Valeur booléenne: TRUE (vraie) = collatéralisé sur la base d'un portefeuille FALSE (fausse) = ne fait pas partie d'un portefeuille
9	Sûretés	Code du portefeuille de sûretés	Jusqu'à 52 caractères alphanumériques Les caractères spéciaux ne sont pas autorisés
10	Sûretés	UTI	52 caractères alphanumériques au maximum, seuls les caractères alphabétiques majuscules de A à Z et les chiffres de 0 à 9 sont autorisés
11	Sûretés	Catégorie de collatéralisation	4 caractères alphabétiques: UNCL = non collatéralisé (<i>Uncollateralised</i>) PRC1 = collatéralisé partiellement (<i>Partially collateralised</i>): contrepartie 1 uniquement PRC2 = collatéralisé partiellement (<i>Partially collateralised</i>): contrepartie 2 uniquement PRCL = collatéralisé partiellement (<i>Partially collateralised</i>) OWC1 = collatéralisé unilatéralement (<i>One-way collateralised</i>): contrepartie 1 uniquement

▼ B

	Section	Champ	Format
			<p>OWC2 = collatéralisé unilatéralement (<i>One-way collateralised</i>): contrepartie 2 uniquement</p> <p>OWP1 = collatéralisé unilatéralement/partiellement: contrepartie 1</p> <p>OWP2 = collatéralisé unilatéralement/partiellement: contrepartie 2</p> <p>FLCL = pleinement collatéralisé (<i>Fully collateralised</i>)</p> <p>À compléter conformément à l'article 5 du présent règlement</p>
12	Sûretés	Marge initiale fournie par la contrepartie 1 (avant décote)	<p>Toute valeur supérieure ou égale à zéro, jusqu'à 25 caractères numériques, dont 5 décimales au maximum. Si la valeur comporte plus de cinq chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure.</p> <p>Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.</p>
13	Sûretés	Marge initiale fournie par la contrepartie 1 (après décote)	<p>Toute valeur supérieure ou égale à zéro, jusqu'à 25 caractères numériques, dont 5 décimales au maximum. Si la valeur comporte plus de cinq chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure.</p> <p>Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.</p>
14	Sûretés	Monnaie de la marge initiale fournie	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques
15	Sûretés	Marge de variation fournie par la contrepartie 1 (avant décote)	<p>Toute valeur supérieure ou égale à zéro, jusqu'à 25 caractères numériques, dont 5 décimales au maximum. Si la valeur comporte plus de cinq chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure.</p> <p>Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.</p>
16	Sûretés	Marge de variation fournie par la contrepartie 1 (après décote)	<p>Toute valeur supérieure ou égale à zéro, jusqu'à 25 caractères numériques, dont 5 décimales au maximum. Si la valeur comporte plus de cinq chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure.</p> <p>Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.</p>
17	Sûretés	Monnaie de la marge de variation fournie	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques

▼ B

	Section	Champ	Format
18	Sûretés	Sûretés excédentaires fournies par la contrepartie 1	Toute valeur supérieure ou égale à zéro, jusqu'à 25 caractères numériques, dont 5 décimales au maximum. Si la valeur comporte plus de cinq chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
19	Sûretés	Monnaie des sûretés excédentaires fournies	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques
20	Sûretés	Marge initiale reçue par la contrepartie 1 (avant décote)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro, jusqu'à 25 caractères numériques, dont 5 décimales au maximum. Si la valeur comporte plus de cinq chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
21	Sûretés	Marge initiale reçue par la contrepartie 1 (après décote)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro, jusqu'à 25 caractères numériques, dont 5 décimales au maximum. Si la valeur comporte plus de cinq chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
22	Sûretés	Monnaie de la marge initiale reçue	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques
23	Sûretés	Marge de variation reçue par la contrepartie 1 (avant décote)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro, jusqu'à 25 caractères numériques, dont 5 décimales au maximum. Si la valeur comporte plus de cinq chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
24	Sûretés	Marge de variation reçue par la contrepartie 1 (après décote)	Toute valeur supérieure ou égale à zéro, jusqu'à 25 caractères numériques, dont 5 décimales au maximum. Si la valeur comporte plus de cinq chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.

▼ **B**

	Section	Champ	Format
25	Sûretés	Monnaie de la marge de variation reçue	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques
26	Sûretés	Sûretés excédentaires reçues par la contrepartie 1	Toute valeur supérieure ou égale à zéro, jusqu'à 25 caractères numériques, dont 5 décimales au maximum. Si la valeur comporte plus de cinq chiffres après le séparateur décimal, les contreparties déclarantes arrondissent à la moitié supérieure. Le séparateur décimal n'est pas compté comme un caractère numérique. Si un séparateur décimal doit être employé, utiliser le point.
27	Sûretés	Monnaie des sûretés excédentaires reçues	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques
28	Sûretés	Type d'action	«MARU» = actualisation des marges (<i>Margin update</i>) «CORR» = correction
29	Sûretés	Date de l'événement	Date au format ISO 8601 et TUC, comme suit: AAAA-MM-JJ.

Tableau 4

Classification des matières premières

Catégorie de produit	Sous-catégorie de produit	Produit
«AGRI» — Produits agricoles	«GROS» — Grains et oléagineux	«FWHT» — Blé fourrager «SOYB» — Graines de soja «CORN» — Maïs «RPSD» — Colza «RICE» — Riz «OTHR» — Autres
	«SOFT» — Produits non durables	«CCOA» — Cacao «ROBU» — Café robusta «WHSG» — Sucre blanc «BRWN» — Sucre brut «OTHR» — Autres
	«POTA» — Pomme de terre	
	«OOLI» — Huile d'olive	«LAMP» — Huile d'olive lampante «OTHR» — Autres
	«DIRY» — Produits laitiers	
	«FRST» — Produits sylvicoles	

▼ **B**

Catégorie de produit	Sous-catégorie de produit	Produit
	«SEAF» — Produits de la mer	
	«LSTK» — Bétail	
	«GRIN» — Céréales	«MWHT» — Blé meunier «OTHR» — Autres
	«OTHR» — Autres	
«NRGY» — Énergie	«ELEC» — Électricité	«BSLD» — Charge de base «FITR» — Droits financiers de transport «PKLD» — Charge de pointe «OFFP» — Hors période de pointe «OTHR» — Autres
	«NGAS» — Gaz naturel	«GASP» — GASPOOL «LNGG» — Gaz naturel liquéfié (GNL) «NBPG» — National Balancing Point (NBP) «NCGG» — NetConnect Germany (NCG) «TTFG» — Title Transfer Facility (TTF) «OTHR» — Autres
	«OILP» — Pétrole	«BAKK» — Bakken «BDSL» — Biodiesel «BRNT» — Brent «BRNX» — Brent NX «CNDA» — Canadian «COND» — Condensats «DSEL» — Diesel «DUBA» — Dubaï «ESPO» — ESPO «ETHA» — Éthanol «FUEL» — Fioul «FOIL» — Mazout «GOIL» — Gasoil «GSLN» — Essence «HEAT» — Mazout de chauffage «JTFL» — Carburéacteurs «KERO» — Kérosène «LLSO» — Light Louisiana Sweet (LLS) «MARS» — Mars «NAPH» — Naphtha «NGLO» — Liquides de gaz naturel (LGN) «TAPI» — Tapis «URAL» — Urals «WTIO» — West Texas Intermediate (WTI) «OTHR» — Autres

▼ **B**

Catégorie de produit	Sous-catégorie de produit	Produit
	«COAL» — Charbon «INRG» — Interénergies «RNG» — Énergies renouvelables «LGHT» — Fractions légères «DIST» — Distillats «OTHR» — Autres	
«ENVR» — Environnement	«EMIS» — Émissions	«CERE» — Unités de réduction certifiée des émissions (URCE) «ERUE» — Unités de réduction des émissions (URE) «EUA» — Quotas d'émission de l'Union européenne (EUA) «EUAA» — Quotas du secteur de l'aviation de l'Union européenne «OTHR» — Autres
	«WTHR» — Climatique «CRBR» — Carbone «OTHR» — Autres	
«FRGT» — Fret	«WETF» — Vrac liquide	«TNKR» — Navires citernes «OTHR» — Autres
	«DRYF» — Vrac solide	«DBCR» — Vraquiers «OTHR» — Autres
	«CSHP» — Navires porte-conteneurs	
	«OTHR» — Autres	
«FRTL» — Engrais	«AMMO» — Ammoniac «DAPH» — Phosphate diammonique «PTSH» — Potasse «SLPH» — Soufre «UREA» — Urée «UAAN» — Urée et nitrate d'ammonium «OTHR» — Autres	
«INDP» — Produits industriels	«CSTR» — Construction «MFTG» — Fabrication	
«METL» — Métaux	«NPRM» — Non précieux	«ALUM» — Aluminium «ALUA» — Alliage d'aluminium «BLT» — Cobalt «COPR» — Cuivre «IRON» — Minerai de fer

▼ B

Catégorie de produit	Sous-catégorie de produit	Produit
		«LEAD» — Plomb «MOLY» — Molybdène «NASC» — North American Special Aluminium Alloy Contract (NASAAC) «NICK» — Nickel «STEL» — Acier «TINN» — Étain «ZINC» — Zinc «OTHR» — Autres
	«PRME» — Précieux	«GOLD» — Or «SLVR» — Argent «PTNM» — Platine «PLDM» — Palladium «OTHR» — Autres
«MCEX» — Exotiques multi-produits		
«PAPR» — Papier	«CBRD» — Papier pour carton ondulé «NSPT» — Papier journal «PULP» — Pâte à papier «RCVP» — Papier recyclé «OTHR» — Autres	
«POLY» — Polypropylène	«PLST» — Plastiques «OTHR» — Autres	
«INFL» — Inflation		
«OEST» — Statistiques économiques officielles		
«OTHC» — Autres dérivés C10 au sens du tableau 10.1 de l'annexe III du règlement délégué (UE) 2017/583 de la Commission ⁽¹⁾		
«OTHR» — Autres		

⁽¹⁾ Règlement délégué (UE) 2017/583 de la Commission du 14 juillet 2016 complétant le règlement (UE) n° 600/2014 du Parlement européen et du Conseil concernant les marchés d'instruments financiers par des normes techniques de réglementation relatives aux obligations de transparence applicables aux plates-formes de négociation et aux entreprises d'investissement pour les obligations, produits financiers structurés, quotas d'émission et instruments dérivés (JO L 87 du 31.3.2017, p. 229).