

RÈGLEMENT DÉLÉGUÉ (UE) 2019/358 DE LA COMMISSION**du 13 décembre 2018****complétant le règlement (UE) 2015/2365 du Parlement européen et du Conseil par des normes techniques de réglementation concernant la collecte, la vérification, l'agrégation, la comparaison et la publication de données sur les opérations de financement sur titres (OFT) par les référentiels centraux****(Texte présentant de l'intérêt pour l'EEE)**

LA COMMISSION EUROPÉENNE,

vu le traité sur le fonctionnement de l'Union européenne,

vu le règlement (UE) 2015/2365 du Parlement européen et du Conseil du 25 novembre 2015 relatif à la transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation et modifiant le règlement (UE) n° 648/2012 ⁽¹⁾, et notamment son article 5, paragraphe 7, point a), et son article 12, paragraphe 3, points a) et b),

considérant ce qui suit:

- (1) Afin d'assurer la haute qualité des éléments d'opérations de financement sur titres (OFT) déclarés aux référentiels centraux, ceux-ci devraient vérifier l'identité des entités qui soumettent les déclarations, la cohérence logique de l'ordre dans lequel ces éléments sont déclarés ainsi que leur exhaustivité et leur exactitude.
- (2) Pour la même raison, les référentiels centraux devraient procéder au rapprochement des éléments de chaque déclaration d'OFT qu'ils reçoivent. Il conviendrait de définir une procédure normalisée pour permettre aux référentiels centraux d'effectuer ce rapprochement de manière cohérente et réduire les risques de non-concordance de certains éléments. Il est vrai que certains éléments d'OFT peuvent ne pas être identiques en raison des spécificités des technologies utilisées par les entités qui soumettent les déclarations. Il est donc nécessaire de prévoir certaines marges de tolérance afin que de légères différences entre les éléments d'OFT déclarés n'empêchent pas les autorités d'analyser les données avec un degré de confiance suffisant.
- (3) L'on peut s'attendre à une amélioration progressive de la part des entités qui soumettent les déclarations, tant en termes de réduction du nombre de déclarations rejetées qu'en termes de déclarations concordantes. Ces entités devraient néanmoins disposer d'un délai suffisant pour s'adapter aux exigences en matière de déclaration, notamment pour empêcher une accumulation de transactions non rapprochées dès l'entrée en application de l'obligation de déclaration. Il convient, dans un premier temps, de limiter le rapprochement à un nombre de champs réduit.
- (4) Les entités qui soumettent les déclarations et les entités responsables des déclarations, le cas échéant, devraient pouvoir s'assurer qu'elles respectent leurs obligations déclaratives au titre du règlement (UE) 2015/2365. Elles devraient donc pouvoir accéder quotidiennement à certaines informations sur ces déclarations, notamment sur le résultat de la vérification de ces dernières et sur l'état d'avancement du rapprochement des données déclarées. Il est par conséquent nécessaire de préciser les informations qu'un référentiel central devrait mettre à la disposition de ces entités à la fin de chaque jour ouvrable.
- (5) Pour contribuer à l'intégrité des éléments d'OFT, l'accès direct et immédiat prévu à l'article 12, paragraphe 2, du règlement (UE) 2015/2365 devrait être fourni de manière harmonisée et cohérente. Pour harmoniser les déclarations, minimiser les coûts pour le secteur financier et garantir la comparabilité et l'agrégation cohérente des données d'un référentiel central à l'autre, il convient que toutes les déclarations produites et tous les échanges soient effectués au format XML et selon une méthodologie largement utilisée dans le secteur.
- (6) L'accès aux données au niveau des positions sur les expositions entre deux contreparties est essentiel pour permettre aux entités visées à l'article 12, paragraphe 2, du règlement (UE) 2015/2365 de déterminer les sources potentielles de risques, systémiques ou non, pour la stabilité financière.
- (7) Afin d'assurer au public un niveau adéquat de transparence des OFT, les critères utilisés pour l'agrégation des positions devraient permettre au grand public de comprendre le fonctionnement des marchés des OFT, sans pour

⁽¹⁾ JO L 337 du 23.12.2015, p. 1.

autant compromettre la confidentialité des données déclarées aux référentiels centraux. La fréquence et les éléments de la publication par un référentiel central, conformément à l'article 12, paragraphe 1, du règlement (UE) 2015/2365, de positions agrégées devraient être définis sur la base du cadre correspondant prévu par le règlement (UE) n° 648/2012 du Parlement européen et du Conseil ⁽²⁾ pour les contrats dérivés.

- (8) Le présent règlement se fonde sur les projets de normes techniques de réglementation soumis à la Commission par l'Autorité européenne des marchés financiers (AEMF), conformément à la procédure prévue à l'article 10 du règlement (UE) n° 1095/2010 du Parlement européen et du Conseil ⁽³⁾.
- (9) Les dispositions du présent règlement portent sur des normes opérationnelles pour la collecte, l'agrégation et la comparaison de données par les référentiels centraux et sur les procédures que ces derniers doivent appliquer pour vérifier l'exhaustivité et l'exactitude des éléments qui leur sont déclarés concernant des OFT. Afin de garantir la cohérence de ces dispositions et de permettre aux référentiels centraux d'en avoir une vision globale, il est souhaitable de regrouper les normes techniques de réglementation concernées dans un règlement unique.
- (10) L'AEMF a mené des consultations publiques ouvertes sur ces projets de normes techniques de réglementation, analysé les coûts et avantages potentiels qu'elles impliquent et demandé l'avis du groupe des parties intéressées au secteur financier institué en application de l'article 37 du règlement (UE) n° 1095/2010,

A ADOPTÉ LE PRÉSENT RÈGLEMENT:

Article premier

Vérification par les référentiels centraux des déclarations d'OFT

1. Les référentiels centraux vérifient tout ce qui suit dans chaque déclaration d'OFT qu'ils reçoivent:
- a) l'identité de l'entité qui soumet la déclaration, indiquée dans le champ 2 du tableau 1 de l'annexe I du règlement d'exécution (UE) 2019/363 de la Commission ⁽⁴⁾;
 - b) que le modèle XML utilisé pour déclarer une OFT respecte la méthodologie ISO 20022, conformément au règlement d'exécution (UE) 2019/363;
 - c) que l'entité qui soumet la déclaration, si elle est différente de la contrepartie déclarante indiquée dans le champ 3 du tableau 1 de l'annexe I du règlement d'exécution (UE) 2019/363, est dûment autorisée à effectuer la déclaration pour le compte de la contrepartie déclarante, sauf dans le cas prévu à l'article 4, paragraphe 3, du règlement (UE) 2015/2365;
 - d) que la déclaration d'OFT n'a pas déjà été soumise antérieurement;
 - e) que la déclaration d'OFT, si elle mentionne le type d'action «Modification», concerne bien une déclaration d'OFT soumise antérieurement;
 - f) que la déclaration d'OFT, si elle mentionne le type d'action «Modification», ne concerne pas une OFT déclarée comme annulée;
 - g) que la déclaration d'OFT ne mentionne pas le type d'action «Nouveau» concernant une OFT qui a déjà été déclarée;
 - h) que la déclaration d'OFT ne mentionne pas le type d'action «Composante de la position» concernant une OFT qui a déjà été déclarée;

⁽²⁾ 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).

⁽³⁾ Règlement (UE) n° 1095/2010 du Parlement européen et du Conseil du 24 novembre 2010 instituant une Autorité européenne de surveillance (Autorité européenne des marchés financiers), modifiant la décision n° 716/2009/CE et abrogeant la décision 2009/77/CE de la Commission (JO L 331 du 15.12.2010, p. 84).

⁽⁴⁾ Règlement d'exécution (UE) 2019/363 de la Commission du 13 décembre 2018 définissant les normes techniques d'exécution en ce qui concerne le format et la fréquence des déclarations des éléments des opérations de financement sur titres aux référentiels centraux conformément au règlement (UE) 2015/2365 du Parlement européen et du Conseil, et modifiant le règlement d'exécution (UE) n° 1247/2012 de la Commission en ce qui concerne les codes utilisés pour la déclaration des contrats dérivés (voir page 85 du présent Journal officiel).

- i) que la déclaration d'OFT ne vise pas à modifier les éléments relatifs à l'entité qui soumet la déclaration, à la contrepartie déclarante ou à l'autre contrepartie d'une OFT déclarée antérieurement;
- j) que la déclaration d'OFT ne vise pas à modifier une déclaration d'OFT existante en indiquant une date de valeur postérieure à la date déclarée d'échéance de l'OFT;
- k) l'exactitude et l'exhaustivité de la déclaration d'OFT.

2. Les référentiels centraux vérifient si des informations sur les sûretés figurent bien dans les champs 73 à 96 du tableau 2 de l'annexe I du règlement d'exécution (UE) 2019/363 pour les OFT pour lesquelles le champ 72 «Code signalétique Prêt de titres non garanti» de ce même tableau est déclaré comme «faux». Les référentiels centraux notifient, conformément à l'article 3 du présent règlement, le résultat de la vérification à l'entité qui soumet la déclaration, à la contrepartie déclarante et à l'entité responsable de la déclaration, le cas échéant.

3. Les référentiels centraux rejettent toute déclaration d'OFT qui ne respecte pas l'une des exigences énoncées au paragraphe 1 et lui attribuent l'une des catégories du tableau 2 de l'annexe I du présent règlement.

4. Dans les soixante minutes suivant la réception d'une déclaration d'OFT, les référentiels centraux fournissent à l'entité qui soumet la déclaration et à la contrepartie déclarante, ainsi que, le cas échéant, à l'entité responsable de la déclaration, des informations détaillées sur les résultats de la vérification des données prévue au paragraphe 1. Les référentiels centraux fournissent ces résultats sous un format XML et selon un modèle élaborés selon la méthodologie ISO 20022. Ces résultats indiquent, le cas échéant, les motifs précis du rejet, en vertu du paragraphe 3, d'une déclaration d'OFT.

Article 2

Rapprochement des données par les référentiels centraux

1. Le référentiel central procède au rapprochement d'une OFT déclarée en prenant les mesures décrites au paragraphe 2, pour autant que toutes les conditions suivantes soient remplies:

- a) le référentiel central a achevé les vérifications prévues à l'article 1, paragraphes 1 et 2;
- b) les contreparties à l'OFT déclarée sont toutes deux soumises à une obligation de déclaration;
- c) le référentiel central n'a pas reçu, pour l'OFT déclarée, de déclaration ultérieure mentionnant le type d'action «Erreur».

2. Si toutes les conditions posées au paragraphe 1 sont remplies, le référentiel central prend les mesures suivantes, en utilisant la valeur déclarée en dernier lieu pour chaque champ du tableau 1 de l'annexe I du présent règlement:

- a) un référentiel central qui reçoit une déclaration d'OFT vérifie s'il a reçu une déclaration d'OFT correspondante de l'autre contrepartie ou pour le compte de celle-ci;
- b) s'il n'a pas reçu la déclaration d'OFT correspondante visée au point a), le référentiel central s'efforce d'identifier le référentiel central qui a reçu cette déclaration d'OFT correspondante, en communiquant à tous les référentiels centraux enregistrés les valeurs des champs suivants, pour l'OFT déclarée: «Identifiant de transaction unique», «Contrepartie déclarante», «Autre contrepartie» et «Type d'accord-cadre»;
- c) un référentiel central qui constate qu'un autre référentiel central a reçu la déclaration d'OFT correspondante visée au point a) échange avec celui-ci les éléments de l'OFT déclarée, sous un format XML et selon un modèle élaborés selon la méthodologie ISO 20022;
- d) sous réserve du point e), le référentiel central traite comme rapprochée une SFT déclarée lorsque les éléments de cette OFT recourent ceux de la déclaration d'OFT correspondante visée au point a) du présent paragraphe;
- e) le référentiel central s'efforce de faire concorder séparément les champs relatifs aux données sur les prêts et les champs relatifs aux données sur les sûretés de l'OFT déclarée, en respectant les limites de tolérance et les dates d'application indiquées dans le tableau 1 de l'annexe I du présent règlement;

- f) pour chaque OFT déclarée, le référentiel central attribue ensuite des valeurs aux catégories de rapprochement, comme prévu au tableau 3 de l'annexe I du présent règlement;
- g) le référentiel central prend dès que possible les mesures visées aux points a) à f) du présent paragraphe et ne prend plus de telles mesures après 18h00, en temps universel coordonné, d'un jour ouvrable donné;
- h) si le référentiel central ne parvient pas à effectuer le rapprochement d'une OFT déclarée, il s'efforce d'en faire concorder les éléments le jour ouvrable suivant. Il cesse d'essayer de procéder au rapprochement de cette OFT trente jours calendaires après l'échéance déclarée de l'OFT ou lorsqu'il reçoit une déclaration la concernant mentionnant le type d'action «Cessation» ou «Composante de position».
3. À la fin de chaque jour ouvrable, le référentiel central vérifie avec chaque référentiel central avec lequel il a procédé au rapprochement d'OFT déclarées le nombre total d'OFT déclarées qui ont été rapprochées.
4. Au plus tard dans les soixante minutes qui suivent la conclusion, conformément au paragraphe 2, point g), du processus de réconciliation, le référentiel central fournit à l'entité qui soumet la déclaration et à la contrepartie déclarante, ainsi qu'à l'entité responsable de la déclaration, le cas échéant, les résultats du rapprochement qu'il a effectué concernant les OFT déclarées. Le référentiel central fournit ces résultats, y compris des informations sur les champs qui n'ont pas pu être rapprochés, sous un format XML et selon un modèle élaborés selon la méthodologie ISO 20022.

Article 3

Mécanismes de réponse en fin de journée

À la fin de chaque jour ouvrable, le référentiel central met les informations suivantes sur les OFT concernées à la disposition de l'entité qui soumet la déclaration et de la contrepartie déclarante, ainsi que, le cas échéant, de l'entité responsable de la déclaration, sous un format XML et selon un modèle élaborés conformément à la méthodologie ISO 20022:

- a) les OFT déclarées ce jour-là;
- b) les valeurs les plus récentes des OFT qui ne sont pas arrivées à échéance ou qui n'ont pas fait l'objet d'une déclaration mentionnant l'un des types d'action «Erreur», «Cessation» ou «Composante de position»;
- c) les identifiants de transaction uniques (UTI) des OFT pour lesquelles il est déclaré «faux» dans le champ 72 du tableau 2 de l'annexe I du règlement d'exécution (UE) 2019/363 et pour lesquelles il n'a pas encore été transmis d'informations sur les sûretés dans les champs 73 à 96 du même tableau;
- d) les déclarations d'OFT rejetées ce jour-là;
- e) l'état de rapprochement de toutes les OFT déclarées, à l'exception de celles qui sont arrivées à expiration ou pour lesquelles des déclarations mentionnant le type d'action «Cessation» ou «Composante de position» ont été reçues plus d'un mois avant ce jour-là.

Article 4

Accès aux éléments des OFT

Les référentiels centraux assurent aux entités visées à l'article 12, paragraphe 2, du règlement (UE) 2015/2365 un accès direct et immédiat aux éléments des OFT sous une forme électronique lisible par machine, y compris en cas de délégation en vertu de l'article 28 du règlement (UE) n° 1095/2010, conformément au règlement délégué (UE) 2019/357 de la Commission ⁽³⁾.

Aux fins du premier alinéa, les référentiels centraux utilisent un format XML et un modèle élaborés conformément à la méthodologie ISO 20022.

⁽³⁾ Règlement délégué (UE) 2019/357 de la Commission du 13 décembre 2018 complétant le règlement (UE) 2015/2365 du Parlement européen et du Conseil par des normes techniques de réglementation concernant l'accès aux éléments d'opérations de financement sur titres (OFT) détenus par les référentiels centraux (voir page 22 du présent Journal officiel).

*Article 5***Calcul des données au niveau des positions et accès à celles-ci**

1. Les référentiels centraux calculent les données au niveau des positions sur les expositions entre contreparties en termes de prêts et de sûretés. Le calcul des données au niveau des positions se fonde sur les critères suivants:
 - a) les valeurs des catégories de rapprochement du tableau 3 de l'annexe I du présent règlement;
 - b) le type d'OFT,
 - c) le secteur des contreparties;
 - d) le statut en termes de compensation;
 - e) la conclusion ou non sur une plate-forme de négociation;
 - f) le type de sûreté;
 - g) la monnaie de la jambe espèces;
 - h) la tranche de maturité;
 - i) la tranche de décote;
 - j) les référentiels centraux auxquels l'autre contrepartie a déclaré les éléments d'OFT.
2. Les référentiels centraux veillent à ce que les entités visées à l'article 12, paragraphe 2, du règlement (UE) 2015/2365 aient accès aux données au niveau des positions conformément aux modalités d'accès aux données définies dans le règlement délégué (UE) 2019/357.
3. Les données au niveau des positions visées au paragraphe 1 sont fournies sous une forme électronique lisible par machine, sous un format XML et selon un modèle élaborés conformément à la méthodologie ISO 20022.
4. L'accès prévu au paragraphe 2 est fourni dès que possible et au plus tard le jour ouvrable suivant la réception d'une déclaration d'OFT conformément à l'article 4, paragraphe 1, du règlement (UE) 2015/2365.
5. Les référentiels centraux fournissent aux entités visées à l'article 12, paragraphe 2, du règlement (UE) 2015/2365 un accès à des données au niveau agrégé, conformément aux modalités d'accès aux données définies dans le règlement délégué (UE) 2019/357, calculées suivant des normes et processus communément admis de collecte et d'agrégation au niveau international des données relatives aux OFT.

*Article 6***Calcul de données de position agrégées pour publication**

1. Les référentiels centraux calculent, conformément aux critères définis aux paragraphes 2 et 3, des données de position agrégées pour les valeurs suivantes:
 - a) le montant en principal des contrats de mise en pension, des opérations d'achat-revente ou de vente-rachat, le volume total de titres ou de matières premières prêtés ou empruntés et le montant des prêts sur marge;
 - b) le nombre d'UTI correspondant aux OFT pertinentes;
 - c) la valeur de marché des sûretés.
2. Les référentiels centraux calculent des données de position agrégées pour toutes les OFT déclarées avec la mention du type d'action «Nouveau» entre le samedi 00h00mn00s (TUC) et le vendredi 23h59mn59s (TUC) sur la base des critères suivants et des valeurs correspondantes du tableau 1 de l'annexe II du présent règlement:
 - a) la localisation de la contrepartie déclarante ou, le cas échéant, de la succursale concernée;
 - b) la localisation de l'autre contrepartie ou, le cas échéant, de la succursale concernée;
 - c) le type d'OFT,
 - d) le statut de l'OFT en termes de rapprochement, comme indiqué au tableau 3 de l'annexe I du présent règlement;

- e) le type de plate-forme sur laquelle l'OFT a été conclue;
 - f) le fait qu'il y ait eu ou non compensation de l'OFT;
 - g) la méthode de transfert de la sûreté;
 - h) chaque indice utilisé comme référence lors d'une OFT négociée sur une plate-forme d'exécution autre que «XXXX», dès lors que le montant nominal agrégé déclaré au référentiel central pour l'indice est supérieur à cinq milliards d'EUR et qu'au moins six contreparties différentes ont déclaré les OFT concernées au référentiel central.
3. Au plus tard le vendredi 23h59mn59s (TUC), les référentiels centraux calculent des données de position agrégées pour toutes les OFT qui ne sont pas arrivées à échéance ou qui n'ont pas fait l'objet d'une déclaration mentionnant l'un des types d'action «Erreur», «Cessation» ou «Composante de position», en se basant sur les critères suivants et sur les valeurs correspondantes du tableau 1 de l'annexe II du présent règlement:
- a) la localisation de la contrepartie déclarante ou, le cas échéant, de la succursale concernée;
 - b) la localisation de l'autre contrepartie ou, le cas échéant, de la succursale concernée;
 - c) le type d'OFT,
 - d) le statut de l'OFT en termes de rapprochement, comme indiqué au tableau 3 de l'annexe I du présent règlement;
 - e) le type de plate-forme sur laquelle l'OFT a été conclue;
 - f) le fait qu'il y ait eu ou non compensation de l'OFT;
 - g) la méthode de transfert de la sûreté;
 - h) chaque indice utilisé comme référence lors d'une OFT négociée sur une plate-forme d'exécution autre que «XXXX», dès lors que le montant nominal agrégé déclaré au référentiel central pour l'indice est supérieur à 5 milliards d'EUR et qu'au moins six contreparties différentes ont déclaré les OFT concernées au référentiel central.
4. Les référentiels centraux ont une procédure permettant d'identifier les valeurs extraordinaires parmi les données de position agrégées.
5. Les référentiels centraux ont une procédure permettant d'effectuer et de notifier les corrections à apporter aux données de position agrégées, notamment celles découlant de déclarations mentionnant le type d'action «Erreur», et de publier les données agrégées originales et corrigées.

Article 7

Publication de données de position agrégées

1. Les référentiels centraux publient sur leur site web des données de position agrégées, calculées conformément à l'article 6, à un rythme hebdomadaire et au plus tard le mardi midi, pour les OFT déclarées au plus tard à 23h59min59s (TUC) le vendredi précédent.
2. Les référentiels centraux publient toutes les données de position agrégées en euros et appliquent les taux de change publiés sur le site web de la BCE le vendredi précédant la publication de ces données.
3. Les référentiels centraux veillent à ce que les données de position agrégées soient publiées sous le format d'un tableau conforme à l'annexe II du présent règlement et qui permette le téléchargement des données.
4. Les données de position agrégées qu'un référentiel central a publiées sur son site web restent sur ce site pendant au moins 104 semaines.

Article 8

Entrée en vigueur

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

Il est obligatoire dans tous ses éléments et directement applicable dans tout État membre.

Fait à Bruxelles, le 13 décembre 2018.

Par la Commission
Le président
Jean-Claude JUNCKER

ANNEXE I

Tableau 1

Champs relatifs au rapprochement, niveaux de tolérance et date du début de la phase de rapprochement

Tableau	Section	Champ	Tolérance	Disposition indiquant la date de début:
Données sur les contreparties	s.o.	Contrepartie déclarante	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données sur les contreparties	s.o.	Côté de la contrepartie	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données sur les contreparties	s.o.	Autre contrepartie	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Identifiant de transaction unique (UTI)	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Type d'OFT	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Compensé	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Horodatage de la compensation	Une heure	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Prêt	Contrepartie centrale	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Plate-forme de négociation	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Type d'accord-cadre	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Horodatage de l'exécution	Une heure	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Date de valeur (date de début)	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Date d'échéance (date de fin)	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Date de cessation	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Préavis minimum	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Prêt	Date la plus proche de remboursement sur demande	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Prêt	Indicateur vrac (<i>general collateral</i>)	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois

Tableau	Section	Champ	Tolérance	Disposition indiquant la date de début:
Données relatives aux opérations	Prêt	Indicateur de livraison selon valeur (<i>delivery by value</i> - «DBV»)	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Prêt	Méthode de fourniture des sûretés	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Échéance ouverte	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Option de résiliation	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Prêt	Taux fixe	À la troisième décimale	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Convention de calcul des jours	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Taux variable	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Période de référence du taux variable - unité de temps	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Période de référence du taux variable - multiplicateur	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Prêt	Fréquence de paiement pour le taux variable - unité de temps	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Prêt	Fréquence de paiement pour le taux variable - multiplicateur	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Prêt	Fréquence de révision du taux variable - unité de temps	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Fréquence de révision du taux variable - multiplicateur	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Écart (<i>spread</i>)	À la troisième décimale	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Montant monétaire du prêt avec appel de marge	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Monnaie du prêt avec appel de marge	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365

Tableau	Section	Champ	Tolérance	Disposition indiquant la date de début:
Données relatives aux opérations	Prêt	Taux ajusté	À la troisième décimale	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Prêt	Date d'application du taux	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Prêt	Montant en principal à la date de valeur	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Montant en principal à la date d'échéance	0,0005 %	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Monnaie du montant en principal	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Type d'actif	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Identifiant du titre	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Classification du titre	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Catégorie de produit	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Prêt	Sous-catégorie de produit	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Prêt	Produit	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Prêt	Quantité ou montant nominal	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Unité de mesure	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Prêt	Monnaie du montant nominal	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Prix des titres ou matières premières	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Prêt	Monnaie du prix	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Prêt	Qualité du titre	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Échéance du titre	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365

Tableau	Section	Champ	Tolérance	Disposition indiquant la date de début:
Données relatives aux opérations	Prêt	Juridiction dont dépend l'émetteur	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	LEI de l'émetteur	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Type de titre	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Valeur du prêt	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Prêt	Valeur de marché	0,0005 %	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Prêt	Taux de rémunération (<i>rebate</i>) fixe	À la troisième décimale	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Taux de rémunération (<i>rebate</i>) variable	à la troisième décimale	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Période de référence du taux de rémunération variable - unité de temps	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Prêt	Période de référence du taux de rémunération variable - multiplicateur	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Prêt	Fréquence des versements au taux de rémunération variable - unité de temps	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Prêt	Fréquence des versements au taux de rémunération variable - multiplicateur	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Prêt	Fréquence de révision du taux de rémunération variable - unité de temps	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Prêt	Fréquence de révision du taux de rémunération variable - multiplicateur	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Prêt	Écart (<i>spread</i>) du taux de rémunération	À la troisième décimale	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Prêt	Commission de prêt (<i>lending fee</i>)	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365

Tableau	Section	Champ	Tolérance	Disposition indiquant la date de début:
Données relatives aux opérations	Prêt	Accords d'exclusivité	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Prêt	Encours des prêts avec appel de marge	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Monnaie principale de l'encours des prêts avec appel de marge	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Valeur de marché des positions courtes	0,0005 %	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Sûretés	Code signalétique «SL» pour prêt de titres non garanti	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Sûretés	Couverture de l'exposition nette	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Sûretés	Date de valeur de la sûreté	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Sûretés	Type de composante de la sûreté	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Sûretés	Montant des sûretés en espèces	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Sûretés	Monnaie des sûretés en espèces	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Sûretés	Identifiant du titre utilisé en tant que sûreté	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Sûretés	Classification du titre utilisé en tant que sûreté	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Sûretés	Catégorie de produit	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Sûretés	Sous-catégorie de produit	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Sûretés	Produit	Non	Article 33, par. 2, point a) iv), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Sûretés	Quantité ou montant nominal de la sûreté	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Sûretés	Unité de mesure de la sûreté	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois

Tableau	Section	Champ	Tolérance	Disposition indiquant la date de début:
Données relatives aux opérations	Sûretés	Monnaie du montant nominal de la sûreté	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Sûretés	Monnaie du prix	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Sûretés	Prix unitaire	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Sûretés	Valeur de marché de la sûreté	0,0005 %	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365 + 24 mois
Données relatives aux opérations	Sûretés	Décote ou marge	À la troisième décimale	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Sûretés	Qualité de la sûreté	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Sûretés	Date d'échéance de la sûreté	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Sûretés	Juridiction dont dépend l'émetteur	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Sûretés	LEI de l'émetteur	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Sûretés	Type de sûreté	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Sûretés	Possibilité de réutiliser la sûreté	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Sûretés	Identifiant du panier de sûretés	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365
Données relatives aux opérations	Prêt	Niveau	Non	Article 33, par. 2, point a) i), du règlement (UE) 2015/2365

Tableau 2

Motifs de rejet d'une déclaration d'opération de financement sur titres

Catégories de motifs de rejet	Motifs
Schéma	— l'OFT a été rejetée en raison d'un schéma non conforme
Autorisation	— l'OFT a été rejetée parce que l'entité qui soumet la déclaration n'était pas autorisée à le faire pour le compte de la contrepartie déclarante
Logique	— l'OFT a été rejetée en raison d'un type d'action illogique
Règles de conduite	— l'OFT a été rejetée pour non-conformité avec une ou plusieurs règles de validation

Tableau 3

Résultats du processus de rapprochement

Catégories	Valeurs
Type de déclaration	Unilatéral/Bilatéral
Obligation de déclaration pour les deux contreparties	Oui/Non
Situation en termes d'appariement	Apparié/Non-apparié
Situation en termes de rapprochement des prêts	Rapproché/Non rapproché
Situation en termes de rapprochement des sûretés	Rapproché/Non rapproché
Autres modifications	Oui/Non

Tableau 1

Données publiques

Tableau A. Agrégation

Date	Référentiel central	Type d'agrégation	Type de plate-forme de négociation	Localisation de la contrepartie déclarante	Localisation de l'autre contrepartie	Rapprochement	Type d'OFT	Compensé	Méthode de transfert des sûretés	Indice utilisé comme référence ⁽¹⁾	Montant total prêté	Nombre total d'opérations	Valeur totale des sûretés
20161007	Référentiel central de l'Union européenne	Déclarées	XXXX	EEE	EEE	Bilatéral, rapproché au niveau des prêts, non rapproché au niveau des sûretés	Opération de pension	Oui	TTCA	
...	...	En cours	XOFF	Hors EEE	Hors EEE	Bilatéral, rapproché au niveau des prêts, rapproché au niveau des sûretés	BSB/SBB	Non	SICA	
...	EEE - MIC	Unilatéral EEE, rapproché au niveau des prêts, rapproché au niveau des sûretés	Prêt ou emprunt de titres ou de matières premières	...	SIUR	
...	Hors EEE - MIC	Prêt avec appel de marge
...

⁽¹⁾ Indiquer les indices pertinents figurant dans le champ 25 du tableau 2 «Données relatives aux prêts et sûretés» de l'annexe I du règlement d'exécution (UE) 2019/363.